【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年1月21日提出
【計算期間】	第26特定期間(自　2019年4月23日至　2019年10月21日)
【ファンド名】	新光７資産バランスファンド
【発行者名】	アセットマネジメントＯｎｅ株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

ａ．ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属し、主として投資信託証券に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

委託者は、受託者と合意のうえ、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において、以下のように分類・区分されます。

■商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型 追加型	国　内 海　外 内　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

■商品分類の定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の投資信託財産とともに運用されるファンドをいう。
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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式　一般、債券　一般、不動産投信））（資産配分固定型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年１回 年２回 年４回 年６回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他（　　）	グローバル （含む日本） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ **為替ヘッジ** あり（　　） 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

その他資産 （投資信託証券（資産複合 （株式　一般、債券　一般、不動産投信）） （資産配分固定型））	投資信託証券への投資を通じて、実質的に株式　一般、債券　一般、不動産投信の複数の資産に投資を行います。 資産配分固定型とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。
年12回（毎月）	目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（含む日本） エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（含む日本）・エマージング地域（複数の新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジなし（注）	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

※当ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。このため、組み入れている資産を示す「属性区分表」の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と、収益の源泉となる資産を示す「商品分類表」の投資対象資産（資産複合）とは異なります。

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

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

b．ファンドの特色

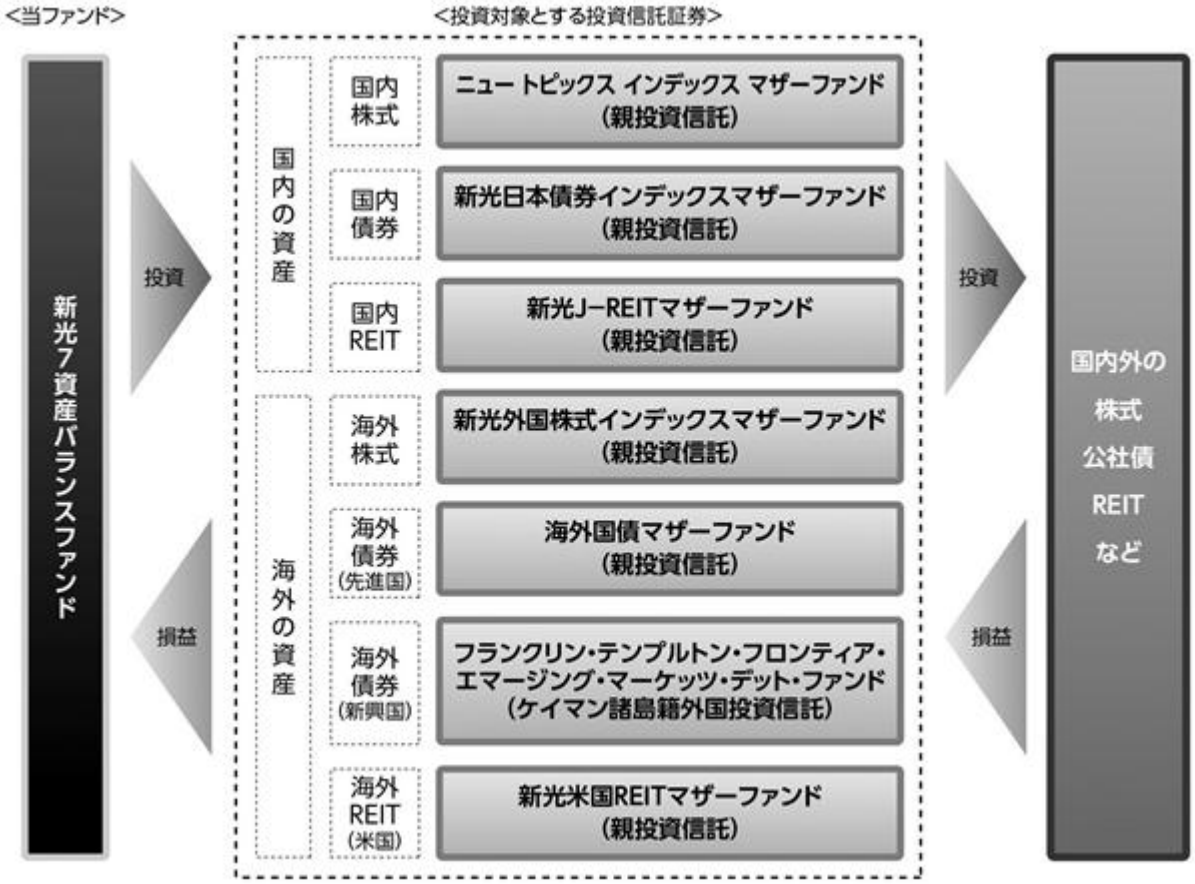
1 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産（株式、公社債、不動産投資信託証券）にバランスよく分散投資します。

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

●投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とします。

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

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



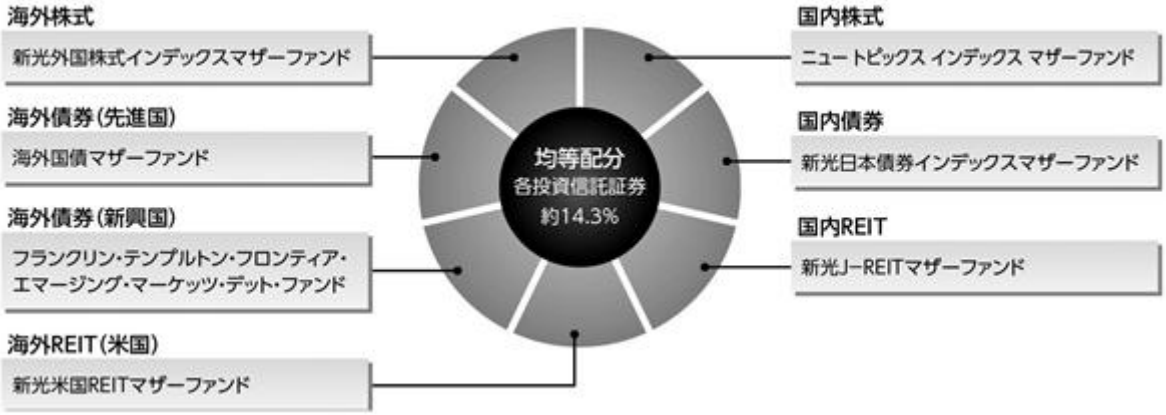
2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

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

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

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



▌分配方針

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

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

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

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

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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

◆投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が支払われるイメージ

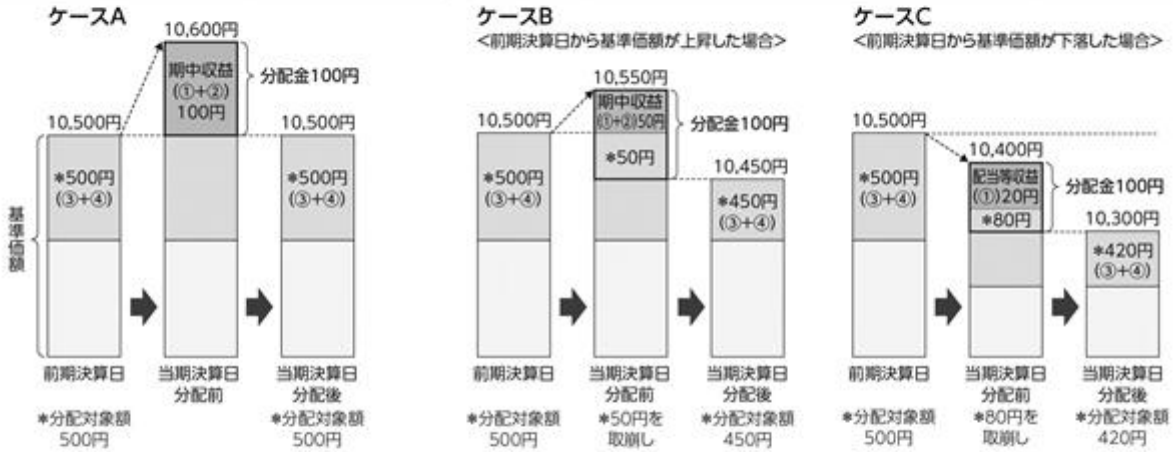
◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合　　**計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合**



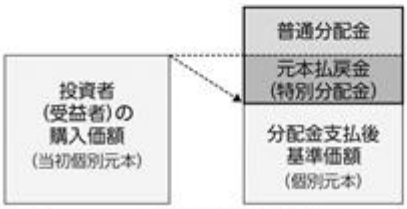
上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
ケースB：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
ケースC：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

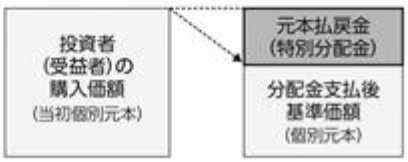
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご留意ください。

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合　　**分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合**



※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は、非課税扱いとなります。



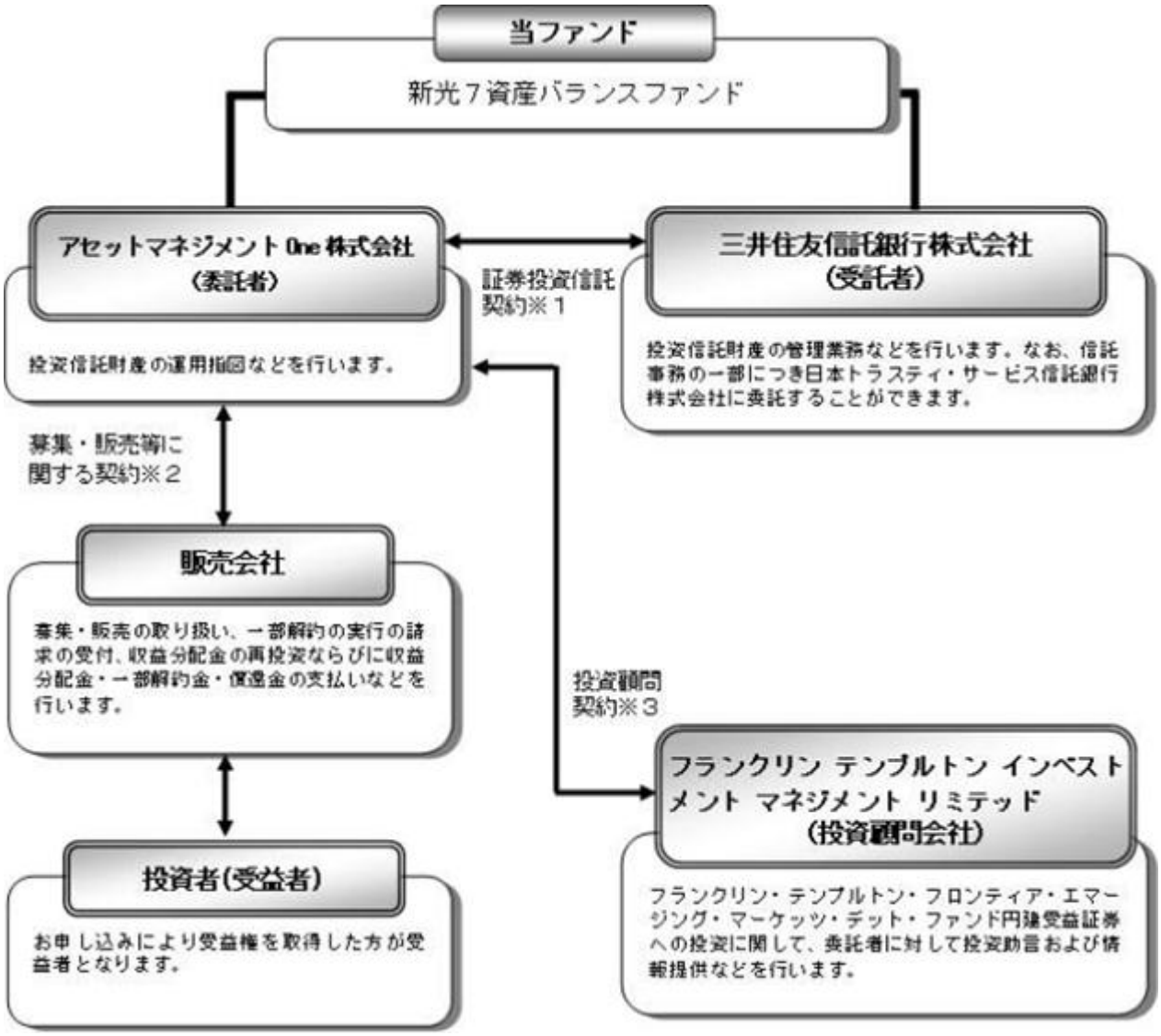
普通分配金　　：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（２）【ファンドの沿革】

2006年10月31日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2016年10月１日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

（３）【ファンドの仕組み】

ａ．ファンドの仕組み



※１　証券投資信託契約

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

※２　募集・販売等に関する契約

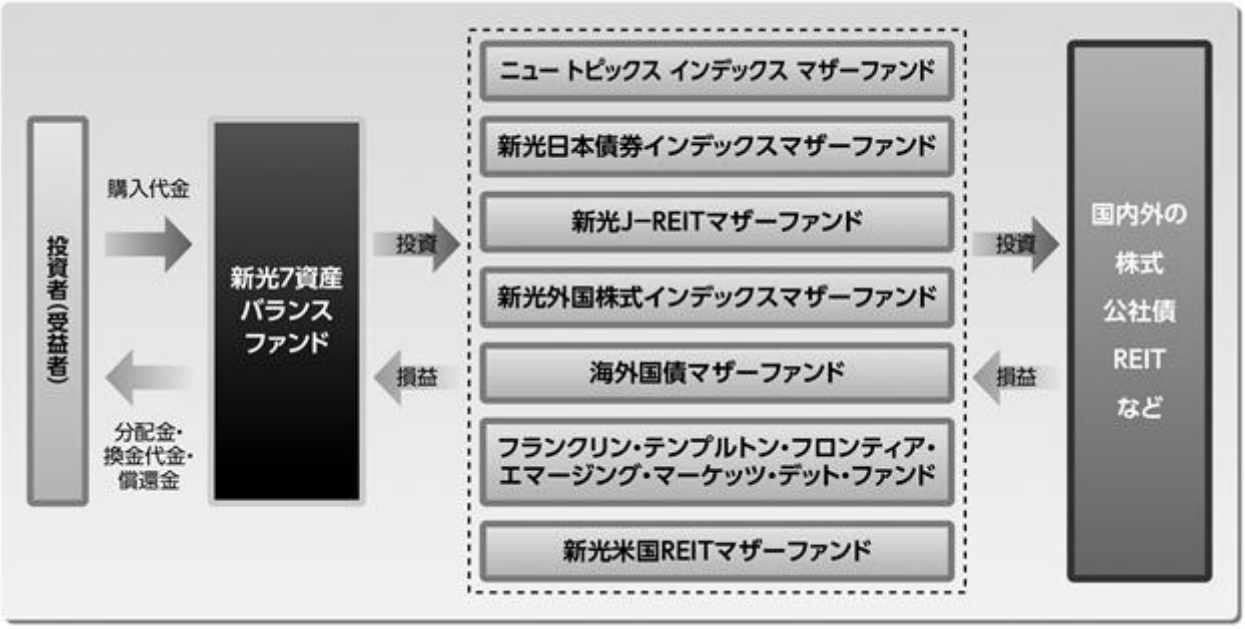
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

※３　投資顧問契約

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

■当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

ファンド・オブ・ファンズとは、投資信託証券への投資を目的とする投資信託のことで、一般に投資対象に選んだ複数の投資信託証券を組み入れて運用する仕組みを「ファンド・オブ・ファンズ方式」といいます。



ｂ．委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額
20億円（2019年10月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2019年10月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株※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、投資信託証券を主要投資対象として、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

ｂ．運用の方法

（イ）主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

（ロ）投資態度

① 以下の投資信託証券を通じて、実質的にわが国および海外の、株式、公社債および不動産投資信託証券に分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

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

② 投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とし、基本投資配分比率に基づき各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は、純資産総額に対する各投資信託証券の構成比率が均等となる率とします。

③ 各投資信託証券の構成比率については、原則として、６ヵ月ごとにチェックを行い、基本投資配分比率に対し一定の範囲を超過している場合には調整を行います。

④ 投資信託証券に含まれる外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。

⑤ フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド円建受益証券への投資にあたっては、フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッドから投資助言および情報提供を受けます。

⑥ 当ファンドの資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

ａ．投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ｂ．運用の指図範囲

（イ）委託者は、信託金を、主として次の第１号に掲げる外国投資信託の受益証券および第２号にから第７号に掲げるアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託であるマザーファンドの受益証券ならびに第８号から第12号に掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．ケイマン諸島籍外国投資信託　フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの円建受益証券

２．証券投資信託　ニュー トピックス インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

３．証券投資信託　新光日本債券インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

４．証券投資信託　新光外国株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

５．証券投資信託　海外国債マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

６．証券投資信託　新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

７．証券投資信託　新光米国ＲＥＩＴマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

８．コマーシャル・ペーパー

９．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの

10．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。）

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

12. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第１号に掲げる外国投資信託の受益証券および第２号から第７号に掲げる証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）を以下「投資信託証券」といい、第10号の証券を以下「公社債」といいます。公社債にかかる運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売り戻し条件付きの買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借り入れ）に限り行うことができるものとします。

（ロ）委託者は、信託金を、上記（イ）に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

（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は、委託者は、信託金を、上記（ロ）に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。 ・投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。 ・株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年１月14日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2002年１月15日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

東証株価指数について

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

① 東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

② ㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③ ㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

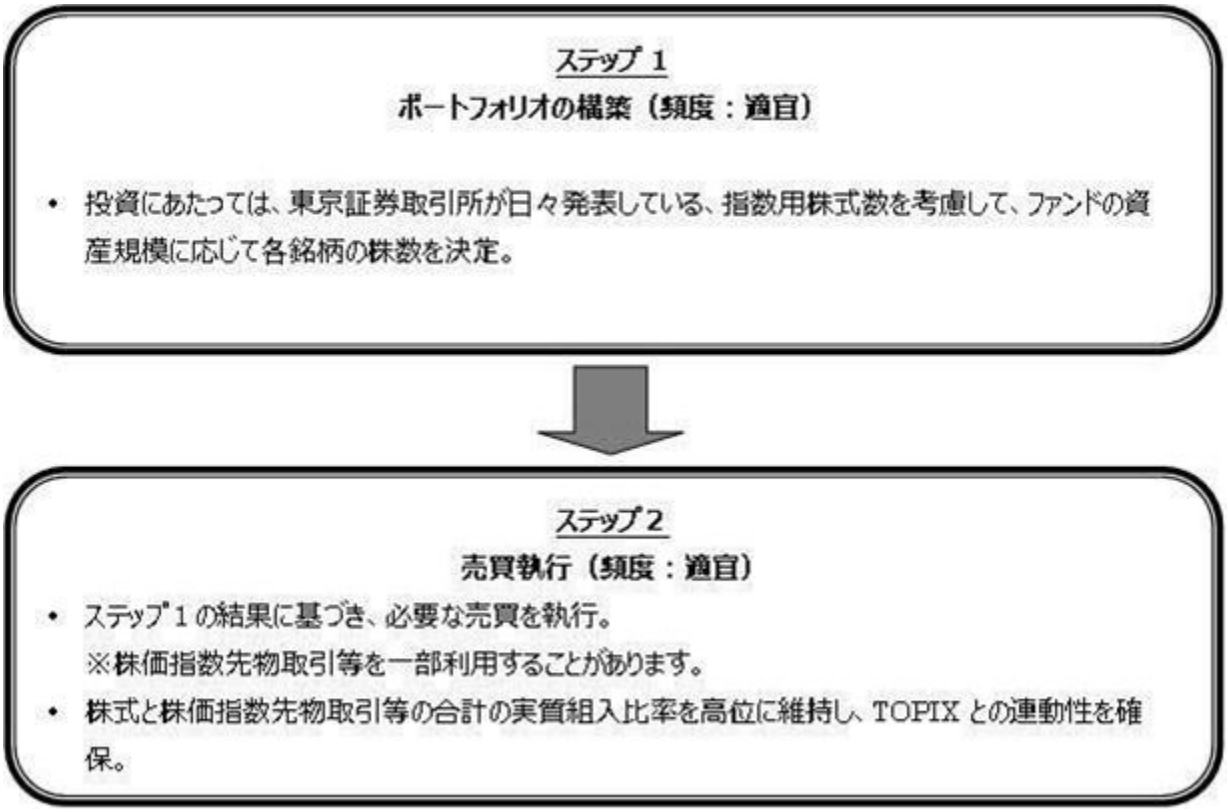
④ ㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

⑤ 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、㈱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。
⑥ ㈱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。
⑦ ㈱東京証券取引所は、委託会社またはニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
⑧ 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所はニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

運用プロセス

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



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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光日本債券インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・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。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10％以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限ります。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年８月17日
委託会社	アセットマネジメント0ne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合について

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

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

運用プロセス

新光日本債券インデックスマザーファンドは、以下のプロセスにより「ＮＯＭＵＲＡ－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。

ステップ1	
意思決定の範囲	NOMURA-BPI総合に関わる情報収集と対応
内容	NOMURA-BPI総合は月次で構成銘柄の入替えが行われるため、野村総合研究所からの情報等でポートフォリオとベンチマークの乖離をチェックします。

↓

ステップ2	
意思決定の範囲	売買規模の決定（銘柄、額面）
内容	ファンドの設定解約に伴う資金の流出入を元に、ファンドの連動率確保のための売買規模を想定します。銘柄および数量を計量モデル等により決定し、NOMURA-BPI総合と連動性の高いポートフォリオを構築します。

↓

ステップ3	
意思決定の範囲	売買執行指図
内容	売買銘柄決定時に、各銘柄の流動性や売買銘柄数にも留意し、ベンチマークとの連動性を確保します。なお、ベンチマーク構成銘柄の変更時など、リバランスに関わる売買も適宜指示します。

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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 ・不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができるものとします。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

東証REIT指数（配当込み）について

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

① 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、㈱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㈱東京証券取引所が有しています。

② ㈱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。

③ ㈱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。

④ ㈱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、㈱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。

⑤ 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、㈱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。

⑥ ㈱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。

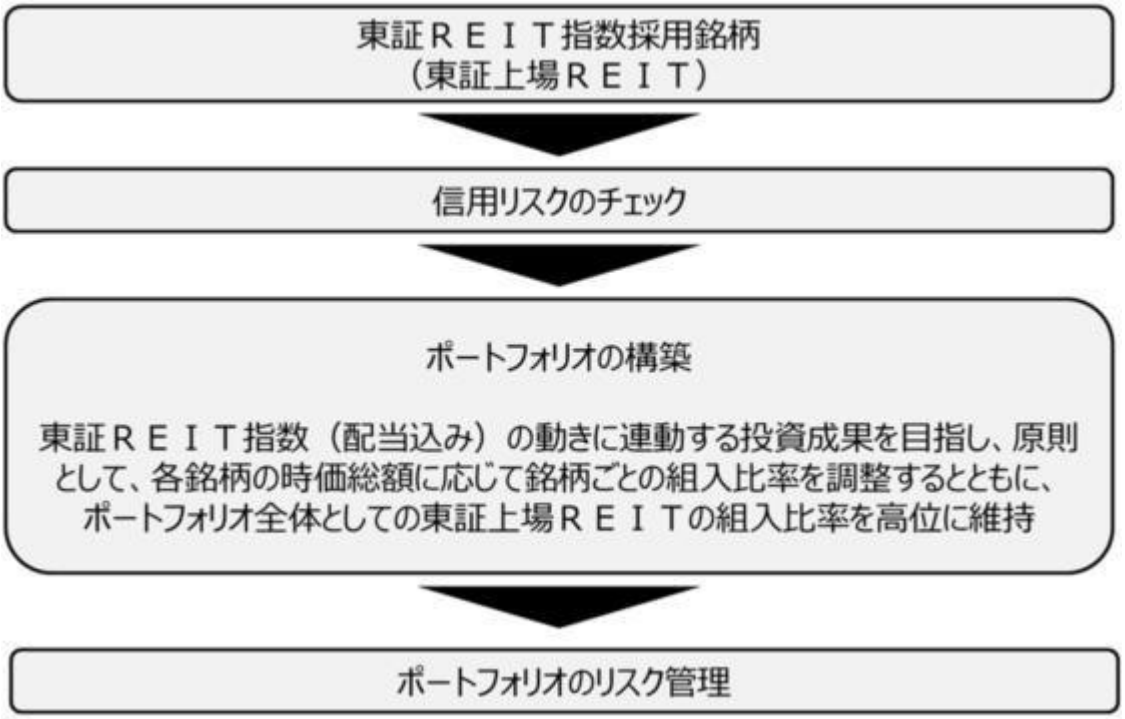
⑦ ㈱東京証券取引所は、委託会社または新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンドおよび新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑧ 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンドおよび新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

運用プロセス

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



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

※運用プロセスは2019年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年８月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

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

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

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

運用プロセス

新光外国株式インデックスマザーファンドは、以下のプロセスにより「MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）」に連動する投資成果をめざした運用を行います。

ステップ１
リスクモニタリング

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

↓

ステップ２
ポートフォリオの構築

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

↓

ステップ３
売買執行

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

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。
※運用プロセスは2019年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。 ・日本を除く、FTSE世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、７～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。 ・債券ポートフォリオは、日本を除くＧ７構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの６ヵ国）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。 ・通貨アロケーション ・イールドカーブ戦略 ・セクターアロケーション ・デュレーション調整 ・外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。
主な投資制限	・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限ります。 ・外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月４日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2001年11月５日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

FTSE世界国債インデックス（除く日本、７～10年、円ベース）について

FTSE世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

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

運用プロセス

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

※運用プロセスは2019年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

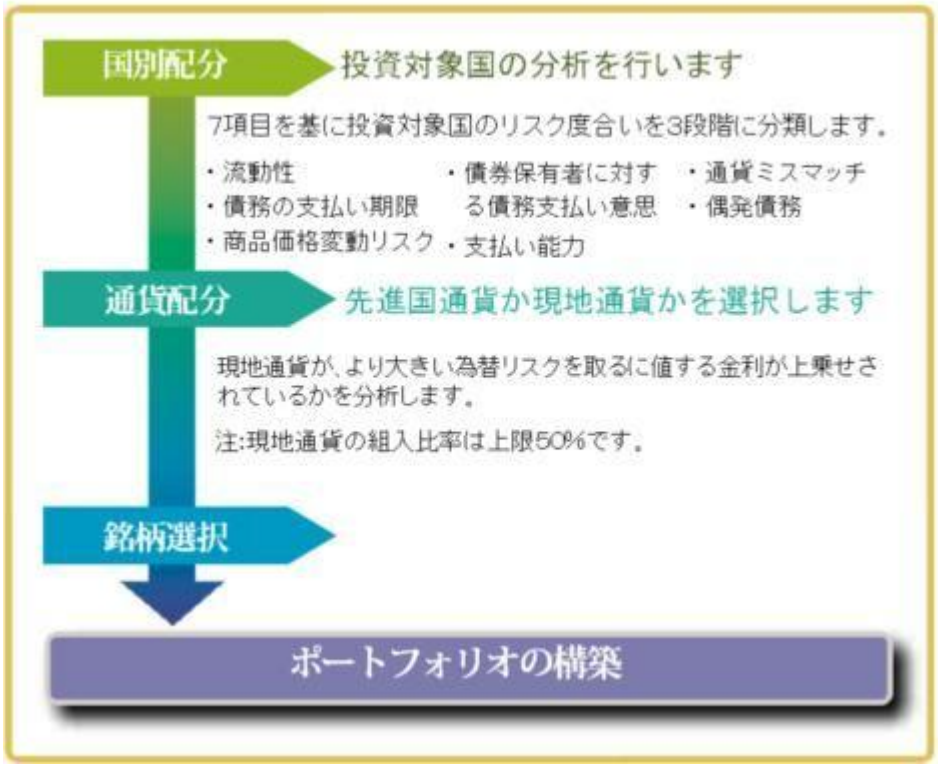
ファンド名	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド （以下、当概要において「ファンド」といいます。）
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託／円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、政府保証債は除きます。 ・クレジットリンク債への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・発行体格付けにおいて、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インクまたはＳ＆Ｐグローバル・レーティングのソブリン信用格付けがＣａａ１またはＣＣＣ＋以下の証券または無格付けの証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。 ・ファンドにおける証券の平均信用格付けは、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インクまたはＳ＆Ｐグローバル・レーティングの格付けにおいてＢ１またはＢ＋以上とします。 ・ファンドにおける証券の平均デュレーションは、８年以下とします。
信託期間	150年
決算日	毎年５月31日
収益分配方針	受託会社は毎月３日（休業日の場合は翌営業日）に受益者に分配金を支払います。当該月次分配にかかわらず、投資顧問会社および管理会社からの通知により受託会社は分配を行う場合があります。 分配はネット・インカム収益とネット実現損益の合計の範囲内で行うことができますが、受益者の利益にかなうと判断される場合には純資産から分配を行うこともできます。
信託報酬等	運用報酬　　：純資産総額に対し0.40% その他報酬※：純資産総額に対し0.15%（上限） ※その他報酬には、受託会社報酬、管理事務代行会社報酬、保管受託銀行報酬、監査報酬、法的費用が含まれます。
信託設定日	2006年３月８日
関係法人	受託会社兼管理事務代行会社：ＢＮＹ メロン ファンド マネジメント（ケイマン）リミテッド 副管理事務代行会社：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店 保管受託銀行：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン 管理会社：フランクリン テンプルトン インターナショナル サービシーズ エスエー アール エル 投資顧問会社：フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（ＦＴＩＭＬ社）は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンプルトン（設立：1947年、運用総資産：約74.9兆円※）の一員です。ＦＴＩＭＬ社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

※2019年９月末現在、１米ドル＝108.075円で換算

運用プロセス



出所：ＦＴＩＭＬ社資料を基にアセットマネジメントOne作成
※運用プロセスは2019年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「ＲＥＩＴ」といいます。）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。 ・ＲＥＩＴの組入比率は原則として高位を保ちます。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・ＲＥＩＴおよび短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 ・ＲＥＩＴへの投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄のＲＥＩＴへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

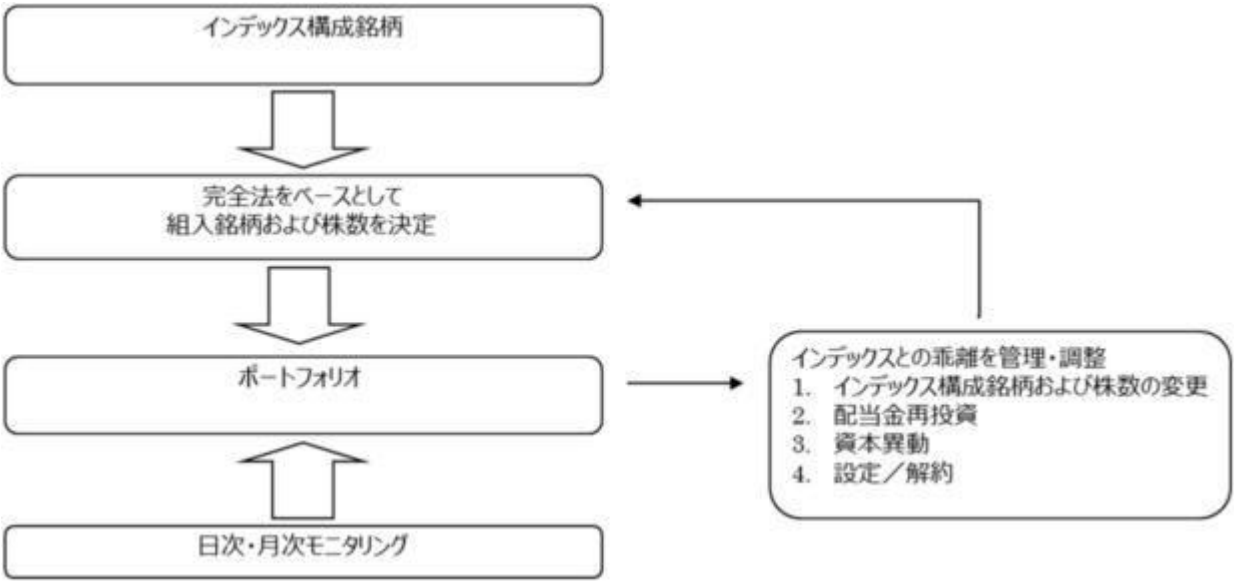
FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスについて

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

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

運用プロセス

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

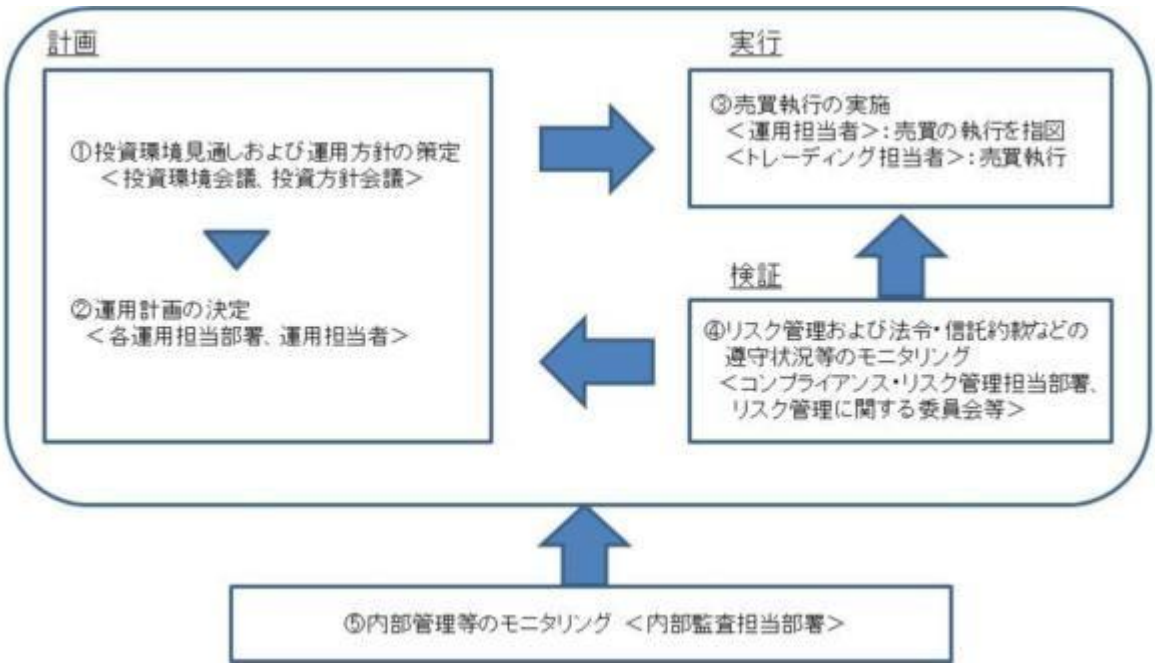


※運用プロセスは2019年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

※前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。
※前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は2020年１月21日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①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。

②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。

③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。

④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。
定期的に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。

⑤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10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

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

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

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

３．上記２．にかかわらず、上記２．にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。

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

ｂ．投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．分配金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

ｃ．毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

ｄ．「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して５営業日までに、受益者に支払われます。

「分配金再投資コース」の受益者の分配金は、税金を差し引いた後、別に定める契約に基づき、全額再投資されます。

（５）【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

ａ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ｂ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ｃ．公社債の借り入れ

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

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

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

ｄ．同一銘柄の投資信託証券への投資制限

委託者は、原則として、投資信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ｅ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券（外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。）への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

ｆ．外国為替予約の指図

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

ｇ．資金の借り入れ

（イ）委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、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り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を目的として資金借り入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10％を超えないこととします。

（ハ）収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

ｈ．受託者の自己または利害関係人等との取引

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

（ロ）上記（イ）の取り扱いは、約款に定める範囲内での委託者の指図による取引についても同様とします。

ｉ．デリバティブ取引等に係る投資制限

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

ｊ．信用リスク集中回避のための投資制限

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

ｋ．ファンドの投資制限

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

３【投資リスク】

（１）ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

ａ．資産配分リスク

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。

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

ｂ．株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

ｃ．ＲＥＩＴの価格変動リスク

ＲＥＩＴの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

ｄ．為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

ｅ．カントリーリスク

投資する国・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。

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

ｇ．信用リスク

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。

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

また、当ファンドが実質的に投資する株式の発行企業が、業績悪化、経営不振あるいは倒産などに陥った場合には、その企業の株式の価値が大きく減少すること、もしくは無くなることがあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。これらの影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

ｈ．流動性リスク

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しようとする場合、需要または供給が乏しいために、有価証券などを希望する時期に、希望する価格で、希望する数量を売買することができないリスクをいいます。

当ファンドまたは当ファンドが組み入れる投資信託証券が、特に流動性の低い有価証券などを売却する場合には、その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

ｉ．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

（イ）当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

（ロ）有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

（ハ）法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。

（ニ）投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。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）投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券（ベビーファンド）が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券（ベビーファンド）の価額が変動する可能性があります。

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

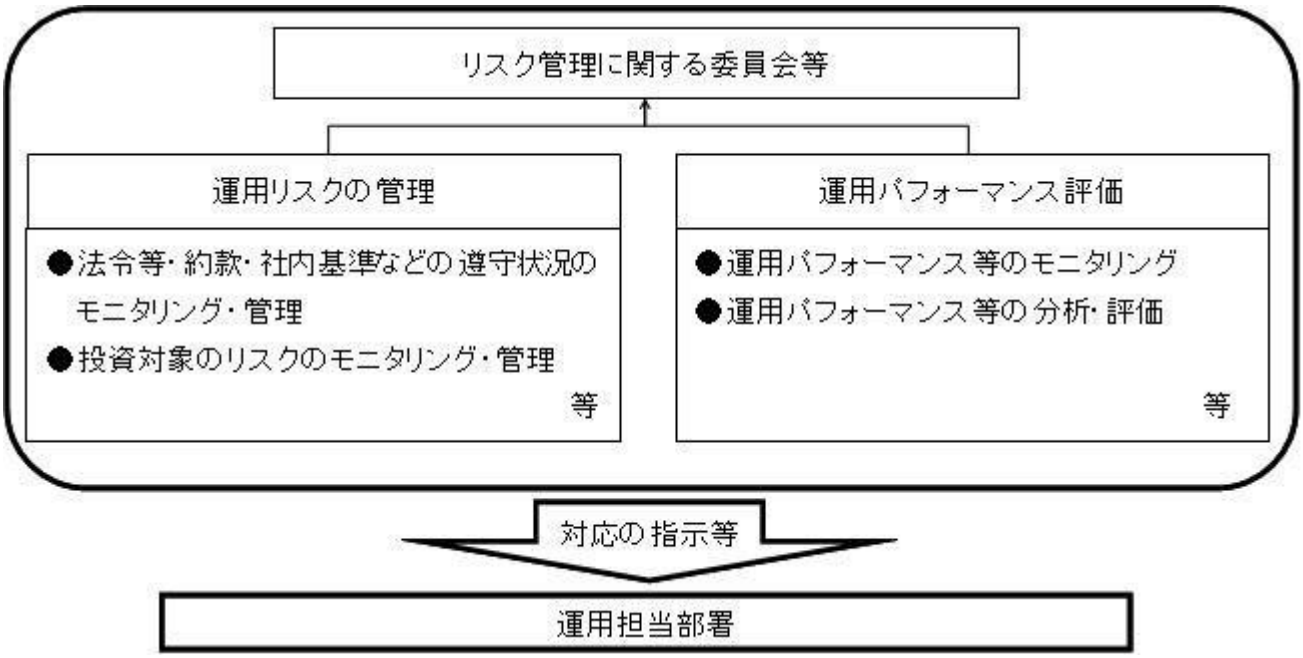
（２）リスク管理体制

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

・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。

・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。

・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

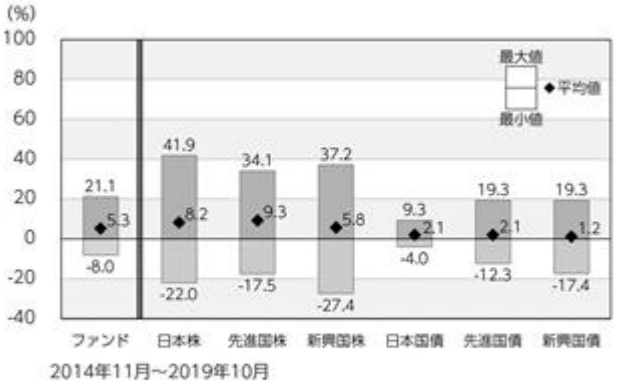


※リスク管理体制は2019年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

＊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。

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.75%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。商品および投資環境の説明・情報提供、購入の事務手続きなどの対価として販売会社にお支払いいただきます。当該手数料には消費税等が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

（２）【換金（解約）手数料】

ａ．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

ｂ．信託財産留保額

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

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

（３）【信託報酬等】

<table>
<tr><td>ファンド</td><td>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.045%（税抜0.95%）
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。
※運用管理費用（信託報酬）の配分は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。
<table>
<tr><th colspan="4">運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）</th></tr>
<tr><th>各販売会社の
取扱純資産額</th><th>委託会社</th><th>販売会社</th><th>受託会社</th></tr>
<tr><td>300億円未満の部分</td><td>年率0.42%</td><td>年率0.45%</td><td>年率0.08%</td></tr>
<tr><td>300億円以上
500億円未満の部分</td><td>年率0.37%</td><td>年率0.50%</td><td>年率0.08%</td></tr>
<tr><td>500億円以上の部分</td><td>年率0.32%</td><td>年率0.55%</td><td>年率0.08%</td></tr>
<tr><td>主な役務</td><td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td><td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価</td><td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td></tr>
</table>
※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド）に対する投資顧問報酬（投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうちのファンドにおける保有分に対し年率0.05%）が含まれます。</td></tr>
<tr><td>投資対象とする
外国投資信託</td><td>フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865%
※当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</td></tr>
<tr><td>実質的な負担</td><td>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.12365%（税抜1.02865%）程度
※上記は概算の数値です。実際の運用管理費用（信託報酬）は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。</td></tr>
</table>

（４）【その他の手数料等】

a．投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、監査法人に支払うファンドの監査報酬、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。

　投資信託財産にかかる監査報酬は毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、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。

b．証券取引に伴う手数料・税金等、当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税等および資産を外国で保管する場合の費用についても投資信託財産が負担します。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

ａ．個人の受益者に対する課税

（イ）収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（ロ）解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

（ハ）損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限ります。）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、ご留意ください。

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。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2019年10月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

ｃ．個別元本について

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

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

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

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

ｄ．収益分配金の課税について

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

収益分配の際、①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、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

令和1年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		635,023,000	12.68
	内　ケイマン諸島	635,023,000	12.68
親投資信託受益証券		4,240,013,280	84.68
	内　日本	4,240,013,280	84.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		132,075,637	2.64
純資産総額		5,007,111,917	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）
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10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		3,383,549,550	96.11
	内　日本	3,383,549,550	96.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		137,037,867	3.89
純資産総額		3,520,587,417	100.00

その他資産の投資状況

令和1年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		133,480,000	3.79
	内　日本	133,480,000	3.79

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

新光日本債券インデックスマザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		7,101,143,700	74.39
	内　日本	7,101,143,700	74.39
地方債証券		987,439,380	10.34
	内　日本	987,439,380	10.34
特殊債券		838,193,000	8.78
	内　日本	838,193,000	8.78
社債券		514,591,000	5.39
	内　日本	514,591,000	5.39
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		104,559,237	1.10
純資産総額		9,545,926,317	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）

投資証券		2,605,564,770	98.56
	内　日本	2,605,564,770	98.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		38,176,253	1.44
純資産総額		2,643,741,023	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		2,717,439,428	91.68
	内　アメリカ	1,767,478,158	59.63
	内　イギリス	165,672,481	5.59
	内　フランス	105,388,930	3.56
	内　スイス	104,302,326	3.52
	内　カナダ	102,818,902	3.47
	内　ドイツ	89,403,840	3.02
	内　オーストラリア	66,509,970	2.24
	内　オランダ	53,640,665	1.81
	内　アイルランド	52,167,861	1.76
	内　スペイン	29,497,071	1.00
	内　スウェーデン	25,539,328	0.86
	内　香港	24,142,628	0.81
	内　イタリア	19,438,891	0.66
	内　デンマーク	18,237,966	0.62
	内　バミューダ	13,880,723	0.47
	内　シンガポール	12,508,220	0.42
	内　フィンランド	11,839,071	0.40
	内　ジャージィー	10,277,149	0.35
	内　ベルギー	9,613,741	0.32
	内　ノルウェー	6,290,218	0.21
	内　ケイマン諸島	6,200,425	0.21
	内　イスラエル	5,464,830	0.18
	内　オランダ領キュラソー	3,503,018	0.12
	内　ルクセンブルグ	3,387,140	0.11
	内　オーストリア	2,023,903	0.07
	内　ポルトガル	1,934,513	0.07
	内　ニュージーランド	1,917,140	0.06
	内　リベリア	1,644,083	0.06
	内　パナマ	1,359,659	0.05
	内　イギリス領バージン諸島	616,843	0.02
	内　パプアニューギニア	467,541	0.02
	内　モーリシャス	272,194	0.01
投資信託受益証券		5,252,166	0.18
	内　オーストラリア	4,727,586	0.16
	内　シンガポール	524,580	0.02
投資証券		71,953,881	2.43
	内　アメリカ	64,576,512	2.18
	内　香港	1,914,045	0.06
	内　オランダ	1,498,257	0.05

	内　カナダ	1,462,499	0.05
	内　フランス	1,306,599	0.04
	内　イギリス	1,195,969	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		169,435,695	5.72
純資産総額		2,964,081,170	100.00

その他資産の投資状況

令和1年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		165,279,797	5.58
	内　アメリカ	116,143,657	3.92
	内　ドイツ	26,308,236	0.89
	内　オーストラリア	12,552,940	0.42
	内　イギリス	10,274,964	0.35

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

海外国債マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		18,046,995,878	97.97
	内　アメリカ	9,054,305,096	49.15
	内　フランス	3,057,200,376	16.60
	内　イタリア	2,641,649,812	14.34
	内　ドイツ	1,787,398,553	9.70
	内　イギリス	1,037,640,084	5.63
	内　カナダ	468,801,957	2.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		373,213,803	2.03
純資産総額		18,420,209,681	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		739,743,530	99.41
	内　アメリカ	739,743,530	99.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,389,159	0.59
純資産総額		744,132,689	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

令和1年10月31日現在

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

1	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	372,845,225	1.9616 731,410,477	1.9674 733,535,695	－ －	14.65
2	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	325,349,085	2.1932 713,588,148	2.2451 730,441,230	－ －	14.59
3	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	308,546,790	2.2877 705,893,346	2.2828 704,350,612	－ －	14.07
4	海外国債マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	294,983,390	2.3636 697,252,238	2.3642 697,399,730	－ －	13.93
5	新光外国株式インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	274,821,629	2.4773 680,843,103	2.5339 696,370,525	－ －	13.91
6	新光日本債券インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	520,033,360	1.3009 676,563,401	1.3036 677,915,488	－ －	13.54
7	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド ケイマン諸島	投資信託受益証券	239,000	2,661.0000 635,979,000	2,657.0000 635,023,000	－ －	12.68

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	12.68
親投資信託受益証券	84.68
合計	97.36

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	16,000	6,821.00 109,136,000	7,542.00 120,672,000	－ －	3.43
2	ソニー 日本	株式 電気機器	9,100	5,316.55 48,380,605	6,625.00 60,287,500	－ －	1.71
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	97,600	564.58 55,103,008	569.80 55,612,480	－ －	1.58
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	9,400	4,585.35 43,102,290	5,376.00 50,534,400	－ －	1.44
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	700	53,560.00 37,492,000	68,820.00 48,174,000	－ －	1.37
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	12,000	4,468.53 53,622,360	3,928.00 47,136,000	－ －	1.34
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	11,200	3,849.00 43,108,800	4,190.00 46,928,000	－ －	1.33
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	9,800	3,818.00 37,416,400	3,880.00 38,024,000	－ －	1.08
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	9,800	2,852.00 27,949,600	3,611.00 35,387,800	－ －	1.01
10	任天堂 日本	株式 その他製品	900	31,237.94 28,114,150	38,620.00 34,758,000	－ －	0.99
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	11,300	3,170.00 35,821,000	2,942.00 33,244,600	－ －	0.94
12	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	192,700	174.09 33,547,143	168.80 32,527,760	－ －	0.92
13	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	10,500	2,663.72 27,969,060	2,999.00 31,489,500	－ －	0.89
14	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	10,400	2,618.16 27,228,890	2,975.00 30,940,000	－ －	0.88
15	信越化学工業 日本	株式 化学	2,500	8,610.00 21,525,000	12,160.00 30,400,000	－ －	0.86
16	ファナック 日本	株式 電気機器	1,400	17,185.00 24,059,000	21,600.00 30,240,000	－ －	0.86
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	5,100	5,185.00 26,443,500	5,868.00 29,926,800	－ －	0.85

18	花王 日本	株式 化学	3,400	7,475.00 25,415,000	8,744.00 29,729,600	－ －	0.84
19	第一三共 日本	株式 医薬品	4,100	3,632.00 14,891,200	7,140.00 29,274,000	－ －	0.83
20	日立製作所 日本	株式 電気機器	6,900	3,386.83 23,369,160	4,069.00 28,076,100	－ －	0.80
21	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	2,900	6,412.00 18,594,800	9,603.00 27,848,700	－ －	0.79
22	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,800	12,150.00 21,870,000	15,230.00 27,414,000	－ －	0.78
23	三菱商事 日本	株式 卸売業	9,900	3,091.00 30,600,900	2,764.00 27,363,600	－ －	0.78
24	日本電産 日本	株式 電気機器	1,700	12,290.00 20,893,000	16,085.00 27,344,500	－ －	0.78
25	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	1,200	23,790.00 28,548,000	22,295.00 26,754,000	－ －	0.76
26	資生堂 日本	株式 化学	2,900	6,103.14 17,699,106	8,968.00 26,007,200	－ －	0.74
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	4,200	4,470.38 18,775,596	5,863.00 24,624,600	－ －	0.70
28	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	2,500	9,945.00 24,862,500	9,849.00 24,622,500	－ －	0.70
29	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	1,500	11,100.00 16,650,000	15,885.00 23,827,500	－ －	0.68
30	ＳＭＣ 日本	株式 機械	500	37,252.84 18,626,420	47,190.00 23,595,000	－ －	0.67

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.11
合計	96.11

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年10月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	13.55
情報・通信業		8.02
輸送用機器		7.67
化学		7.13
銀行業		5.62
医薬品		5.57
機械		5.00
サービス業		4.88
卸売業		4.73
小売業		4.54
陸運業		4.31
食料品		3.79
建設業		2.72
不動産業		2.39
保険業		2.22
その他製品		2.19
精密機器		2.16
電気・ガス業		1.56
その他金融業		1.09
ガラス・土石製品		0.82
ゴム製品		0.77
証券、商品先物取引業		0.75
非鉄金属		0.74
鉄鋼		0.74
繊維製品		0.60
金属製品		0.58
石油・石炭製品		0.52
空運業		0.50
鉱業		0.26
パルプ・紙		0.23
海運業		0.17
倉庫・運輸関連業		0.16
水産・農林業		0.10
合計		96.11

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

新光日本債券インデックスマザーファンド

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	120.13 120,130,000	121.46 121,463,000	2.1 2029/12/28	1.27
2	１８回　東京都公募公債　２０年 日本	地方債証券	100,000,000	119.97 119,970,000	120.75 120,757,000	2.22 2029/3/19	1.27

3	１２８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	120,000,000	100.58 120,703,200	100.53 120,638,400	0.1 2021/6/20	1.26
4	１２７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	120,000,000	100.54 120,649,200	100.45 120,540,000	0.1 2021/3/20	1.26
5	３６回　東日本旅客鉄道社債 日本	社債券	100,000,000	111.89 111,890,000	110.40 110,409,000	2.11 2024/12/20	1.16
6	１２回　兵庫県公募公債１５年 日本	地方債証券	100,000,000	104.77 104,770,000	107.60 107,609,000	0.781 2030/12/6	1.13
7	４９回　政保地方公共団体金融機構債券 日本	特殊債券	100,000,000	104.11 104,110,000	103.51 103,518,000	0.882 2023/6/16	1.08
8	２４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	102.98 102,980,000	103.20 103,206,000	0.484 2025/6/30	1.08
9	５８回　政保地方公共団体金融機構債券 日本	特殊債券	100,000,000	103.44 103,440,000	103.20 103,204,000	0.645 2024/3/15	1.08
10	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	100,000,000	100.13 100,139,000	102.90 102,907,000	0.1 2028/3/20	1.08
11	４回　第一三共社債 日本	社債券	100,000,000	103.23 103,230,000	102.80 102,806,000	0.846 2023/9/15	1.08
12	１０４回　日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	102.91 102,910,000	102.45 102,453,000	0.715 2023/3/20	1.07
13	３４回　政保地方公共団体金融機構債券 日本	特殊債券	100,000,000	103.08 103,080,000	102.33 102,336,000	0.9 2022/3/14	1.07
14	２４年度７回　広島県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	102.83 102,830,000	102.33 102,331,000	0.67 2023/3/27	1.07
15	２４年度２回　広島市公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	102.79 102,790,000	102.24 102,249,000	0.7 2022/12/22	1.07
16	３１３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	100,000,000	103.36 103,367,000	102.11 102,112,000	1.3 2021/3/20	1.07
17	３２７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	100.21 100,210,000	101.92 101,927,000	0.17 2027/10/29	1.07
18	７８３回　東京都公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	100.32 100,328,000	101.90 101,909,000	0.22 2028/6/20	1.07
19	１６９回　共同発行市場公募地方債 日本	地方債証券	100,000,000	100.29 100,290,000	101.57 101,574,000	0.205 2027/4/23	1.06
20	２１８回　神奈川県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	100.57 100,570,000	101.29 101,294,000	0.195 2025/12/19	1.06

21	１１回　ブリヂストン社債 日本	社債券	100,000,000	99.80 99,800,000	100.75 100,752,000	0.295 2027/4/21	1.06
22	４７回　野村ホールディングス社債 日本	社債券	100,000,000	100.91 100,910,000	100.66 100,666,000	0.472 2021/12/24	1.05
23	３１７回　利附信金中金債（５年） 日本	特殊債券	100,000,000	100.00 100,000,000	100.08 100,086,000	0.06 2021/4/27	1.05
24	４４回　ホンダファイナンス社債 日本	社債券	100,000,000	99.83 99,830,000	99.95 99,958,000	0.08 2022/9/20	1.05
25	３３９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	90,000,000	102.91 92,619,900	103.86 93,475,800	0.4 2025/6/20	0.98
26	３３３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	103.59 82,876,800	103.81 83,048,000	0.6 2024/3/20	0.87
27	３３５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	103.28 82,630,400	103.78 83,028,000	0.5 2024/9/20	0.87
28	３３８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	103.36 82,689,800	103.68 82,948,800	0.4 2025/3/20	0.87
29	３４６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	100.54 80,432,000	102.78 82,228,800	0.1 2027/3/20	0.86
30	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	101.43 81,148,600	102.59 82,076,000	0.1 2026/9/20	0.86

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	74.39
地方債証券	10.34
特殊債券	8.78
社債券	5.39
合計	98.90

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	221	823,000.00 181,883,000	820,000.00 181,220,000	－ －	6.85
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	228	732,000.00 166,896,000	737,000.00 168,036,000	－ －	6.36
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	712	204,700.00 145,746,400	206,500.00 147,028,000	－ －	5.56
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	513	217,000.00 111,321,000	218,000.00 111,834,000	－ －	4.23
5	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	455	236,700.00 107,698,500	244,400.00 111,202,000	－ －	4.21
6	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	432	245,409.79 106,017,030	252,000.00 108,864,000	－ －	4.12
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	328	307,500.00 100,860,000	302,000.00 99,056,000	－ －	3.75
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	308	317,500.00 97,790,000	314,500.00 96,866,000	－ －	3.66
9	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	569	147,000.00 83,643,000	140,800.00 80,115,200	－ －	3.03
10	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	217	362,000.00 78,554,000	359,000.00 77,903,000	－ －	2.95
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	145	520,000.00 75,400,000	519,000.00 75,255,000	－ －	2.85
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	1,002	68,200.05 68,336,460	68,300.00 68,436,600	－ －	2.59
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	668	102,800.00 68,670,400	99,900.00 66,733,200	－ －	2.52
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	736	85,499.02 62,927,283	89,700.00 66,019,200	－ －	2.50
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	114	580,000.00 66,120,000	570,000.00 64,980,000	－ －	2.46
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	71	863,000.00 61,273,000	846,000.00 60,066,000	－ －	2.27

17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	76	698,000.00 53,048,000	680,000.00 51,680,000	－ －	1.95
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	281	170,700.00 47,966,700	169,300.00 47,573,300	－ －	1.80
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	263	183,400.00 48,234,200	178,600.00 46,971,800	－ －	1.78
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	53	843,000.00 44,679,000	861,000.00 45,633,000	－ －	1.73
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	149	279,700.00 41,675,300	274,700.00 40,930,300	－ －	1.55
22	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	194	207,500.00 40,255,000	206,200.00 40,002,800	－ －	1.51
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	81	493,000.00 39,933,000	482,500.00 39,082,500	－ －	1.48
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	246	157,300.00 38,695,800	155,400.00 38,228,400	－ －	1.45
25	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	204	181,500.00 37,026,000	185,900.00 37,923,600	－ －	1.43
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	74	470,000.00 34,780,000	469,000.00 34,706,000	－ －	1.31
27	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	212	164,200.00 34,810,400	160,900.00 34,110,800	－ －	1.29
28	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人 日本	投資証券	271	126,000.00 34,146,000	125,400.00 33,983,400	－ －	1.29
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	95	353,000.00 33,535,000	352,000.00 33,440,000	－ －	1.26
30	プレミア投資法人 日本	投資証券	206	168,000.00 34,608,000	162,100.00 33,392,600	－ －	1.26

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	98.56
合計	98.56

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	3,035	22,262.69 67,567,275	26,486.14 80,385,461	－ －	2.71
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	4,797	11,929.98 57,228,121	15,745.13 75,529,421	－ －	2.55
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	280	186,449.37 52,205,825	193,805.31 54,265,487	－ －	1.83
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	1,581	15,783.24 24,953,310	20,496.65 32,405,219	－ －	1.09
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	2,137	12,117.25 25,894,574	13,689.48 29,254,423	－ －	0.99
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	208	116,082.40 24,145,141	137,329.25 28,564,485	－ －	0.96
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	195	117,265.93 22,866,857	137,265.01 26,766,678	－ －	0.90
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	1,746	15,824.61 27,629,785	14,463.61 25,253,479	－ －	0.85
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	2,015	9,409.37 18,959,884	11,663.65 23,502,264	－ －	0.79
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	1,646	10,061.60 16,561,394	13,603.46 22,391,307	－ －	0.76

11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	1,139	15,671.09 17,849,381	19,516.73 22,229,566	－ －	0.75
12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,783	8,805.12 24,504,664	7,373.35 20,520,043	－ －	0.69
13	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	5,927	3,105.25 18,404,861	3,442.78 20,405,390	－ －	0.69
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	858	23,913.31 20,517,623	23,218.65 19,921,610	－ －	0.67
15	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	4,781	3,341.52 15,975,841	4,159.21 19,885,211	－ －	0.67
16	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	720	20,250.59 14,580,425	25,721.81 18,519,704	－ －	0.62
17	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	2,939	5,238.21 15,395,119	6,162.60 18,111,904	－ －	0.61
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	595	22,387.90 13,320,803	30,176.09 17,954,774	－ －	0.61
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	2,704	6,365.12 17,211,297	6,622.08 17,906,108	－ －	0.60
20	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	620	30,110.76 18,668,673	27,742.62 17,200,426	－ －	0.58
21	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	1,175	12,748.75 14,979,792	14,110.84 16,580,246	－ －	0.56
22	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	2,803	5,774.99 16,187,311	5,665.02 15,879,068	－ －	0.54
23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,253	13,012.24 16,304,347	12,669.27 15,874,603	－ －	0.54
24	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	1,686	8,150.75 13,742,175	9,387.63 15,827,550	－ －	0.53
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	2,654	5,409.15 14,355,906	5,872.98 15,586,908	－ －	0.53

26	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	3,638	4,821.20 17,539,548	4,189.70 15,242,137	－ －	0.51
27	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	462	27,693.74 12,794,509	32,684.89 15,100,422	－ －	0.51
28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	2,787	5,129.33 14,295,461	5,178.33 14,432,013	－ －	0.49
29	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	2,936	4,174.45 12,256,212	4,865.84 14,286,127	－ －	0.48
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	914	12,791.22 11,691,177	14,905.67 13,623,784	－ －	0.46

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	91.68
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.43
合計	94.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年10月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	7.48
医薬品		5.14
ソフトウェア		4.99
石油・ガス・消耗燃料		4.81
情報技術サービス		3.87
保険		3.65
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.16
半導体・半導体製造装置		3.03
コンピュータ・周辺機器		3.00
資本市場		2.70
ヘルスケア機器・用品		2.63
インターネット販売・通信販売		2.35
航空宇宙・防衛		2.23
化学		2.14
各種電気通信サービス		2.04
電力		1.98
飲料		1.90
食品		1.89
バイオテクノロジー		1.82
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.81
ホテル・レストラン・レジャー		1.71
専門小売り		1.68
機械		1.56
食品・生活必需品小売り		1.46
繊維・アパレル・贅沢品		1.41
家庭用品		1.35
金属・鉱業		1.26
コングロマリット		1.26
メディア		1.23
娯楽		1.21
総合公益事業		1.07
陸運・鉄道		0.92
各種金融サービス		0.90
自動車		0.81
タバコ		0.80
通信機器		0.76
専門サービス		0.73
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.73
パーソナル用品		0.70
電気設備		0.69
航空貨物・物流サービス		0.53
複合小売り		0.52
不動産管理・開発		0.51
電子装置・機器・部品		0.50
消費者金融		0.48
商業サービス・用品		0.48
家庭用耐久財		0.39

建設関連製品	0.39
建設・土木	0.34
無線通信サービス	0.30
建設資材	0.29
容器・包装	0.28
エネルギー設備・サービス	0.27
自動車部品	0.27
商社・流通業	0.26
運送インフラ	0.21
ガス	0.19
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
紙製品・林産品	0.10
旅客航空輸送業	0.10
水道	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
販売	0.05
レジャー用品	0.04
海運業	0.04
各種消費者サービス	0.01
合計	91.68

（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。

海外国債マザーファンド

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	751,272,000	102.19 767,798,147	108.96 818,593,009	2.875 2028/8/15	4.44
2	US T N/B 2.375 05/15/29 アメリカ	国債証券	762,160,000	102.31 779,814,722	105.10 801,042,064	2.375 2029/5/15	4.35
3	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	762,160,000	97.71 744,779,690	103.71 790,443,277	2.25 2027/2/15	4.29
4	US T N/B 2.0 11/15/26 アメリカ	国債証券	762,160,000	97.27 741,415,638	101.99 777,343,652	2 2026/11/15	4.22
5	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証券	762,160,000	100.98 769,662,512	98.47 750,548,964	1.625 2029/8/15	4.07
6	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	653,280,000	103.78 678,022,810	111.21 726,569,850	3.125 2028/11/15	3.94
7	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	653,280,000	97.81 638,978,612	108.82 710,952,375	2.875 2028/5/15	3.86
8	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	653,280,000	100.70 657,905,954	107.19 700,285,534	2.625 2029/2/15	3.80
9	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	642,392,000	97.65 627,355,366	107.70 691,876,258	2.75 2028/2/15	3.76
10	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	653,280,000	94.49 617,289,036	104.72 684,157,684	2.375 2027/5/15	3.71
11	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	653,280,000	93.07 608,043,082	103.82 678,237,334	2.25 2027/11/15	3.68

12	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	653,280,000	93.27 609,329,229	103.80 678,135,259	2.25 2027/8/15	3.68
13	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	485,840,000	118.71 576,740,664	124.31 603,969,080	2.75 2027/10/25	3.28
14	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	364,380,000	152.60 556,075,459	153.92 560,874,101	5.5 2029/4/25	3.04
15	FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス	国債証券	425,110,000	102.18 434,407,763	108.19 459,927,614	0.75 2028/11/25	2.50
16	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	364,380,000	119.33 434,843,804	118.57 432,066,864	3 2029/8/1	2.35
17	UK TREASURY 6.0 12/07/28 イギリス	国債証券	267,083,000	145.98 389,888,466	148.17 395,742,222	6 2028/12/7	2.15
18	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	364,380,000	100.22 365,181,636	108.15 394,084,257	0.75 2028/5/25	2.14
19	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	364,380,000	103.31 376,451,909	105.78 385,449,909	0.5 2029/5/25	2.09
20	ITALY BTPS 6.5 11/01/27 イタリア	国債証券	242,920,000	124.80 303,164,160	143.98 349,756,216	6.5 2027/11/1	1.90
21	DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 ドイツ	国債証券	303,650,000	101.91 309,474,007	107.90 327,651,406	0.5 2027/8/15	1.78
22	ITALY BTPS 4.75 09/01/28 イタリア	国債証券	242,920,000	118.95 288,956,983	132.97 323,032,829	4.75 2028/9/1	1.75
23	FRANCE OAT 0.25 11/25/26 フランス	国債証券	279,358,000	102.08 285,193,302	103.92 290,321,404	0.25 2026/11/25	1.58
24	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証券	242,920,000	103.11 250,482,099	116.44 282,874,024	2.8 2028/12/1	1.54
25	ITALY BTPS 2.2 06/01/27 イタリア	国債証券	242,920,000	92.96 225,818,432	110.61 268,693,812	2.2 2027/6/1	1.46
26	ITALY BTPS 2.0 02/01/28 イタリア	国債証券	242,920,000	90.67 220,255,564	109.53 266,077,077	2 2028/2/1	1.44
27	ITALY BTPS 2.05 08/01/27 イタリア	国債証券	242,920,000	91.56 222,417,552	109.50 265,997,642	2.05 2027/8/1	1.44
28	ITALY BTPS 7.25 11/01/26 イタリア	国債証券	182,190,000	128.85 234,751,815	144.75 263,720,025	7.25 2026/11/1	1.43
29	DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 ドイツ	国債証券	242,920,000	98.56 239,429,239	106.05 257,631,235	0.25 2028/8/15	1.40
30	US T N/B 2.875 05/15/49 アメリカ	国債証券	217,760,000	113.66 247,527,622	113.02 246,119,836	2.875 2049/5/15	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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.97
合計	97.97

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券	2,435	24,935.38 60,717,664	23,653.09 57,595,277	－ －	7.74
2	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	2,298	15,682.07 36,037,399	15,161.53 34,841,218	－ －	4.68
3	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	3,478	9,755.47 33,929,537	9,546.59 33,203,069	－ －	4.46
4	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	464	62,757.08 29,119,286	62,187.89 28,855,185	－ －	3.88
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	1,702	16,324.10 27,783,627	16,460.47 28,015,734	－ －	3.76
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	2,244	10,025.65 22,497,577	9,849.28 22,101,795	－ －	2.97
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	820	26,287.83 21,556,025	24,308.54 19,933,010	－ －	2.68
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	2,025	9,622.04 19,484,633	9,673.98 19,589,825	－ －	2.63
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	771	23,971.28 18,481,860	23,842.54 18,382,600	－ －	2.47
10	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証券	621	26,576.07 16,503,742	26,336.98 16,355,266	－ －	2.20
11	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,150	14,476.50 16,647,980	14,090.16 16,203,684	－ －	2.18
12	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	1,762	8,654.22 15,248,744	8,921.62 15,719,907	－ －	2.11
13	VENTAS INC アメリカ	投資証券	2,061	7,928.37 16,340,380	7,066.31 14,563,669	－ －	1.96
14	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証券	4,123	3,080.28 12,700,010	3,269.66 13,480,834	－ －	1.81
15	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	856	13,982.56 11,969,078	15,126.69 12,948,453	－ －	1.74
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	362	36,069.76 13,057,256	35,674.53 12,914,180	－ －	1.74
17	HCP INC アメリカ	投資証券	2,722	4,070.72 11,080,515	4,016.58 10,933,139	－ －	1.47

18	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	618	16,988.52 10,498,910	17,318.45 10,702,803	－ －	1.44
19	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	935	10,174.10 9,512,785	10,036.55 9,384,182	－ －	1.26
20	MID AMERICA アメリカ	投資証券	628	14,715.97 9,241,633	14,890.42 9,351,189	－ －	1.26
21	UDR INC アメリカ	投資証券	1,605	5,422.56 8,703,223	5,483.19 8,800,530	－ －	1.18
22	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	2,638	3,357.79 8,857,854	3,316.48 8,748,886	－ －	1.18
23	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	490	16,965.47 8,313,084	17,461.08 8,555,931	－ －	1.15
24	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	684	12,436.29 8,506,428	12,069.34 8,255,434	－ －	1.11
25	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	1,989	3,699.65 7,358,612	3,864.15 7,685,796	－ －	1.03
26	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	4,004	1,790.11 7,167,640	1,813.94 7,263,018	－ －	0.98
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	959	7,516.05 7,207,899	7,529.05 7,220,360	－ －	0.97
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	920	7,493.78 6,894,283	7,594.37 6,986,829	－ －	0.94
29	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	956	6,799.22 6,500,059	7,263.38 6,943,795	－ －	0.93
30	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,554	2,519.99 6,436,059	2,612.03 6,671,127	－ －	0.90

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	99.41
合計	99.41

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

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。

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。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

海外国債マザーファンド
該当事項はありません。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０１１２月	買建	8	128,642,604	133,480,000	3.79

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

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。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド
該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和1年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec19	買建	7	113,406,686	116,143,657	3.92
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec19	買建	6	25,541,823	26,308,236	0.89
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec19	買建	1	12,573,642	12,552,940	0.42
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec19	買建	1	10,249,661	10,274,964	0.35

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

海外国債マザーファンド
該当事項はありません。

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】

①【純資産の推移】

直近日（令和1年10月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	１口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	１口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第7特定期間末 (平成22年 4月20日)	16,678	16,777	0.6743	0.6783
第8特定期間末 (平成22年10月20日)	13,023	13,108	0.6117	0.6157
第9特定期間末 (平成23年 4月20日)	12,014	12,090	0.6284	0.6324
第10特定期間末 (平成23年10月20日)	9,331	9,365	0.5447	0.5467
第11特定期間末 (平成24年 4月20日)	8,395	8,423	0.5983	0.6003
第12特定期間末 (平成24年10月22日)	7,563	7,588	0.5969	0.5989
第13特定期間末 (平成25年 4月22日)	9,376	9,400	0.7854	0.7874
第14特定期間末 (平成25年10月21日)	8,609	8,631	0.7728	0.7748
第15特定期間末 (平成26年 4月21日)	8,104	8,125	0.7970	0.7990
第16特定期間末 (平成26年10月20日)	7,644	7,663	0.8254	0.8274
第17特定期間末 (平成27年 4月20日)	7,692	7,709	0.9283	0.9303
第18特定期間末 (平成27年10月20日)	6,937	6,952	0.8993	0.9013
第19特定期間末 (平成28年 4月20日)	6,329	6,344	0.8666	0.8686
第20特定期間末 (平成28年10月20日)	5,699	5,713	0.8330	0.8350
第21特定期間末 (平成29年 4月20日)	5,622	5,635	0.8684	0.8704
第22特定期間末 (平成29年10月20日)	5,597	5,609	0.9138	0.9158
第23特定期間末 (平成30年 4月20日)	5,336	5,348	0.8885	0.8905
第24特定期間末 (平成30年10月22日)	5,115	5,126	0.8935	0.8955
第25特定期間末 (平成31年 4月22日)	5,013	5,024	0.9197	0.9217
第26特定期間末 (令和1年10月21日)	4,980	4,991	0.9464	0.9484
平成30年10月末日	5,056	－	0.8897	－

11月末日	5,113	－	0.9029	－
12月末日	4,841	－	0.8585	－
平成31年1月末日	4,972	－	0.8860	－
2月末日	5,057	－	0.9032	－
3月末日	5,051	－	0.9144	－
4月末日	5,001	－	0.9189	－
令和1年5月末日	4,834	－	0.8979	－
6月末日	4,879	－	0.9091	－
7月末日	4,910	－	0.9239	－
8月末日	4,847	－	0.9140	－
9月末日	4,925	－	0.9339	－
10月末日	5,007	－	0.9525	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第7特定期間	0.0240
第8特定期間	0.0240
第9特定期間	0.0240
第10特定期間	0.0220
第11特定期間	0.0120
第12特定期間	0.0120
第13特定期間	0.0120
第14特定期間	0.0120
第15特定期間	0.0120
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0120
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0120
第26特定期間	0.0120

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第7特定期間	7.0
第8特定期間	△5.7
第9特定期間	6.7
第10特定期間	△9.8
第11特定期間	12.0
第12特定期間	1.8
第13特定期間	33.6
第14特定期間	△0.1
第15特定期間	4.7
第16特定期間	5.1
第17特定期間	13.9
第18特定期間	△1.8
第19特定期間	△2.3
第20特定期間	△2.5
第21特定期間	5.7
第22特定期間	6.6
第23特定期間	△1.5
第24特定期間	1.9
第25特定期間	4.3
第26特定期間	4.2

（注1）収益率は期間騰落率です。
（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

（４）【設定及び解約の実績】

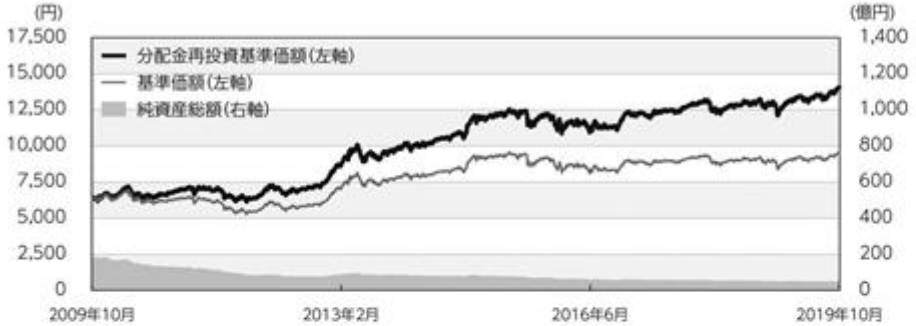
	設定口数	解約口数
第7特定期間	65,470,071	5,293,476,712
第8特定期間	64,807,629	3,510,685,871
第9特定期間	93,294,151	2,262,935,013
第10特定期間	55,270,668	2,043,398,766
第11特定期間	24,129,070	3,124,126,893
第12特定期間	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	22,407,208	820,891,392
第15特定期間	25,208,228	996,341,985
第16特定期間	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	13,815,643	989,033,927
第18特定期間	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	5,348,676	374,412,075
第22特定期間	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	45,095,213	164,575,560
第24特定期間	4,817,074	285,434,876
第25特定期間	13,966,043	287,993,351
第26特定期間	34,127,005	222,623,381

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

≪参考情報≫

データの基準日:2019年10月31日

基準価額・純資産の推移 (2009年10月30日～2019年10月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2006年10月31日)

分配の推移(税引前)

2019年 6月	20円
2019年 7月	20円
2019年 8月	20円
2019年 9月	20円
2019年10月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	4,160円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	新光米国REITマザーファンド	14.65
2	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド	14.59
3	新光J-REITマザーファンド	14.07
4	海外国債マザーファンド	13.93
5	新光外国株式インデックスマザーファンド	13.91
6	新光日本債券インデックスマザーファンド	13.54
7	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド	12.68

■ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.43
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.71
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.58
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.44
5	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.37

■新光日本債券インデックスマザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	97回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	特殊債券	日本	2.1	2029/12/28	1.27
2	18回　東京都公募公債　20年	地方債証券	日本	2.22	2029/3/19	1.27
3	128回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/6/20	1.26
4	127回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/3/20	1.26
5	36回　東日本旅客鉄道社債	社債券	日本	2.11	2024/12/20	1.16

■新光J-REITマザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.85
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	6.36
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	5.56
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	4.23
5	オリックス不動産投資法人	日本	4.21

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年10月31日

■新光外国株式インデックスマザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.71
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.55
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.83
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.09
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	0.99

■海外国債マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/8/15	4.44
2	US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	アメリカ	2.375	2029/5/15	4.35
3	US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	アメリカ	2.25	2027/2/15	4.29
4	US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	アメリカ	2	2026/11/15	4.22
5	US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	アメリカ	1.625	2029/8/15	4.07

■フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド(現地2019年10月14日現在)

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

①組入公社債の上位5通貨

順位	通貨	比率(%)
1	米ドル	61.2
2	南アフリカランド	4.4
3	メキシコペソ	3.9
4	ウルグアイペソ	3.4
5	コロンビアペソ	3.0

②組入公社債の上位5ヵ国

順位	国/地域	比率(%)
1	南アフリカ	6.5
2	トルコ	6.2
3	コロンビア	5.1
4	メキシコ	5.0
5	その他	4.4

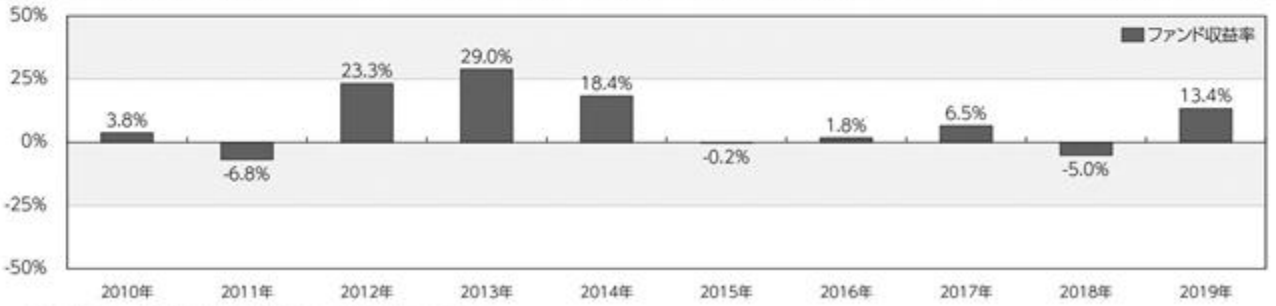
■新光米国REITマザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	7.74
2	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	アメリカ	4.68
3	PROLOGIS INC	アメリカ	4.46
4	EQUINIX INC	アメリカ	3.88
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.76

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。
※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。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

２【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

（ロ）受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

（ハ）委託者は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。また、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

（ニ）一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

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

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

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時～午後５時です。）

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

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

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

ニューヨーク証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ロンドンの銀行の休業日

（ト）委託者は、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

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

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

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
外国投資信託証券	計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2021年10月20日までです。

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

（５）【その他】

ａ．信託の終了（投資信託契約の解約）

（イ）委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより、受益権の総口数が30億口を下回ることとなった場合、またはこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

（ロ）委託者は、上記（イ）の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

（ハ）上記（ロ）の投資信託契約の解約にかかる公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

（ニ）上記（ハ）の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、投資信託契約の解約をしません。

（ホ）委託者は、上記（ニ）の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

（ヘ）上記（ハ）から（ホ）までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記（ホ）の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

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

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

上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、約款第53条第４項に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

（リ）受託者は、委託者の承諾を受けて、その任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、下記「ｂ．投資信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託者を選任します。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

ｂ．投資信託約款の変更

（イ）委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

委託者は、上記の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、投資信託約款の変更をしません。

委託者は、上記の規定により、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

（ロ）委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、上記（イ）の規定にしたがいます。

ｃ．異議申し立ておよび受益権の買取請求

投資信託契約の解約または投資信託約款の変更でその内容が重大な場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

上記の買取請求に関する手続きについては、上記「ａ．信託の終了」または「ｂ．投資信託約款の変更」で規定する公告または書面に記載します。

ｄ．運用報告書

委託者は、毎年４月、10月の決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知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「ｅ．公告」に記載の委託者のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

ｅ．公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

ｆ．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

ｇ．信託事務処理の再信託

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

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

ｈ．信託業務の委託等

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

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

１．投資信託財産の保存にかかる業務

２．投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

ｉ．関係法人との契約の更改

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

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

４【受益者の権利等】

ａ．収益分配金請求権

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

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

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

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

ｂ．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c. 一部解約請求権

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

d. 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

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

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成31年4月23日から令和1年10月21日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【新光７資産バランスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成31年4月22日現在	当期 令和1年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	138,905,934	96,816,404
投資信託受益証券	680,773,000	635,979,000
親投資信託受益証券	4,213,760,737	4,205,550,713
未収入金	－	60,000,000
流動資産合計	5,033,439,671	4,998,346,117
資産合計	5,033,439,671	4,998,346,117
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,902,513	10,525,520
未払解約金	4,586,500	2,837,764
未払受託者報酬	393,525	365,620
未払委託者報酬	4,279,584	3,976,168
未払利息	319	－
その他未払費用	18,679	17,353
流動負債合計	20,181,120	17,722,425
負債合計	20,181,120	17,722,425
純資産の部		
元本等		
元本	5,451,256,537	5,262,760,161
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△437,997,986	△282,136,469
（分配準備積立金）	442,990,345	469,997,340
元本等合計	5,013,258,551	4,980,623,692
純資産合計	5,013,258,551	4,980,623,692
負債純資産合計	5,033,439,671	4,998,346,117

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　平成30年10月23日 至　平成31年4月22日	当期 自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
営業収益		
受取配当金	81,185,000	76,530,000
有価証券売買等損益	155,186,759	151,855,976
営業収益合計	236,371,759	228,385,976
営業費用		
支払利息	56,699	43,894
受託者報酬	2,157,401	2,111,022
委託者報酬	23,461,711	22,957,319
その他費用	102,408	100,208
営業費用合計	25,778,219	25,212,443
営業利益又は営業損失（△）	210,593,540	203,173,533
経常利益又は経常損失（△）	210,593,540	203,173,533
当期純利益又は当期純損失（△）	210,593,540	203,173,533
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	130,690	△581,558
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△609,833,340	△437,997,986
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,917,788	18,631,418
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	29,917,788	18,631,418
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,500,352	2,572,951
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,500,352	2,572,951
分配金	67,044,932	63,952,041
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△437,997,986	△282,136,469

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	当期 自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21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、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月20日及び10月20日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を平成31年4月22日、当特定期間末日を令和1年10月21日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期 平成31年4月22日現在	当期 令和1年10月21日現在
１．　期首元本額	5,725,283,845円	5,451,256,537円
期中追加設定元本額	13,966,043円	34,127,005円
期中一部解約元本額	287,993,351円	222,623,381円
２．　受益権の総数	5,451,256,537口	5,262,760,161口
３．　元本の欠損	元本の欠損　437,997,986円	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は282,136,469円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自　平成30年10月23日 至　平成31年4月22日	当期 自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日

１．　分配金の計算過程	第143期（自　平成30年10月23日 至　平成30年11月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（15,413,993円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（6,586,935円）及び分配準備積立金（406,176,271円）より分配対象収益は428,177,199円（1万口当たり755.46円）であり、うち11,335,249円（1万口当たり20円）を分配しております。	（自平成31年4月23日　至令和1年5月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,743,340円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,116,251円）及び分配準備積立金（438,695,523円）より分配対象収益は463,555,114円（1万口当たり858.86円）であり、うち10,794,634円（1万口当たり20円）を分配金額としております。
	第144期（自　平成30年11月21日 至　平成30年12月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（15,333,553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（7,020,557円）及び分配準備積立金（408,093,662円）より分配対象収益は430,447,772円（1万口当たり762.78円）であり、うち11,286,149円（1万口当たり20円）を分配しております。	（自令和1年5月21日　至令和1年6月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（19,216,229円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,196,849円）及び分配準備積立金（443,781,915円）より分配対象収益は470,194,993円（1万口当たり874.72円）であり、うち10,750,653円（1万口当たり20円）を分配金額としております。
	第145期（自　平成30年12月21日 至　平成31年 1月21日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（21,152,733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（7,167,213円）及び分配準備積立金（410,203,276円）より分配対象収益は438,523,222円（1万口当たり780.54円）であり、うち11,236,011円（1万口当たり20円）を分配しております。	（自令和1年6月21日　至令和1年7月22日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,461,696円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,971,020円）及び分配準備積立金（448,337,123円）より分配対象収益は474,769,839円（1万口当たり889.59円）であり、うち10,673,882円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

	第146期（自　平成31年 1月22日 至　平成31年 2月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（19,541,374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（7,217,377円）及び分配準備積立金（419,014,434円）より分配対象収益は445,773,185円（1万口当たり795.48円）であり、うち11,207,295円（1万口当たり20円）を分配しております。	（自令和1年7月23日　至令和1年8月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（13,242,484円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,988,830円）及び分配準備積立金（453,673,472円）より分配対象収益は474,904,786円（1万口当たり894.68円）であり、うち10,616,168円（1万口当たり20円）を分配金額としております。
	第147期（自　平成31年 2月21日 至　平成31年 3月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（22,401,623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（7,182,790円）及び分配準備積立金（422,523,187円）より分配対象収益は452,107,600円（1万口当たり816.22円）であり、うち11,077,715円（1万口当たり20円）を分配しております。	（自令和1年8月21日　至令和1年9月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,434,432円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（9,518,247円）及び分配準備積立金（453,786,830円）より分配対象収益は481,739,509円（1万口当たり909.69円）であり、うち10,591,184円（1万口当たり20円）を分配金額としております。
	第148期（自　平成31年 3月21日 至　平成31年 4月22日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（26,747,226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（7,132,375円）及び分配準備積立金（427,145,632円）より分配対象収益は461,025,233円（1万口当たり845.70円）であり、うち10,902,513円（1万口当たり20円）を分配しております。	（自令和1年9月21日　至令和1年10月21日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（22,121,562円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（9,834,242円）及び分配準備積立金（458,401,298円）より分配対象収益は490,357,102円（1万口当たり931.74円）であり、うち10,525,520円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自　平成30年10月23日 至　平成31年4月22日	当期 自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、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。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 ①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。 ②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。 ③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。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 平成31年4月22日現在	当期 令和1年10月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	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。	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	前期 平成31年4月22日現在 最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期 令和1年10月21日現在 最終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	△6,129,000	△4,302,000
親投資信託受益証券	39,999,422	70,927,701
合計	33,870,422	66,625,701

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前期 平成31年4月22日現在	当期 令和1年10月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9197円 (9,197円)	0.9464円 (9,464円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年10月21日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド	239,000	635,979,000	
投資信託受益証券　合計		239,000	635,979,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	294,983,390	697,252,238	
	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド	325,349,085	713,588,148	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	274,821,629	680,843,103	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	520,033,360	676,563,401	
	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド	308,546,790	705,893,346	
	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド	372,845,225	731,410,477	
親投資信託受益証券　合計		2,096,579,479	4,205,550,713	
合計			4,841,529,713	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド」投資信託証券、「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、「新光日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド」受益証券、「新光外国株式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」受益証券及び「新光米国ＲＥＩＴマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」及び「親投資信託受益証券」は、すべてこれらの証券であります。

同投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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10月21日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	121,587,151
株式	3,440,145,730
派生商品評価勘定	3,702,408
未収入金	3,022,228
未収配当金	36,822,605
流動資産合計	3,605,280,122
資産合計	3,605,280,122
負債の部	
流動負債	
前受金	2,825,000
未払解約金	26,812,000
流動負債合計	29,637,000
負債合計	29,637,000
純資産の部	
元本等	
元本	1,630,241,818
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,945,401,304
元本等合計	3,575,643,122
純資産合計	3,575,643,122
負債純資産合計	3,605,280,122

注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		令和1年10月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,051,818,455円
	同期中追加設定元本額	83,302,187円
	同期中一部解約元本額	1,504,878,824円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニュー　トピックス　インデックス	238,835,881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）	96,323,435円
	新光世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	429,868,569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）	49,657,090円
	ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	32,711,332円
	ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	416,242,475円
	グローバル・ナビ	18,950,996円
	太陽財形株投　太陽一般財形　３０	4,842,913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	2,916,115円
	計	1,630,241,818円
２．	受益権の総数	1,630,241,818口
３．	差入代用有価証券	
	株式	150,459,300円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	令和1年10月21日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	206,383,401
合計	206,383,401

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成31年1月15日から令和1年10月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	令和1年10月21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 先物取引 買建	126,575,000	－	130,280,000	3,705,000
合計	126,575,000	－	130,280,000	3,705,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

１．　原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和1年10月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1933円 (21,933円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和1年10月21日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	100	2,884.00	288,400	
日本水産	2,000	605.00	1,210,000	
マルハニチロ	300	2,808.00	842,400	
カネコ種苗	100	1,344.00	134,400	
サカタのタネ	200	3,490.00	698,000	
ホクト	200	1,923.00	384,600	
ヒノキヤグループ	100	2,017.00	201,700	
ショーボンドホールディングス	300	4,090.00	1,227,000	
ミライト・ホールディングス	600	1,674.00	1,004,400	
日本アクア	100	652.00	65,200	
ファーストコーポレーション	100	641.00	64,100	
ＴＡＴＥＲＵ	400	205.00	82,000	
スペースバリューホールディングス	200	531.00	106,200	
三井松島ホールディングス	100	1,238.00	123,800	
国際石油開発帝石	8,100	963.90	7,807,590	
石油資源開発	300	2,688.00	806,400	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	100	1,561.00	156,100	
安藤・間	1,300	819.00	1,064,700	
東急建設	600	859.00	515,400	
コムシスホールディングス	700	3,190.00	2,233,000	
ミサワホーム	200	1,142.00	228,400	
ビーアールホールディングス	200	441.00	88,200	
高松コンストラクショングループ	100	2,626.00	262,600	
東建コーポレーション	100	6,900.00	690,000	
ヤマウラ	100	899.00	89,900	
大成建設	1,700	4,195.00	7,131,500	
大林組	5,000	1,108.00	5,540,000	
清水建設	5,100	1,009.00	5,145,900	
飛島建設	100	1,300.00	130,000	
長谷工コーポレーション	2,100	1,342.00	2,818,200	

松井建設	200	811.00	162,200	
鹿島建設	3,900	1,473.00	5,744,700	
不動テトラ	100	1,425.00	142,500	
大末建設	100	946.00	94,600	
鉄建建設	100	2,862.00	286,200	
西松建設	400	2,149.00	859,600	
三井住友建設	1,200	592.00	710,400	
大豊建設	100	3,085.00	308,500	
前田建設工業	1,200	997.00	1,196,400	
佐田建設	100	430.00	43,000	
ナカノフドー建設	100	490.00	49,000	
奥村組	300	3,020.00	906,000	
東鉄工業	200	3,350.00	670,000	
淺沼組	100	3,940.00	394,000	
戸田建設	1,900	667.00	1,267,300	
熊谷組	200	3,300.00	660,000	
矢作建設工業	200	724.00	144,800	
ピーエス三菱	200	747.00	149,400	
日本ハウスホールディングス	300	524.00	157,200	
大東建託	600	14,050.00	8,430,000	
新日本建設	200	824.00	164,800	
ＮＩＰＰＯ	400	2,193.00	877,200	
前田道路	500	2,356.00	1,178,000	
東亜建設工業	100	1,452.00	145,200	
若築建設	100	1,623.00	162,300	
東洋建設	600	489.00	293,400	
五洋建設	2,000	627.00	1,254,000	
世紀東急工業	200	751.00	150,200	
福田組	100	4,465.00	446,500	
住友林業	1,200	1,554.00	1,864,800	
日本基礎技術	200	398.00	79,600	
巴コーポレーション	200	417.00	83,400	
大和ハウス工業	4,600	3,676.00	16,909,600	
ライト工業	300	1,608.00	482,400	
積水ハウス	5,100	2,334.50	11,905,950	
日特建設	100	703.00	70,300	
北陸電気工事	100	953.00	95,300	
ユアテック	300	693.00	207,900	
中電工	200	2,458.00	491,600	
関電工	800	1,025.00	820,000	
きんでん	1,100	1,583.00	1,741,300	
東京エネシス	200	954.00	190,800	
住友電設	100	2,153.00	215,300	
日本電設工業	300	2,348.00	704,400	
協和エクシオ	700	2,721.00	1,904,700	
新日本空調	100	1,995.00	199,500	
日本工営	100	3,280.00	328,000	
九電工	300	3,565.00	1,069,500	
三機工業	400	1,308.00	523,200	
日揮ホールディングス	1,400	1,508.00	2,111,200	

ヤマト	100	791.00	79,100	
太平電業	100	2,506.00	250,600	
高砂熱学工業	400	1,918.00	767,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	200	3,085.00	617,000	
明星工業	300	816.00	244,800	
大氣社	200	3,405.00	681,000	
ダイダン	100	2,387.00	238,700	
日比谷総合設備	100	1,944.00	194,400	
東芝プラントシステム	400	2,068.00	827,200	
日本製粉	500	1,739.00	869,500	
日清製粉グループ本社	1,700	2,067.00	3,513,900	
昭和産業	100	3,155.00	315,500	
鳥越製粉	100	912.00	91,200	
中部飼料	200	1,221.00	244,200	
フィード・ワン	1,000	164.00	164,000	
日本甜菜製糖	100	2,007.00	200,700	
三井製糖	100	2,295.00	229,500	
塩水港精糖	200	209.00	41,800	
日新製糖	100	1,971.00	197,100	
ＬＩＦＵＬＬ	500	665.00	332,500	
ジェイエイシーリクルートメント	100	2,012.00	201,200	
日本Ｍ＆Ａセンター	1,100	3,005.00	3,305,500	
タケエイ	100	1,043.00	104,300	
トラスト・テック	200	1,319.00	263,800	
コシダカホールディングス	300	1,686.00	505,800	
パソナグループ	200	1,455.00	291,000	
リンクアンドモチベーション	300	580.00	174,000	
ＧＣＡ	200	840.00	168,000	
エス・エム・エス	500	2,719.00	1,359,500	
パーソルホールディングス	1,400	2,044.00	2,861,600	
リニカル	100	961.00	96,100	
クックパッド	500	308.00	154,000	
アイ・ケイ・ケイ	100	692.00	69,200	
森永製菓	400	5,340.00	2,136,000	
江崎グリコ	400	4,865.00	1,946,000	
名糖産業	100	1,256.00	125,600	
井村屋グループ	100	2,011.00	201,100	
不二家	100	2,082.00	208,200	
山崎製パン	1,100	1,950.00	2,145,000	
亀田製菓	100	4,765.00	476,500	
寿スピリッツ	200	7,210.00	1,442,000	
カルビー	700	3,365.00	2,355,500	
森永乳業	300	4,260.00	1,278,000	
六甲バター	100	1,789.00	178,900	
ヤクルト本社	1,100	6,090.00	6,699,000	
明治ホールディングス	1,100	7,760.00	8,536,000	
雪印メグミルク	400	2,605.00	1,042,000	
プリマハム	200	2,545.00	509,000	
日本ハム	600	4,675.00	2,805,000	
丸大食品	200	2,337.00	467,400	

Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	100	2,912.00	291,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	1,000	687.00	687,000	
学情	100	1,513.00	151,300	
スタジオアリス	100	1,881.00	188,100	
シミックホールディングス	100	1,740.00	174,000	
システナ	500	1,593.00	796,500	
デジタルアーツ	100	6,570.00	657,000	
日鉄ソリューションズ	200	3,635.00	727,000	
綜合警備保障	600	5,600.00	3,360,000	
キューブシステム	100	767.00	76,700	
いちご	1,900	444.00	843,600	
日本駐車場開発	1,600	163.00	260,800	
コア	100	1,348.00	134,800	
カカクコム	1,100	2,442.00	2,686,200	
セントケア・ホールディング	100	499.00	49,900	
ルネサンス	100	1,662.00	166,200	
ディップ	200	2,864.00	572,800	
ＳＢＳホールディングス	100	1,699.00	169,900	
オプトホールディング	100	1,563.00	156,300	
ツクイ	300	430.00	129,000	
エムスリー	3,000	2,675.00	8,025,000	
ツカダ・グローバルホールディング	100	603.00	60,300	
アウトソーシング	800	1,093.00	874,400	
ウェルネット	100	721.00	72,100	
ディー・エヌ・エー	800	1,895.00	1,516,000	
博報堂ＤＹホールディングス	2,000	1,581.00	3,162,000	
ぐるなび	200	737.00	147,400	
タカミヤ	200	678.00	135,600	
ジャパンベストレスキューシステム	100	1,039.00	103,900	
ファンコミュニケーションズ	400	518.00	207,200	
ライク	100	1,804.00	180,400	
ＷＤＢホールディングス	100	2,724.00	272,400	
ティア	100	598.00	59,800	
バリューコマース	100	1,618.00	161,800	
インフォマート	800	1,480.00	1,184,000	
サッポロホールディングス	500	2,740.00	1,370,000	
アサヒグループホールディングス	3,100	5,359.00	16,612,900	
キリンホールディングス	6,300	2,258.00	14,225,400	
宝ホールディングス	1,100	1,078.00	1,185,800	
オエノンホールディングス	400	411.00	164,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	1,000	2,523.00	2,523,000	
サントリー食品インターナショナル	1,000	4,630.00	4,630,000	
ダイドーグループホールディングス	100	4,520.00	452,000	
伊藤園	500	5,270.00	2,635,000	
キーコーヒー	100	2,240.00	224,000	
日清オイリオグループ	200	3,595.00	719,000	
不二製油グループ本社	400	3,205.00	1,282,000	
Ｊ－オイルミルズ	100	4,275.00	427,500	
ローソン	400	6,060.00	2,424,000	

サンエー	100	5,020.00	502,000	
カワチ薬品	100	2,144.00	214,400	
エービーシー・マート	200	7,430.00	1,486,000	
ハードオフコーポレーション	100	804.00	80,400	
高千穂交易	100	1,121.00	112,100	
アスクル	200	2,863.00	572,600	
ゲオホールディングス	200	1,348.00	269,600	
アダストリア	200	2,608.00	521,600	
ジーフット	100	617.00	61,700	
くら寿司	100	4,490.00	449,000	
キャンドゥ	100	1,605.00	160,500	
エレマテック	100	1,061.00	106,100	
パルグループホールディングス	100	3,570.00	357,000	
エディオン	600	1,063.00	637,800	
あらた	100	4,020.00	402,000	
サーラコーポレーション	300	624.00	187,200	
ワッツ	100	610.00	61,000	
ハローズ	100	2,510.00	251,000	
ＪＰホールディングス	400	297.00	118,800	
東京エレクトロン　デバイス	100	2,078.00	207,800	
ひらまつ	300	321.00	96,300	
フィールズ	100	529.00	52,900	
双日	8,100	336.00	2,721,600	
アルフレッサ　ホールディングス	1,600	2,377.00	3,803,200	
ハニーズホールディングス	100	1,330.00	133,000	
キッコーマン	1,000	5,240.00	5,240,000	
味の素	3,300	2,024.00	6,679,200	
キユーピー	800	2,449.00	1,959,200	
ハウス食品グループ本社	600	4,035.00	2,421,000	
カゴメ	600	2,775.00	1,665,000	
焼津水産化学工業	100	1,052.00	105,200	
アリアケジャパン	100	8,430.00	843,000	
ニチレイ	800	2,454.00	1,963,200	
横浜冷凍	400	1,087.00	434,800	
東洋水産	800	4,410.00	3,528,000	
イートアンド	100	1,712.00	171,200	
日清食品ホールディングス	600	8,210.00	4,926,000	
永谷園ホールディングス	100	2,085.00	208,500	
一正蒲鉾	100	1,075.00	107,500	
フジッコ	200	2,000.00	400,000	
ロック・フィールド	200	1,487.00	297,400	
日本たばこ産業	8,600	2,408.50	20,713,100	
ケンコーマヨネーズ	100	2,491.00	249,100	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,882.00	188,200	
なとり	100	1,648.00	164,800	
北の達人コーポレーション	600	640.00	384,000	
ユーグレナ	600	851.00	510,600	
スター・マイカ・ホールディングス	100	1,883.00	188,300	
片倉工業	200	1,367.00	273,400	
グンゼ	100	4,625.00	462,500	

ヒューリック	3,100	1,151.00	3,568,100	
ラサ商事	100	850.00	85,000	
アルペン	100	1,720.00	172,000	
クオールホールディングス	200	1,488.00	297,600	
アルコニックス	200	1,349.00	269,800	
神戸物産	300	5,980.00	1,794,000	
ジンズホールディングス	100	6,280.00	628,000	
ビックカメラ	900	1,152.00	1,036,800	
ＤＣＭホールディングス	800	1,066.00	852,800	
ペッパーフードサービス	100	1,617.00	161,700	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	1,000	2,975.00	2,975,000	
あい　ホールディングス	200	1,874.00	374,800	
ディーブイエックス	100	873.00	87,300	
アークランドサービスホールディングス	100	1,900.00	190,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	1,900	1,380.00	2,622,000	
ドトール・日レスホールディングス	300	2,198.00	659,400	
マツモトキヨシホールディングス	600	3,935.00	2,361,000	
ブロンコビリー	100	2,536.00	253,600	
ＺＯＺＯ	1,600	2,522.00	4,035,200	
ココカラファイン	200	5,950.00	1,190,000	
三越伊勢丹ホールディングス	2,700	875.00	2,362,500	
東洋紡	600	1,470.00	882,000	
ユニチカ	400	333.00	133,200	
富士紡ホールディングス	100	3,130.00	313,000	
日清紡ホールディングス	1,000	876.00	876,000	
倉敷紡績	100	2,418.00	241,800	
ダイワボウホールディングス	100	4,765.00	476,500	
シキボウ	100	925.00	92,500	
日東紡績	200	3,120.00	624,000	
トヨタ紡織	500	1,523.00	761,500	
マクニカ・富士エレホールディングス	400	1,547.00	618,800	
ラクト・ジャパン	100	3,735.00	373,500	
ウエルシアホールディングス	400	6,320.00	2,528,000	
クリエイトＳＤホールディングス	200	2,731.00	546,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	300	1,064.00	319,200	
八洲電機	100	862.00	86,200	
メディアスホールディングス	100	746.00	74,600	
レスターホールディングス	200	1,840.00	368,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	200	367.00	73,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	800	1,049.00	839,200	
三洋貿易	100	2,173.00	217,300	
シュッピン	100	1,076.00	107,600	
ウイン・パートナーズ	100	1,365.00	136,500	
ネクステージ	200	1,160.00	232,000	
ジョイフル本田	400	1,387.00	554,800	
すかいらーくホールディングス	1,600	1,923.00	3,076,800	
綿半ホールディングス	100	1,993.00	199,300	
日本毛織	500	1,071.00	535,500	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	400	964.00	385,600	
三栄建築設計	100	1,539.00	153,900	
野村不動産ホールディングス	1,000	2,471.00	2,471,000	
三重交通グループホールディングス	300	581.00	174,300	
サムティ	200	1,979.00	395,800	
ディア・ライフ	200	491.00	98,200	
日本商業開発	100	1,493.00	149,300	
プレサンスコーポレーション	200	1,763.00	352,600	
ユニゾホールディングス	200	4,960.00	992,000	
日本管理センター	100	1,437.00	143,700	
フージャースホールディングス	300	657.00	197,100	
オープンハウス	400	2,880.00	1,152,000	
東急不動産ホールディングス	3,900	729.00	2,843,100	
飯田グループホールディングス	1,200	1,762.00	2,114,400	
帝国繊維	200	1,932.00	386,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	657.00	65,700	
ＢＥＥＮＯＳ	100	1,272.00	127,200	
あさひ	100	1,205.00	120,500	
日本調剤	100	3,850.00	385,000	
コスモス薬品	100	22,490.00	2,249,000	
シップヘルスケアホールディングス	300	4,530.00	1,359,000	
トーエル	100	810.00	81,000	
ソフトクリエイトホールディングス	100	1,800.00	180,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	6,100	4,299.00	26,223,900	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	400	1,865.00	746,000	
ツルハホールディングス	300	12,370.00	3,711,000	
デリカフーズホールディングス	100	695.00	69,500	
サンマルクホールディングス	100	2,385.00	238,500	
トリドールホールディングス	200	2,341.00	468,200	
帝人	1,200	2,160.00	2,592,000	
東レ	11,300	846.20	9,562,060	
クラレ	2,300	1,368.00	3,146,400	
旭化成	10,300	1,173.50	12,087,050	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	100	720.00	72,000	
稲葉製作所	100	1,432.00	143,200	
トーカロ	400	1,018.00	407,200	
アルファ	100	1,239.00	123,900	
ＳＵＭＣＯ	1,800	1,796.00	3,232,800	
ハウスドゥ	100	1,840.00	184,000	
日本フエルト	100	481.00	48,100	
アツギ	100	828.00	82,800	
ジャパンミート	100	2,208.00	220,800	
コメダホールディングス	300	2,088.00	626,400	
アレンザホールディングス	100	800.00	80,000	
バロックジャパンリミテッド	100	922.00	92,200	
クスリのアオキホールディングス	100	7,600.00	760,000	
共和レザー	100	742.00	74,200	
スシローグローバルホールディングス	200	7,380.00	1,476,000	

ＬＩＸＩＬビバ	100	1,728.00	172,800	
セーレン	400	1,281.00	512,400	
ソトー	100	979.00	97,900	
小松マテーレ	200	835.00	167,000	
ワコールホールディングス	400	2,802.00	1,120,800	
ホギメディカル	200	3,310.00	662,000	
ＴＳＩホールディングス	500	569.00	284,500	
ワールド	200	2,445.00	489,000	
ＴＩＳ	500	6,610.00	3,305,000	
電算システム	100	2,956.00	295,600	
グリー	1,000	491.00	491,000	
コーエーテクモホールディングス	300	2,424.00	727,200	
三菱総合研究所	100	3,685.00	368,500	
ＡＧＳ	100	704.00	70,400	
ファインデックス	100	962.00	96,200	
ＫＬａｂ	300	970.00	291,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	200	1,026.00	205,200	
ネクソン	4,100	1,246.00	5,108,600	
アイスタイル	400	715.00	286,000	
エムアップ	100	1,933.00	193,300	
エイチーム	100	1,076.00	107,600	
テクノスジャパン	100	523.00	52,300	
コロプラ	500	1,399.00	699,500	
ブロードリーフ	700	593.00	415,100	
デジタルハーツホールディングス	100	894.00	89,400	
じげん	200	566.00	113,200	
フィックスターズ	200	1,504.00	300,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	100	1,154.00	115,400	
オプティム	100	2,706.00	270,600	
特種東海製紙	100	3,925.00	392,500	
ティーガイア	100	2,253.00	225,300	
豆蔵ホールディングス	100	1,737.00	173,700	
テクマトリックス	100	2,276.00	227,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	400	2,291.00	916,400	
GMOペイメントゲートウェイ	200	7,700.00	1,540,000	
ザッパラス	100	377.00	37,700	
インターネットイニシアティブ	200	2,538.00	507,600	
さくらインターネット	200	614.00	122,800	
ＳＲＡホールディングス	100	2,509.00	250,900	
朝日ネット	100	650.00	65,000	
ｅＢＡＳＥ	100	1,171.00	117,100	
アバント	100	2,100.00	210,000	
アドソル日進	100	2,250.00	225,000	
コムチュア	200	1,946.00	389,200	
王子ホールディングス	6,500	554.00	3,601,000	
日本製紙	700	1,839.00	1,287,300	
北越コーポレーション	1,000	542.00	542,000	
中越パルプ工業	100	1,531.00	153,100	

大王製紙	700	1,448.00	1,013,600	
メディカル・データ・ビジョン	100	1,159.00	115,900	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	1,680.00	168,000	
オープンドア	100	1,995.00	199,500	
アカツキ	100	6,340.00	634,000	
ＬＩＮＥ	300	3,925.00	1,177,500	
カナミックネットワーク	100	590.00	59,000	
レンゴー	1,500	781.00	1,171,500	
トーモク	100	1,620.00	162,000	
ザ・パック	100	4,030.00	403,000	
オークネット	100	1,374.00	137,400	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	100	632.00	63,200	
マクロミル	300	905.00	271,500	
昭和電工	1,000	2,912.00	2,912,000	
住友化学	11,400	507.00	5,779,800	
住友精化	100	3,360.00	336,000	
日産化学	900	4,360.00	3,924,000	
クレハ	100	6,710.00	671,000	
テイカ	100	2,071.00	207,100	
石原産業	300	1,094.00	328,200	
日本曹達	200	2,774.00	554,800	
東ソー	2,200	1,506.00	3,313,200	
トクヤマ	400	2,809.00	1,123,600	
セントラル硝子	300	2,492.00	747,600	
東亜合成	900	1,206.00	1,085,400	
大阪ソーダ	200	2,949.00	589,800	
関東電化工業	300	913.00	273,900	
デンカ	600	3,075.00	1,845,000	
イビデン	900	2,316.00	2,084,400	
信越化学工業	2,600	12,005.00	31,213,000	
堺化学工業	100	2,650.00	265,000	
第一稀元素化学工業	200	816.00	163,200	
エア・ウォーター	1,200	2,009.00	2,410,800	
大陽日酸	1,200	2,498.00	2,997,600	
日本パーカライジング	800	1,241.00	992,800	
高圧ガス工業	200	849.00	169,800	
四国化成工業	200	1,206.00	241,200	
ステラ　ケミファ	100	2,934.00	293,400	
保土谷化学工業	100	3,955.00	395,500	
日本触媒	200	6,580.00	1,316,000	
大日精化工業	100	3,235.00	323,500	
カネカ	400	3,555.00	1,422,000	
協和キリン	1,500	2,033.00	3,049,500	
三菱瓦斯化学	1,500	1,524.00	2,286,000	
三井化学	1,300	2,579.00	3,352,700	
ＪＳＲ	1,500	1,829.00	2,743,500	
東京応化工業	200	4,255.00	851,000	
大阪有機化学工業	100	1,131.00	113,100	
三菱ケミカルホールディングス	9,700	823.50	7,987,950	

ＫＨネオケム	300	2,510.00	753,000	
ダイセル	2,100	939.00	1,971,900	
住友ベークライト	300	4,440.00	1,332,000	
積水化学工業	3,100	1,750.00	5,425,000	
日本ゼオン	1,300	1,372.00	1,783,600	
アイカ工業	400	3,440.00	1,376,000	
宇部興産	700	2,276.00	1,593,200	
積水樹脂	200	2,140.00	428,000	
タキロンシーアイ	300	650.00	195,000	
旭有機材	100	1,421.00	142,100	
日立化成	700	3,540.00	2,478,000	
ニチバン	100	1,737.00	173,700	
リケンテクノス	400	498.00	199,200	
大倉工業	100	1,947.00	194,700	
積水化成品工業	200	776.00	155,200	
タイガースポリマー	100	608.00	60,800	
ダイキアクシス	100	884.00	88,400	
ダイキョーニシカワ	300	821.00	246,300	
竹本容器	100	991.00	99,100	
森六ホールディングス	100	2,338.00	233,800	
日本化薬	900	1,332.00	1,198,800	
カーリットホールディングス	200	620.00	124,000	
ＥＰＳホールディングス	200	1,281.00	256,200	
プレステージ・インターナショナル	500	925.00	462,500	
フェイス	100	796.00	79,600	
アミューズ	100	2,848.00	284,800	
野村総合研究所	2,800	2,295.00	6,426,000	
サイバネットシステム	100	688.00	68,800	
クイック	100	1,448.00	144,800	
ケネディクス	1,300	588.00	764,400	
電通	1,500	3,775.00	5,662,500	
インテージホールディングス	200	948.00	189,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	1,237.00	123,700	
ソースネクスト	600	484.00	290,400	
シーティーエス	200	780.00	156,000	
日本精化	100	1,230.00	123,000	
扶桑化学工業	100	2,699.00	269,900	
ＦＩＧ	200	314.00	62,800	
ＡＤＥＫＡ	700	1,478.00	1,034,600	
日油	500	3,580.00	1,790,000	
ミヨシ油脂	100	1,213.00	121,300	
ハリマ化成グループ	100	1,242.00	124,200	
花王	3,600	8,290.00	29,844,000	
第一工業製薬	100	3,320.00	332,000	
三洋化成工業	100	5,130.00	513,000	
武田薬品工業	13,000	3,797.00	49,361,000	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	13,100	1,708.50	22,381,350	
大日本住友製薬	1,100	1,750.00	1,925,000	
塩野義製薬	1,900	6,003.00	11,405,700	

田辺三菱製薬	1,600	1,229.00	1,966,400	
わかもと製薬	200	264.00	52,800	
あすか製薬	200	1,109.00	221,800	
日本新薬	400	9,230.00	3,692,000	
中外製薬	1,500	8,300.00	12,450,000	
科研製薬	300	5,110.00	1,533,000	
エーザイ	1,800	5,534.00	9,961,200	
理研ビタミン	100	3,620.00	362,000	
ロート製薬	800	3,140.00	2,512,000	
小野薬品工業	3,500	1,916.00	6,706,000	
久光製薬	400	4,945.00	1,978,000	
有機合成薬品工業	100	236.00	23,600	
持田製薬	200	4,095.00	819,000	
参天製薬	2,800	1,860.00	5,208,000	
扶桑薬品工業	100	2,067.00	206,700	
ツムラ	500	2,930.00	1,465,000	
日医工	400	1,236.00	494,400	
テルモ	4,200	3,488.00	14,649,600	
みらかホールディングス	400	2,539.00	1,015,600	
キッセイ薬品工業	300	2,694.00	808,200	
生化学工業	300	1,164.00	349,200	
栄研化学	300	1,583.00	474,900	
日水製薬	100	1,257.00	125,700	
鳥居薬品	100	2,784.00	278,400	
ＪＣＲファーマ	100	8,110.00	811,000	
東和薬品	200	2,540.00	508,000	
富士製薬工業	100	1,335.00	133,500	
沢井製薬	300	5,700.00	1,710,000	
ゼリア新薬工業	300	1,931.00	579,300	
第一三共	4,200	6,632.00	27,854,400	
キョーリン製薬ホールディングス	300	1,835.00	550,500	
大幸薬品	100	2,840.00	284,000	
ダイト	100	2,965.00	296,500	
大塚ホールディングス	2,800	4,345.00	12,166,000	
大正製薬ホールディングス	300	7,790.00	2,337,000	
ペプチドリーム	800	4,935.00	3,948,000	
大日本塗料	200	1,085.00	217,000	
日本ペイントホールディングス	1,200	6,200.00	7,440,000	
関西ペイント	1,600	2,621.00	4,193,600	
神東塗料	100	195.00	19,500	
中国塗料	500	958.00	479,000	
日本特殊塗料	100	1,140.00	114,000	
藤倉化成	200	543.00	108,600	
太陽ホールディングス	100	3,785.00	378,500	
ＤＩＣ	600	3,105.00	1,863,000	
サカタインクス	300	1,191.00	357,300	
東洋インキＳＣホールディングス	300	2,603.00	780,900	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	100	1,002.00	100,200	
アルプス技研	100	1,565.00	156,500	
日本空調サービス	200	709.00	141,800	

オリエンタルランド	1,700	16,690.00	28,373,000	
フォーカスシステムズ	100	879.00	87,900	
ダスキン	400	2,860.00	1,144,000	
パーク２４	800	2,614.00	2,091,200	
明光ネットワークジャパン	200	974.00	194,800	
ファルコホールディングス	100	1,634.00	163,400	
フジ・メディア・ホールディングス	1,500	1,399.00	2,098,500	
ラウンドワン	400	1,399.00	559,600	
リゾートトラスト	600	1,752.00	1,051,200	
オービック	500	12,300.00	6,150,000	
ジャストシステム	200	4,275.00	855,000	
ＴＤＣソフト	100	851.00	85,100	
Ｚホールディングス	9,500	333.00	3,163,500	
ビー・エム・エル	200	3,145.00	629,000	
トレンドマイクロ	600	5,310.00	3,186,000	
りらいあコミュニケーションズ	300	1,400.00	420,000	
ＩＤホールディングス	100	1,244.00	124,400	
リソー教育	700	424.00	296,800	
日本オラクル	300	8,950.00	2,685,000	
フューチャー	200	1,932.00	386,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	100	1,324.00	132,400	
ＳＢテクノロジー	100	1,926.00	192,600	
ユー・エス・エス	1,700	2,003.00	3,405,100	
オービックビジネスコンサルタント	100	4,340.00	434,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	700	2,868.00	2,007,600	
アイティフォー	200	867.00	173,400	
東京個別指導学院	100	897.00	89,700	
サイバーエージェント	800	4,055.00	3,244,000	
楽天	6,600	1,064.00	7,022,400	
クリーク・アンド・リバー社	100	1,148.00	114,800	
テー・オー・ダブリュー	100	761.00	76,100	
大塚商会	800	4,025.00	3,220,000	
サイボウズ	200	1,067.00	213,400	
ソフトブレーン	100	727.00	72,700	
セントラルスポーツ	100	3,200.00	320,000	
電通国際情報サービス	100	3,515.00	351,500	
デジタルガレージ	300	3,465.00	1,039,500	
イーエムシステムズ	100	1,775.00	177,500	
ＣＩＪ	100	833.00	83,300	
日本エンタープライズ	100	227.00	22,700	
WOWOW	100	2,581.00	258,100	
スカラ	100	953.00	95,300	
フルキャストホールディングス	100	2,262.00	226,200	
エン・ジャパン	200	4,350.00	870,000	
富士フイルムホールディングス	3,100	4,699.00	14,566,900	
コニカミノルタ	3,200	784.00	2,508,800	
資生堂	2,900	8,563.00	24,832,700	
ライオン	1,900	2,170.00	4,123,000	
高砂香料工業	100	2,648.00	264,800	
マンダム	300	2,688.00	806,400	

ミルボン	200	5,530.00	1,106,000	
ファンケル	700	2,764.00	1,934,800	
コーセー	300	18,560.00	5,568,000	
コタ	100	1,285.00	128,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	600	2,505.00	1,503,000	
ノエビアホールディングス	100	5,580.00	558,000	
エステー	100	1,535.00	153,500	
コニシ	300	1,515.00	454,500	
長谷川香料	200	1,990.00	398,000	
星光ＰＭＣ	100	833.00	83,300	
小林製薬	400	8,590.00	3,436,000	
荒川化学工業	100	1,698.00	169,800	
メック	100	1,806.00	180,600	
タカラバイオ	400	2,170.00	868,000	
ＪＣＵ	200	2,528.00	505,600	
新田ゼラチン	100	688.00	68,800	
デクセリアルズ	400	827.00	330,800	
アース製薬	100	5,580.00	558,000	
北興化学工業	200	544.00	108,800	
クミアイ化学工業	600	980.00	588,000	
日本農薬	300	554.00	166,200	
富士興産	100	671.00	67,100	
ニチレキ	200	1,166.00	233,200	
ユシロ化学工業	100	1,372.00	137,200	
ビーピー・カストロール	100	1,450.00	145,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	100	1,298.00	129,800	
出光興産	1,700	3,120.00	5,304,000	
ＪＸＴＧホールディングス	24,500	508.00	12,446,000	
コスモエネルギーホールディングス	400	2,318.00	927,200	
横浜ゴム	900	2,288.00	2,059,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	900	1,407.00	1,266,300	
ブリヂストン	4,600	4,347.00	19,996,200	
住友ゴム工業	1,300	1,357.00	1,764,100	
藤倉コンポジット	100	429.00	42,900	
オカモト	100	4,070.00	407,000	
アキレス	100	1,849.00	184,900	
フコク	100	712.00	71,200	
ニッタ	200	2,973.00	594,600	
住友理工	300	918.00	275,400	
三ツ星ベルト	200	2,033.00	406,600	
バンドー化学	300	885.00	265,500	
ＡＧＣ	1,500	3,530.00	5,295,000	
日本板硝子	700	675.00	472,500	
有沢製作所	200	1,074.00	214,800	
日本山村硝子	100	1,266.00	126,600	
日本電気硝子	600	2,420.00	1,452,000	
オハラ	100	1,526.00	152,600	
住友大阪セメント	300	4,900.00	1,470,000	
太平洋セメント	900	3,070.00	2,763,000	
日本ヒューム	100	796.00	79,600	

日本コンクリート工業	300	306.00	91,800	
三谷セキサン	100	3,390.00	339,000	
アジアパイルホールディングス	200	554.00	110,800	
東海カーボン	1,600	1,118.00	1,788,800	
日本カーボン	100	3,980.00	398,000	
東洋炭素	100	2,449.00	244,900	
ノリタケカンパニーリミテド	100	4,380.00	438,000	
ＴＯＴＯ	1,100	4,230.00	4,653,000	
日本碍子	1,800	1,549.00	2,788,200	
日本特殊陶業	1,300	2,084.00	2,709,200	
ＭＡＲＵＷＡ	100	7,320.00	732,000	
ヨータイ	100	704.00	70,400	
イソライト工業	100	526.00	52,600	
東京窯業	200	305.00	61,000	
ニッカトー	100	780.00	78,000	
フジミインコーポレーテッド	100	2,750.00	275,000	
クニミネ工業	100	949.00	94,900	
ニチアス	400	2,158.00	863,200	
日本製鉄	6,800	1,546.00	10,512,800	
神戸製鋼所	2,700	574.00	1,549,800	
中山製鋼所	200	468.00	93,600	
合同製鐵	100	2,342.00	234,200	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	4,000	1,334.50	5,338,000	
東京製鐵	800	891.00	712,800	
共英製鋼	200	2,079.00	415,800	
大和工業	300	2,832.00	849,600	
東京鐵鋼	100	1,380.00	138,000	
大阪製鐵	100	1,403.00	140,300	
淀川製鋼所	200	2,055.00	411,000	
丸一鋼管	500	2,903.00	1,451,500	
大同特殊鋼	200	4,620.00	924,000	
日本冶金工業	100	2,360.00	236,000	
山陽特殊製鋼	200	1,501.00	300,200	
愛知製鋼	100	3,435.00	343,500	
日立金属	1,600	1,247.00	1,995,200	
大平洋金属	100	2,497.00	249,700	
新日本電工	900	182.00	163,800	
栗本鐵工所	100	1,710.00	171,000	
日本製鋼所	400	2,252.00	900,800	
三菱製鋼	100	1,150.00	115,000	
日亜鋼業	200	331.00	66,200	
エンビプロ・ホールディングス	100	649.00	64,900	
大紀アルミニウム工業所	200	727.00	145,400	
日本軽金属ホールディングス	4,000	205.00	820,000	
三井金属鉱業	400	2,815.00	1,126,000	
東邦亜鉛	100	2,118.00	211,800	
三菱マテリアル	1,000	2,975.00	2,975,000	
住友金属鉱山	2,000	3,349.00	6,698,000	
ＤＯＷＡホールディングス	300	3,745.00	1,123,500	

古河機械金属	200	1,515.00	303,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	200	1,674.00	334,800	
東邦チタニウム	300	878.00	263,400	
ＵＡＣＪ	200	1,948.00	389,600	
古河電気工業	400	2,853.00	1,141,200	
住友電気工業	5,500	1,406.00	7,733,000	
フジクラ	1,800	457.00	822,600	
タツタ電線	300	518.00	155,400	
平河ヒューテック	100	1,077.00	107,700	
リョービ	200	1,898.00	379,600	
アーレスティ	200	525.00	105,000	
アサヒホールディングス	300	2,278.00	683,400	
東洋製罐グループホールディングス	900	1,750.00	1,575,000	
ホッカンホールディングス	100	1,718.00	171,800	
コロナ	100	1,120.00	112,000	
横河ブリッジホールディングス	300	1,754.00	526,200	
ＯＳＪＢホールディングス	700	260.00	182,000	
三和ホールディングス	1,500	1,255.00	1,882,500	
文化シヤッター	400	950.00	380,000	
三協立山	200	1,185.00	237,000	
アルインコ	100	1,155.00	115,500	
ＬＩＸＩＬグループ	2,200	2,017.00	4,437,400	
日本フイルコン	100	503.00	50,300	
ノーリツ	300	1,316.00	394,800	
長府製作所	100	2,471.00	247,100	
リンナイ	300	7,570.00	2,271,000	
ユニプレス	300	1,715.00	514,500	
ダイニチ工業	100	695.00	69,500	
日東精工	200	584.00	116,800	
岡部	300	889.00	266,700	
ジーテクト	200	1,735.00	347,000	
東プレ	300	1,782.00	534,600	
高周波熱錬	300	930.00	279,000	
東京製綱	100	1,081.00	108,100	
サンコール	100	467.00	46,700	
パイオラックス	200	1,992.00	398,400	
エイチワン	100	669.00	66,900	
日本発条	1,500	858.00	1,287,000	
三浦工業	600	3,195.00	1,917,000	
タクマ	500	1,264.00	632,000	
テクノプロ・ホールディングス	300	6,640.00	1,992,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	100	3,815.00	381,500	
ＫｅｅＰｅｒ技研	100	1,468.00	146,800	
Ｇｕｎｏｓｙ	100	1,685.00	168,500	
イー・ガーディアン	100	1,668.00	166,800	
リブセンス	100	300.00	30,000	
ジャパンマテリアル	400	1,517.00	606,800	
ベクトル	200	1,026.00	205,200	
ウチヤマホールディングス	100	505.00	50,500	

キャリアリンク	100	597.00	59,700	
ＩＢＪ	100	971.00	97,100	
アサンテ	100	2,029.00	202,900	
M&Aキャピタルパートナーズ	100	7,160.00	716,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	100	1,361.00	136,100	
エスクロー・エージェント・ジャパン	200	218.00	43,600	
リクルートホールディングス	10,200	3,532.00	36,026,400	
エラン	100	1,674.00	167,400	
ツガミ	300	924.00	277,200	
オークマ	200	6,210.00	1,242,000	
東芝機械	200	2,280.00	456,000	
アマダホールディングス	2,200	1,193.00	2,624,600	
アイダエンジニアリング	400	886.00	354,400	
ＦＵＪＩ	600	1,698.00	1,018,800	
牧野フライス製作所	200	5,120.00	1,024,000	
オーエスジー	700	2,158.00	1,510,600	
旭ダイヤモンド工業	400	655.00	262,000	
DMG森精機	900	1,618.00	1,456,200	
ソディック	300	831.00	249,300	
ディスコ	200	21,680.00	4,336,000	
日東工器	100	2,265.00	226,500	
パンチ工業	100	519.00	51,900	
冨士ダイス	100	633.00	63,300	
土木管理総合試験所	100	454.00	45,400	
日本郵政	11,600	994.00	11,530,400	
ベルシステム２４ホールディングス	200	1,734.00	346,800	
鎌倉新書	100	1,470.00	147,000	
ストライク	100	3,620.00	362,000	
ソラスト	300	1,189.00	356,700	
インソース	100	2,663.00	266,300	
豊田自動織機	1,200	6,230.00	7,476,000	
東洋機械金属	100	594.00	59,400	
島精機製作所	200	2,645.00	529,000	
オプトラン	200	3,290.00	658,000	
フリュー	100	948.00	94,800	
ヤマシンフィルタ	300	906.00	271,800	
日阪製作所	200	909.00	181,800	
やまびこ	300	1,195.00	358,500	
平田機工	100	7,670.00	767,000	
ペガサスミシン製造	100	523.00	52,300	
ナブテスコ	900	3,340.00	3,006,000	
三井海洋開発	200	2,763.00	552,600	
レオン自動機	100	1,598.00	159,800	
ＳＭＣ	400	45,970.00	18,388,000	
ホソカワミクロン	100	3,890.00	389,000	
ユニオンツール	100	3,530.00	353,000	
オイレス工業	200	1,601.00	320,200	
サトーホールディングス	200	2,981.00	596,200	
技研製作所	100	3,700.00	370,000	

日精樹脂工業	100	1,047.00	104,700	
オカダアイヨン	100	1,312.00	131,200	
小松製作所	6,700	2,490.00	16,683,000	
住友重機械工業	800	3,235.00	2,588,000	
日立建機	600	2,599.00	1,559,400	
日工	200	682.00	136,400	
巴工業	100	2,390.00	239,000	
井関農機	100	1,602.00	160,200	
ＴＯＷＡ	100	983.00	98,300	
北川鉄工所	100	2,034.00	203,400	
シンニッタン	200	435.00	87,000	
ローツェ	100	3,880.00	388,000	
クボタ	7,900	1,739.50	13,742,050	
東洋エンジニアリング	200	749.00	149,800	
三菱化工機	100	1,790.00	179,000	
月島機械	300	1,595.00	478,500	
帝国電機製作所	100	1,232.00	123,200	
新東工業	400	1,008.00	403,200	
澁谷工業	100	2,911.00	291,100	
アイチコーポレーション	300	723.00	216,900	
小森コーポレーション	400	1,214.00	485,600	
鶴見製作所	100	2,084.00	208,400	
荏原製作所	700	3,125.00	2,187,500	
西島製作所	200	1,029.00	205,800	
北越工業	200	1,230.00	246,000	
ダイキン工業	2,000	14,720.00	29,440,000	
オルガノ	100	5,470.00	547,000	
トーヨーカネツ	100	1,974.00	197,400	
栗田工業	800	2,924.00	2,339,200	
椿本チエイン	200	3,550.00	710,000	
大同工業	100	826.00	82,600	
日機装	400	1,161.00	464,400	
木村化工機	100	394.00	39,400	
レイズネクスト	300	1,097.00	329,100	
アネスト岩田	200	1,018.00	203,600	
ダイフク	800	5,840.00	4,672,000	
加藤製作所	100	1,960.00	196,000	
タダノ	700	1,067.00	746,900	
フジテック	500	1,481.00	740,500	
ＣＫＤ	400	1,496.00	598,400	
キトー	100	1,589.00	158,900	
平和	400	2,188.00	875,200	
理想科学工業	100	1,733.00	173,300	
ＳＡＮＫＹＯ	400	3,755.00	1,502,000	
日本金銭機械	200	948.00	189,600	
マースグループホールディングス	100	1,986.00	198,600	
福島工業	100	3,305.00	330,500	
オーイズミ	100	525.00	52,500	
ダイコク電機	100	1,513.00	151,300	
竹内製作所	200	1,672.00	334,400	

アマノ	400	3,175.00	1,270,000	
ＪＵＫＩ	200	950.00	190,000	
サンデンホールディングス	200	677.00	135,400	
蛇の目ミシン工業	100	410.00	41,000	
ブラザー工業	1,900	1,992.00	3,784,800	
マックス	200	1,912.00	382,400	
モリタホールディングス	300	1,832.00	549,600	
グローリー	400	3,050.00	1,220,000	
新晃工業	100	1,788.00	178,800	
大和冷機工業	200	1,183.00	236,600	
セガサミーホールディングス	1,500	1,555.00	2,332,500	
日本ピストンリング	100	1,309.00	130,900	
リケン	100	3,975.00	397,500	
ＴＰＲ	200	1,841.00	368,200	
ツバキ・ナカシマ	300	1,745.00	523,500	
ホシザキ	400	8,870.00	3,548,000	
大豊工業	100	802.00	80,200	
日本精工	3,000	989.00	2,967,000	
ＮＴＮ	3,200	325.00	1,040,000	
ジェイテクト	1,400	1,289.00	1,804,600	
不二越	100	5,040.00	504,000	
ミネベアミツミ	2,800	1,882.00	5,269,600	
日本トムソン	400	454.00	181,600	
ＴＨＫ	900	2,876.00	2,588,400	
ユーシン精機	100	1,002.00	100,200	
前澤給装工業	100	2,105.00	210,500	
イーグル工業	200	1,019.00	203,800	
前澤工業	100	393.00	39,300	
日本ピラー工業	100	1,431.00	143,100	
キッツ	600	721.00	432,600	
日立製作所	6,700	4,129.00	27,664,300	
三菱電機	14,800	1,515.00	22,422,000	
富士電機	1,000	3,375.00	3,375,000	
東洋電機製造	100	1,644.00	164,400	
安川電機	1,700	3,985.00	6,774,500	
シンフォニア　テクノロジー	200	1,274.00	254,800	
明電舎	300	1,967.00	590,100	
山洋電気	100	5,030.00	503,000	
デンヨー	100	1,790.00	179,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	100	1,308.00	130,800	
グリーンズ	100	1,298.00	129,800	
日総工産	100	1,265.00	126,500	
キュービーネットホールディングス	100	2,242.00	224,200	
三櫻工業	200	888.00	177,600	
マキタ	1,800	3,440.00	6,192,000	
東芝テック	200	3,715.00	743,000	
マブチモーター	400	4,015.00	1,606,000	
日本電産	1,800	15,170.00	27,306,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	501.00	50,100	
トレックス・セミコンダクター	100	1,418.00	141,800	

東光高岳	100	1,203.00	120,300	
ダブル・スコープ	200	571.00	114,200	
宮越ホールディングス	100	1,037.00	103,700	
ダイヘン	200	3,375.00	675,000	
ヤーマン	200	688.00	137,600	
ＪＶＣケンウッド	1,100	308.00	338,800	
ミマキエンジニアリング	100	542.00	54,200	
第一精工	100	2,538.00	253,800	
日新電機	300	1,370.00	411,000	
大崎電気工業	300	708.00	212,400	
オムロン	1,600	6,310.00	10,096,000	
日東工業	200	2,125.00	425,000	
ＩＤＥＣ	200	2,117.00	423,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	500	1,909.00	954,500	
メルコホールディングス	100	2,762.00	276,200	
日本電気	1,900	4,585.00	8,711,500	
富士通	1,400	8,795.00	12,313,000	
沖電気工業	600	1,455.00	873,000	
岩崎通信機	100	820.00	82,000	
電気興業	100	3,425.00	342,500	
サンケン電気	200	2,438.00	487,600	
アイホン	100	1,698.00	169,800	
ルネサスエレクトロニクス	7,100	723.00	5,133,300	
セイコーエプソン	1,800	1,506.00	2,710,800	
ワコム	1,100	409.00	449,900	
アルバック	300	4,780.00	1,434,000	
ＥＩＺＯ	100	3,905.00	390,500	
ジャパンディスプレイ	3,500	58.00	203,000	
日本信号	400	1,227.00	490,800	
京三製作所	300	454.00	136,200	
能美防災	200	2,082.00	416,400	
ホーチキ	100	1,452.00	145,200	
エレコム	100	4,120.00	412,000	
パナソニック	17,000	894.60	15,208,200	代用有価証券 7,500株
シャープ	1,500	1,254.00	1,881,000	
アンリツ	1,000	2,185.00	2,185,000	
富士通ゼネラル	500	1,818.00	909,000	
ソニー	10,000	6,460.00	64,600,000	代用有価証券 3,700株
ＴＤＫ	800	10,520.00	8,416,000	
帝国通信工業	100	1,206.00	120,600	
タムラ製作所	600	605.00	363,000	
アルプスアルパイン	1,500	2,119.00	3,178,500	
鈴木	100	635.00	63,500	
ローランド　ディー．ジー．	100	2,071.00	207,100	
フォスター電機	200	2,024.00	404,800	
ヨコオ	100	3,190.00	319,000	
ホシデン	400	1,064.00	425,600	
ヒロセ電機	200	13,430.00	2,686,000	

日本航空電子工業	300	1,703.00	510,900	
ＴＯＡ	200	1,218.00	243,600	
マクセルホールディングス	300	1,529.00	458,700	
古野電気	200	1,058.00	211,600	
スミダコーポレーション	100	1,081.00	108,100	
アイコム	100	2,382.00	238,200	
リオン	100	2,598.00	259,800	
本多通信工業	100	507.00	50,700	
船井電機	100	602.00	60,200	
横河電機	1,500	1,923.00	2,884,500	
新電元工業	100	3,590.00	359,000	
アズビル	900	2,949.00	2,654,100	
東亜ディーケーケー	100	840.00	84,000	
日本光電工業	700	3,140.00	2,198,000	
チノー	100	1,412.00	141,200	
共和電業	200	423.00	84,600	
日本電子材料	100	622.00	62,200	
堀場製作所	300	6,900.00	2,070,000	
アドバンテスト	1,000	5,300.00	5,300,000	
小野測器	100	521.00	52,100	
エスペック	100	1,931.00	193,100	
キーエンス	700	66,880.00	46,816,000	
日置電機	100	3,665.00	366,500	
シスメックス	1,200	6,780.00	8,136,000	
日本マイクロニクス	300	951.00	285,300	
メガチップス	100	1,759.00	175,900	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	100	3,830.00	383,000	
デンソー	3,300	4,832.00	15,945,600	
原田工業	100	872.00	87,200	
コーセル	200	1,174.00	234,800	
イリソ電子工業	100	5,380.00	538,000	
オプテックスグループ	200	1,682.00	336,400	
千代田インテグレ	100	2,326.00	232,600	
アイ・オー・データ機器	100	894.00	89,400	
レーザーテック	300	7,490.00	2,247,000	
スタンレー電気	1,000	2,947.00	2,947,000	
岩崎電気	100	1,381.00	138,100	
ウシオ電機	900	1,588.00	1,429,200	
岡谷電機産業	100	383.00	38,300	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	100	592.00	59,200	
日本セラミック	200	2,752.00	550,400	
古河電池	100	628.00	62,800	
山一電機	100	1,412.00	141,200	
図研	100	1,989.00	198,900	
日本電子	300	2,857.00	857,100	
カシオ計算機	1,300	1,735.00	2,255,500	
ファナック	1,400	20,925.00	29,295,000	
日本シイエムケイ	400	645.00	258,000	
エンプラス	100	3,835.00	383,500	
ローム	700	8,820.00	6,174,000	

浜松ホトニクス	1,100	4,030.00	4,433,000	
三井ハイテック	200	1,814.00	362,800	
新光電気工業	500	1,076.00	538,000	
京セラ	2,300	6,923.00	15,922,900	
太陽誘電	700	2,868.00	2,007,600	
村田製作所	4,700	5,837.00	27,433,900	
双葉電子工業	200	1,370.00	274,000	
日東電工	1,000	5,551.00	5,551,000	
東海理化電機製作所	400	1,910.00	764,000	
ニチコン	500	1,036.00	518,000	
日本ケミコン	100	1,707.00	170,700	
ＫＯＡ	200	1,356.00	271,200	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	500	1,006.00	503,000	
日立造船	1,200	354.00	424,800	
三菱重工業	2,500	4,361.00	10,902,500	
川崎重工業	1,200	2,535.00	3,042,000	
ＩＨＩ	1,100	2,591.00	2,850,100	
名村造船所	400	305.00	122,000	
三菱ロジスネクスト	200	1,052.00	210,400	
ＦＰＧ	500	1,086.00	543,000	
全国保証	400	4,390.00	1,756,000	
めぶきフィナンシャルグループ	7,600	266.00	2,021,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	200	1,420.00	284,000	
九州フィナンシャルグループ	2,400	443.00	1,063,200	
かんぽ生命保険	500	1,723.00	861,500	
ゆうちょ銀行	4,100	1,057.00	4,333,700	
富山第一銀行	300	315.00	94,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	9,200	422.00	3,882,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	900	781.00	702,900	
マーキュリアインベストメント	100	749.00	74,900	
アルヒ	100	2,353.00	235,300	
日産自動車	17,500	682.60	11,945,500	
いすゞ自動車	4,700	1,249.00	5,870,300	
トヨタ自動車	16,500	7,400.00	122,100,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	1,900	944.00	1,793,600	
三菱自動車工業	5,500	486.00	2,673,000	
エフテック	100	689.00	68,900	
武蔵精密工業	400	1,407.00	562,800	
日産車体	300	929.00	278,700	
新明和工業	600	1,288.00	772,800	
極東開発工業	300	1,389.00	416,700	
日信工業	300	1,559.00	467,700	
トピー工業	100	2,102.00	210,200	
ティラド	100	2,040.00	204,000	
タチエス	200	1,393.00	278,600	
ＮＯＫ	800	1,686.00	1,348,800	
フタバ産業	400	754.00	301,600	

ＫＹＢ	200	3,350.00	670,000	
市光工業	200	831.00	166,200	
大同メタル工業	200	658.00	131,600	
プレス工業	700	458.00	320,600	
ミクニ	200	327.00	65,400	
太平洋工業	300	1,610.00	483,000	
ケーヒン	300	1,714.00	514,200	
河西工業	200	855.00	171,000	
アイシン精機	1,200	3,675.00	4,410,000	
マツダ	4,700	987.40	4,640,780	
今仙電機製作所	100	884.00	88,400	
本田技研工業	12,500	2,895.00	36,187,500	代用有価証券 6,000株
スズキ	2,700	4,934.00	13,321,800	
ＳＵＢＡＲＵ	4,600	3,038.00	13,974,800	
安永	100	1,298.00	129,800	
ヤマハ発動機	1,900	2,100.00	3,990,000	
ショーワ	400	1,672.00	668,800	
小糸製作所	900	5,560.00	5,004,000	
ＴＢＫ	200	426.00	85,200	
エクセディ	200	2,179.00	435,800	
ミツバ	300	684.00	205,200	
豊田合成	500	2,226.00	1,113,000	
愛三工業	200	922.00	184,400	
日本プラスト	100	698.00	69,800	
ヨロズ	100	1,370.00	137,000	
エフ・シー・シー	300	2,142.00	642,600	
シマノ	600	15,760.00	9,456,000	
テイ・エス　テック	300	3,345.00	1,003,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	700	692.00	484,400	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,714.00	171,400	
第四北越フィナンシャルグループ	300	2,738.00	821,400	
ジャムコ	100	1,500.00	150,000	
小野建	100	1,392.00	139,200	
はるやまホールディングス	100	817.00	81,700	
ノジマ	300	1,870.00	561,000	
佐鳥電機	100	866.00	86,600	
伯東	100	1,267.00	126,700	
コンドーテック	100	971.00	97,100	
中山福	100	540.00	54,000	
ライトオン	100	587.00	58,700	
ナガイレーベン	200	2,514.00	502,800	
三菱食品	200	2,766.00	553,200	
良品計画	2,100	2,327.00	4,886,700	
三城ホールディングス	200	280.00	56,000	
松田産業	100	1,484.00	148,400	
第一興商	200	5,060.00	1,012,000	
メディパルホールディングス	1,600	2,384.00	3,814,400	
アドヴァン	200	1,133.00	226,600	
萩原電気ホールディングス	100	2,778.00	277,800	

アルビス	100	2,434.00	243,400	
アズワン	100	8,770.00	877,000	
スズデン	100	1,347.00	134,700	
シモジマ	100	1,175.00	117,500	
ドウシシャ	100	1,720.00	172,000	
コナカ	200	409.00	81,800	
高速	100	1,315.00	131,500	
たけびし	100	1,392.00	139,200	
イオン北海道	100	771.00	77,100	
ヒマラヤ	100	820.00	82,000	
コーナン商事	200	2,512.00	502,400	
ネットワンシステムズ	500	2,918.00	1,459,000	
エコス	100	1,713.00	171,300	
ワタミ	200	1,417.00	283,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	3,500	1,695.00	5,932,500	
丸文	100	610.00	61,000	
西松屋チェーン	300	953.00	285,900	
ゼンショーホールディングス	700	2,283.00	1,598,100	
ハピネット	100	1,321.00	132,100	
日本ライフライン	400	1,729.00	691,600	
サイゼリヤ	200	2,569.00	513,800	
タカショー	100	471.00	47,100	
エクセル	100	1,212.00	121,200	
ＶＴホールディングス	700	467.00	326,900	
マルカ	100	2,202.00	220,200	
アルゴグラフィックス	100	2,564.00	256,400	
ＩＤＯＭ	500	520.00	260,000	
日本エム・ディ・エム	100	1,887.00	188,700	
ユナイテッドアローズ	200	3,320.00	664,000	
進和	100	2,341.00	234,100	
ダイトロン	100	1,451.00	145,100	
ハイデイ日高	200	2,086.00	417,200	
シークス	200	1,611.00	322,200	
コロワイド	500	2,082.00	1,041,000	
ピーシーデポコーポレーション	200	482.00	96,400	
オーハシテクニカ	100	1,425.00	142,500	
壱番屋	100	5,110.00	511,000	
スギホールディングス	300	6,210.00	1,863,000	
薬王堂ホールディングス	100	2,693.00	269,300	
島津製作所	1,900	2,706.00	5,141,400	
ＪＭＳ	100	655.00	65,500	
長野計器	100	697.00	69,700	
ブイ・テクノロジー	100	6,470.00	647,000	
スター精密	200	1,628.00	325,600	
東京計器	100	925.00	92,500	
インターアクション	100	1,887.00	188,700	
オーバル	100	242.00	24,200	
東京精密	300	3,390.00	1,017,000	
マニー	600	2,600.00	1,560,000	

ニコン	2,600	1,360.00	3,536,000	
トプコン	800	1,416.00	1,132,800	
オリンパス	8,800	1,469.00	12,927,200	
理研計器	100	2,129.00	212,900	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	300	7,640.00	2,292,000	
キヤノン電子	200	1,921.00	384,200	
タムロン	100	2,321.00	232,100	
ＨＯＹＡ	3,000	9,176.00	27,528,000	
シード	100	900.00	90,000	
ノーリツ鋼機	100	1,530.00	153,000	
朝日インテック	1,300	2,840.00	3,692,000	
キヤノン	8,000	2,914.00	23,312,000	代用有価証券 4,100株
リコー	4,500	967.00	4,351,500	
シチズン時計	1,600	553.00	884,800	
リズム時計工業	100	1,024.00	102,400	
大研医器	100	527.00	52,700	
メニコン	200	3,685.00	737,000	
スノーピーク	100	1,110.00	111,000	
パラマウントベッドホールディングス	200	4,110.00	822,000	
トランザクション	100	914.00	91,400	
ニホンフラッシュ	100	2,717.00	271,700	
前田工繊	200	1,707.00	341,400	
永大産業	200	344.00	68,800	
アートネイチャー	200	659.00	131,800	
バンダイナムコホールディングス	1,500	6,950.00	10,425,000	
共立印刷	200	160.00	32,000	
ＳＨＯＥＩ	100	4,585.00	458,500	
フランスベッドホールディングス	200	997.00	199,400	
マーベラス	200	788.00	157,600	
パイロットコーポレーション	300	4,090.00	1,227,000	
萩原工業	100	1,656.00	165,600	
エイベックス	200	1,291.00	258,200	
トッパン・フォームズ	300	1,041.00	312,300	
フジシールインターナショナル	300	2,723.00	816,900	
タカラトミー	600	1,179.00	707,400	
レック	200	1,051.00	210,200	
タカノ	100	799.00	79,900	
プロネクサス	100	1,161.00	116,100	
大建工業	100	1,945.00	194,500	
きもと	300	170.00	51,000	
凸版印刷	2,200	1,985.00	4,367,000	
大日本印刷	2,100	2,809.00	5,898,900	
ＮＩＳＳＨＡ	300	1,154.00	346,200	
藤森工業	100	3,465.00	346,500	
宝印刷	100	1,717.00	171,700	
前澤化成工業	100	1,147.00	114,700	
アシックス	1,200	1,910.00	2,292,000	
ＪＳＰ	100	1,866.00	186,600	
ニチハ	200	3,055.00	611,000	

エフピコ	200	6,620.00	1,324,000	
ヤマハ	900	5,040.00	4,536,000	
クリナップ	100	577.00	57,700	
ピジョン	900	4,700.00	4,230,000	
天馬	100	1,990.00	199,000	
キングジム	100	872.00	87,200	
象印マホービン	400	1,535.00	614,000	
リンテック	400	2,256.00	902,400	
信越ポリマー	300	825.00	247,500	
東リ	400	262.00	104,800	
イトーキ	300	469.00	140,700	
任天堂	800	38,550.00	30,840,000	
三菱鉛筆	200	1,779.00	355,800	
松風	100	1,570.00	157,000	
タカラスタンダード	300	1,860.00	558,000	
コクヨ	700	1,566.00	1,096,200	
ナカバヤシ	100	529.00	52,900	
ニフコ	600	2,636.00	1,581,600	
立川ブラインド工業	100	1,400.00	140,000	
グローブライド	100	2,758.00	275,800	
オカムラ	500	1,070.00	535,000	
バルカー	100	2,405.00	240,500	
伊藤忠商事	10,200	2,276.00	23,215,200	
丸紅	14,400	741.70	10,680,480	
スクロール	200	337.00	67,400	
ヨンドシーホールディングス	200	2,610.00	522,000	
三陽商会	100	1,468.00	146,800	
長瀬産業	800	1,590.00	1,272,000	
蝶理	100	1,688.00	168,800	
豊田通商	1,600	3,625.00	5,800,000	
オンワードホールディングス	900	605.00	544,500	
三共生興	200	528.00	105,600	
兼松	600	1,259.00	755,400	
美津濃	100	2,830.00	283,000	
ファミリーマート	1,600	2,826.00	4,521,600	
三井物産	12,000	1,792.50	21,510,000	
日本紙パルプ商事	100	3,910.00	391,000	
東京エレクトロン	1,000	21,775.00	21,775,000	
日立ハイテクノロジーズ	400	6,520.00	2,608,000	
カメイ	200	1,211.00	242,200	
スターゼン	100	4,595.00	459,500	
セイコーホールディングス	200	2,518.00	503,600	
山善	600	968.00	580,800	
住友商事	8,600	1,710.50	14,710,300	
日本ユニシス	500	3,465.00	1,732,500	
内田洋行	100	4,320.00	432,000	
三菱商事	10,300	2,703.50	27,846,050	代用有価証券 5,200株
第一実業	100	3,300.00	330,000	
キヤノンマーケティングジャパン	400	2,325.00	930,000	

西華産業	100	1,356.00	135,600	
佐藤商事	100	842.00	84,200	
菱洋エレクトロ	100	1,914.00	191,400	
東京産業	100	570.00	57,000	
ユアサ商事	100	3,250.00	325,000	
小林産業	100	315.00	31,500	
阪和興業	300	3,080.00	924,000	
正栄食品工業	100	3,335.00	333,500	
カナデン	100	1,270.00	127,000	
菱電商事	100	1,551.00	155,100	
ニプロ	1,000	1,242.00	1,242,000	
フルサト工業	100	1,617.00	161,700	
岩谷産業	300	3,735.00	1,120,500	
イワキ	200	456.00	91,200	
兼松エレクトロニクス	100	3,180.00	318,000	
三愛石油	400	1,062.00	424,800	
稲畑産業	400	1,369.00	547,600	
明和産業	100	533.00	53,300	
ゴールドウイン	300	7,980.00	2,394,000	
ユニ・チャーム	2,900	3,496.00	10,138,400	
デサント	400	1,398.00	559,200	
キング	100	529.00	52,900	
ワキタ	300	1,069.00	320,700	
ヤマトインターナショナル	100	388.00	38,800	
東邦ホールディングス	400	2,485.00	994,000	
サンゲツ	400	2,014.00	805,600	
ミツウロコグループホールディングス	200	1,124.00	224,800	
シナネンホールディングス	100	1,869.00	186,900	
伊藤忠エネクス	300	860.00	258,000	
サンリオ	500	2,130.00	1,065,000	
サンワ　テクノス	100	899.00	89,900	
リョーサン	200	2,816.00	563,200	
新光商事	300	929.00	278,700	
トーホー	100	1,746.00	174,600	
三信電気	100	1,620.00	162,000	
東陽テクニカ	200	1,089.00	217,800	
モスフードサービス	200	2,686.00	537,200	
加賀電子	100	2,090.00	209,000	
三益半導体工業	100	2,050.00	205,000	
ソーダニッカ	200	603.00	120,600	
立花エレテック	100	1,775.00	177,500	
木曽路	200	2,721.00	544,200	
ＳＲＳホールディングス	200	1,044.00	208,800	
ケーヨー	300	520.00	156,000	
上新電機	200	2,242.00	448,400	
日本瓦斯	200	3,240.00	648,000	
ロイヤルホールディングス	300	2,701.00	810,300	
いなげや	200	1,527.00	305,400	
島忠	300	2,882.00	864,600	
チヨダ	200	1,636.00	327,200	

ライフコーポレーション	100	2,496.00	249,600	
リンガーハット	200	2,420.00	484,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	200	477.00	95,400	
ＡＯＫＩホールディングス	300	1,098.00	329,400	
オークワ	200	1,361.00	272,200	
コメリ	200	2,276.00	455,200	
青山商事	300	1,915.00	574,500	
しまむら	200	9,200.00	1,840,000	
はせがわ	100	401.00	40,100	
高島屋	1,100	1,232.00	1,355,200	
松屋	300	887.00	266,100	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	700	1,235.00	864,500	
近鉄百貨店	100	3,335.00	333,500	
パルコ	100	1,299.00	129,900	
丸井グループ	1,200	2,416.00	2,899,200	
クレディセゾン	1,000	1,514.00	1,514,000	
アクシアル　リテイリング	100	4,145.00	414,500	
イオン	5,600	2,168.50	12,143,600	
イズミ	300	4,245.00	1,273,500	
フォーバル	100	996.00	99,600	
平和堂	300	2,054.00	616,200	
フジ	200	1,965.00	393,000	
ヤオコー	200	5,020.00	1,004,000	
ゼビオホールディングス	200	1,217.00	243,400	
ケーズホールディングス	1,500	1,219.00	1,828,500	
ＰＡＬＴＡＣ	300	5,140.00	1,542,000	
三谷産業	200	309.00	61,800	
日産東京販売ホールディングス	200	298.00	59,600	
新生銀行	1,100	1,656.00	1,821,600	
あおぞら銀行	800	2,679.00	2,143,200	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	100,700	555.30	55,918,710	
りそなホールディングス	16,100	458.70	7,385,070	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,900	3,870.00	11,223,000	
三井住友フィナンシャルグループ	10,300	3,759.00	38,717,700	
千葉銀行	5,000	571.00	2,855,000	
群馬銀行	2,900	362.00	1,049,800	
武蔵野銀行	200	1,863.00	372,600	
千葉興業銀行	400	314.00	125,600	
筑波銀行	600	198.00	118,800	
七十七銀行	500	1,648.00	824,000	
青森銀行	100	2,832.00	283,200	
秋田銀行	100	2,136.00	213,600	
山形銀行	200	1,491.00	298,200	
岩手銀行	100	2,519.00	251,900	
東邦銀行	1,300	255.00	331,500	
東北銀行	100	1,021.00	102,100	
みちのく銀行	100	1,668.00	166,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,300	2,029.00	2,637,700	
静岡銀行	3,600	815.00	2,934,000	
十六銀行	200	2,384.00	476,800	

スルガ銀行	1,500	442.00	663,000	
八十二銀行	3,500	459.00	1,606,500	
山梨中央銀行	200	1,056.00	211,200	
大垣共立銀行	300	2,472.00	741,600	
福井銀行	100	1,437.00	143,700	
北國銀行	200	2,969.00	593,800	
滋賀銀行	300	2,532.00	759,600	
南都銀行	200	2,543.00	508,600	
百五銀行	1,300	340.00	442,000	
京都銀行	500	4,180.00	2,090,000	
紀陽銀行	500	1,669.00	834,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,000	1,054.00	1,054,000	
広島銀行	2,200	539.00	1,185,800	
山陰合同銀行	900	654.00	588,600	
中国銀行	1,300	1,036.00	1,346,800	
伊予銀行	1,900	567.00	1,077,300	
百十四銀行	200	2,170.00	434,000	
四国銀行	200	999.00	199,800	
阿波銀行	200	2,540.00	508,000	
大分銀行	100	2,828.00	282,800	
宮崎銀行	100	2,658.00	265,800	
佐賀銀行	100	1,551.00	155,100	
沖縄銀行	100	3,570.00	357,000	
琉球銀行	300	1,174.00	352,200	
セブン銀行	4,900	307.00	1,504,300	
みずほフィナンシャルグループ	198,900	165.30	32,878,170	
山口フィナンシャルグループ	1,800	742.00	1,335,600	
芙蓉総合リース	200	7,130.00	1,426,000	
みずほリース	300	3,015.00	904,500	
東京センチュリー	300	5,050.00	1,515,000	
ＳＢＩホールディングス	1,700	2,343.00	3,983,100	
日本証券金融	600	513.00	307,800	
アイフル	2,200	254.00	558,800	
名古屋銀行	100	3,165.00	316,500	
北洋銀行	2,200	234.00	514,800	
愛知銀行	100	3,580.00	358,000	
中京銀行	100	2,116.00	211,600	
大光銀行	100	1,654.00	165,400	
愛媛銀行	200	1,124.00	224,800	
トマト銀行	100	1,063.00	106,300	
京葉銀行	600	654.00	392,400	
栃木銀行	800	202.00	161,600	
東和銀行	300	849.00	254,700	
リコーリース	100	3,500.00	350,000	
イオンフィナンシャルサービス	900	1,648.00	1,483,200	
アコム	2,900	435.00	1,261,500	
ジャックス	200	2,418.00	483,600	
オリエントコーポレーション	4,000	145.00	580,000	
日立キャピタル	300	2,452.00	735,600	
オリックス	9,800	1,652.00	16,189,600	

三菱ＵＦＪリース	3,300	656.00	2,164,800	
ジャフコ	200	4,350.00	870,000	
九州リースサービス	100	601.00	60,100	
トモニホールディングス	1,100	366.00	402,600	
大和証券グループ本社	11,700	495.30	5,795,010	
野村ホールディングス	25,800	491.20	12,672,960	
岡三証券グループ	1,200	385.00	462,000	
丸三証券	400	525.00	210,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,700	302.00	513,400	
水戸証券	400	239.00	95,600	
いちよし証券	300	694.00	208,200	
松井証券	700	893.00	625,100	
ＳＯＭＰＯホールディングス	2,600	4,251.00	11,052,600	
だいこう証券ビジネス	100	582.00	58,200	
日本取引所グループ	4,000	1,773.00	7,092,000	
マネックスグループ	1,300	261.00	339,300	
極東証券	200	818.00	163,600	
岩井コスモホールディングス	100	1,131.00	113,100	
藍澤證券	300	728.00	218,400	
フィデアホールディングス	1,400	120.00	168,000	
池田泉州ホールディングス	1,600	188.00	300,800	
アニコム　ホールディングス	100	4,015.00	401,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	3,800	3,428.00	13,026,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,200	2,293.00	2,751,600	
第一生命ホールディングス	8,300	1,754.00	14,558,200	
東京海上ホールディングス	5,200	5,731.00	29,801,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	100	867.00	86,700	
イー・ギャランティ	100	1,454.00	145,400	
アサックス	100	615.00	61,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	100	2,179.00	217,900	
Ｔ＆Ｄホールディングス	4,500	1,186.00	5,337,000	
三井不動産	7,800	2,725.50	21,258,900	
三菱地所	10,300	2,111.50	21,748,450	
平和不動産	300	2,684.00	805,200	
東京建物	1,600	1,520.00	2,432,000	
ダイビル	400	1,204.00	481,600	
京阪神ビルディング	300	1,332.00	399,600	
住友不動産	3,300	4,069.00	13,427,700	
太平洋興発	100	791.00	79,100	
テーオーシー	300	824.00	247,200	
レオパレス２１	1,800	289.00	520,200	
スターツコーポレーション	200	2,753.00	550,600	
フジ住宅	200	669.00	133,800	
空港施設	200	538.00	107,600	
明和地所	100	552.00	55,200	
ゴールドクレスト	100	2,257.00	225,700	
リログループ	800	2,509.00	2,007,200	

エスリード	100	1,754.00	175,400	
日神不動産	200	488.00	97,600	
日本エスコン	300	904.00	271,200	
タカラレーベン	700	436.00	305,200	
サンヨーハウジング名古屋	100	937.00	93,700	
イオンモール	700	1,745.00	1,221,500	
ファースト住建	100	1,351.00	135,100	
カチタス	200	4,510.00	902,000	
東祥	100	2,222.00	222,200	
トーセイ	200	1,369.00	273,800	
サンフロンティア不動産	200	1,320.00	264,000	
エフ・ジェー・ネクスト	100	1,092.00	109,200	
ランドビジネス	100	763.00	76,300	
グランディハウス	100	482.00	48,200	
東武鉄道	1,600	3,590.00	5,744,000	
相鉄ホールディングス	500	2,867.00	1,433,500	
東急	4,000	2,070.00	8,280,000	
京浜急行電鉄	2,000	2,150.00	4,300,000	
小田急電鉄	2,400	2,675.00	6,420,000	
京王電鉄	800	6,820.00	5,456,000	
京成電鉄	1,100	4,525.00	4,977,500	
富士急行	200	4,390.00	878,000	
東日本旅客鉄道	2,600	10,000.00	26,000,000	
西日本旅客鉄道	1,300	9,284.00	12,069,200	
東海旅客鉄道	1,300	22,590.00	29,367,000	
西武ホールディングス	1,800	1,911.00	3,439,800	
鴻池運輸	200	1,650.00	330,000	
西日本鉄道	400	2,478.00	991,200	
ハマキョウレックス	100	3,540.00	354,000	
サカイ引越センター	100	6,440.00	644,000	
近鉄グループホールディングス	1,400	5,820.00	8,148,000	
阪急阪神ホールディングス	1,900	4,285.00	8,141,500	
南海電気鉄道	600	2,777.00	1,666,200	
京阪ホールディングス	600	5,010.00	3,006,000	
名古屋鉄道	1,200	3,395.00	4,074,000	
山陽電気鉄道	100	2,140.00	214,000	
日本通運	500	5,620.00	2,810,000	
ヤマトホールディングス	2,500	1,782.50	4,456,250	
山九	400	5,820.00	2,328,000	
日新	100	1,645.00	164,500	
丸運	100	269.00	26,900	
丸全昭和運輸	100	3,045.00	304,500	
センコーグループホールディングス	800	859.00	687,200	
ニッコンホールディングス	500	2,574.00	1,287,000	
福山通運	200	3,815.00	763,000	
セイノーホールディングス	1,100	1,351.00	1,486,100	
日立物流	300	3,185.00	955,500	
丸和運輸機関	100	2,761.00	276,100	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	100	1,314.00	131,400	
日本郵船	1,200	1,933.00	2,319,600	

商船三井	800	2,940.00	2,352,000	
川崎汽船	400	1,514.00	605,600	
ＮＳユナイテッド海運	100	2,389.00	238,900	
飯野海運	700	364.00	254,800	
九州旅客鉄道	1,200	3,480.00	4,176,000	
ＳＧホールディングス	1,300	2,641.00	3,433,300	
日本航空	2,600	3,350.00	8,710,000	
ＡＮＡホールディングス	2,600	3,715.00	9,659,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	100	2,357.00	235,700	
国際紙パルプ商事	300	311.00	93,300	
総合メディカルホールディングス	100	1,707.00	170,700	
ブックオフグループホールディングス	100	1,138.00	113,800	
三菱倉庫	500	2,741.00	1,370,500	
三井倉庫ホールディングス	200	1,714.00	342,800	
住友倉庫	500	1,463.00	731,500	
澁澤倉庫	100	1,998.00	199,800	
ヤマタネ	100	1,377.00	137,700	
東陽倉庫	300	328.00	98,400	
乾汽船	100	1,162.00	116,200	
日本トランスシティ	300	532.00	159,600	
中央倉庫	100	1,160.00	116,000	
安田倉庫	100	944.00	94,400	
宇徳	100	531.00	53,100	
上組	900	2,404.00	2,163,600	
近鉄エクスプレス	300	1,598.00	479,400	
東海運	100	284.00	28,400	
エーアイテイー	100	971.00	97,100	
東京放送ホールディングス	1,000	1,703.00	1,703,000	
日本テレビホールディングス	1,300	1,403.00	1,823,900	
朝日放送グループホールディングス	100	727.00	72,700	
テレビ朝日ホールディングス	400	1,689.00	675,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	1,000	446.00	446,000	
テレビ東京ホールディングス	100	2,206.00	220,600	
ビジョン	100	1,689.00	168,900	
コネクシオ	100	1,396.00	139,600	
日本通信	1,300	191.00	248,300	
日本電信電話	10,000	5,329.00	53,290,000	
ＫＤＤＩ	11,900	2,982.50	35,491,750	
ソフトバンク	15,400	1,481.00	22,807,400	
光通信	200	23,320.00	4,664,000	
ＮＴＴドコモ	9,200	2,870.00	26,404,000	
エムティーアイ	100	732.00	73,200	
ＧＭＯインターネット	600	1,800.00	1,080,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	400	1,498.00	599,200	
ゼンリン	300	1,833.00	549,900	
東京電力ホールディングス	11,800	538.00	6,348,400	
中部電力	4,500	1,631.50	7,341,750	
関西電力	6,100	1,256.00	7,661,600	
中国電力	2,100	1,444.00	3,032,400	
北陸電力	1,500	757.00	1,135,500	

東北電力	3,500	1,099.00	3,846,500	
四国電力	1,300	1,055.00	1,371,500	
九州電力	3,100	1,085.00	3,363,500	
北海道電力	1,400	583.00	816,200	
沖縄電力	300	1,790.00	537,000	
電源開発	1,200	2,615.00	3,138,000	
エフオン	100	722.00	72,200	
イーレックス	300	1,379.00	413,700	
レノバ	200	940.00	188,000	
東京瓦斯	2,900	2,701.00	7,832,900	
大阪瓦斯	2,900	2,073.00	6,011,700	
東邦瓦斯	700	4,230.00	2,961,000	
北海道瓦斯	100	1,583.00	158,300	
広島ガス	300	349.00	104,700	
西部瓦斯	200	2,431.00	486,200	
静岡ガス	400	919.00	367,600	
メタウォーター	100	3,755.00	375,500	
アイネット	100	1,370.00	137,000	
松竹	100	16,070.00	1,607,000	
東宝	1,000	4,565.00	4,565,000	
エイチ・アイ・エス	200	2,808.00	561,600	
東映	100	15,060.00	1,506,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	3,900	1,433.00	5,588,700	
共立メンテナンス	200	4,745.00	949,000	
イチネンホールディングス	100	1,295.00	129,500	
建設技術研究所	100	1,713.00	171,300	
スペース	100	1,278.00	127,800	
長　大	100	1,004.00	100,400	
アインホールディングス	200	6,140.00	1,228,000	
燦ホールディングス	100	1,078.00	107,800	
東京テアトル	100	1,376.00	137,600	
東京都競馬	100	3,410.00	341,000	
常磐興産	100	1,689.00	168,900	
カナモト	200	2,913.00	582,600	
東京ドーム	500	957.00	478,500	
ＤＴＳ	300	2,307.00	692,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	4,965.00	3,475,500	
シーイーシー	200	1,976.00	395,200	
カプコン	600	2,789.00	1,673,400	
西尾レントオール	100	2,916.00	291,600	
日本空港ビルデング	500	5,290.00	2,645,000	
トランス・コスモス	200	2,650.00	530,000	
乃村工藝社	700	1,321.00	924,700	
ジャステック	100	1,098.00	109,800	
ＳＣＳＫ	400	5,090.00	2,036,000	
藤田観光	100	2,841.00	284,100	
日本管財	200	1,919.00	383,800	
トーカイ	100	2,412.00	241,200	
セコム	1,500	9,897.00	14,845,500	

セントラル警備保障	100	6,160.00	616,000	
アイネス	200	1,154.00	230,800	
丹青社	300	1,138.00	341,400	
メイテック	200	5,640.00	1,128,000	
ＴＫＣ	100	4,510.00	451,000	
富士ソフト	200	4,550.00	910,000	
応用地質	200	1,201.00	240,200	
船井総研ホールディングス	300	2,580.00	774,000	
ＮＳＤ	200	3,115.00	623,000	
進学会ホールディングス	100	512.00	51,200	
オオバ	100	720.00	72,000	
コナミホールディングス	600	4,910.00	2,946,000	
ベネッセホールディングス	500	2,929.00	1,464,500	
イオンディライト	200	3,645.00	729,000	
ナック	100	980.00	98,000	
ニチイ学館	200	1,828.00	365,600	
ダイセキ	200	2,921.00	584,200	
ステップ	100	1,427.00	142,700	
日鉄物産	100	4,465.00	446,500	
トラスコ中山	300	2,695.00	808,500	
ヤマダ電機	4,500	506.00	2,277,000	
オートバックスセブン	600	1,754.00	1,052,400	
モリト	100	795.00	79,500	
アークランドサカモト	200	1,261.00	252,200	
ニトリホールディングス	600	16,090.00	9,654,000	
グルメ杵屋	100	1,172.00	117,200	
愛眼	100	244.00	24,400	
ケーユーホールディングス	100	848.00	84,800	
吉野家ホールディングス	500	2,610.00	1,305,000	
加藤産業	200	3,465.00	693,000	
イノテック	100	970.00	97,000	
イエローハット	300	1,639.00	491,700	
松屋フーズホールディングス	100	3,910.00	391,000	
ＪＢＣＣホールディングス	100	1,514.00	151,400	
ＪＫホールディングス	100	539.00	53,900	
サガミホールディングス	200	1,375.00	275,000	
日伝	100	2,064.00	206,400	
関西スーパーマーケット	100	1,092.00	109,200	
ミロク情報サービス	100	2,880.00	288,000	
杉本商事	100	1,959.00	195,900	
因幡電機産業	200	4,825.00	965,000	
王将フードサービス	100	6,660.00	666,000	
プレナス	200	1,823.00	364,600	
ミニストップ	100	1,469.00	146,900	
アークス	300	2,288.00	686,400	
バローホールディングス	300	1,852.00	555,600	
ミスミグループ本社	1,800	2,495.00	4,491,000	
ベルク	100	5,140.00	514,000	
大　庄	100	1,594.00	159,400	
ファーストリテイリング	200	69,270.00	13,854,000	

ソフトバンクグループ	11,600	4,298.00	49,856,800	
スズケン	700	5,730.00	4,011,000	
サンドラッグ	500	3,530.00	1,765,000	
サックスバー　ホールディングス	100	905.00	90,500	
ジェコス	100	909.00	90,900	
グローセル	100	428.00	42,800	
ベルーナ	400	691.00	276,400	
合計	1,719,700		3,440,145,730	

（２）株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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10月21日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	176,118,355
国債証券	7,145,487,400
地方債証券	985,514,730
特殊債券	837,197,000
社債券	514,117,000
未収利息	14,391,865
前払費用	213,364
流動資産合計	9,673,039,714
資産合計	9,673,039,714
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,000,000
流動負債合計	2,000,000
負債合計	2,000,000
純資産の部	
元本等	
元本	7,433,503,720
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,237,535,994
元本等合計	9,671,039,714
純資産合計	9,671,039,714
負債純資産合計	9,673,039,714

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年10月21日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,199,045,595円
同期中追加設定元本額	1,464,413,887円
同期中一部解約元本額	3,229,955,762円
元本の内訳	
ファンド名	
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内債券インデックスファンド	137,578,139円
新光７資産バランスファンド	520,033,360円
日本債券ファンド	4,866,075,762円
新光世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	562,674,296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）	80,384,822円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	73,716,873円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	1,169,089,987円
グローバル・ナビ	23,950,481円
計	7,433,503,720円
２．　受益権の総数	7,433,503,720口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	令和1年10月21日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	207,074,800
地方債証券	4,776,530
特殊債券	337,000
社債券	△1,543,000
合計	210,645,330

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年11月13日から令和1年10月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和1年10月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3010円 (13,010円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年10月21日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	１２７回　利付国庫債券（５年）	120,000,000	120,574,800	
	１２８回　利付国庫債券（５年）	120,000,000	120,678,000	
	１２９回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	60,396,600	
	１３０回　利付国庫債券（５年）	80,000,000	80,607,200	
	１３１回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	60,515,400	
	１３２回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,379,600	
	１３３回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,527,500	
	１３４回　利付国庫債券（５年）	20,000,000	20,232,400	
	１３５回　利付国庫債券（５年）	30,000,000	30,376,200	

１３６回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,683,000	
１３７回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,730,500	
１３８回　利付国庫債券（５年）	30,000,000	30,466,800	
１３９回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,836,000	
１４０回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,698,000	
１回　利付国債（４０年）	10,000,000	15,375,900	
２回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	14,972,200	
３回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	15,083,900	
４回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	30,469,200	
５回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	29,518,400	
６回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	29,140,800	
７回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	28,075,400	
８回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	26,284,000	
９回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	29,577,000	
１０回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	34,654,800	
１１回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	33,658,500	
１２回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	10,150,300	
３１３回　利付国庫債券（１０年）	100,000,000	102,171,000	
３１５回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	81,916,800	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,285,000	
３１９回　利付国庫債券（１０年）	30,000,000	30,875,700	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,351,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,512,500	
３２２回　利付国庫債券（１０年）	20,000,000	20,556,600	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,411,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	41,236,800	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	10,000,000	10,305,700	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,688,000	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	72,067,800	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	72,753,100	

３３０回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	72,944,900	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	62,182,200	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	83,102,400	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	62,461,800	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	83,064,800	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	30,000,000	31,216,500	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	41,203,600	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	82,962,400	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	90,000,000	93,491,100	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	62,432,400	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	72,543,800	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	61,467,000	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	82,034,400	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	82,112,800	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,369,000	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	82,298,400	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,466,500	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	72,063,600	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	82,365,600	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	100,000,000	102,916,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	61,721,400	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	71,969,800	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	71,892,100	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	41,051,600	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	61,500,000	
７回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,815,800	

１０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,872,400	
１１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,263,100	
１２回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,840,600	
１３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,465,200	
１５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	27,070,800	
１７回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,929,200	
１９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,783,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,747,700	
２１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,466,300	
２２回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,818,000	
２３回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,864,100	
２６回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	41,414,400	
２７回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	14,049,600	
２８回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	42,361,500	
２９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	28,017,000	
３０回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	41,651,700	
３１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	27,527,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	42,062,700	
３３回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	40,472,400	
３４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	41,886,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	40,820,400	
３６回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	27,338,800	
３７回　利付国庫債券（３０年）	40,000,000	54,008,400	
３８回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,677,600	
３９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	27,188,800	

４０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,782,400	
４１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,366,600	
４２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,397,200	
４３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,428,400	
４４回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,459,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,554,600	
４６回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	38,362,200	
４７回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,100,800	
４８回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	37,706,700	
４９回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	37,729,500	
５０回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	33,263,100	
５１回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	29,454,600	
５２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	30,954,300	
５３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,135,200	
５４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	33,251,100	
５５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,157,600	
５６回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	33,221,100	
５７回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	33,247,200	
５８回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	33,230,100	
５９回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	32,439,000	
６０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,708,800	
６１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,623,200	
６２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	20,526,200	
６３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	19,947,000	
４８回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,957,300	

５０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,908,700	
５１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,373,300	
５２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	20,899,000	
５３回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,508,900	
５５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,543,800	
５９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,624,200	
６３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,521,200	
６４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,853,100	
６９回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	33,155,100	
７０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,508,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,347,200	
７６回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	33,561,600	
７８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,486,800	
８１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,359,800	
８４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,418,100	
８８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,734,300	
９０回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,734,900	
９２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	35,164,500	
９５回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,000,200	
９９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,947,300	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	36,242,700	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,936,900	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,163,900	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,296,800	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,397,800	

１１３回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	61,193,000	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,276,700	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,418,400	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,626,400	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,248,900	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,637,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,358,200	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,881,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	37,785,900	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,365,700	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,573,000	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,403,600	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,082,100	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,103,800	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,451,400	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,255,700	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,131,500	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,014,400	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,318,800	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,906,100	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,065,600	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	36,560,100	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	48,851,600	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,688,400	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,208,600	

１４４回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,941,400	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	49,052,400	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	36,863,100	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	48,682,400	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	48,226,400	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	48,298,800	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	59,724,000	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	58,299,500	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	46,710,800	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	59,204,000	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	46,780,400	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	56,929,500	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	31,250,700	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	40,324,800	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,273,600	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,903,200	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,687,700	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,156,100	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,130,300	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,803,600	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,569,000	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,007,200	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	43,446,000	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,943,200	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,861,300	

	１６９回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,280,800	
国債証券　合計		6,430,000,000	7,145,487,400	
地方債証券	７８３回　東京都公募公債	100,000,000	101,589,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	120,390,000	
	２００回　神奈川県公募公債	35,000,000	36,123,850	
	２１８回　神奈川県公募公債	100,000,000	101,108,000	
	４１２回　大阪府公募公債　１０年	50,000,000	50,102,000	
	１２回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	107,186,000	
	２４年度３回　広島県公募公債	66,000,000	67,576,080	
	２４年度７回　広島県公募公債	100,000,000	102,277,000	
	２４年度１回　福岡県公募公債　３０年	10,000,000	13,667,900	
	１０５回　共同発行市場公募地方債	50,000,000	51,158,500	
	１６９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,310,000	
	４８５回　名古屋市公募公債　１０年	30,000,000	30,824,400	
	２４年度２回　広島市公募公債	100,000,000	102,202,000	
地方債証券　合計		941,000,000	985,514,730	
特殊債券	１０４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,400,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	121,204,000	
	２４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,014,000	
	３２７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,609,000	
	３４回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,314,000	
	４９回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,466,000	
	５８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,130,000	
	３１７回　利附信金中金債（５年）	100,000,000	100,060,000	
特殊債券　合計		800,000,000	837,197,000	
社債券	４回　第一三共社債	100,000,000	102,589,000	
	１１回　ブリヂストン社債	100,000,000	100,636,000	
	４４回　ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,823,000	
	４７回　野村ホールディングス社債	100,000,000	100,659,000	
	３６回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,410,000	
社債券　合計		500,000,000	514,117,000	
合計			9,482,316,130	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和1年10月21日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,399,350
投資証券	2,614,501,650
未収入金	57,712,430
未収配当金	18,181,973
流動資産合計	2,715,795,403
資産合計	2,715,795,403
負債の部	
流動負債	
未払解約金	60,250,000
流動負債合計	60,250,000
負債合計	60,250,000
純資産の部	
元本等	
元本	1,160,750,535
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,494,794,868
元本等合計	2,655,545,403
純資産合計	2,655,545,403
負債純資産合計	2,715,795,403

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年10月21日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,377,442,713円
同期中追加設定元本額	6,944,453円
同期中一部解約元本額	223,636,631円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	308,546,790円
グローバル・ナビ	4,578,538円
新光Ｊ－ＲＥＩＴオープン（年２回決算型）	847,625,207円
計	1,160,750,535円
２．　受益権の総数	1,160,750,535口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	令和1年10月21日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	545,279,269
合計	545,279,269

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年10月23日から令和1年10月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和1年10月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2878円 (22,878円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年10月21日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	32	4,636,800	
	ＧＬＰ投資法人	569	83,643,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	271	34,146,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	36	12,222,000	
	いちごオフィスリート投資法人	177	20,602,800	
	いちごホテルリート投資法人	38	5,145,200	
	さくら総合リート投資法人	49	4,914,700	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	114	66,120,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	217	78,554,000	
	イオンリート投資法人	246	38,695,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,467	32,200,650	
	インヴィンシブル投資法人	1,001	68,268,200	
	エスコンジャパンリート投資法人	23	3,047,500	
	オリックス不動産投資法人	455	107,698,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	159	23,277,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	71	61,273,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	142	31,822,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	84	24,771,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	95	33,535,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	46	5,704,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	33	4,029,300	
	ザイマックス・リート投資法人	33	4,507,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	735	62,842,500	
	ジャパンエクセレント投資法人	204	37,026,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	228	166,896,000	
	スターアジア不動産投資法人	76	9,028,800	
	スターツプロシード投資法人	36	7,696,800	

	タカラレーベン不動産投資法人	65	8,313,500	
	トーセイ・リート投資法人	42	5,989,200	
	ヒューリックリート投資法人	194	40,255,000	
	フロンティア不動産投資法人	81	39,933,000	
	プレミア投資法人	206	34,608,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	49	6,958,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	20	2,734,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	513	111,321,000	
	ラサールロジポート投資法人	212	34,810,400	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	35	4,501,000	
	阪急阪神リート投資法人	103	18,385,500	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	56	25,788,000	
	三菱地所物流リート投資法人	45	16,155,000	
	産業ファンド投資法人	281	47,966,700	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	54	7,851,600	
	森トラスト総合リート投資法人	163	32,420,700	
	森ヒルズリート投資法人	263	48,234,200	
	星野リゾート・リート投資法人	35	21,070,000	
	積水ハウス・リート投資法人	668	68,670,400	
	大江戸温泉リート投資法人	39	3,857,100	
	大和ハウスリート投資法人	308	97,790,000	
	大和証券オフィス投資法人	53	44,679,000	
	投資法人みらい	248	15,971,200	
	東急リアル・エステート投資法人	153	32,374,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	76	53,048,000	
	日本ビルファンド投資法人	221	181,883,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	145	75,400,000	
	日本プロロジスリート投資法人	328	100,860,000	
	日本ヘルスケア投資法人	11	2,438,700	
	日本リート投資法人	74	34,780,000	
	日本リテールファンド投資法人	431	105,767,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	149	41,675,300	
	日本賃貸住宅投資法人	257	27,190,600	
	福岡リート投資法人	118	22,207,600	
	平和不動産リート投資法人	142	20,561,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	712	145,746,400	
投資証券　合計		13,187	2,614,501,650	
合計			2,614,501,650	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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10月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	193,704,223
コール・ローン	10,831,352
株式	2,654,884,158
投資信託受益証券	5,149,650
投資証券	72,253,627
派生商品評価勘定	1,572,072
未収入金	46,431
未収配当金	2,477,926
差入委託証拠金	69,177,879
流動資産合計	3,010,097,318
資産合計	3,010,097,318
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	898,115
未払解約金	8,376,000
流動負債合計	9,274,115
負債合計	9,274,115
純資産の部	
元本等	
元本	1,211,262,105
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,789,561,098
元本等合計	3,000,823,203
純資産合計	3,000,823,203
負債純資産合計	3,010,097,318

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		令和1年10月21日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,072,989,866円
	同期中追加設定元本額	26,986,654円
	同期中一部解約元本額	888,714,415円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	新光７資産バランスファンド	274,821,629円
	新光外国株式インデックスＶＡ	372,235,662円
	新光世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	148,626,981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）	15,101,179円
	ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	19,368,251円
	ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	368,518,610円
	グローバル・ナビ	12,589,793円
	計	1,211,262,105円
２．	受益権の総数	1,211,262,105口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び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管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	令和1年10月21日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	170,823,544
投資信託受益証券	596,280
投資証券	11,284,642
合計	182,704,466

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年11月13日から令和1年10月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	令和1年10月21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	2,570,329	－	2,570,410	△81
アメリカ・ドル	1,304,082	－	1,302,000	2,082
イギリス・ポンド	419,559	－	420,570	△1,011
ユーロ	846,688	－	847,840	△1,152
合計	2,570,329	－	2,570,410	△81

（注）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。

①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、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②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相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・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、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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。

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※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。

株式関連

種類	令和1年10月21日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち１年超		
市場取引				
先物取引				
買建	263,744,845	－	264,418,883	674,038
合計	263,744,845	－	264,418,883	674,038

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

１．　原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和1年10月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4774円 (24,774円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和1年10月21日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	280	1,757.510	492,102.800	
	ABBOTT LABORATORIES	1,150	82.790	95,208.500	
	AES CORP	310	16.380	5,077.800	
	ABIOMED INC	30	175.300	5,259.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	578	134.090	77,504.020	
	ADVANCED MICRO DEVICES	780	30.970	24,156.600	
	ADOBE INC	314	265.520	83,373.280	
	CHUBB LTD	298	152.690	45,501.620	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	139	214.880	29,868.320	
	ALLEGHANY CORP	3	780.860	2,342.580	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	53	85.770	4,545.810	
	RALPH LAUREN CORP	55	94.970	5,223.350	
	ALLSTATE CORP	238	108.410	25,801.580	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	458	165.570	75,831.060	
	AMGEN INC	392	202.720	79,466.240	
	HESS CORP	171	64.950	11,106.450	
	AMERICAN EXPRESS CO	489	116.760	57,095.640	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	326	94.140	30,689.640	
	AFLAC INC	531	52.710	27,989.010	
	AMERICAN INTL GROUP	593	53.970	32,004.210	
	AMERCO	2	397.880	795.760	
	ANALOG DEVICES	246	109.480	26,932.080	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	164	98.410	16,139.240	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	490	41.850	20,506.500	
	JONES LANG LASALLE INC	21	143.590	3,015.390	
	VALERO ENERGY CORP	265	91.060	24,130.900	
	APACHE CORP	234	22.440	5,250.960	
	ANSYS INC	62	218.430	13,542.660	
	APPLE INC	3,035	236.410	717,504.350	
	APPLIED MATERIALS INC	606	51.680	31,318.080	
	ALBEMARLE CORP	71	67.130	4,766.230	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	342	39.640	13,556.880	

PINNACLE WEST CAPITAL CORP	59	93.910	5,540.690	
AMEREN CORP	141	76.620	10,803.420	
AUTOLIV INC	50	80.350	4,017.500	
AUTODESK INC	150	139.670	20,950.500	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	278	163.540	45,464.120	
AUTOZONE INC	18	1,110.000	19,980.000	
AVERY DENNISON CORP	54	116.890	6,312.060	
BALL CORP	234	74.110	17,341.740	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	858	208.760	179,116.080	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	538	45.340	24,392.920	
BAXTER INTERNATIONAL INC	305	87.990	26,836.950	
BECTON DICKINSON & CO	175	258.590	45,253.250	
AMETEK INC	130	88.350	11,485.500	
VERIZON COMM INC	2,704	61.050	165,079.200	
WR BERKLEY CORP	85	71.160	6,048.600	
BEST BUY CO INC	155	70.520	10,930.600	
YUM! BRANDS INC	190	112.300	21,337.000	
FIRSTENERGY CORP	329	48.380	15,917.020	
H&R BLOCK INC	93	23.280	2,165.040	
BOEING CO	351	344.000	120,744.000	
ROBERT HALF INTL INC	118	55.090	6,500.620	
BORGWARNER INC	67	38.740	2,595.580	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	881	38.470	33,892.070	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	95	86.555	8,222.720	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	82	122.730	10,063.860	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	17	680.500	11,568.500	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,063	53.030	56,370.890	
INGREDION INC	61	79.820	4,869.020	
ONEOK INC	258	69.200	17,853.600	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	76	104.030	7,906.280	
UNITED RENTALS INC	48	128.660	6,175.680	
SEMPRA ENERGY	175	146.230	25,590.250	
FEDEX CORP	155	149.910	23,236.050	
VERISIGN INC	61	185.510	11,316.110	
AMPHENOL CORP	216	99.000	21,384.000	
BROWN-FORMAN CORP	220	63.710	14,016.200	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	964	6.430	6,198.520	
CSX CORP	522	68.670	35,845.740	
CABOT OIL & GAS CORP	265	17.950	4,756.750	
CAMPBELL SOUP CO	106	47.560	5,041.360	
SEAGATE TECHNOLOGY	203	54.980	11,160.940	

CONSTELLATION BRANDS INC	107	197.020	21,081.140	
CARDINAL HEALTH INC	179	51.540	9,225.660	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	289	42.790	12,366.310	
CATERPILLAR INC	392	130.710	51,238.320	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	105	107.410	11,278.050	
CELGENE CORP	486	102.950	50,033.700	
CITRIX SYSTEMS INC	86	101.520	8,730.720	
CENTURYLINK INC	658	12.440	8,185.520	
CERNER CORP	233	67.760	15,788.080	
JPMORGAN CHASE & CO	2,137	120.560	257,636.720	
CHURCH & DWIGHT CO INC	169	73.890	12,487.410	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	93	115.720	10,761.960	
CINTAS CORP	63	269.310	16,966.530	
CISCO SYSTEMS INC	2,787	46.710	130,180.770	
CLOROX COMPANY	83	149.700	12,425.100	
COCA-COLA CO/THE	2,654	54.780	145,386.120	
COPART INC	161	82.320	13,253.520	
COGNEX CORP	121	51.040	6,175.840	
COLGATE-PALMOLIVE CO	552	68.030	37,552.560	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	204	121.050	24,694.200	
COMERICA INC	138	65.450	9,032.100	
NRG ENERGY, INC.	169	40.150	6,785.350	
COMCAST CORP-CL A	2,936	45.570	133,793.520	
CONAGRA BRANDS INC	340	27.150	9,231.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	226	91.490	20,676.740	
CMS ENERGY CORP	186	64.010	11,905.860	
COOPER COS INC	38	287.810	10,936.780	
MOLSON COORS BREWING CO	66	56.980	3,760.680	
CORNING INC	553	29.330	16,219.490	
SEALED AIR CORP	49	41.450	2,031.050	
HEICO CORP-CL A	82	92.500	7,585.000	
CUMMINS INC	101	170.280	17,198.280	
DR HORTON INC	251	53.970	13,546.470	
DANAHER CORP	419	138.010	57,826.190	
MOODY'S CORP	113	217.300	24,554.900	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	420	60.640	25,468.800	
TARGET CORP	319	112.810	35,986.390	
DEERE & CO	193	173.920	33,566.560	
MORGAN STANLEY	786	43.660	34,316.760	
REPUBLIC SERVICES INC	152	88.240	13,412.480	
COSTAR GROUP INC	27	588.120	15,879.240	
THE WALT DISNEY CO	1,175	130.890	153,795.750	
DOLLAR TREE INC	152	116.980	17,780.960	
DOVER CORP	85	102.220	8,688.700	

OMNICOM GROUP	152	75.380	11,457.760	
DTE ENERGY CO	122	127.340	15,535.480	
DUKE ENERGY CORP	495	95.350	47,198.250	
FLOWSERVE CORP	142	46.560	6,611.520	
DARDEN RESTAURANTS INC	84	110.450	9,277.800	
EBAY INC	594	38.820	23,059.080	
BANK OF AMERICA CORP	5,927	30.350	179,884.450	
CITIGROUP INC	1,503	69.740	104,819.220	
EASTMAN CHEMICAL CO	84	73.090	6,139.560	
E*TRADE FINANCIAL CORP	175	40.850	7,148.750	
EATON CORP PLC	263	82.560	21,713.280	
EATON VANCE CORP	32	44.070	1,410.240	
CADENCE DESIGN SYS INC	203	65.600	13,316.800	
DISH NETWORK CORP	210	34.770	7,301.700	
ECOLAB INC	164	193.820	31,786.480	
PERKINELMER INC	73	83.100	6,066.300	
ELECTRONIC ARTS INC	224	95.130	21,309.120	
SALESFORCE.COM INC	540	144.090	77,808.600	
EMERSON ELECTRIC CO	418	68.650	28,695.700	
ATMOS ENERGY CORP	81	111.600	9,039.600	
ENTERGY CORP	129	118.150	15,241.350	
EOG RESOURCES INC	411	64.440	26,484.840	
EQUIFAX INC	86	144.680	12,442.480	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	150	185.530	27,829.500	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	126	73.940	9,316.440	
EXXON MOBIL CORP	2,783	67.610	188,158.630	
FMC CORP	81	83.010	6,723.810	
NEXTERA ENERGY INC	312	232.480	72,533.760	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	27	249.740	6,742.980	
ASSURANT INC	41	125.670	5,152.470	
FASTENAL CO	343	35.830	12,289.690	
FIFTH THIRD BANCORP	397	27.330	10,850.010	
M&T BANK CORP	87	152.230	13,244.010	
FISERV INC	366	105.670	38,675.220	
FLIR SYSTEMS INC	124	52.890	6,558.360	
MACY'S INC	350	15.120	5,292.000	
FORD MOTOR CO	2,853	9.290	26,504.370	
FRANKLIN RESOURCES INC	237	27.220	6,451.140	
FREEPORT-MCMORAN INC	1,058	9.580	10,135.640	
FLEX LTD	276	9.970	2,751.720	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	122	89.550	10,925.100	
GAP INC/THE	264	16.880	4,456.320	
DENTSPLY SIRONA INC	149	54.900	8,180.100	
GENERAL DYNAMICS CORP	152	174.430	26,513.360	
GENERAL MILLS INC	369	52.550	19,390.950	
GENUINE PARTS CO	111	101.350	11,249.850	
GILEAD SCIENCES INC	798	64.910	51,798.180	
GARTNER INC	58	144.510	8,381.580	

MCKESSON CORP	137	152.260	20,859.620	
NVIDIA CORP	377	190.490	71,814.730	
GENERAL ELECTRIC CO	5,641	8.960	50,543.360	
WW GRAINGER INC	31	310.080	9,612.480	
HALLIBURTON CO	509	18.430	9,380.870	
MONSTER BEVERAGE CORP	294	56.055	16,480.170	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	210	206.520	43,369.200	
HARLEY-DAVIDSON INC	73	36.570	2,669.610	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	140	198.080	27,731.200	
HASBRO INC	81	121.960	9,878.760	
HENRY SCHEIN INC	101	62.810	6,343.810	
HELMERICH & PAYNE INC	102	36.560	3,729.120	
HERSHEY FOODS CORP	92	153.070	14,082.440	
HP INC	1,104	16.850	18,602.400	
F5 NETWORKS INC	32	137.690	4,406.080	
CROWN HOLDINGS INC NPR	116	69.870	8,104.920	
JUNIPER NETWORKS INC	328	23.900	7,839.200	
HOLLYFRONTIER CORP	107	54.800	5,863.600	
HOLOGIC INC	183	49.925	9,136.270	
UNUM GROUP	174	28.270	4,918.980	
HOME DEPOT INC	720	237.930	171,309.600	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	122	69.150	8,436.300	
HORMEL FOODS CORP	194	40.810	7,917.140	
CENTERPOINT ENERGY INC	339	28.640	9,708.960	
LENNOX INTERNATIONAL INC	29	253.340	7,346.860	
HUMANA INC	99	289.260	28,636.740	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	83	115.580	9,593.140	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	459	14.190	6,513.210	
NEKTAR THERAPEUTICS	216	17.270	3,730.320	
BIOGEN INC	118	220.060	25,967.080	
IDEX CORP	47	160.340	7,535.980	
ILLINOIS TOOL WORKS	202	158.310	31,978.620	
INTUIT INC	180	262.470	47,244.600	
IDEXX LABORATORIES INC	64	282.830	18,101.120	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	83	55.790	4,630.570	
INGERSOLL-RAND PLC	173	117.300	20,292.900	
INTEL CORP	2,939	51.360	150,947.040	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	66	117.840	7,777.440	
INTERNATIONAL PAPER CO	301	42.260	12,720.260	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	356	20.650	7,351.400	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	118	92.900	10,962.200	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	49	143.480	7,030.520	
INCYTE CORP	135	77.760	10,497.600	
JOHNSON & JOHNSON	1,746	127.700	222,964.200	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	251	59.000	14,809.000	
KLA CORPORATION	109	159.690	17,406.210	
DEVON ENERGY CORP	232	19.800	4,593.600	
KELLOGG CO	188	61.940	11,644.720	
EAST WEST BANCORP INC	67	41.300	2,767.100	
KEYCORP	654	17.770	11,621.580	
KIMBERLY-CLARK CORP	232	137.220	31,835.040	
BLACKROCK INC/NEW YORK	75	445.040	33,378.000	
KOHLS CORP	158	50.600	7,994.800	
KROGER CO	543	23.940	12,999.420	
LAM RESEARCH CORP	100	233.700	23,370.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	108.220	3,787.700	
AKAMAI TECHNOLOGIES	112	91.510	10,249.120	
LEGGETT & PLATT INC	50	43.610	2,180.500	
LENNAR CORP	171	61.710	10,552.410	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	198	18.490	3,661.020	
ELI LILLY & CO	566	108.640	61,490.240	
L BRANDS INC	261	16.310	4,256.910	
LINCOLN NATIONAL CORP	119	59.530	7,084.070	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	479	117.350	56,210.650	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	230	74.570	17,151.100	
LOCKHEED MARTIN CORP	162	372.480	60,341.760	
LOEWS CORP	156	50.960	7,949.760	
LOWE'S COS INC	549	112.840	61,949.160	
DOMINION ENERGY INC	553	82.160	45,434.480	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	332	27.870	9,252.840	
MCCORMICK & CO INC	75	161.590	12,119.250	
MCDONALD'S CORPORATION	498	208.500	103,833.000	
S&P GLOBAL INC	166	250.480	41,579.680	
EVEREST RE GROUP LTD	33	251.080	8,285.640	
MARKEL CORPORATION	9	1,130.990	10,178.910	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	135	227.460	30,707.100	
MARSH & MCLENNAN COS	328	99.050	32,488.400	
MASCO CORP	187	43.850	8,199.950	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	39	265.780	10,365.420	
METLIFE INC	514	46.100	23,695.400	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	165	57.750	9,528.750	

MEDTRONIC PLC	876	108.120	94,713.120	
ACTIVISION BLIZZARD INC	493	54.540	26,888.220	
CVS HEALTH CORP	842	66.160	55,706.720	
MERCK & CO.INC.	1,686	84.680	142,770.480	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	75	167.460	12,559.500	
MICROSOFT CORP	4,797	137.410	659,155.770	
MICRON TECH INC	796	43.470	34,602.120	
MIDDLEBY CORP	39	115.740	4,513.860	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	189	95.005	17,955.940	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	360	23.680	8,524.800	
3M CO	364	163.100	59,368.400	
MOHAWK INDUSTRIES INC	41	125.170	5,131.970	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	110	175.050	19,255.500	
KANSAS CITY SOUTHERN	60	145.250	8,715.000	
MYLAN NV	314	18.330	5,755.620	
ILLUMINA INC	95	309.440	29,396.800	
XCEL ENERGY INC	313	64.010	20,035.130	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	198	20.110	3,981.780	
NETAPP INC	165	53.490	8,825.850	
NEWELL BRANDS INC	259	19.395	5,023.300	
NEWMONT GOLDCORP CORP	546	38.440	20,988.240	
NVR INC	2	3,892.890	7,785.780	
NIKE INC-CL B	819	96.100	78,705.900	
NOBLE ENERGY INC	392	19.060	7,471.520	
NORDSTROM INC	106	34.580	3,665.480	
NORFOLK SOUTHERN CORP	169	181.910	30,742.790	
EVERSOURCE ENERGY	219	85.600	18,746.400	
NISOURCE INC	241	27.980	6,743.180	
TAPESTRY INC	151	25.560	3,859.560	
NORTHERN TRUST CORP	145	94.680	13,728.600	
NORTHROP GRUMMAN CORP	103	349.620	36,010.860	
WELLS FARGO & CO	2,803	49.970	140,065.910	
NUCOR CORP	256	51.680	13,230.080	
CHENIERE ENERGY INC	161	62.550	10,070.550	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	320	89.800	28,736.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	624	40.450	25,240.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	46	178.530	8,212.380	
OGE ENERGY CORP	108	42.790	4,621.320	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	56	403.200	22,579.200	
ORACLE CORP	1,561	54.550	85,152.550	
PACCAR INC	236	72.035	17,000.260	
PTC INC	57	64.380	3,669.660	
EXELON CORP	690	44.665	30,818.850	

PARKER HANNIFIN CORP	87	184.540	16,054.980	
PAYCHEX INC	220	84.245	18,533.900	
ALIGN TECHNOLOGY INC	52	213.880	11,121.760	
PPL CORPORATION	500	32.030	16,015.000	
PEPSICO INC	914	136.250	124,532.500	
PENTAIR PLC	139	38.550	5,358.450	
PFIZER INC	3,638	36.460	132,641.480	
CONOCOPHILLIPS	721	53.950	38,897.950	
PVH CORP	61	87.390	5,330.790	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	116	123.360	14,309.760	
ALTRIA GROUP INC	1,294	44.330	57,363.020	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	311	143.520	44,634.720	
POLARIS INC	30	90.580	2,717.400	
GARMIN LTD	100	87.460	8,746.000	
FLUOR CORP (NEW)	110	19.060	2,096.600	
PPG INDUSTRIES INC	164	124.230	20,373.720	
COSTCO WHOLESALE CORP	287	302.860	86,920.820	
T ROWE PRICE GROUP INC	151	109.410	16,520.910	
QUEST DIAGNOSTICS	46	102.660	4,722.360	
PROCTER & GAMBLE CO	1,646	117.470	193,355.620	
PROGRESSIVE CORP	394	70.200	27,658.800	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	321	62.290	19,995.090	
PULTE GROUP INC	158	38.300	6,051.400	
GLOBAL PAYMENTS INC	189	160.130	30,264.570	
QUALCOMM INC	793	77.680	61,600.240	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	89	82.690	7,359.410	
EXACT SCIENCES CORP	96	96.470	9,261.120	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	24	189.310	4,543.440	
REGENERON PHARMACEUTICALS	50	300.190	15,009.500	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	55	156.730	8,620.150	
RESMED INC	105	131.210	13,777.050	
US BANCORP	985	55.070	54,243.950	
SEATTLE GENETICS INC /WA	106	87.400	9,264.400	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	245	42.310	10,365.950	
ROSS STORES INC	230	114.130	26,249.900	
ROLLINS INC	113	35.960	4,063.480	
ROPER TECHNOLOGIES INC	60	337.920	20,275.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	67	169.190	11,335.730	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	138	111.180	15,342.840	
RAYTHEON COMPANY	193	199.750	38,551.750	

ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	34	123.540	4,200.360	
ACCENTURE PLC-CL A	418	187.080	78,199.440	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	922	54.480	50,230.560	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	95	187.770	17,838.150	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	166	141.360	23,465.760	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	392	128.330	50,305.360	
BOOKING HOLDINGS INC	32	2,013.530	64,432.960	
SCHLUMBERGER LTD	972	32.310	31,405.320	
SCHWAB (CHARLES) CORP	816	39.940	32,591.040	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	148	137.610	20,366.280	
BUNGE LTD	83	54.700	4,540.100	
SEI INVESTMENTS CO	103	58.700	6,046.100	
ANTHEM INC	164	249.400	40,901.600	
AMERISOURCEBERGEN CORP	89	89.640	7,977.960	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	167	56.000	9,352.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	56	560.860	31,408.160	
CENTENE CORP	252	46.880	11,813.760	
SVB FINANCIAL GROUP	36	204.720	7,369.920	
IAC INTERACTIVE CORP	55	221.850	12,201.750	
SMITH (A.O.) CORP	109	51.010	5,560.090	
ACUITY BRANDS INC	19	122.930	2,335.670	
SNAP-ON INC	10	157.520	1,575.200	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	251	89.690	22,512.190	
ADVANCE AUTO PARTS	42	163.500	6,867.000	
EDISON INTERNATIONAL	253	70.520	17,841.560	
SOUTHERN CO	706	61.140	43,164.840	
BB&T CORP	477	52.670	25,123.590	
AT&T INC	4,781	38.470	183,925.070	
CHEVRON CORP	1,253	114.740	143,769.220	
STANLEY BLACK & DECKER INC	104	149.890	15,588.560	
STATE STREET CORP	250	63.340	15,835.000	
STARBUCKS CORP	785	86.030	67,533.550	
STEEL DYNAMICS INC	184	28.705	5,281.720	
STRYKER CORP	231	215.320	49,738.920	
NETFLIX INC	285	275.300	78,460.500	
SUNTRUST BANKS INC	316	67.890	21,453.240	
SYMANTEC CORP	427	23.010	9,825.270	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	136	36.540	4,969.440	
SYNOPSYS INC	104	134.950	14,034.800	
SYSCO CORP	307	79.140	24,295.980	

INTUITIVE SURGICAL INC	81	566.250	45,866.250	
TELEFLEX INC	34	328.310	11,162.540	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	728	7.500	5,460.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	602	129.460	77,934.920	
TEXTRON INC	152	46.010	6,993.520	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	262	281.420	73,732.040	
TIFFANY & CO	103	88.490	9,114.470	
GLOBE LIFE INC	55	94.680	5,207.400	
DAVITA INC	48	58.690	2,817.120	
TRACTOR SUPPLY CO	81	93.320	7,558.920	
TRIMBLE INC	102	39.730	4,052.460	
TYSON FOODS INC	209	82.420	17,225.780	
UGI CORP	31	48.170	1,493.270	
MARATHON OIL CORP	481	11.300	5,435.300	
UNION PACIFIC CORP	460	161.500	74,290.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	528	136.800	72,230.400	
UNITEDHEALTH GROUP INC	620	245.340	152,110.800	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	67	146.090	9,788.030	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	54	114.620	6,189.480	
VF CORP	250	92.470	23,117.500	
CBS CORP	214	36.750	7,864.500	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	152	176.230	26,786.960	
VULCAN MATERIALS CO	102	146.040	14,896.080	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	491	55.300	27,152.300	
WALMART INC	940	119.140	111,991.600	
WASTE MANAGEMENT INC	261	117.050	30,550.050	
WATERS CORP	49	215.750	10,571.750	
ALLERGAN PLC	212	173.600	36,803.200	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	62	107.620	6,672.440	
VAIL RESORTS INC	26	232.820	6,053.320	
WESTERN DIGITAL CORP	207	58.130	12,032.910	
WABTEC CORP	152	69.420	10,551.840	
WHIRLPOOL CORP	53	161.060	8,536.180	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	116	87.770	10,181.320	
WYNN RESORTS LTD	89	113.520	10,103.280	
NASDAQ INC	81	98.620	7,988.220	
CME GROUP INC	247	213.170	52,652.990	
WILLIAMS COS INC	878	22.910	20,114.980	
LKQ CORP	82	31.245	2,562.090	
ALLIANT ENERGY CORP	133	52.980	7,046.340	
WEC ENERGY GROUP INC	190	92.960	17,662.400	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	241	36.790	8,866.390	

CARMAX INC	98	94.280	9,239.440	
XILINX INC	176	94.340	16,603.840	
TJX COMPANIES INC	765	60.360	46,175.400	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	37	203.060	7,513.220	
ZIONS BANCORP NA	183	44.720	8,183.760	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	643	5.410	3,478.630	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	400	54.270	21,708.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	500	29.920	14,960.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	108	84.780	9,156.240	
SIGNATURE BANK	19	122.710	2,331.490	
CBRE GROUP INC	156	52.210	8,144.760	
LIBERTY GLOBAL PLC	219	25.800	5,650.200	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	33	274.450	9,056.850	
REGIONS FINANCIAL CORP	656	15.770	10,345.120	
DOMINO'S PIZZA INC	32	255.700	8,182.400	
T-MOBILE US INC	255	81.600	20,808.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	222	57.460	12,756.120	
MOSAIC CO/THE	166	19.550	3,245.300	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	27	352.880	9,527.760	
CELANESE CORP	82	121.650	9,975.300	
DEXCOM INC	66	156.920	10,356.720	
DISCOVERY INC-A	95	27.710	2,632.450	
EXPEDIA GROUP INC	107	136.030	14,555.210	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	129	47.770	6,162.330	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	90	142.000	12,780.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	224	24.350	5,454.400	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	361	94.400	34,078.400	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	190	19.690	3,741.100	
VIACOM INC-CLASS B	333	22.050	7,342.650	
LIVE NATION	97	67.010	6,499.970	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	19	841.480	15,988.120	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	56	90.085	5,044.760	
TRANSDIGM GROUP INC	36	526.570	18,956.520	
MASTERCARD INC	595	270.630	161,024.850	
QURATE RETAIL INC	398	9.520	3,788.960	
HANESBRANDS INC	186	15.230	2,832.780	
WESTERN UNION CO	240	24.030	5,767.200	
LEIDOS HOLDINGS INC	95	81.620	7,753.900	
AERCAP HOLDINGS NV	102	55.930	5,704.860	

SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	93	79.430	7,386.990	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	126	20.290	2,556.540	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	78	122.980	9,592.440	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	337	16.460	5,547.020	
DELTA AIR LINES INC	162	53.830	8,720.460	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	99	27.560	2,728.440	
DISCOVER FINANCIAL	239	78.940	18,866.660	
TE CONNECTIVITY LTD	249	92.810	23,109.690	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	120	62.450	7,494.000	
WABCO HOLDING INC	22	135.040	2,970.880	
LULULEMON ATHLETICA INC	82	207.110	16,983.020	
VMWARE INC	55	152.140	8,367.700	
MERCADOLIBRE INC	33	536.270	17,696.910	
ULTA BEAUTY INC	33	239.920	7,917.360	
MSCI INC	55	224.400	12,342.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,016	80.550	81,838.800	
VISA INC	1,139	175.710	200,133.690	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	108	122.410	13,220.280	
DISCOVERY INC-C	284	25.900	7,355.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	459	65.140	29,899.260	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,244	20.020	24,904.880	
XYLEM INC	114	79.780	9,094.920	
ALKERMES PLC	217	18.150	3,938.550	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	181	86.110	15,585.910	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	22	210.100	4,622.200	
SPLUNK INC	109	110.950	12,093.550	
EPAM SYSTEMS INC	38	186.960	7,104.480	
HCA HEALTHCARE INC	195	123.640	24,109.800	
VERISK ANALYTICS INC	110	154.420	16,986.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	32	119.650	3,828.800	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	62	291.830	18,093.460	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	130	104.180	13,543.400	
CIT GROUP INC	15	44.290	664.350	
NXP SEMICONDUCTOR NV	180	109.010	19,621.800	
TARGA RESOURCES CORP	133	39.370	5,236.210	
LEAR CORP	49	119.870	5,873.630	

CBOE GLOBAL MARKETS INC	73	116.770	8,524.210	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	132	50.140	6,618.480	
DOLLAR GENERAL CORP	184	164.410	30,251.440	
FORTINET INC	101	76.555	7,732.050	
AON PLC	160	192.910	30,865.600	
TESLA INC	90	256.950	23,125.500	
GENERAL MOTORS CO	903	36.170	32,661.510	
XPO LOGISTICS INC	59	76.740	4,527.660	
TRIPADVISOR INC	137	37.415	5,125.850	
ALLY FINANCIAL INC	256	30.290	7,754.240	
CAPRI HOLDINGS LTD	179	31.030	5,554.370	
VOYA FINANCIAL INC	76	52.980	4,026.480	
APTIV PLC	173	88.960	15,390.080	
PHILLIPS 66	291	107.200	31,195.200	
FACEBOOK INC	1,581	185.850	293,828.850	
IQVIA HOLDINGS INC	124	143.490	17,792.760	
DIAMONDBACK ENERGY INC	135	81.970	11,065.950	
SERVICENOW INC	116	243.000	28,188.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	64	212.610	13,607.040	
WORKDAY INC	116	154.540	17,926.640	
ABBVIE INC	958	76.460	73,248.680	
ZOETIS INC	308	128.120	39,460.960	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	139	50.210	6,979.190	
COTY INC	435	10.120	4,402.200	
NEWS CORP/NEW-CL A	308	13.470	4,148.760	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	114	39.740	4,530.360	
CDW CORP	88	123.910	10,904.080	
SPRINT CORP	465	6.420	2,985.300	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	187	28.220	5,277.140	
ARCONIC INC	266	27.010	7,184.660	
TWILIO INC	67	106.350	7,125.450	
SNAP INC	476	13.520	6,435.520	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	96	43.320	4,158.720	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	47	43.770	2,057.190	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	57	17.810	1,015.170	
OKTA INC	72	98.560	7,096.320	
BAKER HUGHES CO	504	21.770	10,972.080	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	97	76.970	7,466.090	
TECHNIPFMC LTD	262	22.900	5,999.800	
BROADCOM INC	257	286.730	73,689.610	
BURLINGTON STORES INC	45	202.450	9,110.250	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	41	36.955	1,515.150	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	205	26.230	5,377.150	
VEEVA SYSTEMS INC	94	142.900	13,432.600	
TWITTER INC	540	38.990	21,054.600	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	159	50.450	8,021.550	
EVERGY INC	186	63.310	11,775.660	
PLAINS GP HOLDINGS LP	77	20.040	1,543.080	
ALLEGION PLC	86	103.950	8,939.700	
STERIS PLC	58	143.370	8,315.460	
KKR & CO INC	338	27.450	9,278.100	
PERRIGO CO PLC	129	53.900	6,953.100	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	194	91.150	17,683.100	
ARAMARK	171	44.560	7,619.760	
CIGNA CORP	241	166.880	40,218.080	
DELL TECHNOLOGIES INC	106	49.870	5,286.220	
DOW INC	539	47.960	25,850.440	
AMCOR PLC	1,136	9.590	10,894.240	
XEROX HOLDINGS CORP	123	29.800	3,665.400	
FOX CORP-A	420	32.210	13,528.200	
CORTEVA INC	533	26.040	13,879.320	
PAYCOM SOFTWARE INC	34	202.980	6,901.320	
SABRE CORP	223	20.895	4,659.580	
PARSLEY ENERGY INC	116	15.410	1,787.560	
ARISTA NETWORKS INC	37	239.430	8,858.910	
IHS MARKIT LTD	276	69.740	19,248.240	
FNF GROUP	188	45.450	8,544.600	
SYNCHRONY FINANCIAL	444	34.290	15,224.760	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	285	35.320	10,066.200	
CDK GLOBAL INC	73	48.330	3,528.090	
WAYFAIR INC	64	109.200	6,988.800	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	147	98.260	14,444.220	
QORVO INC	117	77.590	9,078.030	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	178	34.330	6,110.740	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	57	111.020	6,328.140	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	124	28.790	3,569.960	
GODADDY INC	101	63.450	6,408.450	
NIELSEN HOLDINGS PLC	291	20.880	6,076.080	
TRANSUNION	141	81.410	11,478.810	
SQUARE INC	250	60.450	15,112.500	
DUPONT DE NEMOURS INC	482	65.530	31,585.460	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	147	58.770	8,639.190	
WESTROCK CO	165	36.700	6,055.500	
KRAFT HEINZ CO	438	27.610	12,093.180	
FORTIVE CORP	176	70.940	12,485.440	
WASTE CONNECTIONS INC	156	94.200	14,695.200	
ALPHABET INC-CL A	195	1,244.410	242,659.950	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	942	15.350	14,459.700	
	PAYPAL HOLDINGS INC	723	101.220	73,182.060	
	DXC TECHNOLOGY CO	156	26.440	4,124.640	
	ZILLOW GROUP INC-C	177	32.040	5,671.080	
	ALPHABET INC-CL C	208	1,245.490	259,061.920	
	LINDE PLC	353	195.790	69,113.870	
	ATHENE HOLDING LTD	156	40.990	6,394.440	
	ROKU INC	64	129.940	8,316.160	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	108	440.050	47,525.400	
	VISTRA ENERGY CORP	386	26.790	10,340.940	
アメリカ・ドル　小計		199,363		16,726,444.760 (1,815,153,784)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	570	8.674	4,944.180	
	ASHTEAD GROUP	315	21.550	6,788.250	
	SEVERN TRENT PLC	223	22.700	5,062.100	
	BHP GROUP PLC	1,521	16.000	24,336.000	
	BARCLAYS PLC	12,564	1.650	20,730.600	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	787	6.742	5,305.950	
	BT GROUP PLC	5,666	2.062	11,683.290	
	BUNZL PLC	215	19.640	4,222.600	
	EASYJET PLC	32	12.350	395.200	
	AVIVA PLC	2,210	4.122	9,109.620	
	CRODA INTERNATIONAL	127	47.300	6,007.100	
	DIAGEO PLC	1,514	31.165	47,183.810	
	SCHRODERS PLC	92	30.220	2,780.240	
	DCC PLC	61	70.320	4,289.520	
	NATIONAL GRID PLC	2,430	9.000	21,870.000	
	KINGFISHER PLC	1,322	2.154	2,847.580	
	BAE SYSTEMS PLC	2,339	5.398	12,625.920	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,485	26.635	39,552.970	
	HALMA PLC	221	18.540	4,097.340	
	NEXT PLC	64	67.360	4,311.040	
	IMPERIAL BRANDS PLC	699	18.630	13,022.370	
	JOHNSON MATTHEY PLC	113	29.860	3,374.180	
	ANGLO AMERICAN PLC	799	18.998	15,179.400	
	COMPASS GROUP PLC	1,134	19.265	21,846.510	
	HSBC HOLDINGS PLC	13,152	6.016	79,122.430	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,842	2.754	10,580.860	
	CENTRICA PLC	5,102	0.700	3,571.400	
	UNILEVER PLC	746	46.260	34,509.960	
	MEGGITT PLC	668	5.898	3,939.860	
	MORRISON SUPERMARKETS	706	2.036	1,437.410	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	515	8.778	4,520.670	

RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	651	5.292	3,445.090	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	236	22.290	5,260.440	
PEARSON PLC	786	6.746	5,302.350	
PERSIMMON PLC	154	24.000	3,696.000	
PRUDENTIAL PLC	1,649	15.060	24,833.940	
RIO TINTO PLC	812	39.615	32,167.380	
VODAFONE GROUP PLC	18,588	1.604	29,815.150	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	455	60.050	27,322.750	
RELX PLC	1,314	17.395	22,857.030	
RENTOKIL INITIAL PLC	1,473	4.494	6,619.660	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,257	7.116	8,944.810	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,163	2.383	7,537.420	
ST JAMES'S PLACE PLC	363	10.045	3,646.330	
SSE PLC	743	13.085	9,722.150	
BP PLC	13,126	4.850	63,661.100	
SAGE GROUP PLC(THE)	814	6.900	5,616.600	
SMITHS GROUP PLC	175	15.770	2,759.750	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	64	75.000	4,800.000	
STANDARD CHARTERED PLC	1,716	6.514	11,178.020	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	49,967	0.601	30,030.160	
TAYLOR WIMPLEY PLC	1,666	1.655	2,757.230	
TESCO PLC	6,949	2.440	16,955.560	
3I GROUP PLC	608	10.815	6,575.520	
SMITH & NEPHEW PLC	604	18.295	11,050.180	
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,231	16.462	53,188.720	
WEIR GROUP	158	13.640	2,155.120	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	213	71.020	15,127.260	
WPP PLC	894	9.162	8,190.820	
ASTRAZENECA PLC	853	67.720	57,765.160	
WHITBREAD PLC	131	42.230	5,532.130	
CARNIVAL PLC	110	30.600	3,366.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	98	2.006	196.580	
JOHN WOOD GROUP PLC	410	3.479	1,426.390	
INTERTEK GROUP PLC	85	49.340	4,193.900	
BURBERRY GROUP PLC	184	18.760	3,451.840	
INVESTEC PLC	364	4.299	1,564.830	
INTERCONTINENTAL HOTELS	84	45.200	3,796.800	
ITV PLC	3,200	1.374	4,396.800	
SAINSBURY (J) PLC	1,073	2.162	2,319.820	
G4S PLC	2,154	2.025	4,361.850	
ADMIRAL GROUP PLC	112	20.540	2,300.480	

	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	69	45.280	3,124.320	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,801	22.400	62,742.400	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,490	22.265	55,439.850	
	TUI AG-DI	220	10.490	2,307.800	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	315	2.838	893.970	
	EXPERIAN PLC	666	23.710	15,790.860	
	MONDI PLC	346	15.385	5,323.210	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	311	17.390	5,408.290	
	OCADO GROUP PLC	375	13.300	4,987.500	
	INFORMA PLC	667	7.670	5,115.890	
	GLENCORE PLC	6,429	2.275	14,625.970	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,519	2.901	4,406.610	
	COCA-COLA HBC AG	216	24.060	5,196.960	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	529	4.546	2,404.830	
	FERGUSON PLC	183	64.340	11,774.220	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	388	10.876	4,219.880	
	AUTO TRADER GROUP PLC	571	5.300	3,026.300	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	2,954	2.060	6,085.240	
イギリス・ポンド　小計		202,970		1,162,011.580 (162,925,644)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	682	27.140	18,509.480	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,631	24.960	40,709.760	
	ELBIT SYSTEMS LTD	23	580.200	13,344.600	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	577	16.550	9,549.350	
	NICE LTD	26	529.000	13,754.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	85	88.300	7,505.500	
	AZRIELI GROUP	35	277.000	9,695.000	
イスラエル・シュケル　小計		3,059		113,067.690 (3,465,525)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	99	68.980	6,829.020	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,938	27.760	53,798.880	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	2,354	28.840	67,889.360	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	231	9.150	2,113.650	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	746	8.290	6,184.340	
	TELSTRA CORP LTD	2,169	3.580	7,765.020	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	605	11.080	6,703.400	
	ASX LTD	138	82.450	11,378.100	

BHP GROUP LTD	1,832	34.790	63,735.280	
CALTEX AUSTRALIA LTD	181	26.920	4,872.520	
COMPUTERSHARE LT	432	15.850	6,847.200	
CSL LIMITED	309	250.970	77,549.730	
REA GROUP LTD	34	111.840	3,802.560	
TRANSURBAN GROUP	1,966	14.440	28,389.040	
COCHLEAR LTD	40	208.770	8,350.800	
ORIGIN ENERGY LTD	1,276	7.860	10,029.360	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,221	79.640	97,240.440	
BORAL LIMITED	694	4.770	3,310.380	
RIO TINTO LIMITED	270	87.870	23,724.900	
APA GROUP	787	11.360	8,940.320	
ARISTOCRAT LEISU	415	31.700	13,155.500	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,758	8.050	14,151.900	
TPG TELECOM LTD	751	6.660	5,001.660	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	123	43.110	5,302.530	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	307	25.230	7,745.610	
ORICA LTD	272	23.220	6,315.840	
CIMIC GROUP LTD	36	32.520	1,170.720	
LEND LEASE CORP LTD	452	18.000	8,136.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	342	12.310	4,210.020	
SYDNEY AIRPORT	525	8.220	4,315.500	
MACQUARIE GROUP LTD	241	133.820	32,250.620	
SUNCORP GROUP LTD	1,243	13.440	16,705.920	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,806	28.760	51,940.560	
NEWCREST MINING LTD	458	33.130	15,173.540	
OIL SEARCH LTD	865	7.190	6,219.350	
INCITEC PIVOT LTD	1,139	3.360	3,827.040	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	814	12.560	10,223.840	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	769	7.770	5,975.130	
SANTOS LTD	1,405	7.780	10,930.900	
SONIC HEALTHCARE	331	28.630	9,476.530	
WESFARMERS LTD	859	40.290	34,609.110	
ALUMINA LIMITED	1,597	2.260	3,609.220	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	668	31.930	21,329.240	
WOOLWORTHS GROUP LTD	931	37.490	34,903.190	
SEEK LTD	158	21.840	3,450.720	
AUSNET SERVICES	648	1.810	1,172.880	
AGL ENERGY LTD	269	19.130	5,145.970	
BRAMBLES LTD	1,036	11.940	12,369.840	
CROWN RESORTS LTD	251	12.080	3,032.080	
AURIZON HOLDINGS LTD	934	5.790	5,407.860	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	433	18.600	8,053.800	
	MEDIBANK PVT LTD	1,627	3.370	5,482.990	
	SOUTH32 LTD(AUD)	3,598	2.460	8,851.080	
	COLES GROUP LTD	814	15.000	12,210.000	
オーストラリア・ドル　小計		45,197		891,310.990 (66,331,364)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	160	71.130	11,380.800	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	644	39.020	25,128.880	
	BARRICK GOLD CORP	1,215	22.580	27,434.700	
	ATCO LTD	31	47.950	1,486.450	
	BANK OF MONTREAL	406	96.860	39,325.160	
	BANK OF NOVA SCOTIA	797	75.570	60,229.290	
	NATIONAL BANK OF CANADA	213	67.410	14,358.330	
	BCE INC	104	64.110	6,667.440	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	561	70.080	39,314.880	
	BAUSCH HEALTH COS INC	190	29.570	5,618.300	
	SAPUTO INC	227	38.580	8,757.660	
	BLACKBERRY LTD	603	6.670	4,022.010	
	CGI INC	176	101.910	17,936.160	
	CCL INDUSTRIES INC	154	52.470	8,080.380	
	CAE INC	243	32.260	7,839.180	
	CAMECO CORP	406	12.070	4,900.420	
	ROGERS COMM-CL B	250	65.280	16,320.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	281	111.050	31,205.050	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	746	33.190	24,759.740	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	54	144.290	7,791.660	
	CANADIAN UTILITIES LTD	69	38.460	2,653.740	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	463	114.840	53,170.920	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	300	21.860	6,558.000	
	OPEN TEXT CORP	158	51.600	8,152.800	
	EMPIRE CO LTD	111	34.840	3,867.240	
	KINROSS GOLD CORP	923	6.130	5,657.990	
	FORTIS INC	270	54.510	14,717.700	
	TELUS CORP	44	47.610	2,094.840	
	GREAT WEST LIFECO INC	46	31.050	1,428.300	
	IMPERIAL OIL LTD	76	32.460	2,466.960	
	ENBRIDGE INC	1,408	47.360	66,682.880	
	IGM FINANCIAL INC	35	37.170	1,300.950	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	1,417	24.330	34,475.610	
	LOBLAW CO LTD	121	71.220	8,617.620	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	184	70.110	12,900.240	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	421	58.470	24,615.870	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	20	548.570	10,971.400	

	METRO INC	170	55.950	9,511.500	
	HUSKY ENERGY INC	410	9.000	3,690.000	
	EMERA INC	100	56.120	5,612.000	
	METHANEX CORP	50	46.540	2,327.000	
	ONEX CORP	45	78.320	3,524.400	
	POWER CORP OF CANADA	83	30.670	2,545.610	
	POWER FINANCIAL CORP	114	30.750	3,505.500	
	ROYAL BANK OF CANADA	939	106.950	100,426.050	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	111	17.500	1,942.500	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	87	283.840	24,694.080	
	SHAW COMM INC-B	393	26.220	10,304.460	
	SUNCOR ENERGY INC	1,087	39.580	43,023.460	
	ENCANA CORP	501	5.350	2,680.350	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	480	21.620	10,377.600	
	THOMSON REUTERS CORP	136	87.520	11,902.720	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	1,198	74.100	88,771.800	
	TC ENERGY CORP	631	67.560	42,630.360	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	100	54.160	5,416.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	36	108.840	3,918.240	
	INTACT FINANCIAL CORP	102	135.570	13,828.140	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	210	34.690	7,284.900	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	1,288.500	20,616.000	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	121	122.450	14,816.450	
	CI FINANCIAL CORP	68	19.090	1,298.120	
	TOURMALINE OIL CORP	57	11.360	647.520	
	KEYERA CORP	168	30.340	5,097.120	
	ALTAGAS LTD	279	19.510	5,443.290	
	PEMBINA PIPELINE CORP	284	46.970	13,339.480	
	DOLLARAMA INC	255	46.330	11,814.150	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	1,018	11.270	11,472.860	
	VERMILION ENERGY INC	154	19.380	2,984.520	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	153	58.790	8,994.870	
	INTER PIPELINE LTD	188	22.250	4,183.000	
	NUTRIEN LTD	391	64.270	25,129.570	
	IA FINANCIAL CORP INC	57	61.290	3,493.530	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	351	15.320	5,377.320	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	164	90.720	14,878.080	
	SHOPIFY INC	72	412.160	29,675.520	
	CANOPY GROWTH CORP	278	26.570	7,386.460	
	HYDRO ONE LTD	236	24.030	5,671.080	
カナダ・ドル　小計		24,820		1,213,125.160 (100,252,663)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	1,200	3.920	4,704.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	16,200	0.205	3,321.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,300	24.780	32,214.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	900	10.330	9,297.000	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	500	4.920	2,460.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,000	8.220	8,220.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	7,300	0.915	6,679.500	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	1,600	2.410	3,856.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,300	10.740	24,702.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,300	3.150	13,545.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	600	9.040	5,424.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	900	25.820	23,238.000	
	UOL GROUP LIMITED	300	7.530	2,259.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,900	3.590	6,821.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	4,369	0.940	4,106.860	
シンガポール・ドル　小計		44,669		150,847.360 (12,005,941)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	1,604	12.165	19,512.660	
	NESTLE SA-REGISTERED	2,015	103.120	207,786.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	338	72.780	24,599.640	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	462	289.350	133,679.700	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	30	226.000	6,780.000	
	SIKA INHABER	87	160.200	13,937.400	
	SGS SA-REG	3	2,451.000	7,353.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	1,413	85.510	120,825.630	
	BALOISE HOLDING AG -R	32	179.800	5,753.600	
	BARRY CALLEBAUT AG	3	2,082.000	6,246.000	
	SWISSCOM AG-REG	15	506.800	7,602.000	
	ABB LTD	1,174	18.800	22,071.200	
	GEBERIT AG	27	479.500	12,946.500	
	LONZA GROUP AG-REG	49	335.600	16,444.400	
	LINDT & SPRUENGLI PART	1	7,130.000	7,130.000	
	GIVAUDAN-REG	6	2,810.000	16,860.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	104	387.100	40,258.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD	310	48.200	14,942.000	
	TEMENOS GROUP	41	142.850	5,856.850	
	SONOVA HOLDING AG	34	228.000	7,752.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8	146.600	1,172.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	11	852.000	9,372.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	23	261.000	6,003.000	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	49.360	493.600	
	SCHINDLER NAMEN	13	222.000	2,886.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	24	487.900	11,709.600	
	VIFOR PHARMA AG	32	154.400	4,940.800	
	EMS-CHEMIE HOLDING	5	626.000	3,130.000	
	SWISS PRIME SITE AG	74	100.000	7,400.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	80	76.350	6,108.000	
	DUFRY GROUP	6	83.460	500.760	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	16	757.800	12,124.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	153	43.710	6,687.630	
	SWISS RE LTD	196	102.800	20,148.800	
	ALCON INC	311	58.100	18,069.100	
	UBS GROUP AG	2,793	11.185	31,239.700	
スイス・フラン　小計		11,503		840,324.370 (92,561,729)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	436	310.300	135,290.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	264	274.000	72,336.000	
	ERICSSON LM-B SHS	2,216	88.740	196,647.840	
	LUNDBERGS B	37	357.600	13,231.200	
	SKF AB-B SHS	339	176.100	59,697.900	
	SANDVIK AB	798	166.250	132,667.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,116	93.780	104,658.480	
	SKANSKA AB-B SHS	260	205.200	53,352.000	
	SWEDBANK AB	601	141.950	85,311.950	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,015	93.840	95,247.600	
	VOLVO AB-B SHS	1,016	143.450	145,745.200	
	SWEDISH MATCH AB	152	409.600	62,259.200	
	TELE2 AB-B SHS	310	141.000	43,710.000	
	INDUSTRIVARDEN C	117	205.500	24,043.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	188	252.000	47,376.000	
	SECURITAS AB-B SHS	237	152.200	36,071.400	
	INVESTOR AB-B SHS	275	484.200	133,155.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	524	206.650	108,284.600	
	ASSA ABLOY AB-B	699	226.500	158,323.500	
	TELIA CO AB	1,380	42.150	58,167.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	145	305.600	44,312.000	
	BOLIDEN AB	92	245.900	22,622.800	
	ALFA LAVAL AB	160	204.900	32,784.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	94	472.600	44,424.400	
	ICA GRUPPEN AB	38	437.000	16,606.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	470	75.420	35,447.400	
	HEXAGON AB	174	460.500	80,127.000	
	EPIROC AB-A	625	108.750	67,968.750	
	EPIROC AB-B	60	104.350	6,261.000	

	ESSITY AB-B	469	289.100	135,587.900	
	NORDEA BANK ABP	2,204	70.150	154,610.600	
スウェーデン・クローナ　小計		16,511		2,406,328.520 (27,047,133)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	78	985.600	76,876.800	
	A P MOLLER A/S	7	7,972.000	55,804.000	
	DANSKE BANK A/S	515	96.240	49,563.600	
	GENMAB A/S	40	1,409.500	56,380.000	
	NOVOZYMES-B SHS	162	286.900	46,477.800	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,144	350.600	401,086.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	142	527.000	74,834.000	
	COLOPLAST-B	70	791.200	55,384.000	
	DSV PANALPINA A/S	150	641.600	96,240.000	
	DEMANT A/S	78	172.700	13,470.600	
	H LUNDBECK A/S	15	221.800	3,327.000	
	TRYG A/S	44	186.300	8,197.200	
	PANDORA A/S	66	278.400	18,374.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	100	526.400	52,640.000	
	ORSTED A/S	120	622.800	74,736.000	
デンマーク・クローネ　小計		2,731		1,083,391.800 (17,561,781)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	693	9.110	6,313.230	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	378	13.300	5,027.400	
	FLETCHER BUILDING LTD	1,535	4.820	7,398.700	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,218	4.490	5,468.820	
	MERIDIAN ENERGY LTD	824	5.280	4,350.720	
ニュージーランド・ドル　小計		4,648		28,558.870 (1,981,129)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	410	231.200	94,792.000	
	DNB ASA	638	160.600	102,462.800	
	TELENOR ASA	438	180.450	79,037.100	
	ORKLA ASA	375	84.900	31,837.500	
	EQUINOR ASA	641	167.000	107,047.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	141	371.300	52,353.300	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	258	180.600	46,594.800	
	SCHIBSTED ASA	58	249.800	14,488.400	
ノルウェー・クローネ　小計		2,959		528,612.900 (6,264,063)	
ユーロ	CRH PLC	523	31.410	16,427.430	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	64	86.920	5,562.880	
	KERRY GROUP PLC-A	119	104.000	12,376.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	159	47.760	7,593.840	
	UMICORE	211	36.400	7,680.400	
	AIR LIQUIDE	308	117.500	36,190.000	

AIRBUS SE	381	120.400	45,872.400	
AXA	1,288	23.930	30,821.840	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	450	23.080	10,386.000	
ADIDAS AG	126	281.350	35,450.100	
ASSICURAZIONI GENERALI	758	18.195	13,791.810	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.000	0.000	
DANONE	420	71.960	30,223.200	
SAFRAN SA	228	140.850	32,113.800	
INTESA SANPAOLO	9,378	2.234	20,950.450	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	232	67.410	15,639.120	
ACCOR SA	56	37.960	2,125.760	
BNP PARIBAS	731	46.990	34,349.690	
THALES SA	79	89.980	7,108.420	
CAPGEMINI SA	117	109.000	12,753.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	27	44.100	1,190.700	
INGENICO GROUP	42	91.340	3,836.280	
UNICREDIT SPA	1,327	11.500	15,260.500	
NATIXIS	1,271	3.964	5,038.240	
KONINKLIJKE DSM NV	144	108.150	15,573.600	
COMMERZBANK AG	534	5.303	2,831.800	
EIFFAGE	68	95.160	6,470.880	
FRESENIUS SE & CO KGAA	291	43.365	12,619.210	
UNITED INTERNET	85	35.520	3,019.200	
FUCHS PETROLUB SE PREF	21	34.740	729.540	
PUBLICIS GROUPE	98	37.760	3,700.480	
IBERDROLA SA	3,851	9.122	35,128.820	
ENI SPA	1,644	13.780	22,654.320	
IMERYS SA	82	35.800	2,935.600	
JERONIMO MARTINS	223	14.965	3,337.190	
KBC GROUPE	173	61.660	10,667.180	
HANNOVER RUECK SE	62	158.100	9,802.200	
WARTSILA OYJ	111	10.460	1,161.060	
L'OREAL	168	240.700	40,437.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	184	375.050	69,009.200	
GEA GROUP AG	105	26.660	2,799.300	
BOLLORE	503	3.746	1,884.230	
MEDIOBANCA SPA	225	10.620	2,389.500	
MICHELIN(CGDE)-B	111	102.450	11,371.950	
CONTINENTAL AG	95	117.560	11,168.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	714	30.760	21,962.640	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	254	12.090	3,070.860	
NOKIAN RENKAAT OYJ	73	28.470	2,078.310	
OMV AG	89	49.730	4,425.970	
PERNOD-RICARD	138	161.000	22,218.000	
PEUGEOT SA	384	23.660	9,085.440	

PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	92	65.360	6,013.120	
RENAULT SA	94	48.560	4,564.640	
REPSOL SA	1,073	14.500	15,558.500	
REMY COINTREAU	12	120.900	1,450.800	
MERCK KGAA	64	106.000	6,784.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	353	37.685	13,302.800	
RWE AG	422	27.340	11,537.480	
SEB SA	14	136.400	1,909.600	
SOCIETE GENERALE-A	589	26.030	15,331.670	
VINCI S.A.	348	96.540	33,595.920	
SODEXO	22	96.620	2,125.640	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	357	81.780	29,195.460	
VIVENDI SA	707	25.420	17,971.940	
SAP SE	645	115.820	74,703.900	
TELEFONICA S.A	3,043	7.068	21,507.920	
TOTAL SA	1,578	46.335	73,116.630	
VALEO	152	31.400	4,772.800	
E.ON SE	1,662	8.799	14,623.930	
VOEST-ALPINE AG	26	21.820	567.320	
HENKEL AG & CO KGAA	86	84.400	7,258.400	
SIEMENS AG-REG	521	99.770	51,980.170	
UPM-KYMMENE OYJ	404	28.350	11,453.400	
ING GROEP NV-CVA	2,526	10.162	25,669.210	
PUMA AG	80	70.750	5,660.000	
BAYER AG	654	65.240	42,666.960	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58	11.755	681.790	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	100	93.780	9,378.000	
DAIMLER AG	576	48.425	27,892.800	
BASF SE	596	66.310	39,520.760	
BEIERSDORF AG	52	105.750	5,499.000	
HOCHTIEF AG	43	106.000	4,558.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	59	64.680	3,816.120	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	153	61.100	9,348.300	
ORANGE	1,224	14.925	18,268.200	
SAMPO OYJ-A SHS	308	35.700	10,995.600	
RANDSTAD NV	114	46.730	5,327.220	
ALLIANZ SE	281	218.100	61,286.100	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,781	3.520	6,269.120	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	839	22.980	19,280.220	
HERMES INTL	21	632.400	13,280.400	
ENDESA S.A.	218	23.680	5,162.240	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	94	15.510	1,457.940	
ERSTE GROUP BANK AG	264	30.300	7,999.200	

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	95	247.900	23,550.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	525	13.194	6,926.850	
SOCIETE BIC SA	7	62.000	434.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	97	136.100	13,201.700	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	198	35.740	7,076.520	
HEINEKEN NV	193	97.660	18,848.380	
AKZO NOBEL	162	84.000	13,608.000	
ASML HOLDING NV	283	228.000	64,524.000	
AEGON NV	1,284	3.894	4,999.890	
BANKINTER S.A.	407	6.176	2,513.630	
VOLKSWAGEN AG PFD	148	169.340	25,062.320	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	4,765	4.778	22,767.170	
KERING	49	469.650	23,012.850	
CNP ASSURANCES	121	17.890	2,164.690	
FORTUM OYJ	149	21.750	3,240.750	
AGEAS	36	51.720	1,861.920	
UCB SA	106	70.760	7,500.560	
THYSSENKRUPP AG	236	12.995	3,066.820	
CARREFOUR SA	462	15.355	7,094.010	
NATURGY ENERGY GROUP SA	273	24.160	6,595.680	
ATOS SE	97	65.380	6,341.860	
NOKIA OYJ	4,123	4.714	19,435.820	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	599	39.070	23,402.930	
WOLTERS KLUWER-CVA	213	63.500	13,525.500	
SANOFI	738	82.800	61,106.400	
STMICROELECTRONICS NV	561	19.000	10,659.000	
ELISA OYJ	122	48.940	5,970.680	
BANCO SANTANDER SA	10,519	3.870	40,708.530	
METSO OYJ	96	32.500	3,120.000	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	277	18.085	5,009.540	
QIAGEN N.V.	153	25.470	3,896.910	
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,218	7.092	8,638.050	
BMW VORZUG	19	53.700	1,020.300	
ENEL SPA	5,785	6.768	39,152.880	
VOPAK (KON.)	38	48.300	1,835.400	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,273	15.932	36,213.430	
SARTORIUS AG	27	167.900	4,533.300	
LEONARDO SPA	270	10.245	2,766.150	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	913	16.292	14,874.590	
KONINKLIJKE KPN NV	2,756	2.964	8,168.780	
EUROFINS SCIENTIFIC	8	423.600	3,388.800	
TELEPERFORMANCE	35	201.000	7,035.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	145	143.000	20,735.000	
EURAZEO	23	62.000	1,426.000	
BANCO SABADELL	4,349	1.022	4,444.670	

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	69	88.400	6,099.600	
HEINEKEN HOLDING NV-A	98	89.900	8,810.200	
INDITEX	696	28.450	19,801.200	
JC DECAUX SA	24	22.900	549.600	
ANDRITZ AG	7	37.980	265.860	
MAPFRE SA	646	2.548	1,646.000	
ESSILORLUXOTTICA	208	134.800	28,038.400	
SNAM SPA	1,629	4.546	7,405.430	
CREDIT AGRICOLE SA	761	11.545	8,785.740	
ENAGAS	61	20.350	1,241.350	
WENDEL	13	122.100	1,587.300	
WIRECARD AG	85	111.650	9,490.250	
TENARIS SA	506	9.300	4,705.800	
TELECOM ITALIA-RNC	13,336	0.528	7,041.400	
ATLANTIA SPA	337	22.270	7,504.990	
ILIAD SA	36	92.060	3,314.160	
PROXIMUS	200	27.060	5,412.000	
SES FDR	252	17.355	4,373.460	
TERNA SPA	1,272	5.818	7,400.490	
GRIFOLS SA	289	27.280	7,883.920	
FERROVIAL SA	413	26.000	10,738.000	
LANXESS AG	85	59.280	5,038.800	
NESTE OYJ	312	29.060	9,066.720	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	116	21.400	2,482.400	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	74	37.350	2,763.900	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	40	241.900	9,676.000	
KONE OYJ	256	52.700	13,491.200	
ENGIE	1,310	14.950	19,584.500	
ALSTOM	138	37.930	5,234.340	
TELENET GROUP HOLDING NV	12	42.520	510.240	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	243	18.130	4,405.590	
ELECTRICITE DE FRANCE	195	9.272	1,808.040	
IPSEN SA	42	96.200	4,040.400	
DEUTSCHE WOHNEN	227	35.410	8,038.070	
ARKEMA SA	72	90.000	6,480.000	
LEGRAND SA	162	69.060	11,187.720	
UNILEVER NV	947	54.070	51,204.290	
ADP	21	165.300	3,471.300	
ORION OYJ	120	33.960	4,075.200	
RTL GROUP SA	89	42.700	3,800.300	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	420	13.530	5,682.600	
SYMRISE AG	91	87.760	7,986.160	
SCOR SE	71	36.660	2,602.860	

	PRYSMIAN SPA	246	20.200	4,969.200	
	CAIXABANK	1,966	2.564	5,040.820	
	BUREAU VERITAS SA	164	21.640	3,548.960	
	GETLINK	479	14.780	7,079.620	
	SUEZ SA	272	13.545	3,684.240	
	AMADEUS IT GROUP SA	280	65.500	18,340.000	
	BRENNTAG AG	28	44.190	1,237.320	
	EVONIK INDUSTRIES AG	149	23.670	3,526.830	
	EDENRED	196	44.340	8,690.640	
	BANKIA SA	2,068	1.808	3,738.940	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,645	2.736	4,500.720	
	KION GROUP AG	28	49.760	1,393.280	
	VONOVIA SE	369	48.000	17,712.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	659	4.338	2,858.740	
	FERRARI NV	88	140.050	12,324.400	
	METRO AG	96	14.415	1,383.840	
	CNH INDUSTRIAL NV	625	9.662	6,038.750	
	AXEL SPRINGER SE	21	62.500	1,312.500	
	WORLDLINE SA	38	58.300	2,215.400	
	NN GROUP NV	294	33.540	9,860.760	
	ZALANDO SE	112	41.530	4,651.360	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	767	11.856	9,093.550	
	AENA SME SA	37	167.950	6,214.150	
	ABN AMRO BANK NV	329	16.560	5,448.240	
	EXOR NV	103	61.600	6,344.800	
	COVESTRO AG	103	45.740	4,711.220	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	535	83.540	44,693.900	
	POSTE ITALIANE SPA	458	10.765	4,930.370	
	ADYEN NV	11	620.200	6,822.200	
ユーロ　小計		150,762		2,631,169.650 (318,687,268)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	100	103.700	10,370.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,864	17.280	32,209.920	
	BANK OF EAST ASIA	867	18.460	16,004.820	
	CLP HOLDINGS LTD	1,235	79.950	98,738.250	
	PCCW LTD	884	4.530	4,004.520	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	55.800	27,900.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	766	238.200	182,461.200	
	MTR CORP	903	43.950	39,686.850	
	HANG SENG BANK LTD	400	163.300	65,320.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,086	38.000	41,268.000	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	567	54.450	30,873.150	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	2,000	17.600	35,200.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	7,094	15.220	107,970.680	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	1,000	29.800	29,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,537	50.600	77,772.200	
	KERRY PROPERTIES LTD	452	24.400	11,028.800	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,184	26.800	58,531.200	
	NWS HOLDINGS LTD	500	12.080	6,040.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	1,338	21.400	28,633.200	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	3,562	11.040	39,324.480	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	1,813	7.440	13,488.720	
	SINO LAND CO	2,576	12.020	30,963.520	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,000	115.100	115,100.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	500	73.100	36,550.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	773	58.200	44,988.600	
	SJM HOLDINGS LTD	1,000	7.950	7,950.000	
	WYNN MACAU LTD	699	15.800	11,044.200	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	2,155	12.000	25,860.000	
	AIA GROUP LTD	7,751	75.350	584,037.850	
	HKT TRUST / HKT LTD	2,080	12.240	25,459.200	
	SANDS CHINA LTD	1,374	36.650	50,357.100	
	SWIRE PROPERTIES LTD	432	23.400	10,108.800	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,000	44.500	44,500.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	800	30.150	24,120.000	
	WH GROUP LTD	7,000	7.580	53,060.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,534	72.800	111,675.200	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	1,534	53.400	81,915.600	
香港・ドル　小計		62,860		2,214,316.060 (30,646,134)	
合計		772,052		2,654,884,158 (2,654,884,158)	

（２）株式以外の有価証券

令和1年10月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	583.000	6,762.800	
		GOODMAN GROUP	1,025.000	14,616.500	
		GPT GROUP	956.000	5,946.320	
		MIRVAC GROUP	3,813.000	11,858.430	
		SCENTRE GROUP	4,823.000	18,568.550	
		VICINITY CENTRES	1,672.000	4,280.320	
	オーストラリア・ドル　小計		12,872.000	62,032.920	

				(4,616,490)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	869.000	1,798.830	
		CAPITALAND MALL TRUST	1,500.000	3,960.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	500.000	940.000	
	シンガポール・ドル　小計		2,869.000	6,698.830 (533,160)	
投資信託受益証券　合計			15,741	5,149,650 (5,149,650)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	144.000	2,365.200	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64.000	9,984.640	
		AMERICAN TOWER CORP	300.000	68,727.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	1,115.000	9,789.700	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	92.000	20,255.640	
		BOSTON PROPERTIES INC	97.000	12,450.920	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	66.000	7,572.180	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	281.000	40,480.860	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	154.000	20,478.920	
		DUKE REALTY TRUST	219.000	7,439.430	
		EQUINIX INC	57.000	32,855.370	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	152.000	10,492.560	
		EQUITY RESIDENTIAL	249.000	22,004.130	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	46.000	15,239.800	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	87.000	9,938.880	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	46.000	6,349.840	
		HCP INC	309.000	11,553.510	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	641.000	10,538.040	
		INVITATION HOMES INC	271.000	8,368.480	
		IRON MOUNTAIN INC	234.000	7,839.000	
		KIMCO REALTY	295.000	6,171.400	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	95.000	4,822.200	
		MID AMERICA	54.000	7,298.100	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	88.000	5,043.280	
		PROLOGIS INC	425.000	38,084.250	
		PUBLIC STORAGE	101.000	24,396.550	
		REALTY INCOME CORP	240.000	19,072.800	
		REGENCY CENTERS CORP	105.000	7,226.100	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	75.000	18,307.500	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	201.000	30,133.920	
		SL GREEN	17.000	1,367.480	

		SUN COMMUNITIES INC	62.000	9,658.980	
		THE MACERICH COMPANY	53.000	1,452.200	
		UDR INC	161.000	8,017.800	
		VENTAS INC	234.000	17,049.240	
		VEREIT INC	549.000	5,407.650	
		VORNADO REALTY TRUST	162.000	10,112.040	
		WELLTOWER INC	293.000	26,982.370	
		WEYERHAEUSER CO	490.000	13,857.200	
		WP CAREY INC	102.000	9,531.900	
	アメリカ・ドル　小計		8,426.000	598,717.060 (64,972,775)	
	イギリス・ポンド	SEGRO PLC	1,000.000	8,350.000	
	イギリス・ポンド　小計		1,000.000	8,350.000 (1,170,754)	
	カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	300.000	6,813.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	297.000	7,894.260	
		SMARTCENTRES REIT	100.000	3,228.000	
	カナダ・ドル　小計		697.000	17,935.260 (1,482,170)	
	ユーロ	COVIVIO	34.000	3,464.600	
		GECINA SA	37.000	5,587.000	
		ICADE	19.000	1,601.700	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	89.000	12,250.850	
	ユーロ　小計		179.000	22,904.150 (2,774,151)	
	香港・ドル	LINK REIT	1,607.000	133,943.450	
	香港・ドル　小計		1,607.000	133,943.450 (1,853,777)	
投資証券　合計			11,909	72,253,627 (72,253,627)	
合計				77,403,277 (77,403,277)	

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

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

２．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率（%）	組入投資信託受益証券時価比率（%）	組入投資証券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式	583銘柄	60.49	－	－	68.81
	投資証券	40銘柄	－	－	2.17	
イギリス・ポンド	株式	90銘柄	5.43	－	－	6.01
	投資証券	1銘柄	－	－	0.04	
イスラエル・シュケル	株式	7銘柄	0.12	－	－	0.13
オーストラリア・ドル	株式	54銘柄	2.21	－	－	2.60
	投資信託受益証券	6銘柄	－	0.15	－	
カナダ・ドル	株式	77銘柄	3.34	－	－	3.72
	投資証券	3銘柄	－	－	0.05	
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	0.40	－	－	0.46
	投資信託受益証券	3銘柄	－	0.02	－	
スイス・フラン	株式	36銘柄	3.08	－	－	3.39
スウェーデン・クローナ	株式	31銘柄	0.90	－	－	0.99
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	0.59	－	－	0.64
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.07	－	－	0.07
ノルウェー・クローネ	株式	8銘柄	0.21	－	－	0.23
ユーロ	株式	212銘柄	10.62	－	－	11.77
	投資証券	4銘柄	－	－	0.09	
香港・ドル	株式	37銘柄	1.02	－	－	1.19
	投資証券	1銘柄	－	－	0.06	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

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

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

海外国債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和1年10月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	35,037,172
コール・ローン	140,182,052
国債証券	18,177,098,246
未収利息	133,405,204
前払費用	14,287,809
流動資産合計	18,500,010,483
資産合計	18,500,010,483
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,000,000
流動負債合計	14,000,000
負債合計	14,000,000
純資産の部	
元本等	
元本	7,820,719,594
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,665,290,889
元本等合計	18,486,010,483
純資産合計	18,486,010,483
負債純資産合計	18,500,010,483

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21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（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
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、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
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 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年10月21日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,310,626,345円
同期中追加設定元本額	1,161,582円
同期中一部解約元本額	491,068,333円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	5,692,868,680円
海外国債ファンド（３ヵ月決算型）	990,679,446円
新光７資産バランスファンド	294,983,390円
海外国債ファンド（１年決算型）	21,764,777円
海外国債ファンド（変額年金）	807,156,726円
グローバル・ナビ	13,266,575円
計	7,820,719,594円
２．　受益権の総数	7,820,719,594口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、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管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	令和1年10月21日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,128,220,829
合計	1,128,220,829

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年11月5日から令和1年10月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和1年10月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3637円 (23,637円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年10月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.625 08/15/29	7,000,000.000	6,922,343.750	
		US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	7,162,968.750	
		US T N/B 2.25 02/15/27	7,000,000.000	7,284,375.000	
		US T N/B 2.25 08/15/27	6,000,000.000	6,250,781.220	
		US T N/B 2.25 11/15/27	6,000,000.000	6,253,125.000	
		US T N/B 2.375 05/15/27	6,000,000.000	6,302,812.500	
		US T N/B 2.375 05/15/29	7,000,000.000	7,387,734.340	
		US T N/B 2.625 02/15/29	6,000,000.000	6,457,031.210	
		US T N/B 2.75 02/15/28	5,900,000.000	6,380,296.870	
		US T N/B 2.875 05/15/28	6,000,000.000	6,555,000.000	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,000,000.000	3,409,218.750	
		US T N/B 2.875 08/15/28	6,900,000.000	7,549,031.250	
		US T N/B 3.125 11/15/28	6,000,000.000	6,700,312.500	
	アメリカ・ドル　小計		79,800,000.000 (8,659,896,000)	84,615,031.140 (9,182,423,178)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,300,000.000	1,369,602.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,500,000.000	1,631,100.300	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,200,000.000	1,554,828.000	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,900,000.000	2,810,613.000	
	イギリス・ポンド　小計		5,900,000.000 (827,239,000)	7,366,143.300 (1,032,806,952)	
	カナダ・ドル	CANADA 1.0 06/01/27	1,500,000.000	1,441,515.000	
		CANADA 2.0 06/01/28	2,000,000.000	2,072,660.000	
		CANADA 2.25 06/01/29	2,000,000.000	2,125,100.000	
	カナダ・ドル　小計		5,500,000.000 (454,520,000)	5,639,275.000 (466,029,686)	
	ユーロ	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,500,000.000	1,589,820.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,700,000.000	1,809,527.600	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,000,000.000	2,127,000.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,500,000.000	1,626,345.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,500,000.000	2,705,250.000	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	500,000.000	519,543.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	900,000.000	1,317,222.000	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,000,000.000	1,513,730.000	

		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,000,000.000	1,552,330.000	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,300,000.000	2,395,854.800	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,000,000.000	3,180,646.500	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,000,000.000	3,251,562.000	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,500,000.000	3,795,113.000	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,500,000.000	1,648,725.000	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,000,000.000	1,348,762.000	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,986,000.000	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	4,631,046.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,500,000.000	1,568,959.500	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,000,000.000	2,203,856.000	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,000,000.000	2,202,272.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,000,000.000	2,224,000.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,000,000.000	2,345,231.200	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	3,000,000.000	3,583,088.100	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.000	2,679,068.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,000,000.000	2,899,200.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,500,000.000	2,183,550.000	
	ユーロ　小計		51,900,000.000 (6,286,128,000)	61,887,701.700 (7,495,838,430)	
国債証券　合計			16,227,783,000 (16,227,783,000)	18,177,098,246 (18,177,098,246)	
合計				18,177,098,246 (18,177,098,246)	

（注）
１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
２．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
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 (%)
アメリカ・ドル	国債証券　13銘柄	49.67	50.52
イギリス・ポンド	国債証券　4銘柄	5.59	5.68
カナダ・ドル	国債証券　3銘柄	2.52	2.56
ユーロ	国債証券　26銘柄	40.55	41.24

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

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。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

	令和1年10月21日現在
資産の部	
流動資産	
預金	6,387,359
コール・ローン	769,639
投資証券	734,503,560
未収配当金	312,190
流動資産合計	741,972,748
資産合計	741,972,748
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	－
負債合計	－
純資産の部	
元本等	
元本	378,234,559
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	363,738,189
元本等合計	741,972,748
純資産合計	741,972,748
負債純資産合計	741,972,748

注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年10月21日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	385,865,897円
同期中追加設定元本額	165,509円
同期中一部解約元本額	7,796,847円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	372,845,225円
グローバル・ナビ	5,389,334円
計	378,234,559円
２．　受益権の総数	378,234,559口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、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管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月21日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	令和1年10月21日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	125,034,939
合計	125,034,939

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年10月23日から令和1年10月21日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和1年10月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9617円 (19,617円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年10月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	445.000	12,780.400	
		AGREE REALTY CORP	225.000	17,088.750	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	375.000	9,341.250	
		ALEXANDER'S INC.	13.000	4,604.470	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	614.000	95,790.140	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	260.000	12,272.000	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	763.000	37,516.710	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	596.000	8,487.040	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	1,414.000	36,523.620	
		AMERICAN TOWER CORP	2,420.000	554,397.800	
		AMERICOLD REALTY TRUST	1,054.000	40,178.480	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	812.000	44,237.760	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,172.000	19,080.160	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	300.000	5,481.000	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	547.000	1,591.770	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	766.000	168,650.220	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	143.000	1,748.890	
		BOSTON PROPERTIES INC	851.000	109,234.360	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	200.000	1,828.000	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	958.000	13,977.220	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,631.000	33,826.940	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	406.000	7,722.120	
		BRT APARTMENTS CORP	57.000	922.830	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	513.000	58,856.490	
		CARETRUST REIT INC	500.000	12,017.500	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	300.000	3,498.000	
		CBL & ASSOCIATES	1,013.000	1,519.500	
		CEDAR REALTY TRUST INC	469.000	1,613.360	

CHATHAM LODGING TRUST	251.000	4,354.850	
CITY OFFICE REIT INC	210.000	2,837.100	
CLIPPER REALTY INC	111.000	1,058.940	
COLONY CAPITAL INC	2,679.000	15,082.770	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	653.000	13,092.650	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	1,062.000	8,118.990	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	100.000	4,654.000	
CORECIVIC INC	665.000	10,194.450	
CORENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	71.000	3,318.540	
COREPOINT LODGING INC	263.000	2,548.470	
CORESITE REALTY CORP	202.000	24,488.460	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	621.000	18,449.910	
COUSINS PROPERTIES INC	800.000	29,920.000	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2,284.000	329,033.040	
CUBESMART	1,057.000	36,350.230	
CYRUSONE INC	616.000	46,816.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,123.000	11,106.470	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,143.000	151,996.140	
DOUGLAS EMMETT INC	900.000	38,304.000	
DUKE REALTY TRUST	1,977.000	67,158.690	
EAST GROUP	199.000	25,464.040	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	431.000	9,434.590	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	844.000	11,967.920	
EPR PROPERTIES	423.000	33,116.670	
EQUINIX INC	462.000	266,301.420	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	954.000	65,854.620	
EQUITY RESIDENTIAL	2,013.000	177,888.810	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	416.000	10,296.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	360.000	119,268.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	680.000	77,683.200	
FARMLAND PARTNERS INC	229.000	1,534.300	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	410.000	56,596.400	
FIRST INDUSTRIAL RT	694.000	27,940.440	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	375.000	10,575.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	623.000	5,388.950	

FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	266.000	3,197.320	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,113.000	43,151.010	
GEO GROUP INC	664.000	10,272.080	
GETTY REALTY CORP	183.000	6,004.230	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	171.000	3,997.120	
GLADSTONE LAND CORP	101.000	1,200.890	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	172.000	2,038.200	
GLOBAL NET LEASE INC	436.000	8,445.320	
HCP INC	2,707.000	101,214.730	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	702.000	23,889.060	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,120.000	33,947.200	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	213.000	2,877.630	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	561.000	24,712.050	
HOST HOTELS & RESORTS INC	3,982.000	65,464.080	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	835.000	28,030.950	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	500.000	7,515.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	355.000	7,598.770	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	64.000	4,992.640	
INVITATION HOMES INC	2,381.000	73,525.280	
IRON MOUNTAIN INC	1,568.000	52,528.000	
JBG SMITH PROPERTIES	685.000	26,906.800	
KILROY REALTY CORP	544.000	42,568.000	
KIMCO REALTY	2,219.000	46,421.480	
KITE REALTY GROUP TRUST	453.000	7,542.450	
LAMAR ADVERTISING CO	473.000	39,145.480	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,269.000	13,514.850	
LIBERTY PROPERTY TRUST	857.000	43,501.320	
LIFE STORAGE INC	255.000	27,384.450	
LTC PROPERTIES INC	220.000	11,514.800	
MACK CALI	474.000	10,281.060	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,435.000	48,943.500	
MID AMERICA	625.000	84,468.750	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	500.000	7,300.000	
NATIONAL HEALTH INVS INC	232.000	19,555.280	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	891.000	51,063.210	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	325.000	11,245.000	

NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	446.000	3,108.620	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	101.000	5,066.160	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	261.000	8,088.390	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	1,175.000	52,828.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	100.000	2,781.000	
OUTFRONT MEDIA INC	789.000	21,421.350	
PARAMOUNT GROUP INC	1,129.000	14,473.780	
PARK HOTELS & RESORTS INC	1,509.000	34,329.750	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	712.000	18,768.320	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	380.000	2,135.600	
PHYSICIANS REALTY TRUST	1,034.000	18,560.300	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	699.000	14,560.170	
POTLATCH CORP	369.000	15,579.180	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	259.000	3,783.990	
PROLOGIS INC	3,457.000	309,781.770	
PS BUSINESS PARKS	110.000	20,241.100	
PUBLIC STORAGE	815.000	196,863.250	
QTS REALTY TRUST INC	288.000	15,255.360	
RAYONIER INC	712.000	20,484.240	
REALTY INCOME CORP	1,752.000	139,231.440	
REGENCY CENTERS CORP	914.000	62,901.480	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	616.000	11,389.840	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,194.000	15,629.460	
RETAIL VALUE INC	92.000	3,305.560	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	599.000	27,817.560	
RLJ LODGING TRUST	960.000	15,926.400	
RPT REALTY	425.000	5,916.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	253.000	20,953.460	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,034.000	24,433.420	
SAFEHOLD INC	37.000	1,257.260	
SAUL CENTERS INC	65.000	3,556.800	
SBA COMMUNICATIONS CORP	617.000	150,609.700	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	1,295.000	12,153.570	
SERVICE PROPERTIES TRUST	896.000	22,749.440	

		SIMON PROPERTY GROUP INC	1,692.000	253,664.640	
		SITE CENTERS CORP	783.000	11,815.470	
		SL GREEN	452.000	36,358.880	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	487.000	23,697.420	
		STAG INDUSTRIAL INC	706.000	21,617.720	
		STORE CAPITAL CORP	1,162.000	44,039.800	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	566.000	6,644.840	
		SUN COMMUNITIES INC	487.000	75,869.730	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,228.000	16,614.840	
		TANGER FACTORY OUTLET	502.000	8,197.660	
		TAUBMAN CENTERS INC	321.000	11,825.640	
		TERRENO REALTY CORP	353.000	18,860.790	
		THE MACERICH COMPANY	792.000	21,700.800	
		UDR INC	1,596.000	79,480.800	
		UMH PROPERTIES INC	200.000	2,952.000	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	70.000	7,565.600	
		URBAN EDGE PROPERTIES	619.000	12,658.550	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES	177.000	4,233.840	
		VENTAS INC	2,050.000	149,363.000	
		VEREIT INC	5,812.000	57,248.200	
		VICI PROPERTIES INC	2,540.000	58,775.600	
		VORNADO REALTY TRUST	950.000	59,299.000	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,151.000	4,684.570	
		WASHINGTON REIT	439.000	12,665.150	
		WEINGARTEN REALTY INVST	665.000	19,517.750	
		WELLTOWER INC	2,230.000	205,360.700	
		WEYERHAEUSER CO	4,098.000	115,891.440	
		WHITESTONE REIT	228.000	3,139.560	
		WINTHROP REALTY TRUST-ESCROW	300.000	84.000	
		WP CAREY INC	930.000	86,908.500	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	620.000	12,753.400	
	アメリカ・ドル　小計		134,569.000	6,768,370.440 (734,503,560)	
投資証券　合計			134,569	734,503,560 (734,503,560)	
合計				734,503,560 (734,503,560)	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

２．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

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 （%）
アメリカ・ドル	投資証券　164銘柄	98.99	100.00

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

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。

（参考）

「フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド」は、ケイマン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの2019年5月31日現在の財務書類は、国際財務報告基準に従い作成されており、独立監査人の監査を受けております。

同ファンドの「財政状態計算書」及び「投資ポートフォリオ」は、2019年5月31日現在の財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋したものでありますが、あくまで参考和訳であり、正確性を保証するものではありません。

財政状態計算書
2019年５月31日現在

	2019年 （日本円）	2018年 （日本円）
資産		
流動資産		
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	28,798,229,550	29,518,931,969
現金および現金同等物	1,612,634,555	2,293,049,447
その他の債権	585,504	2,828,809
資産合計	30,411,449,609	31,814,810,225
負債		
流動負債		
ブローカーに対する債務	320,660,640	430,952,768
未払費用	37,865,210	36,512,893
負債合計	358,525,850	467,465,661
受益証券保有者に帰属する純資産	30,052,923,759	31,347,344,564

投資ポートフォリオ（無監査）
2019年５月31日終了会計年度

	公正価値 2019年 （日本円）	公正価値 2018年 （日本円）
債券		
アンゴラ		
Angolan Government International Bond 9.50% due 12/11/2025 REGS	1,065,202,163	1,101,270,519
アンゴラ合計	1,065,202,163	1,101,270,519
アルゼンチン		
Argentina Treasury Bill 0% due 28/06/2019 TBLM	307,882,633	—
Argentina Treasury Bill 0% due 30/04/2020	32,785,893	—
Bonos De La Nacion Argentina En Moneda Dua 4.50% due 13/02/2020	264,109,932	—
Provincia Del Chubut Argentina 7.75% due 26/07/2026 REGS	548,624,657	371,043,510
Provincia De Tierra Del Fuego Argentina 8.95% due 17/04/2027 REGS	487,837,514	558,060,753
Republic of Argentina 5.875% due 11/01/2028	287,071,653	362,411,306
アルゼンチン合計	1,928,312,282	1,291,515,569
アルメニア		
Republic of Armenia International Bond 7.15% due 26/03/2025 REGS	827,802,600	785,937,974
アルメニア合計	827,802,600	785,937,974
アゼルバイジャン		
International Bank of Azerbaijan Ojsc 5.625% due 11/06/2019 REGS	519,343,303	535,248,042
Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026 REGS	400,528,873	383,427,376
アゼルバイジャン合計	919,872,176	918,675,418
ベラルーシ		
Development Bank of the Republic of Belarus JSC 12.00% due 15/05/2022 REGS	322,243,961	—
Republic of Belarus International Bond 6.20% due 28/02/2030 REGS	331,102,508	118,592,053
ベラルーシ合計	653,346,469	118,592,053
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina due 20/12/2021 REGS	350,021,453	634,645,076
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	350,021,453	634,645,076
ブラジル		
Brazil Republic of 2.625% due 05/01/2023	149,837,903	436,523,834
Caixa Economica Federal 4.25% due 13/05/2019 REGS	—	420,522,193
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 8.20% due 06/04/2028 REGS	409,907,720	169,438,098
ブラジル合計	559,745,623	1,026,484,125
カメルーン		
Republic of Cameroon International Bond 9.50% due 19/11/2025 REGS	541,505,227	573,665,713
カメルーン合計	541,505,227	573,665,713

	公正価値 2019年 （日本円）	公正価値 2018年 （日本円）
債券（続き）		
中国		

CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.875% due 14/03/2025 REGS	613,168,580	584,116,899
中国合計	613,168,580	584,116,899
コロンビア		
Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS	494,730,326	581,061,038
Ecopetrol SA 4.125% due 16/01/2025	315,553,418	303,221,382
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	368,005,979	400,986,440
Republic of Colombia 4.375% due 12/07/2021	294,754,675	292,794,837
コロンビア合計	1,473,044,398	1,578,063,697
ドミニカ共和国		
Dominican Republic 8.90% due 15/02/2023 REGS	318,587,731	302,965,804
Dominican Republic International Bond 9.75% due 05/06/2026 REGS	302,750,138	—
Mestenio Ltd 8.50% due 02/01/2020 REGS	35,695,093	91,087,662
ドミニカ共和国合計	657,032,962	394,053,466
エジプト		
Egypt Government Bond 16.40% due 05/09/2020	60,063,858	55,955,249
Egypt Government Bond 18.15% due 13/06/2020	188,383,591	177,436,457
Egypt Treasury Bills 0% due 03/09/2019 TBLM	392,493,699	—
エジプト合計	640,941,148	233,391,706
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035 REGS	255,474,237	482,184,563
エルサルバドル合計	255,474,237	482,184,563
エチオピア		
Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	627,971,988	536,752,709
エチオピア合計	627,971,988	536,752,709
ガボン		
Republic of Gabon 6.95% due 16/06/2025 REGS	92,049,636	476,208,190
ガボン合計	92,049,636	476,208,190
ジョージア		
Georgian Oil & Gas Corp 6.75% due 26/04/2021 REGS	306,311,752	299,914,572
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022 REGS	144,339,258	140,404,816
ジョージア合計	450,651,010	440,319,388
ガーナ		
Ghana Government International Bond 8.125% due 18/01/2026 REGS	229,924,005	236,748,990
Ghana Govt 18.25% due 25/07/2022	527,088,575	719,041,623
Ghana Govt 24.75% due 19/07/2021	76,690,000	118,378,187
Saderea DAC 12.50% due 30/11/2026 REGS	89,813,011	100,738,921
ガーナ合計	923,515,591	1,174,907,721
	公正価値 **2019年** **（日本円）**	**公正価値** **2018年** **（日本円）**
債券（続き）		
インドネシア		
Government of Indonesia 3.375% due 15/04/2023 REGS	437,259,848	691,171,970
インドネシア合計	437,259,848	691,171,970

イラク		
Oilflow SPV 1 DAC (Krg) 12.00% due 13/01/2022 REGS	197,444,218	196,824,873
Republic of Iraq 5.80% due 15/01/2028 REGS	245,435,984	311,279,273
イラク合計	442,880,202	508,104,146
ジャマイカ		
Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045	253,645,523	402,317,233
ジャマイカ合計	253,645,523	402,317,233
ヨルダン		
Jordan Kingdom 6.125% due 29/01/2026 REGS	445,982,637	438,051,760
ヨルダン合計	445,982,637	438,051,760
カザフスタン		
Astana Finance JSC 0% due 22/12/2024 REGS	3,281,544	856,543
Development Bank of Kazakhstan JSC 9.50% due 14/12/2020 REGS	156,682,645	183,162,974
Kazakhstan Government International Bond 4.875% due 14/10/2044 REGS	492,598,640	454,509,535
Kazakhstan Temir Zholy Finance Bv 6.95% due 10/07/2042 REGS	239,464,727	216,984,171
Kazakhstan Temir Zholy National Co JSC 4.85% due 17/11/2027 REGS	237,796,807	224,127,049
カザフスタン合計	1,129,824,363	1,079,640,272
ケニア		
Kenya Government International Bond 6.875% due 24/06/2024 REGS	—	261,403,467
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	340,917,904	313,963,370
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 12/05/2025	305,284,470	302,899,692
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 10/01/2033	89,591,450	17,354,804
ケニア合計	735,793,824	895,621,333
メキシコ		
Mexican Fixed Rate Bonds 5.00% due 11/12/2019	1,002,636,308	914,250,451
Mexican Udibonos 4.50% due 04/12/2025 Index Linked To Mxudi	93,667,646	88,927,571
Mexico City Airport Trust 4.25% due 31/10/2026 REGS	107,140,416	202,656,597
Mexico City Airport Trust 5.50% due 31/07/2047 REGS	199,025,486	112,095,738
メキシコ合計	1,402,469,856	1,317,930,357

	公正価値 2019年 （日本円）	公正価値 2018年 （日本円）
債券（続き）		
モザンビーク		
Mozambique International Bond 10.50% due 18/01/2023 REGS	377,219,062	339,121,321
モザンビーク合計	377,219,062	339,121,321
ペルー		
Iirsa Norte Finance Ltd 8.75% due 30/05/2024 REGS	271,275,755	188,240,445
Lima Metro Line 2 Finance Ltd 5.875% due 05/07/2034 REGS	584,018,145	553,959,361
Peruvian Government International Bond 6.35% due 12/08/2028 REGS	416,522,832	414,818,481
ペルー合計	1,271,816,732	1,157,018,287
ロシア		
Russia Govt Bond - Ofz 7.00% due 16/08/2023	—	297,832,008
Rzd Capital PLC (Russian Railways) 5.70% due 05/04/2022 REGS	423,782,582	423,568,556
ロシア合計	423,782,582	721,400,564

南アフリカ		
Government of South Africa 4.30% due 12/10/2028	596,453,306	581,270,029
Government of South Africa 7.00% due 28/02/2031	1,263,677,457	1,286,763,778
南アフリカ合計	1,860,130,763	1,868,033,807
スリランカ		
National Savings Bank 8.875% due 18/09/2018 REGS	－	245,883,634
スリランカ合計	－	245,883,634
国際機関		
Banque Ouest Africaine De Developpement 5.00% due 27/07/2027 REGS	336,141,815	321,874,094
European Bank for Reconstruction & Development 6.85% due 21/06/2021	328,527,087	－
European Bank for Reconstruction & Development 8.30% due 02/10/2020	171,977,887	－
European Bank for Reconstruction & Development 28.50% due 10/07/2019	722,317,180	－
European Bank For Reconstruction & Development Frn due 21/02/2019	－	132,440,333
International Bank for Reconstruction and Development 9.00% due 26/02/21 REGS	315,227,056	－
International Finance Corp 10.25% due 05/12/2018	－	82,486,770
国際機関合計	1,874,191,025	536,801,197
スリナム		
Government of Suriname 9.25% due 26/10/2026 REGS	287,684,786	219,450,148
Republic of Suriname 9.00% due 28/06/2019	－	162,840,460
スリナム合計	287,684,786	382,290,608

	公正価値 2019年 （日本円）	公正価値 2018年 （日本円）
債券（続き）		
トリニダード・トバゴ		
Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 REGS	757,689,459	790,432,803
トリニダード・トバゴ合計	757,689,459	790,432,803
チュニジア		
Banque Cent de Tunisie International Bond 5.75% due 30/01/2025 REGS	699,545,726	723,654,978
チュニジア合計	699,545,726	723,654,978
トルコ		
Export Credit Bank of Turkey 6.125% due 03/05/2024 REGS	303,554,731	323,744,915
Government of Turkey 4.875% due 16/04/2043	562,335,419	583,625,571
Turkey Government Bond 8.70% due 11/07/2018	－	782,542,486
トルコ合計	865,890,150	1,689,912,972
ウガンダ		
Republic of Uganda Government Bonds 13.75% due 13/06/2019	215,169,308	221,263,595
Republic of Uganda Government Bonds 14.625% due 01/11/2018	－	5,685,024
ウガンダ合計	215,169,308	226,948,619
ウクライナ		

City of Kyiv (CSFB) 8.00% due 06/11/2015	―	502,009,597
KYIV Finance PLC (CITY OF KIEV) 7.50% due 15/12/2022 REGS	606,868,138	―
Ukraine Government 7.375% due 25/09/2032 REGS	514,370,192	608,797,135
ウクライナ合計	1,121,238,330	1,110,806,732
ウルグアイ		
Uruguay Republic of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked	899,655,404	989,454,764
ウルグアイ合計	899,655,404	989,454,764
債券合計	28,081,527,123	28,465,382,143
原油ワラント		
ナイジェリア		
Nigeria Central Bank of WRD Exp 15/11/2020 REGS	600,373,862	936,765,666
ナイジェリア合計	600,373,862	936,765,666
ベネズエラ		
Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020	116,328,565	116,784,160
ベネズエラ合計	116,328,565	116,784,160
原油ワラント合計	716,702,427	1,053,549,826
投資ポートフォリオ	28,798,229,550	29,518,931,969

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

※はアセットマネジメントOneにて追記

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	5,008,542,908円
Ⅱ　負債総額	1,430,991円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,007,111,917円
Ⅳ　発行済数量	5,256,846,760口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9525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10月31日現在

Ⅰ　資産総額	3,651,264,447円
Ⅱ　負債総額	130,677,030円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,520,587,417円
Ⅳ　発行済数量	1,568,101,732口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2451円

新光日本債券インデックスマザーファンド

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	9,626,923,617円
Ⅱ　負債総額	80,997,300円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,545,926,317円
Ⅳ　発行済数量	7,322,750,979口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3036円

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	2,643,741,023円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,643,741,023円
Ⅳ　発行済数量	1,158,114,446口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2828円

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	3,015,283,836円
Ⅱ　負債総額	51,202,666円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,964,081,170円
Ⅳ　発行済数量	1,169,777,874口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5339円

海外国債マザーファンド

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	18,446,209,681円
Ⅱ　負債総額	26,000,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	18,420,209,681円
Ⅳ　発行済数量	7,791,463,987口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3642円

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	748,922,227円
Ⅱ　負債総額	4,789,538円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	744,132,689円
Ⅳ　発行済数量	378,234,559口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9674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。

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（1）資本金の額（2019年10月31日現在）

資本金の額　　20億円

発行する株式総数※　　100,000株
（普通株式 上限100,000株、Ａ種種類株式 上限30,000株）

発行済株式総数　　40,000株
（普通株式24,490株、Ａ種種類株式15,510株）

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

（2）会社の機構（2019年10月31日現在）

①　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。

②　投資運用の意思決定機構

1.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。

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,198,457,447,167
追加型株式投資信託	865	13,922,418,811,581
単位型公社債投資信託	39	108,717,437,174
単位型株式投資信託	171	1,273,596,816,603
合計	1,101	16,503,190,512,525

３【委託会社等の経理状況】

１．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

３．委託会社は、第34期事業年度（自2018年4月1日至2019年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第35期中間会計期間（自2019年4月1日至2019年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第33期 （2018年3月31日現在）		第34期 （2019年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		49,071,217		41,087,475
金銭の信託		12,083,824		18,773,228
有価証券		―		153,518
未収委託者報酬		11,769,015		12,438,085
未収運用受託報酬		4,574,225		3,295,109
未収投資助言報酬		341,689		327,064
未収収益		59,526		56,925
前払費用		569,431		573,874
その他		427,238		491,914
流動資産計		78,896,169		77,197,195
固定資産				
有形固定資産		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
ソフトウエア		1,026,319		885,545
ソフトウエア仮勘定		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
	利益剰余金合計	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	
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	△ 3,200,000	△ 3,200,000			△ 3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		―	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

第34期（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	△12,520,000	△12,520,000			△12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	△300,000	△300,000			△300,000
運用責任準備積立金の取崩	△200,000	△200,000			△200,000
繰越利益剰余金の取崩	△6,600,000	△6,600,000			△6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		―	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	（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 （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
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	（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。 （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エアについては、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。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．引当金の計上基準	（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。 （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。 （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。 ①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。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 （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。 （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。
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

表示方法の変更

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1．有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

※1．関係会社に対する事項

（千円）

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

※2．固定資産除却損の内訳

（千円）

	第33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
建物	298	1,550
器具備品	8,217	439
ソフトウエア	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

①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。

②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。

③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す。

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
①非上場株式	272,464	276,764
②関係会社株式	3,229,196	4,499,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
②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 その他有価証券(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 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	－

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第33期（2018年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	1,267,157	146,101	1,121,055
②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			
①株式	―	―	―
②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			
①株式	1,326,372	111,223	1,215,148
②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			
①株式	―	―	―
②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)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
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
①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③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.発生したのれんの金額	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

①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。

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当はありません。

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当はありません。

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,470,802	未払手数料	894,336
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	－	－	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	9,079,083	未払手数料	1,549,208

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	―	―
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第35期中間会計期間末 （2019年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		37,156,171
金銭の信託		18,742,684
有価証券		997
未収委託者報酬		11,945,046
未収運用受託報酬		3,120,602
未収投資助言報酬		332,118
未収収益		58,808
前払費用		781,218
その他		2,233,840
流動資産計		74,371,488
固定資産		
有形固定資産		1,362,999
建物	※1	1,051,855
器具備品	※1	311,144
無形固定資産		3,541,152
ソフトウエア		3,323,996
ソフトウエア仮勘定		213,219
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		6
投資その他の資産		8,896,987
投資有価証券		958,309
関係会社株式		4,499,196
長期差入保証金		1,307,197
繰延税金資産		2,036,732
その他		95,551
固定資産計		13,801,139
資産合計		88,172,628

（単位：千円）

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

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	
						別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079
当中間期変動額							
剰余金の配当							△11,280,000
中間純利益							7,197,308
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額合計	―	―	―	―	―	―	△4,082,691
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	10,063,387

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金合計	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	
当期首残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085
当中間期変動額					
剰余金の配当	△11,280,000	△11,280,000			△11,280,000
中間純利益	7,197,308	7,197,308			7,197,308
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)			△405,643	△405,643	△405,643
当中間期変動額合計	△4,082,691	△4,082,691	△405,643	△405,643	△4,488,335
当中間期末残高	41,866,681	63,419,638	441,111	441,111	63,860,750

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの: 移動平均法による原価法
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	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年 (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エアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (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。
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2019年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 （千円）
①非上場株式	259,369
②関係会社株式	4,499,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第35期中間会計期間末
（2019年9月30日現在）

1.子会社株式

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

2.その他有価証券

区　分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	691,010	58,146	632,863
②投資信託	5,937	3,000	2,937
小計	696,947	61,146	635,800
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	-	-	-
②投資信託	2,990	3,000	△9
小計	2,990	3,000	△9
合計	699,937	64,146	635,791

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

（企業結合等関係）

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

1.結合当事企業

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

2.企業結合日

2016年10月1日

3.企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2019年9月30日まで

（2）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（3）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（4）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

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

（2）損益計算書項目

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

（１）サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
中間純利益金額	7,197,308千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	―
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,197,308千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数 （うち普通株式） （うちA種種類株式）	40,000株 (24,490株) (15,510株)

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

４【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

ａ．資本金の額

2019年３月末日現在、342,037百万円

ｂ．事業の内容

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

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

ａ．資本金の額

2019年３月末日現在、300万ポンド

ｂ．事業の内容

英国籍の法人であり、内外の有価証券等にかかる投資顧問業務を営んでいます。

（3）販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名　　称	資本金の額 （単位：百万円）	事業の内容
いちよし証券株式会社（※）	14,577	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
永和証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡安証券株式会社	650	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
あかつき証券株式会社	3,067	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
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おります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
西村証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三にいがた証券株式会社	852	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
三豊証券株式会社	300	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2019年３月末日現在

（※）新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

２【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

（1）委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理

（2）投資信託財産の計算

（3）その他上記業務に付随する一切の業務

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

「販売会社」は以下の業務を行います。

(1) 募集・販売の取り扱い

(2) 受益者に対する一部解約事務

(3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い

(4) 受益者に対する収益分配金の再投資

(5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付

(6) 受益者に対する運用報告書の交付

(7) 所得税および地方税の源泉徴収

（8）その他上記業務に付随する一切の業務

３【資本関係】

該当事項はありません。
※持株比率５％以上を記載します。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	2019年 7月22日
有価証券報告書	2019年 7月22日
臨時報告書	2019年 4月26日、2019年 7月31日

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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和１年１１月２９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　　長谷川　敬　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光７資産バランスファンドの平成３１年４月２３日から令和１年１０月２１日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光７資産バランスファンドの令和１年１０月２１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　　上

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

独立監査人の中間監査報告書

２０１９年１１月２８日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山野　浩　印
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　長谷川　敬　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の２０１９年４月１日から２０２０年３月３１日までの第３５期事業年度の中間会計期間（２０１９年４月１日から２０１９年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以　上

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