【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７月20日提出
【計算期間】	第27特定期間(自　2019年10月22日至　2020年4月20日)
【ファンド名】	新光７資産バランスファンド
【発行者名】	アセットマネジメントＯｎｅ株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	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

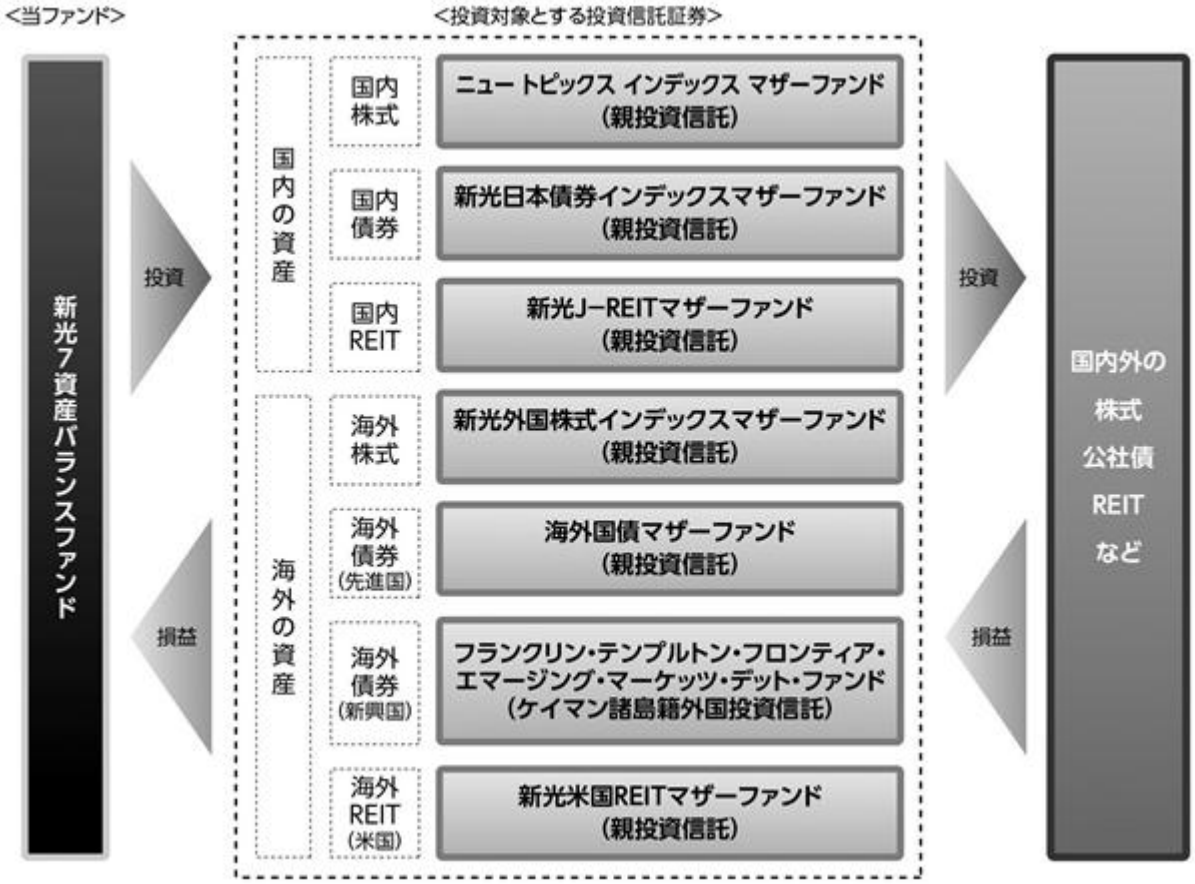
1 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産（株式、公社債、不動産投資信託証券）にバランスよく分散投資します。

●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。



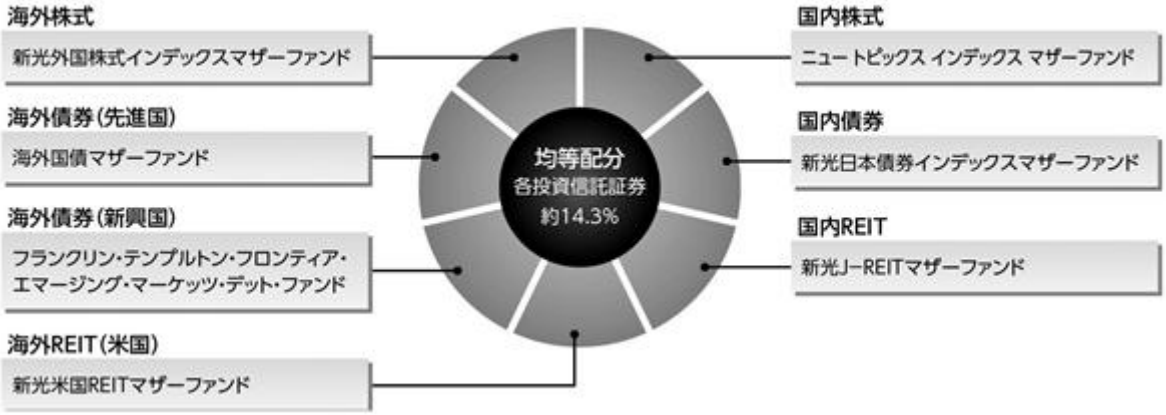
2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

●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。

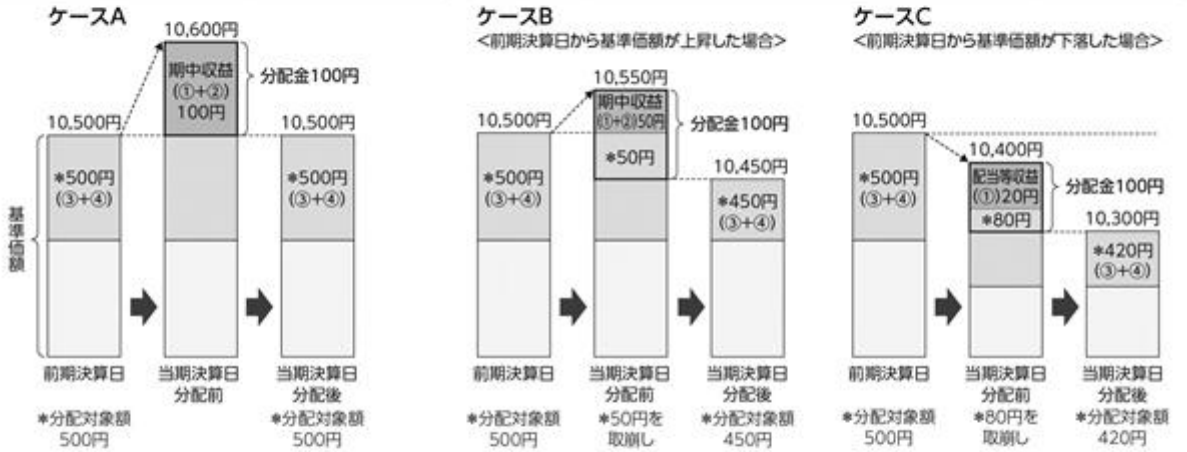
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

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。

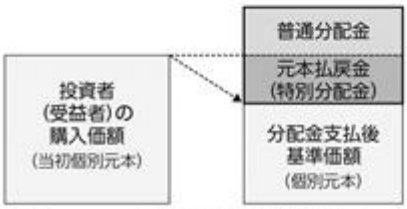
ケースA：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
ケースB：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
ケースC：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★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。

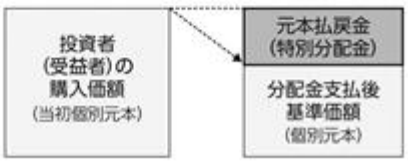
◆投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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。



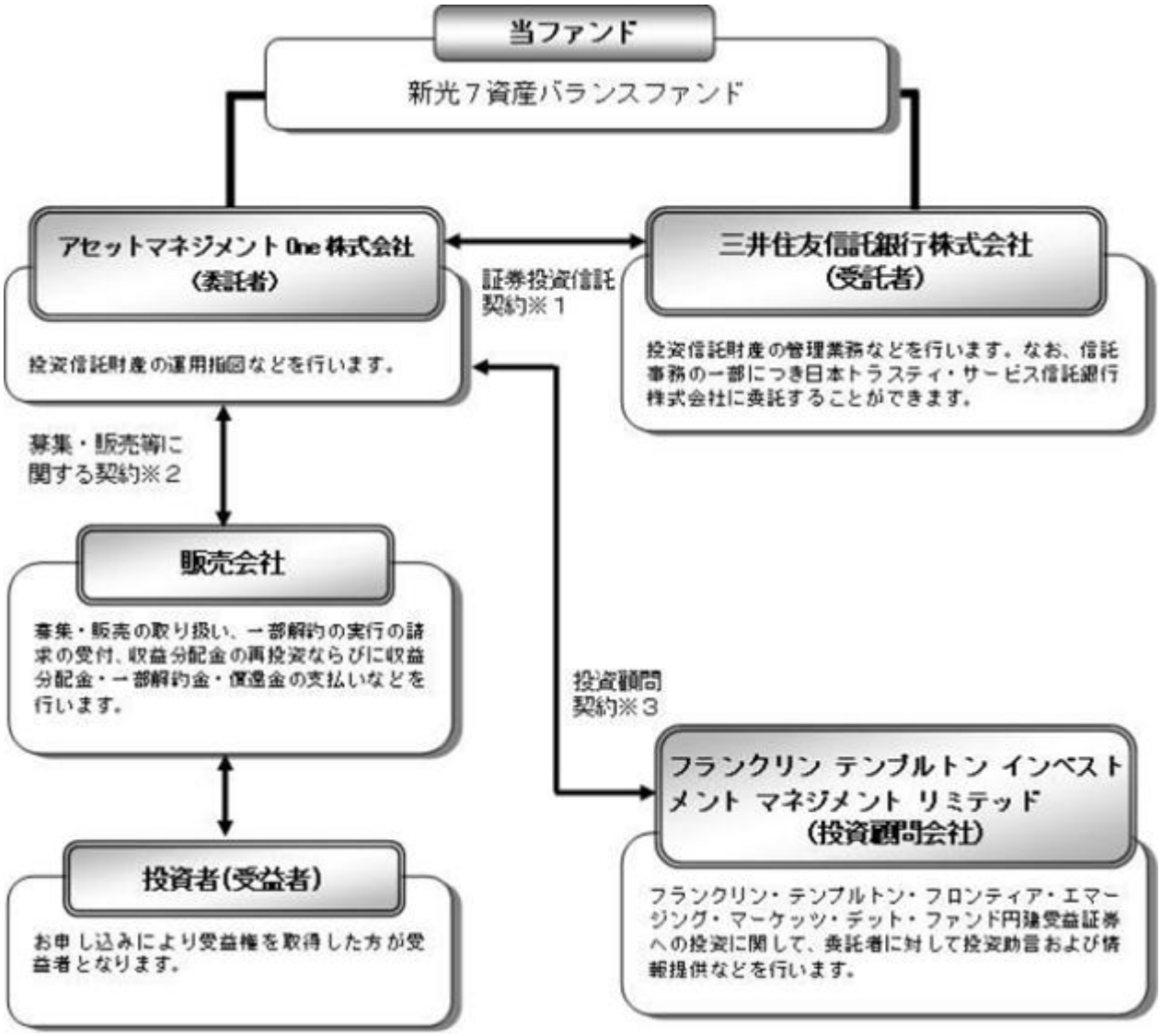
普通分配金　　：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（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。

※日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。（以下同じ）

※２　募集・販売等に関する契約

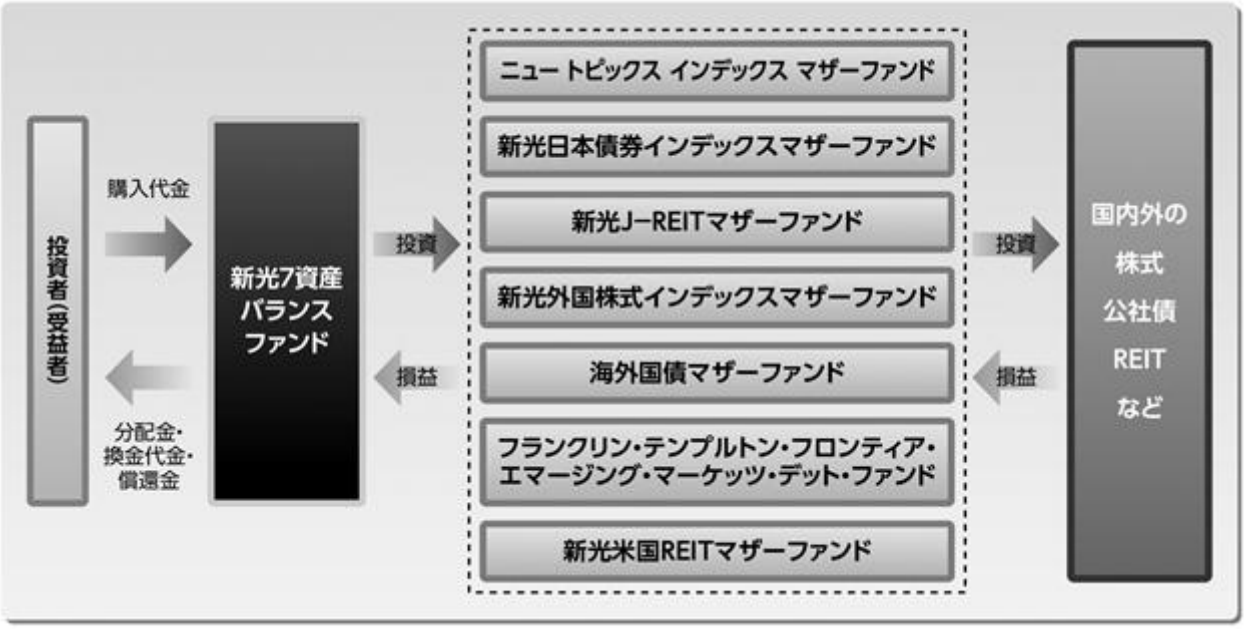
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

※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（2020年４月30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

（2020年４月30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

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。

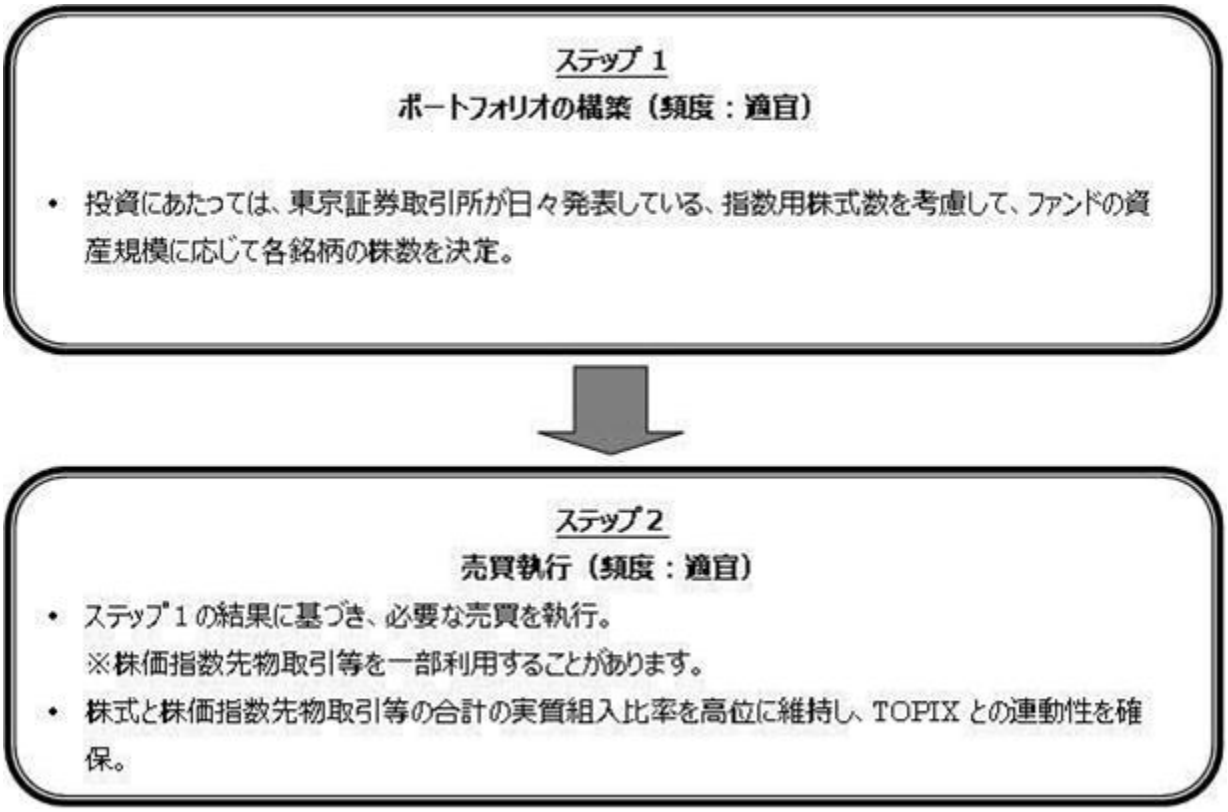
④ ㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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2020年４月30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

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2020年４月30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

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。

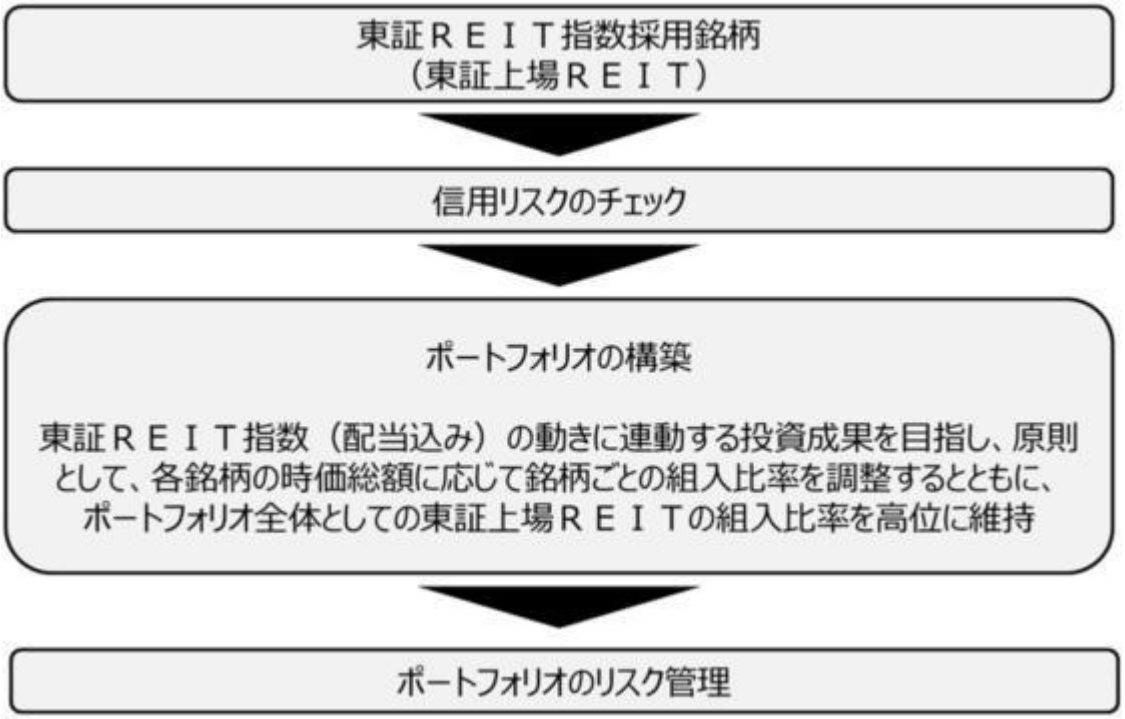
⑦ ㈱東京証券取引所は、委託会社または新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンドおよび新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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2020年４月30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

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2020年４月30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

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2020年４月30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。

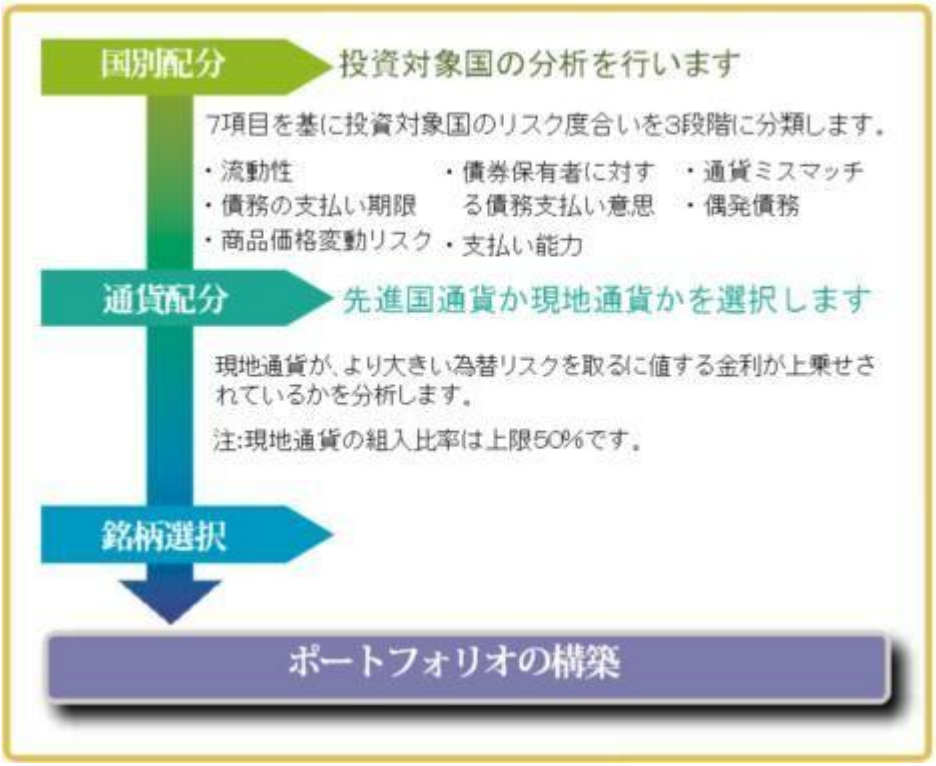
ファンド名	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド （以下、当概要において「ファンド」といいます。）
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託／円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、政府保証債は除きます。 ・クレジットリンク債への投資は、純資産総額の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62.6兆円※）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。

※2020年３月末現在、１米ドル＝107.955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2020年４月30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

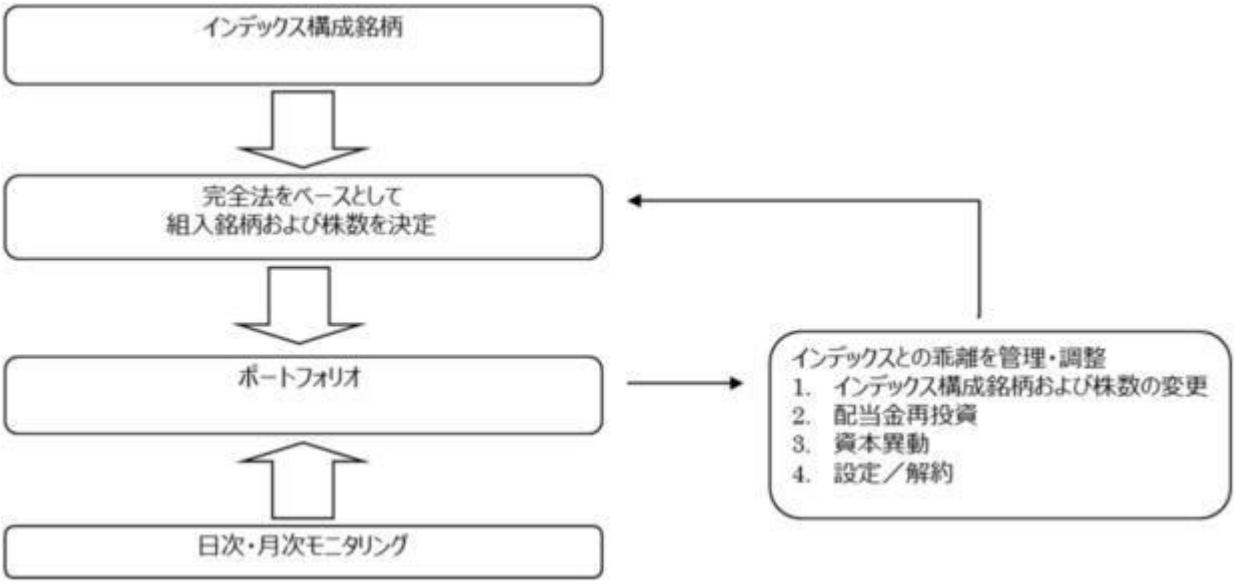
FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスについて

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。

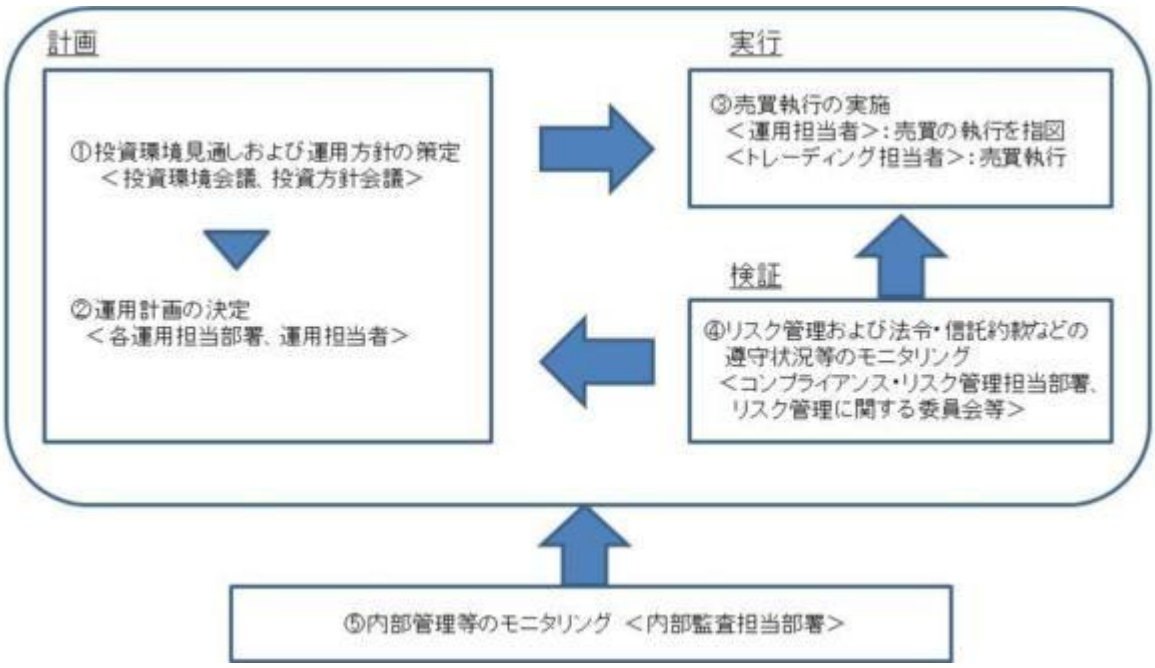


※運用プロセスは2020年４月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

※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７月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



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2020年４月30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。

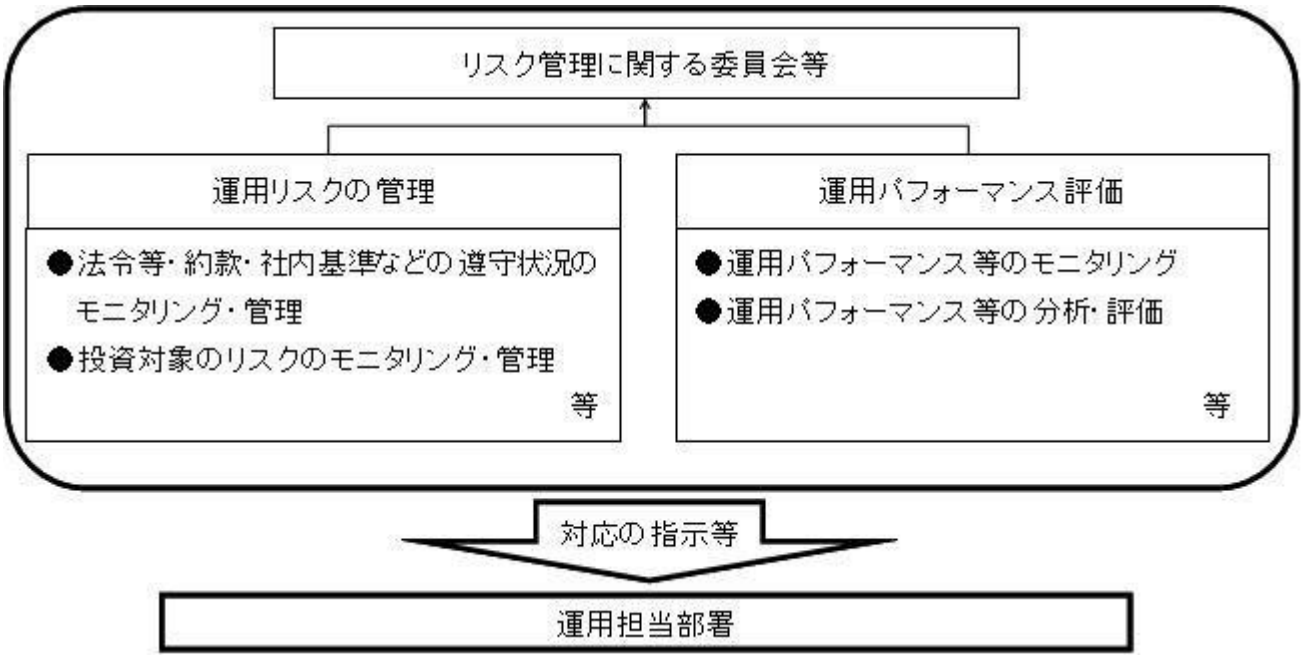
（２）リスク管理体制

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。



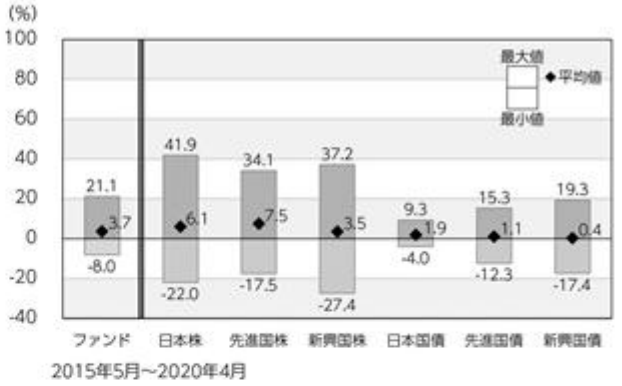
※リスク管理体制は2020年４月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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。

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



＊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><td>各販売会社の
取扱純資産額</td><td>委託会社</td><td>販売会社</td><td>受託会社</td></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、2020年４月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

ｃ．個別元本について

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

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

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

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

ｄ．収益分配金の課税について

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

収益分配の際、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2年4月30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		522,858,000	12.33
	内　ケイマン諸島	522,858,000	12.33
親投資信託受益証券		3,572,206,860	84.25
	内　日本	3,572,206,860	84.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		144,871,621	3.42
純資産総額		4,239,936,481	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2年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		2,216,235,660	96.66
	内　日本	2,216,235,660	96.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		76,518,996	3.34
純資産総額		2,292,754,656	100.00

その他資産の投資状況

令和2年4月30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）		72,700,000	3.17
	内　日本	72,700,000	3.17

（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2年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		5,976,557,100	73.63
	内　日本	5,976,557,100	73.63
地方債証券		827,131,060	10.19
	内　日本	827,131,060	10.19
特殊債券		731,850,000	9.02
	内　日本	731,850,000	9.02
社債券		511,245,000	6.30
	内　日本	511,245,000	6.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		69,840,750	0.86
純資産総額		8,116,623,910	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2年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		1,396,230,120	98.77
	内　日本	1,396,230,120	98.77
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		17,457,380	1.23
純資産総額		1,413,687,500	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2年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		1,817,592,133	89.88
	内　アメリカ	1,243,245,554	61.48
	内　イギリス	92,810,664	4.59
	内　スイス	71,202,276	3.52
	内　カナダ	65,104,341	3.22
	内　フランス	61,936,217	3.06
	内　ドイツ	52,652,143	2.60
	内　オーストラリア	36,372,693	1.80
	内　アイルランド	36,242,505	1.79
	内　オランダ	33,377,086	1.65
	内　スウェーデン	16,240,095	0.80
	内　スペイン	16,230,487	0.80
	内　香港	15,327,967	0.76
	内　デンマーク	13,760,778	0.68
	内　イタリア	10,199,243	0.50
	内　バミューダ	8,873,841	0.44
	内　フィンランド	7,668,199	0.38
	内　シンガポール	6,505,927	0.32
	内　ジャージィー	5,645,573	0.28
	内　ベルギー	5,307,593	0.26
	内　ケイマン諸島	3,692,952	0.18
	内　イスラエル	3,666,703	0.18
	内　ノルウェー	3,147,394	0.16
	内　ニュージーランド	2,041,344	0.10
	内　ルクセンブルグ	1,724,478	0.09
	内　オランダ領キュラソー	1,190,360	0.06
	内　ポルトガル	1,111,616	0.05
	内　オーストリア	907,552	0.04
	内　リベリア	477,664	0.02
	内　パナマ	381,703	0.02
	内　マン島	297,270	0.01
	内　パプアニューギニア	166,736	0.01
	内　イギリス領バージン諸島	83,179	0.00
投資信託受益証券		2,758,266	0.14
	内　オーストラリア	1,957,079	0.10
	内　シンガポール	801,187	0.04
投資証券		45,578,444	2.25

	内　アメリカ	41,803,834	2.07
	内　香港	1,062,480	0.05
	内　フランス	1,043,026	0.05
	内　イギリス	760,951	0.04
	内　カナダ	505,105	0.02
	内　オランダ	403,048	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		156,282,559	7.73
純資産総額		2,022,211,402	100.00

その他資産の投資状況

令和2年4月30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）		152,533,987	7.54
	内　アメリカ	110,006,634	5.44
	内　ドイツ	34,405,600	1.70
	内　イギリス	8,121,753	0.40

（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2年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		16,805,061,330	97.70
	内　アメリカ	8,622,396,810	50.13
	内　フランス	2,724,663,204	15.84
	内　ドイツ	2,063,867,916	12.00
	内　イタリア	1,860,387,584	10.82
	内　イギリス	1,063,746,474	6.18
	内　カナダ	469,999,342	2.73
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		395,569,829	2.30
純資産総額		17,200,631,159	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2年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		606,815,117	98.24
	内　アメリカ	606,815,117	98.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,849,907	1.76
純資産総額		617,665,024	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2年4月30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	291,396,487	2.2729 662,344,214	2.3161 674,903,403	－ －	15.92
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	308,442,058	1.9590 604,268,835	2.0019 617,470,155	－ －	14.56
3	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	379,226,578	1.6034 608,051,896	1.6042 608,355,276	－ －	14.35
4	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	354,031,541	1.6575 586,842,682	1.6464 582,877,529	－ －	13.75
5	海外国債マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	230,356,162	2.4161 556,586,558	2.3974 552,255,862	－ －	13.03
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	414,421,755	1.2876 533,650,893	1.2942 536,344,635	－ －	12.65
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	253,200	2,108.0000 533,745,600	2,065.0000 522,858,000	－ －	12.33

（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2年4月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	12.33
親投資信託受益証券	84.25
合計	96.58

（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2年4月30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	12,100	7,728.74 93,517,806	6,666.00 80,658,600	－ －	3.52
2	ソニー 日本	株式 電気機器	6,800	8,012.21 54,483,083	6,932.00 47,137,600	－ －	2.06
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	8,400	5,049.00 42,411,600	4,633.00 38,917,200	－ －	1.70
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	1,000	40,470.00 40,470,000	38,770.00 38,770,000	－ －	1.69
5	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	9,000	4,408.00 39,672,000	3,883.00 34,947,000	－ －	1.52
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	14,200	2,790.60 39,626,641	2,443.00 34,690,600	－ －	1.51
7	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	73,000	578.04 42,196,922	434.30 31,703,900	－ －	1.38
8	任天堂 日本	株式 その他製品	700	43,200.00 30,240,000	44,650.00 31,255,000	－ －	1.36
9	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	7,900	3,283.00 25,935,700	3,109.00 24,561,100	－ －	1.07
10	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	7,800	3,113.47 24,285,108	3,148.00 24,554,400	－ －	1.07
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	7,400	4,214.00 31,183,600	3,182.00 23,546,800	－ －	1.03
12	第一三共 日本	株式 医薬品	3,100	7,200.00 22,320,000	7,382.00 22,884,200	－ －	1.00
13	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	8,500	3,074.00 26,129,000	2,610.50 22,189,250	－ －	0.97
14	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	2,200	10,730.00 23,606,000	9,866.00 21,705,200	－ －	0.95
15	信越化学工業 日本	株式 化学	1,800	12,365.00 22,257,000	12,015.00 21,627,000	－ －	0.94
16	花王 日本	株式 化学	2,600	9,131.00 23,740,600	8,316.00 21,621,600	－ －	0.94
17	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	7,400	3,979.38 29,447,442	2,844.00 21,045,600	－ －	0.92

18	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,400	15,580.00 21,812,000	14,005.00 19,607,000	－ －	0.86
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,800	6,147.00 23,358,600	5,086.00 19,326,800	－ －	0.84
20	村田製作所 日本	株式 電気機器	3,200	6,870.00 21,984,000	6,019.00 19,260,800	－ －	0.84
21	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	145,000	166.35 24,122,105	125.80 18,241,000	－ －	0.80
22	ファナック 日本	株式 電気機器	1,000	20,915.00 20,915,000	17,830.00 17,830,000	－ －	0.78
23	三菱商事 日本	株式 卸売業	7,500	2,898.77 21,740,787	2,300.00 17,250,000	－ －	0.75
24	日立製作所 日本	株式 電気機器	5,200	4,587.00 23,852,400	3,241.00 16,853,200	－ －	0.74
25	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	9,400	1,895.50 17,817,700	1,786.50 16,793,100	－ －	0.73
26	日本電産 日本	株式 電気機器	2,600	7,770.00 20,202,000	6,286.00 16,343,600	－ －	0.71
27	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	700	25,300.00 17,710,000	22,940.00 16,058,000	－ －	0.70
28	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	7,500	2,575.93 19,319,486	2,125.00 15,937,500	－ －	0.70
29	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	900	21,945.00 19,750,500	17,005.00 15,304,500	－ －	0.67
30	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	1,100	16,010.00 17,611,000	13,680.00 15,048,000	－ －	0.66

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年4月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.66
合計	96.66

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和2年4月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	14.34
情報・通信業		9.39
輸送用機器		7.17
化学		7.17
医薬品		6.45
銀行業		5.02
サービス業		4.89
機械		4.72
卸売業		4.51
小売業		4.46
陸運業		4.20
食料品		3.92
精密機器		2.55
建設業		2.52
その他製品		2.44
保険業		2.14
不動産業		2.08
電気・ガス業		1.63
その他金融業		1.06
証券、商品先物取引業		0.77
ガラス・土石製品		0.75
非鉄金属		0.65
ゴム製品		0.62
鉄鋼		0.55
金属製品		0.51
繊維製品		0.51
石油・石炭製品		0.44
空運業		0.34
パルプ・紙		0.26
鉱業		0.21
倉庫・運輸関連業		0.16
海運業		0.14
水産・農林業		0.10
合計		96.66

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

新光日本債券インデックスマザーファンド

令和2年4月30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	120.84 120,847,000	119.65 119,656,000	2.1 2029/12/28	1.47
2	１８回　東京都公募公債　２０年 日本	地方債証券	100,000,000	120.19 120,192,000	118.51 118,517,000	2.22 2029/3/19	1.46
3	３６回　東日本旅客鉄道社債 日本	社債券	100,000,000	110.15 110,159,000	108.90 108,909,000	2.11 2024/12/20	1.34
4	１２回　兵庫県公募公債　１５年 日本	地方債証券	100,000,000	106.81 106,810,000	106.19 106,198,000	0.781 2030/12/6	1.31
5	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	103.44 103,449,000	102.72 102,728,000	0.882 2023/6/16	1.27
6	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	103.13 103,134,000	102.45 102,459,000	0.645 2024/3/15	1.26
7	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	103.07 103,074,000	102.34 102,342,000	0.484 2025/6/30	1.26
8	４回　第一三共社債 日本	社債券	100,000,000	102.52 102,526,000	102.14 102,146,000	0.846 2023/9/15	1.26
9	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	102.41 102,417,000	101.99 101,991,000	0.715 2023/3/20	1.26
10	２４年度７回　広島県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	102.29 102,294,000	101.84 101,844,000	0.67 2023/3/27	1.25
11	２４年度２回　広島市公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	102.21 102,211,000	101.77 101,771,000	0.7 2022/12/22	1.25
12	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	102.29 102,295,000	101.74 101,740,000	0.9 2022/3/14	1.25
13	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	101.75 101,758,000	100.93 100,934,000	0.17 2027/10/29	1.24
14	１６９回　共同発行市場公募地方債 日本	地方債証券	100,000,000	101.41 101,412,000	100.83 100,832,000	0.205 2027/4/23	1.24
15	２１８回　神奈川県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	101.22 101,220,000	100.69 100,696,000	0.195 2025/12/19	1.24
16	４７回　野村ホールディングス社債 日本	社債券	100,000,000	100.56 100,566,000	100.48 100,480,000	0.472 2021/12/24	1.24

17	１１回　ブリヂストン社債 日本	社債券	100,000,000	100.07 100,075,000	99.90 99,904,000	0.295 2027/4/21	1.23
18	４４回　ホンダファイナンス社債 日本	社債券	100,000,000	99.84 99,844,000	99.80 99,806,000	0.08 2022/9/20	1.23
19	３３９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	90,000,000	103.39 93,059,100	102.95 92,657,700	0.4 2025/6/20	1.14
20	３３８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	103.24 82,596,000	102.80 82,245,600	0.4 2025/3/20	1.01
21	３１５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	102.22 81,780,800	101.58 81,271,200	1.2 2021/6/20	1.00
22	１３０回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	80,000,000	100.62 80,498,400	100.47 80,380,800	0.1 2021/12/20	0.99
23	３２９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	70,000,000	103.59 72,513,700	103.09 72,163,700	0.8 2023/6/20	0.89
24	３４１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	70,000,000	103.05 72,139,900	102.67 71,872,500	0.3 2025/12/20	0.89
25	３２８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	70,000,000	102.68 71,876,700	102.26 71,582,700	0.6 2023/3/20	0.88
26	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	70,000,000	102.11 71,479,400	101.95 71,367,800	0.1 2028/3/20	0.88
27	３５２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	70,000,000	102.01 71,409,800	101.86 71,304,800	0.1 2028/9/20	0.88
28	２４年度３回　広島県公募公債 日本	地方債証券	66,000,000	102.38 67,576,080	101.90 67,254,660	0.82 2022/9/26	0.83
29	３３４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	60,000,000	103.69 62,215,200	103.25 61,950,600	0.6 2024/6/20	0.76
30	３４０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	60,000,000	103.55 62,132,400	103.10 61,860,000	0.4 2025/9/20	0.76

（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2年4月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	73.63
地方債証券	10.19
特殊債券	9.02
社債券	6.30
合計	99.14

（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2年4月30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	166	811,666.07 134,736,568	643,000.00 106,738,000	－ －	7.55
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	171	724,117.11 123,824,027	584,000.00 99,864,000	－ －	7.06
3	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	258	303,521.28 78,308,491	295,600.00 76,264,800	－ －	5.39
4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	553	195,617.45 108,176,454	123,600.00 68,350,800	－ －	4.83
5	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	244	308,534.66 75,282,459	260,500.00 63,562,000	－ －	4.50
6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	426	144,164.16 61,413,934	138,700.00 59,086,200	－ －	4.18
7	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	162	355,805.54 57,640,498	329,000.00 53,298,000	－ －	3.77
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	341	226,459.39 77,222,653	129,700.00 44,227,700	－ －	3.13
9	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	384	204,110.55 78,378,453	108,800.00 41,779,200	－ －	2.96
10	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	324	231,773.79 75,094,709	118,400.00 38,361,600	－ －	2.71
11	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	57	685,420.50 39,068,969	644,000.00 36,708,000	－ －	2.60
12	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	113	496,197.53 56,070,322	299,000.00 33,787,000	－ －	2.39
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	501	98,483.65 49,340,309	66,000.00 33,066,000	－ －	2.34
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	220	166,506.80 36,631,498	150,000.00 33,000,000	－ －	2.33
15	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	53	824,062.11 43,675,292	539,000.00 28,567,000	－ －	2.02
16	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	112	275,134.75 30,815,093	253,900.00 28,436,800	－ －	2.01
17	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	197	177,668.27 35,000,650	138,700.00 27,323,900	－ －	1.93

18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	86	551,829.81 47,457,364	317,000.00 27,262,000	－ －	1.93
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	159	161,059.20 25,608,413	151,700.00 24,120,300	－ －	1.71
20	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	75	346,445.12 25,983,384	320,500.00 24,037,500	－ －	1.70
21	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	40	803,690.87 32,147,635	597,000.00 23,880,000	－ －	1.69
22	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	751	63,281.55 47,524,445	27,970.00 21,005,470	－ －	1.49
23	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	49	465,250.26 22,797,263	425,000.00 20,825,000	－ －	1.47
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	185	150,243.55 27,795,058	107,600.00 19,906,000	－ －	1.41
25	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	551	79,794.95 43,967,021	36,000.00 19,836,000	－ －	1.40
26	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	112	215,369.13 24,121,343	170,400.00 19,084,800	－ －	1.35
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	209.4	103,929.36 21,762,809	90,500.00 18,950,700	－ －	1.34
28	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	61	466,467.80 28,454,536	304,000.00 18,544,000	－ －	1.31
29	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	158	174,293.82 27,538,425	116,200.00 18,359,600	－ －	1.30
30	日本リート投資法人 日本	投資証券	56	450,389.35 25,221,804	323,500.00 18,116,000	－ －	1.28

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年4月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	98.77
合計	98.77

（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2年4月30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	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	3,524	15,665.22 55,204,242	18,961.94 66,821,891	－ －	3.30
2	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	2,162	27,595.01 59,660,426	30,749.70 66,480,862	－ －	3.29
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	205	192,191.65 39,399,290	253,571.51 51,982,161	－ －	2.57
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	1,176	20,028.93 23,554,029	20,753.08 24,405,628	－ －	1.21
5	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	151	137,671.23 20,788,356	143,363.96 21,647,959	－ －	1.07
6	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	148	137,503.02 20,350,448	143,438.77 21,228,938	－ －	1.05
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	1,279	14,168.26 18,121,210	16,056.14 20,535,814	－ －	1.02
8	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	834	18,834.99 15,708,389	19,427.89 16,202,866	－ －	0.80
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	1,437	11,354.49 16,316,410	11,275.27 16,202,577	－ －	0.80
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	1,522	13,468.43 20,498,956	10,458.29 15,917,529	－ －	0.79
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	1,209	12,682.39 15,333,017	12,512.33 15,127,418	－ －	0.75

12	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	461	27,230.19 12,553,122	30,741.15 14,171,672	－ －	0.70
13	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	2,113	6,155.59 13,006,772	6,604.56 13,955,447	－ －	0.69
14	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	438	28,824.31 12,625,050	30,317.94 13,279,262	－ －	0.66
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	639	23,203.89 14,827,289	20,263.61 12,948,453	－ －	0.64
16	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	540	24,207.81 13,072,222	23,704.83 12,800,610	－ －	0.63
17	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	337	32,791.93 11,050,882	37,429.15 12,613,625	－ －	0.62
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	2,010	6,264.13 12,590,910	6,211.28 12,484,681	－ －	0.62
19	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	3,547	4,074.74 14,453,103	3,358.92 11,914,103	－ －	0.59
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	4,170	3,404.46 14,196,606	2,648.23 11,043,154	－ －	0.55
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	2,692	3,896.43 10,489,191	4,073.88 10,966,896	－ －	0.54
22	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	1,238	8,814.99 10,912,958	8,631.88 10,686,279	－ －	0.53
23	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	886	14,188.35 12,570,880	11,996.15 10,628,595	－ －	0.53
24	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,054	7,134.30 14,653,856	5,072.05 10,417,991	－ －	0.52
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	1,983	5,468.22 10,843,500	5,035.71 9,985,821	－ －	0.49
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	676	14,073.42 9,513,632	14,252.18 9,634,475	－ －	0.48
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	1,033	9,492.90 9,806,172	9,313.21 9,620,555	－ －	0.48

28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	2,062	5,097.12 10,510,277	4,631.74 9,550,659	－ －	0.47
29	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	214	32,065.58 6,862,035	44,018.68 9,419,998	－ －	0.47
30	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	926	12,246.89 11,340,629	10,112.03 9,363,748	－ －	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2年4月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	89.88
投資信託受益証券	0.14
投資証券	2.25
合計	92.27

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和2年4月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	6.14
医薬品		5.86
銀行		5.46
情報技術サービス		4.27
コンピュータ・周辺機器		3.53
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.52
半導体・半導体製造装置		3.48
石油・ガス・消耗燃料		3.48
インターネット販売・通信販売		3.16
保険		2.94
ヘルスケア機器・用品		2.89
資本市場		2.71
バイオテクノロジー		2.07
化学		2.02
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.99
電力		1.97
食品		1.90
各種電気通信サービス		1.85
飲料		1.75
専門小売り		1.60
食品・生活必需品小売り		1.53
航空宇宙・防衛		1.49
ホテル・レストラン・レジャー		1.43
機械		1.40
家庭用品		1.38
娯楽		1.37
金属・鉱業		1.27
繊維・アパレル・贅沢品		1.27

コングロマリット	1.16
メディア	1.08
総合公益事業	1.03
陸運・鉄道	0.98
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.86
各種金融サービス	0.86
タバコ	0.83
自動車	0.77
専門サービス	0.73
通信機器	0.73
電気設備	0.71
パーソナル用品	0.63
電子装置・機器・部品	0.45
航空貨物・物流サービス	0.45
複合小売り	0.43
不動産管理・開発	0.43
商業サービス・用品	0.42
建設関連製品	0.39
消費者金融	0.36
家庭用耐久財	0.32
無線通信サービス	0.29
容器・包装	0.27
建設・土木	0.26
建設資材	0.23
商社・流通業	0.21
自動車部品	0.21
ガス	0.19
運送インフラ	0.16
エネルギー設備・サービス	0.14
水道	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
紙製品・林産品	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06
旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.05
販売	0.04
レジャー用品	0.03
合計	89.88

（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2年4月30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 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	801,525,000	107.58 862,348,658	112.85 904,533,482	2.375 2027/5/15	5.26
2	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	641,220,000	111.77 716,708,524	121.11 776,627,626	3.125 2028/11/15	4.52
3	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	641,220,000	109.85 704,438,360	118.56 760,246,462	2.875 2028/8/15	4.42
4	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	641,220,000	109.70 703,438,378	118.13 757,491,217	2.875 2028/5/15	4.40
5	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	641,220,000	107.74 690,893,677	117.36 752,581,875	2.625 2029/2/15	4.38
6	US T N/B 2.375 05/15/29 アメリカ	国債証券	641,220,000	106.04 679,988,161	115.59 741,210,243	2.375 2029/5/15	4.31
7	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証券	641,220,000	99.41 637,462,450	109.19 700,182,179	1.625 2029/8/15	4.07
8	US T N/B 1.75 11/15/29 アメリカ	国債証券	587,785,000	100.50 590,723,925	110.48 649,410,583	1.75 2029/11/15	3.78
9	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	534,350,000	108.57 580,187,077	116.71 623,686,640	2.75 2028/2/15	3.63
10	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	534,350,000	104.65 559,230,404	112.60 601,728,195	2.25 2027/11/15	3.50
11	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	534,350,000	104.57 558,813,077	112.30 600,100,094	2.25 2027/8/15	3.49
12	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証券	534,350,000	103.69 554,095,902	108.28 578,600,859	1.5 2030/2/15	3.36
13	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	464,000,000	124.66 578,434,464	122.29 567,446,944	2.75 2027/10/25	3.30
14	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	348,000,000	154.42 537,382,992	150.57 523,987,080	5.5 2029/4/25	3.05
15	FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス	国債証券	406,000,000	108.58 440,839,672	107.51 436,524,704	0.75 2028/11/25	2.54
16	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	348,000,000	108.51 377,642,640	107.34 373,564,080	0.75 2028/5/25	2.17
17	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	348,000,000	106.20 369,601,056	105.28 366,395,976	0.5 2029/5/25	2.13
18	DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 ドイツ	国債証券	290,000,000	108.28 314,018,380	108.35 314,218,190	0.5 2027/8/15	1.83
19	ITALY BTPS 6.5 11/01/27 イタリア	国債証券	232,000,000	144.62 335,518,400	134.56 312,179,200	6.5 2027/11/1	1.81
20	DEUTSCHLAND 08/15/29 ドイツ	国債証券	290,000,000	102.74 297,970,708	104.95 304,378,200	－ 2029/8/15	1.77
21	ITALY BTPS 4.75 09/01/28 イタリア	国債証券	232,000,000	131.74 305,640,976	123.94 287,545,672	4.75 2028/9/1	1.67
22	UK TREASURY 0.875 10/22/29 イギリス	国債証券	265,960,000	101.75 270,623,608	105.87 281,571,852	0.875 2029/10/22	1.64

23	FRANCE OAT 0.0 11/25/29 フランス	国債証券	266,800,000	101.54 270,925,192	100.36 267,769,284	－ 2029/11/25	1.56
24	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	232,000,000	117.63 272,901,600	110.66 256,737,000	3 2029/8/1	1.49
25	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証券	232,000,000	115.49 267,943,760	108.91 252,677,000	2.8 2028/12/1	1.47
26	DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 ドイツ	国債証券	232,000,000	106.49 247,059,120	107.08 248,434,880	0.25 2028/8/15	1.44
27	ITALY BTPS 2.05 08/01/27 イタリア	国債証券	232,000,000	110.03 255,271,456	103.35 239,784,760	2.05 2027/8/1	1.39
28	ITALY BTPS 2.0 02/01/28 イタリア	国債証券	232,000,000	108.76 252,324,360	103.09 239,177,152	2 2028/2/1	1.39
29	UK TREASURY 6.0 12/07/28 イギリス	国債証券	159,576,000	148.77 237,409,194	149.32 238,291,649	6 2028/12/7	1.39
30	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29 ドイツ	国債証券	197,200,000	106.56 210,144,405	107.26 211,528,354	0.25 2029/2/15	1.23

（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2年4月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.70
合計	97.70

（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2年4月30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	2,448	23,823.07 58,318,893	25,307.88 61,953,701	－ －	10.03
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	4,082	8,998.41 36,731,526	9,635.39 39,331,699	－ －	6.37
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	2,310	15,059.32 34,787,032	16,611.87 38,373,426	－ －	6.21
4	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	474	61,258.70 29,036,628	72,598.92 34,411,892	－ －	5.57
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,453	13,894.66 20,188,954	15,881.95 23,076,474	－ －	3.74
6	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証券	624	26,154.93 16,320,680	31,149.39 19,437,224	－ －	3.15
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	824	24,284.66 20,010,567	19,954.76 16,442,727	－ －	2.66
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	2,036	8,649.78 17,610,958	7,034.18 14,321,597	－ －	2.32

9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	775	21,605.08 16,743,944	17,720.11 13,733,088	－ －	2.22
10	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	2,286	8,691.74 19,869,325	5,614.94 12,835,775	－ －	2.08
11	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	1,712	13,865.34 23,737,471	7,352.65 12,587,747	－ －	2.04
12	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	675	15,963.45 10,775,331	16,711.26 11,280,101	－ －	1.83
13	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	1,814	7,870.97 14,277,950	5,906.70 10,714,762	－ －	1.73
14	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証券	4,145	2,770.41 11,483,368	2,389.61 9,904,946	－ －	1.60
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	364	32,349.10 11,775,075	26,634.14 9,694,827	－ －	1.57
16	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	861	12,819.16 11,037,300	10,499.97 9,040,480	－ －	1.46
17	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,816	3,588.91 10,106,379	2,918.61 8,218,833	－ －	1.33
18	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	2,045	3,507.72 7,173,297	3,793.88 7,758,494	－ －	1.26
19	MID AMERICA アメリカ	投資証券	632	13,561.87 8,571,104	12,042.11 7,610,614	－ －	1.23
20	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	2,974	3,016.60 8,971,373	2,554.19 7,596,169	－ －	1.23
21	VENTAS INC アメリカ	投資証券	2,073	6,724.48 13,939,862	3,490.37 7,235,545	－ －	1.17
22	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	503	15,548.04 7,820,666	14,141.03 7,112,942	－ －	1.15
23	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	951	9,124.25 8,677,163	7,258.60 6,902,938	－ －	1.12
24	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	699	11,500.50 8,038,855	9,569.13 6,688,828	－ －	1.08
25	UDR INC アメリカ	投資証券	1,614	4,923.42 7,946,401	4,072.81 6,573,524	－ －	1.06
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	964	6,931.28 6,681,757	6,548.99 6,313,229	－ －	1.02
27	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	3,955	1,649.16 6,522,456	1,343.35 5,312,972	－ －	0.86
28	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	2,855	2,047.38 5,845,288	1,848.85 5,278,469	－ －	0.85
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	519	11,308.73 5,869,234	9,498.60 4,929,776	－ －	0.80
30	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,568	2,290.66 5,882,433	1,912.97 4,912,514	－ －	0.80

（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2年4月30日現在

種類	投資比率（%）

投資証券	98.24
合計	98.24

（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2年4月30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　０２０６月	買建	5	69,366,650	72,700,000	3.17

（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2年4月30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 Jun20	買建	7	95,449,604	110,006,634	5.44
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun20	買建	10	30,983,600	34,405,600	1.70
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun20	買建	1	7,502,066	8,121,753	0.40

（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2年4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
第27特定期間末 (令和2年4月20日)	4,234	4,244	0.8402	0.8422
平成31年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	－
11月末日	4,970	－	0.9567	－
12月末日	4,956	－	0.9578	－
令和2年1月末日	4,964	－	0.9640	－
2月末日	4,704	－	0.9230	－
3月末日	4,185	－	0.8242	－
4月末日	4,239	－	0.8416	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
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
第27特定期間	0.0120

③【収益率の推移】

	収益率（%）
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
第27特定期間	△10.0

（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】

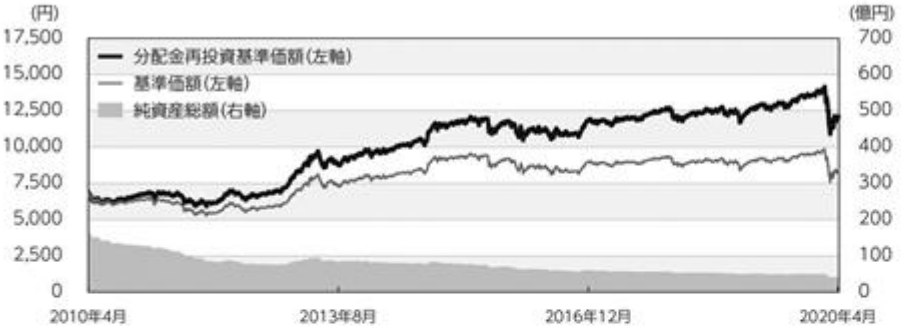
	設定口数	解約口数
第8特定期間	64,807,629	3,510,685,871
第9特定期間	93,294,151	2,262,935,013
第10特定期間	55,270,668	2,043,398,766
第11特定期間	24,129,070	3,124,126,893
第12特定期間	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	22,407,208	820,891,392
第15特定期間	25,208,228	996,341,985
第16特定期間	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	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
第27特定期間	9,232,953	232,290,245

（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:2020年4月30日

基準価額・純資産の推移 (2010年4月30日～2020年4月30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12月	20円
2020年 1月	20円
2020年 2月	20円
2020年 3月	20円
2020年 4月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	4,280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	新光外国株式インデックスマザーファンド	15.92
2	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド	14.56
3	新光米国REITマザーファンド	14.35
4	新光J-REITマザーファンド	13.75
5	海外国債マザーファンド	13.03
6	新光日本債券インデックスマザーファンド	12.65
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	12.33

■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	3.52
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.06
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.70
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.69
5	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.52

■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	1.47
2	18回　東京都公募公債　20年	地方債証券	日本	2.22	2029/3/19	1.46
3	36回　東日本旅客鉄道社債	社債券	日本	2.11	2024/12/20	1.34
4	12回　兵庫県公募公債　15年	地方債証券	日本	0.781	2030/12/6	1.31
5	49回　政保地方公共団体金融機構債券	特殊債券	日本	0.882	2023/6/16	1.27

■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	7.55
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	7.06
3	日本プロロジスリート投資法人	日本	5.39
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.83
5	大和ハウスリート投資法人	日本	4.50

○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:2020年4月30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	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.30
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	3.29
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.57
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	1.21
5	ALPHABET INC-CL C	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	1.07

■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 2.375 05/15/27	国債証券	アメリカ	2.375	2027/5/15	5.26
2	US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	4.52
3	US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/8/15	4.42
4	US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/5/15	4.40
5	US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	アメリカ	2.625	2029/2/15	4.38

■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2020年4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	60.3
2	南アフリカランド	4.3
3	メキシコペソ	4.2
4	ウルグアイペソ	3.5
5	エジプトポンド	3.2

②組入公社債の上位5ヵ国

順位	国/地域	比率(%)
1	その他	7.4
2	南アフリカ	6.6
3	コロンビア	5.7
4	メキシコ	5.4
5	ペルー	4.4

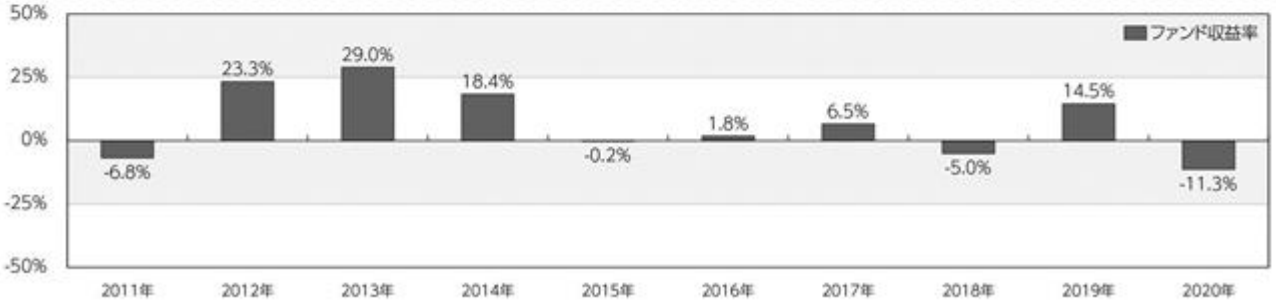
■新光米国REITマザーファンド

※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	10.03
2	PROLOGIS INC	アメリカ	6.37
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	アメリカ	6.21
4	EQUINIX INC	アメリカ	5.57
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.74

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。
※2020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（令和1年10月22日から令和2年4月20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 令和1年10月21日現在	当期 令和2年4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	96,816,404	83,952,945
投資信託受益証券	635,979,000	533,745,600
親投資信託受益証券	4,205,550,713	3,630,118,594
未収入金	60,000,000	―
流動資産合計	4,998,346,117	4,247,817,139
資産合計	4,998,346,117	4,247,817,139
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,525,520	10,079,405
未払解約金	2,837,764	100
未払受託者報酬	365,620	279,553
未払委託者報酬	3,976,168	3,040,239
その他未払費用	17,353	12,600
流動負債合計	17,722,425	13,411,897
負債合計	17,722,425	13,411,897
純資産の部		
元本等		
元本	5,262,760,161	5,039,702,869
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△282,136,469	△805,297,627
（分配準備積立金）	469,997,340	489,876,976
元本等合計	4,980,623,692	4,234,405,242
純資産合計	4,980,623,692	4,234,405,242
負債純資産合計	4,998,346,117	4,247,817,139

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　平成31年4月23日 至　令和1年10月21日	当期 自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20日
営業収益		
受取配当金	76,530,000	65,808,000
有価証券売買等損益	151,855,976	△519,167,719
営業収益合計	228,385,976	△453,359,719
営業費用		
支払利息	43,894	28,155
受託者報酬	2,111,022	2,084,359
委託者報酬	22,957,319	22,667,862
その他費用	100,208	96,143
営業費用合計	25,212,443	24,876,519
営業利益又は営業損失（△）	203,173,533	△478,236,238
経常利益又は経常損失（△）	203,173,533	△478,236,238
当期純利益又は当期純損失（△）	203,173,533	△478,236,238
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（△）	△581,558	△413,972
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△437,997,986	△282,136,469
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,631,418	17,100,418
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	18,631,418	17,100,418
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	2,572,951	784,713
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	2,572,951	784,713
分配金	63,952,041	61,654,597
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△282,136,469	△805,297,627

（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　令和1年10月22日 至　令和2年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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 令和1年10月21日現在	当期 令和2年4月20日現在
１．　期首元本額	5,451,256,537円	5,262,760,161円
期中追加設定元本額	34,127,005円	9,232,953円
期中一部解約元本額	222,623,381円	232,290,245円
２．　受益権の総数	5,262,760,161口	5,039,702,869口
３．　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は282,136,469円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は805,297,627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31年4月23日 至　令和1年10月21日	当期 自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20日

１．　分配金の計算過程	（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。 （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。 （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。	（自令和1年10月22日　至令和1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（14,721,515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（9,872,717円）及び分配準備積立金（466,664,952円）より分配対象収益は491,259,184円（1万口当たり939.91円）であり、うち10,453,236円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自令和1年11月21日　至令和1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（12,359,317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（10,014,123円）及び分配準備積立金（466,633,685円）より分配対象収益は489,007,125円（1万口当たり943.77円）であり、うち10,362,785円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自令和1年12月21日　至令和2年1月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（19,292,029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（10,030,042円）及び分配準備積立金（466,284,898円）より分配対象収益は495,606,969円（1万口当たり961.19円）であり、うち10,312,336円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

	（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。 （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。 （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。	（自令和2年1月21日　至令和2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（15,866,813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（10,162,825円）及び分配準備積立金（473,889,917円）より分配対象収益は499,919,555円（1万口当たり972.04円）であり、うち10,285,896円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自令和2年2月21日　至令和2年3月23日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（16,539,349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（10,109,443円）及び分配準備積立金（473,576,951円）より分配対象収益は500,225,743円（1万口当たり984.60円）であり、うち10,160,939円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自令和2年3月24日　至令和2年4月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（24,077,188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（10,257,932円）及び分配準備積立金（475,879,193円）より分配対象収益は510,214,313円（1万口当たり1,012.38円）であり、うち10,079,405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31年4月23日 至　令和1年10月21日	当期 自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 令和1年10月21日現在	当期 令和2年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(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。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	前期 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）	当期 令和2年4月20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	△4,302,000	△17,724,000
親投資信託受益証券	70,927,701	375,045,873
合計	66,625,701	357,321,873

（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 令和1年10月21日現在	当期 令和2年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9464円 (9,464円)	0.8402円 (8,402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2年4月20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	253,200	533,745,600	
投資信託受益証券　合計		253,200	533,745,600	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	230,356,162	556,586,558	
	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド	308,442,058	604,268,835	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	291,396,487	662,344,214	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	414,421,755	533,650,893	
	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド	354,031,541	586,842,682	
	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド	428,106,157	686,425,412	
親投資信託受益証券　合計		2,026,754,160	3,630,118,594	
合計			4,163,864,194	

（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2年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	70,890,268
株式	2,172,570,150
派生商品評価勘定	2,068,680
未収配当金	27,992,156
流動資産合計	2,273,521,254
資産合計	2,273,521,254
負債の部	
流動負債	
前受金	2,030,000
未払解約金	27,665,000
流動負債合計	29,695,000
負債合計	29,695,000
純資産の部	
元本等	
元本	1,145,344,367
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,098,481,887
元本等合計	2,243,826,254
純資産合計	2,243,826,254
負債純資産合計	2,273,521,254

注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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	1,630,241,818円
	同期中追加設定元本額	93,859,337円
	同期中一部解約元本額	578,756,788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	229,708,203円
	新光７資産バランスファンド	308,442,058円
	ニュー　トピックス　インデックス（変額年金）	79,876,306円
	世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	410,457,334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）	24,782,591円
	ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	35,198,985円
	ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	15,030,516円
	グローバル・ナビ	19,274,510円
	太陽財形株投　太陽一般財形　３０	5,216,720円
	太陽財形株投　太陽一般財形　５０	14,156,390円
	太陽財形株投　太陽年金・住宅財形　３０	3,200,754円
	計	1,145,344,367円
２．	受益権の総数	1,145,344,367口
３．	差入代用有価証券	
	株式	135,791,000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　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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2年4月20日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△464,021,125
合計	△464,021,125

（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（令和2年1月15日から令和2年4月20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2年4月20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	55,190,000	－	57,260,000	2,070,000
合計	55,190,000	－	57,260,000	2,070,000

（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2年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9591円 (19,591円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和2年4月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	100	2,541.00	254,100	
日本水産	1,500	468.00	702,000	
マルハニチロ	200	2,260.00	452,000	
サカタのタネ	200	3,475.00	695,000	
ホクト	100	1,959.00	195,900	
ショーボンドホールディングス	200	4,260.00	852,000	
ミライト・ホールディングス	400	1,308.00	523,200	
タマホーム	100	1,194.00	119,400	
日本アクア	100	612.00	61,200	
ＴＡＴＥＲＵ	300	123.00	36,900	
スペースバリューホールディングス	200	316.00	63,200	
住石ホールディングス	300	117.00	35,100	
三井松島ホールディングス	100	840.00	84,000	
国際石油開発帝石	5,900	635.00	3,746,500	
石油資源開発	200	1,816.00	363,200	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	100	1,529.00	152,900	
安藤・間	900	641.00	576,900	
東急建設	400	526.00	210,400	
コムシスホールディングス	500	2,782.00	1,391,000	

ビーアールホールディングス	200	469.00	93,800	
高松コンストラクショングループ	100	2,145.00	214,500	
ヤマウラ	100	711.00	71,100	
大成建設	1,100	3,090.00	3,399,000	
大林組	3,400	890.00	3,026,000	
清水建設	3,400	800.00	2,720,000	
飛島建設	100	991.00	99,100	
長谷工コーポレーション	1,300	1,129.00	1,467,700	
松井建設	100	596.00	59,600	
鹿島建設	2,700	1,044.00	2,818,800	
不動テトラ	100	1,256.00	125,600	
鉄建建設	100	2,153.00	215,300	
西松建設	300	1,897.00	569,100	
三井住友建設	800	410.00	328,000	
大豊建設	100	2,186.00	218,600	
前田建設工業	900	794.00	714,600	
佐田建設	100	344.00	34,400	
ナカノフドー建設	100	317.00	31,700	
奥村組	200	2,188.00	437,600	
東鉄工業	100	2,710.00	271,000	
富士ピー・エス	100	485.00	48,500	
戸田建設	1,400	606.00	848,400	
熊谷組	200	2,223.00	444,600	
矢作建設工業	200	731.00	146,200	
ピーエス三菱	100	511.00	51,100	
日本ハウスホールディングス	200	284.00	56,800	
大東建託	400	10,375.00	4,150,000	
新日本建設	100	757.00	75,700	
ＮＩＰＰＯ	300	2,275.00	682,500	
前田道路	300	1,975.00	592,500	
東亜建設工業	100	1,325.00	132,500	
日本国土開発	200	507.00	101,400	
若築建設	100	1,141.00	114,100	
東洋建設	400	415.00	166,000	
五洋建設	1,300	515.00	669,500	
世紀東急工業	200	760.00	152,000	
住友林業	900	1,255.00	1,129,500	
日本基礎技術	100	388.00	38,800	
巴コーポレーション	200	327.00	65,400	
大和ハウス工業	3,400	2,629.50	8,940,300	
ライト工業	200	1,244.00	248,800	
積水ハウス	3,700	1,761.50	6,517,550	
日特建設	100	704.00	70,400	
北陸電気工事	100	881.00	88,100	
ユアテック	200	621.00	124,200	
中電工	100	2,055.00	205,500	
関電工	500	835.00	417,500	
きんでん	800	1,635.00	1,308,000	
東京エネシス	100	689.00	68,900	
住友電設	100	2,109.00	210,900	

日本電設工業	200	2,101.00	420,200	
協和エクシオ	500	2,513.00	1,256,500	
新日本空調	100	1,985.00	198,500	
日本工営	100	2,746.00	274,600	
九電工	200	2,685.00	537,000	
三機工業	200	1,175.00	235,000	
日揮ホールディングス	1,000	986.00	986,000	
ヤマト	100	646.00	64,600	
太平電業	100	2,165.00	216,500	
高砂熱学工業	300	1,613.00	483,900	
ＮＥＣネッツエスアイ	100	4,725.00	472,500	
明星工業	200	676.00	135,200	
大氣社	200	2,900.00	580,000	
ダイダン	100	2,559.00	255,900	
日比谷総合設備	100	1,763.00	176,300	
日本製粉	300	1,654.00	496,200	
日清製粉グループ本社	1,200	1,648.00	1,977,600	
昭和産業	100	3,270.00	327,000	
鳥越製粉	100	872.00	87,200	
中部飼料	100	1,564.00	156,400	
フィード・ワン	700	157.00	109,900	
日本甜菜製糖	100	1,654.00	165,400	
三井製糖	100	2,168.00	216,800	
塩水港精糖	100	201.00	20,100	
日新製糖	100	1,879.00	187,900	
ＬＩＦＵＬＬ	400	342.00	136,800	
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,111.00	111,100	
日本Ｍ＆Ａセンター	800	3,690.00	2,952,000	
ＵＴグループ	100	1,377.00	137,700	
タケエイ	100	757.00	75,700	
ビーネックスグループ	100	600.00	60,000	
コシダカホールディングス	200	427.00	85,400	
パソナグループ	100	1,061.00	106,100	
リンクアンドモチベーション	200	351.00	70,200	
ＧＣＡ	100	627.00	62,700	
エス・エム・エス	300	2,179.00	653,700	
パーソルホールディングス	1,000	1,075.00	1,075,000	
クックパッド	400	319.00	127,600	
アイ・ケイ・ケイ	100	648.00	64,800	
森永製菓	300	4,670.00	1,401,000	
江崎グリコ	300	4,785.00	1,435,500	
名糖産業	100	1,301.00	130,100	
不二家	100	2,094.00	209,400	
山崎製パン	800	2,235.00	1,788,000	
亀田製菓	100	5,130.00	513,000	
寿スピリッツ	100	4,660.00	466,000	
カルビー	500	3,290.00	1,645,000	
森永乳業	200	4,300.00	860,000	
六甲バター	100	1,415.00	141,500	
ヤクルト本社	700	7,000.00	4,900,000	

明治ホールディングス	700	7,650.00	5,355,000	
雪印メグミルク	300	2,433.00	729,900	
プリマハム	200	2,365.00	473,000	
日本ハム	400	3,460.00	1,384,000	
丸大食品	100	1,908.00	190,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	100	2,286.00	228,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	700	624.00	436,800	
スタジオアリス	100	1,417.00	141,700	
シミックホールディングス	100	1,418.00	141,800	
システナ	400	1,466.00	586,400	
デジタルアーツ	100	6,310.00	631,000	
日鉄ソリューションズ	200	2,775.00	555,000	
綜合警備保障	400	5,440.00	2,176,000	
キューブシステム	100	660.00	66,000	
いちご	1,400	240.00	336,000	
日本駐車場開発	1,200	132.00	158,400	
カカクコム	800	2,320.00	1,856,000	
セントケア・ホールディング	100	402.00	40,200	
ルネサンス	100	946.00	94,600	
ディップ	100	1,934.00	193,400	
ＳＢＳホールディングス	100	1,757.00	175,700	
オプトホールディング	100	1,535.00	153,500	
新日本科学	100	570.00	57,000	
ツクイ	200	421.00	84,200	
ベネフィット・ワン	300	1,976.00	592,800	
エムスリー	2,300	4,005.00	9,211,500	
ツカダ・グローバルホールディング	100	340.00	34,000	
アウトソーシング	600	481.00	288,600	
ウェルネット	100	502.00	50,200	
ディー・エヌ・エー	500	1,273.00	636,500	
博報堂ＤＹホールディングス	1,400	1,106.00	1,548,400	
ぐるなび	200	556.00	111,200	
タカミヤ	100	413.00	41,300	
ジャパンベストレスキューシステム	100	736.00	73,600	
ファンコミュニケーションズ	300	431.00	129,300	
エスプール	200	761.00	152,200	
ティア	100	556.00	55,600	
バリューコマース	100	2,042.00	204,200	
インフォマート	1,100	734.00	807,400	
サッポロホールディングス	400	1,975.00	790,000	
アサヒグループホールディングス	2,300	3,549.00	8,162,700	
キリンホールディングス	4,600	2,071.00	9,526,600	
宝ホールディングス	800	752.00	601,600	
オエノンホールディングス	300	413.00	123,900	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	800	2,037.00	1,629,600	
サントリー食品インターナショナル	700	3,970.00	2,779,000	
ダイドーグループホールディングス	100	3,925.00	392,500	
伊藤園	300	6,200.00	1,860,000	
キーコーヒー	100	2,204.00	220,400	

日清オイリオグループ	100	3,450.00	345,000	
不二製油グループ本社	300	2,661.00	798,300	
Ｊ－オイルミルズ	100	4,100.00	410,000	
ローソン	300	6,080.00	1,824,000	
サンエー	100	4,560.00	456,000	
カワチ薬品	100	2,437.00	243,700	
エービーシー・マート	200	5,390.00	1,078,000	
アスクル	100	3,515.00	351,500	
ゲオホールディングス	200	1,353.00	270,600	
アダストリア	100	1,378.00	137,800	
ジーフット	100	440.00	44,000	
くら寿司	100	4,360.00	436,000	
キャンドゥ	100	1,805.00	180,500	
エレマテック	100	797.00	79,700	
パルグループホールディングス	100	1,303.00	130,300	
エディオン	500	911.00	455,500	
あらた	100	4,300.00	430,000	
サーラコーポレーション	200	560.00	112,000	
ＪＰホールディングス	300	269.00	80,700	
フジオフードシステム	100	1,246.00	124,600	
ひらまつ	200	144.00	28,800	
フィールズ	100	328.00	32,800	
双日	5,900	250.00	1,475,000	
アルフレッサ　ホールディングス	1,200	2,122.00	2,546,400	
ハニーズホールディングス	100	1,103.00	110,300	
キッコーマン	800	4,890.00	3,912,000	
味の素	2,400	1,913.50	4,592,400	
キユーピー	600	2,130.00	1,278,000	
ハウス食品グループ本社	400	3,315.00	1,326,000	
カゴメ	400	2,669.00	1,067,600	
焼津水産化学工業	100	909.00	90,900	
アリアケジャパン	100	6,620.00	662,000	
ニチレイ	500	2,739.00	1,369,500	
横浜冷凍	300	871.00	261,300	
東洋水産	600	5,420.00	3,252,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	869.00	86,900	
日清食品ホールディングス	500	9,100.00	4,550,000	
永谷園ホールディングス	100	2,174.00	217,400	
フジッコ	100	1,970.00	197,000	
ロック・フィールド	100	1,354.00	135,400	
日本たばこ産業	6,300	1,975.00	12,442,500	
ケンコーマヨネーズ	100	2,004.00	200,400	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,553.00	155,300	
なとり	100	1,704.00	170,400	
北の達人コーポレーション	400	468.00	187,200	
ユーグレナ	500	678.00	339,000	
スター・マイカ・ホールディングス	100	1,312.00	131,200	
ＡＤワークスグループ	200	163.00	32,600	
片倉工業	200	1,025.00	205,000	
グンゼ	100	3,670.00	367,000	

ヒューリック	2,300	1,021.00	2,348,300	
ラサ商事	100	831.00	83,100	
アルペン	100	1,566.00	156,600	
クオールホールディングス	200	1,194.00	238,800	
アルコニックス	100	1,072.00	107,200	
神戸物産	400	5,410.00	2,164,000	
ジンズホールディングス	100	5,690.00	569,000	
ビックカメラ	600	910.00	546,000	
ＤＣＭホールディングス	600	1,041.00	624,600	
ペッパーフードサービス	100	439.00	43,900	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	800	3,190.00	2,552,000	
あい　ホールディングス	200	1,354.00	270,800	
アークランドサービスホールディングス	100	1,630.00	163,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	1,300	785.00	1,020,500	
ドトール・日レスホールディングス	200	1,679.00	335,800	
マツモトキヨシホールディングス	400	3,795.00	1,518,000	
ブロンコビリー	100	2,021.00	202,100	
ＺＯＺＯ	700	1,753.00	1,227,100	
ココカラファイン	100	5,180.00	518,000	
三越伊勢丹ホールディングス	1,900	615.00	1,168,500	
東洋紡	400	1,193.00	477,200	
ユニチカ	300	303.00	90,900	
富士紡ホールディングス	100	2,516.00	251,600	
日清紡ホールディングス	700	695.00	486,500	
倉敷紡績	100	2,590.00	259,000	
ダイワボウホールディングス	100	6,560.00	656,000	
シキボウ	100	1,115.00	111,500	
日東紡績	200	5,080.00	1,016,000	
トヨタ紡織	300	1,261.00	378,300	
マクニカ・富士エレホールディングス	300	1,394.00	418,200	
ウエルシアホールディングス	300	8,410.00	2,523,000	
クリエイトＳＤホールディングス	200	3,105.00	621,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	1,090.00	218,000	
八洲電機	100	807.00	80,700	
メディアスホールディングス	100	913.00	91,300	
レスターホールディングス	100	1,682.00	168,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	100	379.00	37,900	
ＴＯＫＡＩホールディングス	600	933.00	559,800	
三洋貿易	100	849.00	84,900	
シュッピン	100	716.00	71,600	
ウイン・パートナーズ	100	906.00	90,600	
ネクステージ	200	670.00	134,000	
ジョイフル本田	300	1,280.00	384,000	
ホットランド	100	1,031.00	103,100	
すかいらーくホールディングス	1,200	1,566.00	1,879,200	
日本毛織	300	908.00	272,400	
ダイトウボウ	200	139.00	27,800	
ダイドーリミテッド	100	195.00	19,500	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	1,053.00	315,900	
野村不動産ホールディングス	600	1,698.00	1,018,800	
三重交通グループホールディングス	200	476.00	95,200	
サムティ	200	1,337.00	267,400	
ディア・ライフ	100	407.00	40,700	
日本商業開発	100	1,310.00	131,000	
プレサンスコーポレーション	200	1,084.00	216,800	
ＴＨＥグローバル社	100	319.00	31,900	
日本管理センター	100	1,015.00	101,500	
フージャースホールディングス	200	601.00	120,200	
オープンハウス	300	2,260.00	678,000	
東急不動産ホールディングス	2,900	502.00	1,455,800	
飯田グループホールディングス	900	1,371.00	1,233,900	
ムゲンエステート	100	446.00	44,600	
帝国繊維	100	2,115.00	211,500	
日本コークス工業	900	61.00	54,900	
あさひ	100	1,280.00	128,000	
日本調剤	100	1,685.00	168,500	
シップヘルスケアホールディングス	200	4,775.00	955,000	
トーエル	100	779.00	77,900	
セブン＆アイ・ホールディングス	4,200	3,621.00	15,208,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	600	591.00	354,600	
ツルハホールディングス	200	14,740.00	2,948,000	
サンマルクホールディングス	100	1,771.00	177,100	
トリドールホールディングス	300	1,225.00	367,500	
帝人	900	1,744.00	1,569,600	
東レ	7,700	480.10	3,696,770	
クラレ	1,700	1,056.00	1,795,200	
旭化成	7,000	726.70	5,086,900	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	100	289.00	28,900	
稲葉製作所	100	1,259.00	125,900	
トーカロ	300	1,021.00	306,300	
ＳＵＭＣＯ	1,300	1,519.00	1,974,700	
ハウスドゥ	100	754.00	75,400	
日本フエルト	100	428.00	42,800	
エコナックホールディングス	200	89.00	17,800	
アツギ	100	631.00	63,100	
ＪＭホールディングス	100	2,304.00	230,400	
コメダホールディングス	200	1,619.00	323,800	
アレンザホールディングス	100	821.00	82,100	
バロックジャパンリミテッド	100	600.00	60,000	
クスリのアオキホールディングス	100	8,860.00	886,000	
共和レザー	100	634.00	63,400	
スシローグローバルホールディングス	500	1,739.00	869,500	
ＬＩＸＩＬビバ	100	1,840.00	184,000	
セーレン	300	1,243.00	372,900	
小松マテーレ	200	725.00	145,000	
ワコールホールディングス	300	2,207.00	662,100	

ホギメディカル	100	3,480.00	348,000	
レナウン	300	79.00	23,700	
ＴＳＩホールディングス	400	375.00	150,000	
ワールド	200	1,265.00	253,000	
ＴＩＳ	1,100	2,052.00	2,257,200	
グリー	700	416.00	291,200	
コーエーテクモホールディングス	200	2,842.00	568,400	
ＡＧＳ	100	750.00	75,000	
ファインデックス	100	851.00	85,100	
ＫＬａｂ	200	704.00	140,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	100	846.00	84,600	
ネクソン	3,000	1,841.00	5,523,000	
アイスタイル	300	282.00	84,600	
エイチーム	100	717.00	71,700	
エニグモ	100	892.00	89,200	
テクノスジャパン	100	390.00	39,000	
コロプラ	300	880.00	264,000	
オルトプラス	100	450.00	45,000	
ブロードリーフ	500	497.00	248,500	
デジタルハーツホールディングス	100	816.00	81,600	
システム情報	100	839.00	83,900	
じげん	300	309.00	92,700	
ブイキューブ	100	1,322.00	132,200	
ディー・エル・イー	100	118.00	11,800	
フィックスターズ	100	1,081.00	108,100	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	100	851.00	85,100	
オプティム	100	2,556.00	255,600	
特種東海製紙	100	4,000.00	400,000	
ティーガイア	100	2,128.00	212,800	
日本アジアグループ	100	239.00	23,900	
テクマトリックス	100	2,647.00	264,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	300	1,638.00	491,400	
GMOペイメントゲートウェイ	200	9,300.00	1,860,000	
インターネットイニシアティブ	200	3,920.00	784,000	
さくらインターネット	100	621.00	62,100	
ＳＲＡホールディングス	100	2,168.00	216,800	
朝日ネット	100	860.00	86,000	
ｅＢＡＳＥ	100	960.00	96,000	
アバント	100	928.00	92,800	
フリービット	100	770.00	77,000	
コムチュア	100	2,358.00	235,800	
アステリア	100	640.00	64,000	
王子ホールディングス	4,400	541.00	2,380,400	
日本製紙	500	1,516.00	758,000	
三菱製紙	100	340.00	34,000	
北越コーポレーション	700	400.00	280,000	
大王製紙	500	1,451.00	725,500	
マークラインズ	100	1,760.00	176,000	

メディカル・データ・ビジョン	100	775.00	77,500	
ｇｕｍｉ	100	680.00	68,000	
オープンドア	100	935.00	93,500	
ＬＩＮＥ	200	5,240.00	1,048,000	
カナミックネットワーク	100	703.00	70,300	
レンゴー	1,000	812.00	812,000	
トーモク	100	1,524.00	152,400	
ザ・パック	100	3,335.00	333,500	
オークネット	100	1,063.00	106,300	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	100	472.00	47,200	
マクロミル	200	688.00	137,600	
昭和電工	800	2,338.00	1,870,400	
住友化学	7,800	315.00	2,457,000	
日産化学	600	3,870.00	2,322,000	
クレハ	100	4,260.00	426,000	
テイカ	100	1,557.00	155,700	
石原産業	200	571.00	114,200	
日本曹達	200	2,749.00	549,800	
東ソー	1,600	1,261.00	2,017,600	
トクヤマ	300	2,255.00	676,500	
セントラル硝子	200	1,810.00	362,000	
東亜合成	700	964.00	674,800	
大阪ソーダ	100	2,427.00	242,700	
関東電化工業	300	869.00	260,700	
デンカ	400	2,599.00	1,039,600	
イビデン	700	2,353.00	1,647,100	
信越化学工業	1,800	11,840.00	21,312,000	
堺化学工業	100	1,712.00	171,200	
第一稀元素化学工業	100	712.00	71,200	
エア・ウォーター	1,000	1,494.00	1,494,000	
大陽日酸	1,000	1,676.00	1,676,000	
日本パーカライジング	500	1,122.00	561,000	
高圧ガス工業	200	681.00	136,200	
四国化成工業	200	1,026.00	205,200	
ステラ　ケミファ	100	2,356.00	235,600	
日本触媒	200	5,010.00	1,002,000	
大日精化工業	100	2,228.00	222,800	
カネカ	300	2,880.00	864,000	
協和キリン	1,100	2,379.00	2,616,900	
三菱瓦斯化学	1,000	1,269.00	1,269,000	
三井化学	1,000	1,900.00	1,900,000	
ＪＳＲ	1,000	1,923.00	1,923,000	
東京応化工業	200	4,255.00	851,000	
大阪有機化学工業	100	1,571.00	157,100	
三菱ケミカルホールディングス	7,100	603.20	4,282,720	
ＫＨネオケム	200	1,659.00	331,800	
ダイセル	1,500	804.00	1,206,000	
住友ベークライト	200	2,547.00	509,400	
積水化学工業	2,300	1,352.00	3,109,600	
日本ゼオン	1,000	837.00	837,000	

アイカ工業	300	2,997.00	899,100	
宇部興産	500	1,656.00	828,000	
積水樹脂	200	1,987.00	397,400	
タキロンシーアイ	200	561.00	112,200	
旭有機材	100	1,298.00	129,800	
日立化成	500	4,610.00	2,305,000	
ニチバン	100	1,453.00	145,300	
リケンテクノス	300	470.00	141,000	
大倉工業	100	1,533.00	153,300	
積水化成品工業	100	587.00	58,700	
タイガースポリマー	100	451.00	45,100	
ダイキョーニシカワ	200	504.00	100,800	
森六ホールディングス	100	1,403.00	140,300	
日本化薬	700	965.00	675,500	
カーリットホールディングス	100	474.00	47,400	
ＥＰＳホールディングス	200	1,159.00	231,800	
プレステージ・インターナショナル	400	874.00	349,600	
プロトコーポレーション	100	868.00	86,800	
アミューズ	100	2,190.00	219,000	
野村総合研究所	1,500	2,595.00	3,892,500	
サイバネットシステム	100	630.00	63,000	
クイック	100	1,032.00	103,200	
ＴＡＣ	100	169.00	16,900	
ＣＥホールディングス	100	466.00	46,600	
ケネディクス	1,000	449.00	449,000	
電通グループ	1,100	2,127.00	2,339,700	
インテージホールディングス	100	753.00	75,300	
ソースネクスト	500	325.00	162,500	
シーティーエス	100	531.00	53,100	
インフォコム	100	2,927.00	292,700	
メディカルシステムネットワーク	100	465.00	46,500	
日本精化	100	1,560.00	156,000	
扶桑化学工業	100	3,155.00	315,500	
ラクスル	100	2,322.00	232,200	
ＦＩＧ	100	241.00	24,100	
ＡＤＥＫＡ	500	1,293.00	646,500	
日油	400	3,660.00	1,464,000	
新日本理化	200	182.00	36,400	
ハリマ化成グループ	100	951.00	95,100	
アルテリア・ネットワークス	100	2,158.00	215,800	
花王	2,600	8,760.00	22,776,000	
三洋化成工業	100	3,970.00	397,000	
武田薬品工業	9,000	3,656.00	32,904,000	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	9,400	1,756.00	16,506,400	
大日本住友製薬	800	1,436.00	1,148,800	
塩野義製薬	1,400	5,500.00	7,700,000	
わかもと製薬	100	232.00	23,200	
あすか製薬	100	1,106.00	110,600	
日本新薬	300	8,150.00	2,445,000	

中外製薬	1,100	13,260.00	14,586,000	
科研製薬	200	5,540.00	1,108,000	
エーザイ	1,300	7,916.00	10,290,800	
理研ビタミン	100	1,992.00	199,200	
ロート製薬	600	3,165.00	1,899,000	
小野薬品工業	2,500	2,524.50	6,311,250	
久光製薬	300	4,930.00	1,479,000	
有機合成薬品工業	100	310.00	31,000	
持田製薬	200	4,070.00	814,000	
参天製薬	2,000	1,908.00	3,816,000	
ツムラ	300	2,881.00	864,300	
日医工	300	1,335.00	400,500	
テルモ	3,100	3,568.00	11,060,800	
みらかホールディングス	300	2,348.00	704,400	
キッセイ薬品工業	200	2,533.00	506,600	
生化学工業	200	1,045.00	209,000	
栄研化学	200	2,057.00	411,400	
鳥居薬品	100	2,975.00	297,500	
ＪＣＲファーマ	100	10,560.00	1,056,000	
東和薬品	100	2,190.00	219,000	
富士製薬工業	100	1,139.00	113,900	
沢井製薬	200	5,850.00	1,170,000	
ゼリア新薬工業	200	2,055.00	411,000	
第一三共	3,100	7,373.00	22,856,300	
キョーリン製薬ホールディングス	200	2,284.00	456,800	
大幸薬品	100	1,847.00	184,700	
ダイト	100	3,460.00	346,000	
大塚ホールディングス	2,100	4,236.00	8,895,600	
大正製薬ホールディングス	200	6,610.00	1,322,000	
ペプチドリーム	600	3,830.00	2,298,000	
大日本塗料	100	823.00	82,300	
日本ペイントホールディングス	900	6,090.00	5,481,000	
関西ペイント	1,200	2,063.00	2,475,600	
神東塗料	100	156.00	15,600	
中国塗料	300	825.00	247,500	
日本特殊塗料	100	795.00	79,500	
藤倉化成	100	480.00	48,000	
太陽ホールディングス	100	4,115.00	411,500	
ＤＩＣ	400	2,394.00	957,600	
サカタインクス	200	882.00	176,400	
東洋インキＳＣホールディングス	200	2,012.00	402,400	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	100	731.00	73,100	
アルプス技研	100	1,565.00	156,500	
サニックス	200	313.00	62,600	
日本空調サービス	100	734.00	73,400	
オリエンタルランド	1,100	14,440.00	15,884,000	
フォーカスシステムズ	100	729.00	72,900	
ダスキン	300	2,768.00	830,400	
パーク２４	600	1,536.00	921,600	
明光ネットワークジャパン	100	778.00	77,800	

ファルコホールディングス	100	1,649.00	164,900	
クレスコ	100	1,390.00	139,000	
フジ・メディア・ホールディングス	1,000	1,049.00	1,049,000	
ラウンドワン	300	789.00	236,700	
リゾートトラスト	500	1,078.00	539,000	
オービック	400	15,190.00	6,076,000	
ジャストシステム	200	6,500.00	1,300,000	
ＴＤＣソフト	100	844.00	84,400	
Ｚホールディングス	14,600	393.00	5,737,800	
ビー・エム・エル	100	2,694.00	269,400	
トレンドマイクロ	500	5,030.00	2,515,000	
りらいあコミュニケーションズ	200	1,140.00	228,000	
リソー教育	500	268.00	134,000	
日本オラクル	200	10,360.00	2,072,000	
フューチャー	100	1,563.00	156,300	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	100	1,062.00	106,200	
ユー・エス・エス	1,200	1,672.00	2,006,400	
オービックビジネスコンサルタント	100	4,205.00	420,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	500	3,345.00	1,672,500	
アイティフォー	100	637.00	63,700	
サイバーエージェント	600	4,390.00	2,634,000	
楽天	4,800	930.00	4,464,000	
クリーク・アンド・リバー社	100	886.00	88,600	
テー・オー・ダブリュー	200	280.00	56,000	
大塚商会	600	4,915.00	2,949,000	
サイボウズ	100	2,230.00	223,000	
ソフトブレーン	100	443.00	44,300	
山田コンサルティンググループ	100	1,092.00	109,200	
電通国際情報サービス	100	4,350.00	435,000	
ＡＣＣＥＳＳ	100	911.00	91,100	
デジタルガレージ	200	3,770.00	754,000	
イーエムシステムズ	100	829.00	82,900	
ＣＩＪ	100	790.00	79,000	
日本エンタープライズ	100	239.00	23,900	
WOWOW	100	2,406.00	240,600	
スカラ	100	514.00	51,400	
フルキャストホールディングス	100	1,285.00	128,500	
エン・ジャパン	200	2,211.00	442,200	
富士フイルムホールディングス	2,100	5,362.00	11,260,200	
コニカミノルタ	2,400	403.00	967,200	
資生堂	2,200	6,868.00	15,109,600	
ライオン	1,400	2,325.00	3,255,000	
高砂香料工業	100	2,047.00	204,700	
マンダム	200	2,073.00	414,600	
ミルボン	100	5,210.00	521,000	
ファンケル	400	2,551.00	1,020,400	
コーセー	200	14,190.00	2,838,000	
コタ	100	1,201.00	120,100	
ポーラ・オルビスホールディングス	500	2,142.00	1,071,000	
ノエビアホールディングス	100	5,320.00	532,000	

エステー	100	1,538.00	153,800	
コニシ	200	1,414.00	282,800	
長谷川香料	100	2,107.00	210,700	
星光ＰＭＣ	100	621.00	62,100	
小林製薬	300	10,610.00	3,183,000	
荒川化学工業	100	1,219.00	121,900	
メック	100	1,526.00	152,600	
タカラバイオ	300	2,288.00	686,400	
ＪＣＵ	100	2,317.00	231,700	
新田ゼラチン	100	664.00	66,400	
デクセリアルズ	300	675.00	202,500	
アース製薬	100	6,060.00	606,000	
北興化学工業	100	568.00	56,800	
クミアイ化学工業	400	847.00	338,800	
日本農薬	200	435.00	87,000	
ニチレキ	100	1,291.00	129,100	
ユシロ化学工業	100	1,125.00	112,500	
富士石油	300	182.00	54,600	
出光興産	1,200	2,399.00	2,878,800	
ＪＸＴＧホールディングス	16,300	365.50	5,957,650	
コスモエネルギーホールディングス	300	1,503.00	450,900	
横浜ゴム	600	1,336.00	801,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	600	1,184.00	710,400	
ブリヂストン	3,100	3,250.00	10,075,000	
住友ゴム工業	1,000	1,000.00	1,000,000	
藤倉コンポジット	100	352.00	35,200	
オカモト	100	4,445.00	444,500	
アキレス	100	1,638.00	163,800	
ニッタ	100	1,889.00	188,900	
住友理工	200	554.00	110,800	
三ツ星ベルト	100	1,345.00	134,500	
バンドー化学	200	609.00	121,800	
ＡＧＣ	1,100	2,522.00	2,774,200	
日本板硝子	500	316.00	158,000	
有沢製作所	200	790.00	158,000	
日本電気硝子	400	1,414.00	565,600	
住友大阪セメント	200	3,400.00	680,000	
太平洋セメント	700	2,117.00	1,481,900	
日本ヒューム	100	555.00	55,500	
日本コンクリート工業	200	239.00	47,800	
三谷セキサン	100	4,380.00	438,000	
アジアパイルホールディングス	200	403.00	80,600	
東海カーボン	1,100	910.00	1,001,000	
日本カーボン	100	3,300.00	330,000	
東洋炭素	100	1,413.00	141,300	
ノリタケカンパニーリミテド	100	3,340.00	334,000	
ＴＯＴＯ	800	3,460.00	2,768,000	
日本碍子	1,300	1,308.00	1,700,400	
日本特殊陶業	800	1,523.00	1,218,400	
ダントーホールディングス	100	81.00	8,100	

ヨータイ	100	611.00	61,100	
イソライト工業	100	398.00	39,800	
東京窯業	100	277.00	27,700	
フジミインコーポレーテッド	100	2,863.00	286,300	
ニチアス	300	1,978.00	593,400	
日本製鉄	4,800	850.30	4,081,440	
神戸製鋼所	2,000	348.00	696,000	
中山製鋼所	100	377.00	37,700	
合同製鐵	100	1,881.00	188,100	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	2,900	707.00	2,050,300	
東京製鐵	500	665.00	332,500	
共英製鋼	100	1,322.00	132,200	
大和工業	200	2,029.00	405,800	
大阪製鐵	100	1,140.00	114,000	
淀川製鋼所	100	1,669.00	166,900	
丸一鋼管	300	2,442.00	732,600	
大同特殊鋼	200	3,305.00	661,000	
日本冶金工業	100	1,531.00	153,100	
山陽特殊製鋼	100	891.00	89,100	
愛知製鋼	100	2,776.00	277,600	
日立金属	1,200	1,092.00	1,310,400	
大平洋金属	100	1,677.00	167,700	
新日本電工	700	150.00	105,000	
栗本鐵工所	100	1,679.00	167,900	
日本製鋼所	300	1,261.00	378,300	
三菱製鋼	100	812.00	81,200	
日亜鋼業	200	255.00	51,000	
大紀アルミニウム工業所	200	552.00	110,400	
日本軽金属ホールディングス	2,700	164.00	442,800	
三井金属鉱業	300	1,902.00	570,600	
東邦亜鉛	100	1,217.00	121,700	
三菱マテリアル	700	2,045.00	1,431,500	
住友金属鉱山	1,400	2,448.50	3,427,900	
ＤＯＷＡホールディングス	300	2,881.00	864,300	
古河機械金属	200	1,044.00	208,800	
エス・サイエンス	500	36.00	18,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	893.00	89,300	
東邦チタニウム	200	596.00	119,200	
ＵＡＣＪ	200	1,603.00	320,600	
古河電気工業	300	1,935.00	580,500	
住友電気工業	4,000	1,065.50	4,262,000	
フジクラ	1,300	285.00	370,500	
昭和電線ホールディングス	100	1,003.00	100,300	
タツタ電線	200	489.00	97,800	
リョービ	100	1,204.00	120,400	
アーレスティ	100	357.00	35,700	
アサヒホールディングス	200	2,290.00	458,000	
東洋製罐グループホールディングス	700	1,054.00	737,800	
ホッカンホールディングス	100	1,526.00	152,600	

コロナ	100	938.00	93,800	
横河ブリッジホールディングス	200	1,836.00	367,200	
ＯＳＪＢホールディングス	500	226.00	113,000	
三和ホールディングス	1,000	780.00	780,000	
文化シヤッター	300	766.00	229,800	
三協立山	100	879.00	87,900	
アルインコ	100	973.00	97,300	
ＬＩＸＩＬグループ	1,600	1,245.00	1,992,000	
日本フイルコン	100	485.00	48,500	
ノーリツ	200	1,100.00	220,000	
長府製作所	100	2,107.00	210,700	
リンナイ	200	8,100.00	1,620,000	
ユニプレス	200	915.00	183,000	
ダイニチ工業	100	636.00	63,600	
日東精工	100	478.00	47,800	
岡部	200	719.00	143,800	
ジーテクト	100	1,052.00	105,200	
東プレ	200	1,177.00	235,400	
高周波熱錬	200	585.00	117,000	
東京製綱	100	545.00	54,500	
サンコール	100	397.00	39,700	
モリテックスチール	100	274.00	27,400	
パイオラックス	200	1,596.00	319,200	
エイチワン	100	492.00	49,200	
日本発条	1,100	688.00	756,800	
三浦工業	500	4,125.00	2,062,500	
タクマ	400	1,205.00	482,000	
テクノプロ・ホールディングス	200	5,060.00	1,012,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	100	809.00	80,900	
イー・ガーディアン	100	1,848.00	184,800	
リブセンス	100	254.00	25,400	
ジャパンマテリアル	300	1,563.00	468,900	
ベクトル	100	832.00	83,200	
ウチヤマホールディングス	100	329.00	32,900	
チャーム・ケア・コーポレーション	100	847.00	84,700	
ＩＢＪ	100	719.00	71,900	
Ｎ・フィールド	100	435.00	43,500	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	100	3,010.00	301,000	
シグマクシス	100	1,643.00	164,300	
ウィルグループ	100	615.00	61,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	184.00	18,400	
リクルートホールディングス	7,400	2,924.00	21,637,600	
エラン	100	1,757.00	175,700	
ツガミ	200	881.00	176,200	
オークマ	100	3,480.00	348,000	
芝浦機械	100	2,083.00	208,300	
アマダ	1,400	885.00	1,239,000	
アイダエンジニアリング	300	713.00	213,900	
ＦＵＪＩ	500	1,657.00	828,500	
牧野フライス製作所	100	2,846.00	284,600	

オーエスジー	500	1,283.00	641,500	
旭ダイヤモンド工業	300	462.00	138,600	
ＤＭＧ森精機	700	952.00	666,400	
ソディック	300	718.00	215,400	
ディスコ	100	24,630.00	2,463,000	
日東工器	100	1,759.00	175,900	
パンチ工業	100	330.00	33,000	
日本郵政	8,500	816.50	6,940,250	
ベルシステム２４ホールディングス	200	1,168.00	233,600	
鎌倉新書	100	1,070.00	107,000	
ソラスト	300	1,063.00	318,900	
インソース	100	2,262.00	226,200	
豊田自動織機	900	5,290.00	4,761,000	
豊和工業	100	672.00	67,200	
東洋機械金属	100	410.00	41,000	
島精機製作所	200	1,544.00	308,800	
オプトラン	100	2,963.00	296,300	
イワキ	100	903.00	90,300	
フリュー	100	850.00	85,000	
ヤマシンフィルタ	200	910.00	182,000	
日阪製作所	100	718.00	71,800	
やまびこ	200	778.00	155,600	
平田機工	100	4,845.00	484,500	
ペガサスミシン製造	100	348.00	34,800	
ナブテスコ	600	2,865.00	1,719,000	
三井海洋開発	100	1,398.00	139,800	
レオン自動機	100	1,191.00	119,100	
ＳＭＣ	300	48,810.00	14,643,000	
オイレス工業	100	1,348.00	134,800	
サトーホールディングス	200	2,071.00	414,200	
技研製作所	100	4,055.00	405,500	
日精樹脂工業	100	963.00	96,300	
小松製作所	4,900	1,962.00	9,613,800	
住友重機械工業	600	2,168.00	1,300,800	
日立建機	400	2,514.00	1,005,600	
日工	100	575.00	57,500	
井関農機	100	1,142.00	114,200	
ＴＯＷＡ	100	882.00	88,200	
シンニッタン	200	258.00	51,600	
クボタ	5,700	1,263.50	7,201,950	
東洋エンジニアリング	100	334.00	33,400	
月島機械	200	1,193.00	238,600	
帝国電機製作所	100	1,330.00	133,000	
新東工業	300	736.00	220,800	
澁谷工業	100	2,541.00	254,100	
アイチコーポレーション	200	661.00	132,200	
小森コーポレーション	300	723.00	216,900	
鶴見製作所	100	1,933.00	193,300	
荏原製作所	400	2,223.00	889,200	
酉島製作所	100	755.00	75,500	

北越工業	100	1,007.00	100,700	
ダイキン工業	1,400	13,290.00	18,606,000	
栗田工業	600	2,718.00	1,630,800	
椿本チエイン	200	2,412.00	482,400	
大同工業	100	618.00	61,800	
日機装	300	820.00	246,000	
木村化工機	100	445.00	44,500	
レイズネクスト	200	1,179.00	235,800	
アネスト岩田	200	882.00	176,400	
ダイフク	600	7,170.00	4,302,000	
加藤製作所	100	1,224.00	122,400	
タダノ	500	775.00	387,500	
フジテック	400	1,548.00	619,200	
ＣＫＤ	300	1,764.00	529,200	
キトー	100	1,002.00	100,200	
平和	300	1,780.00	534,000	
理想科学工業	100	1,461.00	146,100	
ＳＡＮＫＹＯ	200	3,030.00	606,000	
日本金銭機械	100	535.00	53,500	
マースグループホールディングス	100	1,652.00	165,200	
フクシマガリレイ	100	3,195.00	319,500	
竹内製作所	200	1,413.00	282,600	
アマノ	300	2,400.00	720,000	
ＪＵＫＩ	200	585.00	117,000	
サンデンホールディングス	100	340.00	34,000	
蛇の目ミシン工業	100	422.00	42,200	
ブラザー工業	1,300	1,701.00	2,211,300	
マックス	200	1,532.00	306,400	
モリタホールディングス	200	1,636.00	327,200	
グローリー	300	2,349.00	704,700	
新晃工業	100	1,401.00	140,100	
大和冷機工業	200	903.00	180,600	
セガサミーホールディングス	1,100	1,302.00	1,432,200	
リケン	100	2,807.00	280,700	
ＴＰＲ	100	1,195.00	119,500	
ツバキ・ナカシマ	200	678.00	135,600	
ホシザキ	300	7,800.00	2,340,000	
大豊工業	100	525.00	52,500	
日本精工	2,000	686.00	1,372,000	
ＮＴＮ	2,500	190.00	475,000	
ジェイテクト	1,000	738.00	738,000	
不二越	100	2,849.00	284,900	
ミネベアミツミ	2,000	1,644.00	3,288,000	
日本トムソン	300	356.00	106,800	
ＴＨＫ	600	2,420.00	1,452,000	
ユーシン精機	100	620.00	62,000	
イーグル工業	100	660.00	66,000	
前澤工業	100	322.00	32,200	
日本ピラー工業	100	1,239.00	123,900	
キッツ	400	629.00	251,600	

日立製作所	5,200	3,067.00	15,948,400	
三菱電機	10,800	1,295.00	13,986,000	
富士電機	700	2,447.00	1,712,900	
安川電機	1,200	3,255.00	3,906,000	
シンフォニア　テクノロジー	100	904.00	90,400	
明電舎	200	1,546.00	309,200	
山洋電気	100	4,505.00	450,500	
デンヨー	100	1,855.00	185,500	
ベイカレント・コンサルティング	100	6,990.00	699,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	100	2,790.00	279,000	
日総工産	100	466.00	46,600	
ＲＰＡホールディングス	100	651.00	65,100	
三櫻工業	100	710.00	71,000	
マキタ	1,400	3,365.00	4,711,000	
東芝テック	100	3,590.00	359,000	
マブチモーター	300	3,200.00	960,000	
日本電産	2,600	5,704.00	14,830,400	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	236.00	23,600	
トレックス・セミコンダクター	100	1,057.00	105,700	
東光高岳	100	883.00	88,300	
ダブル・スコープ	200	358.00	71,600	
ダイヘン	100	2,871.00	287,100	
ヤーマン	200	719.00	143,800	
ＪＶＣケンウッド	900	177.00	159,300	
ミマキエンジニアリング	100	392.00	39,200	
日新電機	300	972.00	291,600	
大崎電気工業	200	491.00	98,200	
オムロン	1,000	5,850.00	5,850,000	
日東工業	200	1,769.00	353,800	
ＩＤＥＣ	200	1,473.00	294,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	400	1,419.00	567,600	
日本電気	1,300	4,250.00	5,525,000	
富士通	1,000	10,565.00	10,565,000	
沖電気工業	400	976.00	390,400	
電気興業	100	2,433.00	243,300	
サンケン電気	100	2,174.00	217,400	
アイホン	100	1,467.00	146,700	
ルネサスエレクトロニクス	5,200	476.00	2,475,200	
セイコーエプソン	1,300	1,053.00	1,368,900	
ワコム	700	379.00	265,300	
アルバック	200	2,897.00	579,400	
ＥＩＺＯ	100	3,270.00	327,000	
ジャパンディスプレイ	3,100	44.00	136,400	
日本信号	300	970.00	291,000	
京三製作所	300	459.00	137,700	
能美防災	100	2,000.00	200,000	
ホーチキ	100	1,293.00	129,300	
星和電機	100	573.00	57,300	
エレコム	100	4,460.00	446,000	

パナソニック	12,400	780.60	9,679,440	代用有価証券 7,500株
シャープ	1,300	1,185.00	1,540,500	
アンリツ	700	2,185.00	1,529,500	
富士通ゼネラル	300	1,716.00	514,800	
ソニー	6,900	6,878.00	47,458,200	代用有価証券 3,700株
ＴＤＫ	500	8,830.00	4,415,000	
タムラ製作所	400	392.00	156,800	
アルプスアルパイン	1,000	1,053.00	1,053,000	
日本電波工業	100	396.00	39,600	
鈴木	100	741.00	74,100	
ローランド　ディー．ジー．	100	1,293.00	129,300	
フォスター電機	100	1,142.00	114,200	
ヨコオ	100	2,461.00	246,100	
ティアック	100	149.00	14,900	
ホシデン	300	883.00	264,900	
ヒロセ電機	200	10,760.00	2,152,000	
日本航空電子工業	200	1,389.00	277,800	
ＴＯＡ	100	702.00	70,200	
マクセルホールディングス	200	1,002.00	200,400	
古野電気	100	813.00	81,300	
スミダコーポレーション	100	696.00	69,600	
アイコム	100	2,579.00	257,900	
本多通信工業	100	403.00	40,300	
船井電機	100	452.00	45,200	
横河電機	1,000	1,393.00	1,393,000	
アズビル	700	2,818.00	1,972,600	
東亜ディーケーケー	100	899.00	89,900	
日本光電工業	400	3,880.00	1,552,000	
共和電業	100	380.00	38,000	
堀場製作所	200	5,380.00	1,076,000	
アドバンテスト	800	5,030.00	4,024,000	
エスペック	100	1,658.00	165,800	
キーエンス	1,000	36,940.00	36,940,000	
日置電機	100	3,015.00	301,500	
シスメックス	800	7,309.00	5,847,200	
日本マイクロニクス	200	820.00	164,000	
メガチップス	100	1,591.00	159,100	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	100	2,710.00	271,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	100	366.00	36,600	
デンソー	2,400	3,744.00	8,985,600	
原田工業	100	801.00	80,100	
コーセル	100	920.00	92,000	
イリソ電子工業	100	2,925.00	292,500	
オプテックスグループ	200	1,106.00	221,200	
千代田インテグレ	100	1,697.00	169,700	
レーザーテック	500	6,200.00	3,100,000	
スタンレー電気	800	2,393.00	1,914,400	
ウシオ電機	600	1,026.00	615,600	

岡谷電機産業	100	344.00	34,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	100	335.00	33,500	
日本セラミック	100	1,891.00	189,100	
遠藤照明	100	547.00	54,700	
古河電池	100	559.00	55,900	
双信電機	100	324.00	32,400	
山一電機	100	1,407.00	140,700	
図研	100	2,250.00	225,000	
日本電子	200	2,965.00	593,000	
カシオ計算機	1,000	1,719.00	1,719,000	
ファナック	1,000	14,820.00	14,820,000	
日本シイエムケイ	300	407.00	122,100	
エンプラス	100	2,290.00	229,000	
ローム	500	6,630.00	3,315,000	
浜松ホトニクス	800	4,635.00	3,708,000	
三井ハイテック	100	1,147.00	114,700	
新光電気工業	400	1,186.00	474,400	
京セラ	1,500	5,908.00	8,862,000	
太陽誘電	500	2,922.00	1,461,000	
村田製作所	3,200	5,781.00	18,499,200	
双葉電子工業	200	991.00	198,200	
日東電工	700	4,960.00	3,472,000	
東海理化電機製作所	300	1,319.00	395,700	
ニチコン	400	661.00	264,400	
日本ケミコン	100	1,114.00	111,400	
ＫＯＡ	200	900.00	180,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	400	553.00	221,200	
日立造船	900	329.00	296,100	
三菱重工業	1,800	2,649.50	4,769,100	
川崎重工業	800	1,492.00	1,193,600	
ＩＨＩ	800	1,293.00	1,034,400	
名村造船所	300	188.00	56,400	
サノヤスホールディングス	100	145.00	14,500	
カーブスホールディングス	300	525.00	157,500	
三菱ロジスネクスト	100	944.00	94,400	
ＦＰＧ	300	574.00	172,200	
じもとホールディングス	700	92.00	64,400	
全国保証	300	2,916.00	874,800	
めぶきフィナンシャルグループ	5,600	219.00	1,226,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	1,101.00	110,100	
九州フィナンシャルグループ	1,800	420.00	756,000	
かんぽ生命保険	400	1,301.00	520,400	
ゆうちょ銀行	3,000	961.00	2,883,000	
富山第一銀行	300	266.00	79,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	6,300	305.00	1,921,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	700	606.00	424,200	
アルヒ	200	1,223.00	244,600	
プレミアグループ	100	1,518.00	151,800	

日産自動車	12,800	366.20	4,687,360	
いすゞ自動車	3,100	748.30	2,319,730	
トヨタ自動車	12,100	6,635.00	80,283,500	代用有価証券 9,000株
日野自動車	1,400	598.00	837,200	
三菱自動車工業	4,000	298.00	1,192,000	
エフテック	100	440.00	44,000	
武蔵精密工業	200	844.00	168,800	
日産車体	200	799.00	159,800	
新明和工業	300	1,103.00	330,900	
極東開発工業	200	1,237.00	247,400	
日信工業	200	2,170.00	434,000	
トピー工業	100	1,200.00	120,000	
曙ブレーキ工業	600	175.00	105,000	
タチエス	200	959.00	191,800	
ＮＯＫ	600	1,104.00	662,400	
フタバ産業	300	483.00	144,900	
ＫＹＢ	100	2,059.00	205,900	
市光工業	200	445.00	89,000	
大同メタル工業	200	518.00	103,600	
プレス工業	500	250.00	125,000	
ミクニ	100	238.00	23,800	
太平洋工業	200	828.00	165,600	
ケーヒン	200	2,504.00	500,800	
河西工業	100	483.00	48,300	
アイシン精機	900	2,931.00	2,637,900	
マツダ	3,200	562.00	1,798,400	
今仙電機製作所	100	711.00	71,100	
本田技研工業	8,500	2,451.50	20,837,750	代用有価証券 6,000株
スズキ	2,100	3,205.00	6,730,500	
ＳＵＢＡＲＵ	3,400	2,075.00	7,055,000	
安永	100	978.00	97,800	
ヤマハ発動機	1,400	1,271.00	1,779,400	
ショーワ	300	2,214.00	664,200	
小糸製作所	600	3,950.00	2,370,000	
ＴＢＫ	100	452.00	45,200	
エクセディ	100	1,627.00	162,700	
ミツバ	200	436.00	87,200	
豊田合成	300	1,824.00	547,200	
愛三工業	200	554.00	110,800	
日本プラスト	100	425.00	42,500	
ヨロズ	100	1,056.00	105,600	
エフ・シー・シー	200	1,504.00	300,800	
シマノ	400	16,120.00	6,448,000	
テイ・エス　テック	300	2,790.00	837,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	600	328.00	196,800	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,414.00	141,400	
第四北越フィナンシャルグループ	200	2,123.00	424,600	
ジャムコ	100	650.00	65,000	

小野建	100	1,132.00	113,200	
ノジマ	200	1,826.00	365,200	
佐鳥電機	100	838.00	83,800	
カッパ・クリエイト	100	1,327.00	132,700	
伯東	100	931.00	93,100	
コンドーテック	100	886.00	88,600	
中山福	100	477.00	47,700	
ライトオン	100	483.00	48,300	
ナガイレーベン	200	2,712.00	542,400	
三菱食品	100	2,666.00	266,600	
良品計画	1,400	1,204.00	1,685,600	
三城ホールディングス	100	266.00	26,600	
松田産業	100	1,328.00	132,800	
第一興商	200	3,060.00	612,000	
メディパルホールディングス	1,200	2,055.00	2,466,000	
アドヴァン	200	1,059.00	211,800	
アズワン	100	9,250.00	925,000	
シモジマ	100	1,201.00	120,100	
ドウシシャ	100	1,272.00	127,200	
コナカ	100	326.00	32,600	
高速	100	1,295.00	129,500	
Ｇ－７ホールディングス	100	2,441.00	244,100	
イオン北海道	100	732.00	73,200	
コジマ	200	394.00	78,800	
コーナン商事	200	2,401.00	480,200	
ネットワンシステムズ	400	2,751.00	1,100,400	
ワタミ	100	1,014.00	101,400	
システムソフト	300	75.00	22,500	
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	2,300	2,098.00	4,825,400	
丸文	100	501.00	50,100	
西松屋チェーン	200	827.00	165,400	
ゼンショーホールディングス	500	2,116.00	1,058,000	
ハピネット	100	1,071.00	107,100	
幸楽苑ホールディングス	100	1,441.00	144,100	
日本ライフライン	300	1,224.00	367,200	
サイゼリヤ	200	1,989.00	397,800	
タカショー	100	473.00	47,300	
ＶＴホールディングス	400	291.00	116,400	
アルゴグラフィックス	100	3,410.00	341,000	
ＩＤＯＭ	300	449.00	134,700	
日本エム・ディ・エム	100	1,560.00	156,000	
ユナイテッドアローズ	100	1,720.00	172,000	
進和	100	1,725.00	172,500	
ハイデイ日高	200	1,571.00	314,200	
シークス	100	826.00	82,600	
京都きもの友禅	100	258.00	25,800	
コロワイド	400	1,543.00	617,200	
ピーシーデポコーポレーション	100	548.00	54,800	
オーハシテクニカ	100	1,360.00	136,000	

壱番屋	100	4,215.00	421,500	
スギホールディングス	200	6,380.00	1,276,000	
島津製作所	1,300	2,809.00	3,651,700	
ＪＭＳ	100	856.00	85,600	
長野計器	100	763.00	76,300	
ブイ・テクノロジー	100	3,520.00	352,000	
スター精密	200	1,065.00	213,000	
東京計器	100	735.00	73,500	
インターアクション	100	2,167.00	216,700	
オーバル	100	211.00	21,100	
東京精密	200	3,225.00	645,000	
マニー	400	2,312.00	924,800	
ニコン	1,800	956.00	1,720,800	
トプコン	500	824.00	412,000	
オリンパス	6,000	1,697.00	10,182,000	
理研計器	100	2,031.00	203,100	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	200	4,615.00	923,000	
キヤノン電子	100	1,547.00	154,700	
タムロン	100	1,757.00	175,700	
ＨＯＹＡ	2,200	9,793.00	21,544,600	
ノーリツ鋼機	100	1,087.00	108,700	
エー・アンド・デイ	100	735.00	73,500	
朝日インテック	900	2,849.00	2,564,100	
キヤノン	5,800	2,243.00	13,009,400	代用有価証券 4,100株
リコー	2,800	741.00	2,074,800	
シチズン時計	1,300	356.00	462,800	
大研医器	100	660.00	66,000	
メニコン	200	5,130.00	1,026,000	
スノーピーク	100	787.00	78,700	
パラマウントベッドホールディングス	100	4,325.00	432,500	
トランザクション	100	987.00	98,700	
ニホンフラッシュ	100	1,173.00	117,300	
前田工繊	100	1,969.00	196,900	
永大産業	100	264.00	26,400	
アートネイチャー	100	659.00	65,900	
バンダイナムコホールディングス	1,100	5,409.00	5,949,900	
共立印刷	200	151.00	30,200	
ＳＨＯＥＩ	100	2,038.00	203,800	
フランスベッドホールディングス	200	855.00	171,000	
マーベラス	200	537.00	107,400	
パイロットコーポレーション	200	3,490.00	698,000	
萩原工業	100	1,272.00	127,200	
エイベックス	200	803.00	160,600	
トッパン・フォームズ	200	958.00	191,600	
フジシールインターナショナル	200	1,800.00	360,000	
タカラトミー	500	842.00	421,000	
廣済堂	100	844.00	84,400	
アーク	400	89.00	35,600	
レック	100	1,196.00	119,600	

三光合成	100	258.00	25,800	
プロネクサス	100	1,003.00	100,300	
ホクシン	100	115.00	11,500	
大建工業	100	1,604.00	160,400	
きもと	200	137.00	27,400	
凸版印刷	1,500	1,570.00	2,355,000	
大日本印刷	1,400	2,262.00	3,166,800	
ＮＩＳＳＨＡ	200	726.00	145,200	
藤森工業	100	3,005.00	300,500	
ヴィア・ホールディングス	100	429.00	42,900	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	100	1,787.00	178,700	
前澤化成工業	100	1,014.00	101,400	
未来工業	100	1,940.00	194,000	
アシックス	900	999.00	899,100	
ＪＳＰ	100	1,350.00	135,000	
ニチハ	200	1,942.00	388,400	
エフピコ	100	7,950.00	795,000	
ヤマハ	600	4,260.00	2,556,000	
クリナップ	100	531.00	53,100	
ピジョン	700	4,035.00	2,824,500	
天馬	100	1,510.00	151,000	
キングジム	100	838.00	83,800	
象印マホービン	300	1,529.00	458,700	
リンテック	300	2,298.00	689,400	
信越ポリマー	200	850.00	170,000	
東リ	300	254.00	76,200	
イトーキ	200	297.00	59,400	
任天堂	700	45,930.00	32,151,000	
三菱鉛筆	200	1,323.00	264,600	
タカラスタンダード	200	1,537.00	307,400	
コクヨ	500	1,362.00	681,000	
ナカバヤシ	100	530.00	53,000	
ニフコ	400	1,893.00	757,200	
オカムラ	400	784.00	313,600	
バルカー	100	1,785.00	178,500	
伊藤忠商事	7,500	2,127.50	15,956,250	
丸紅	11,100	495.40	5,498,940	
スクロール	200	301.00	60,200	
ヨンドシーホールディングス	100	1,714.00	171,400	
三陽商会	100	857.00	85,700	
長瀬産業	600	1,245.00	747,000	
蝶理	100	1,528.00	152,800	
豊田通商	1,200	2,390.00	2,868,000	
オンワードホールディングス	600	370.00	222,000	
三共生興	200	457.00	91,400	
兼松	400	1,055.00	422,000	
美津濃	100	1,756.00	175,600	
ファミリーマート	900	1,848.00	1,663,200	
三井物産	9,400	1,470.00	13,818,000	
日本紙パルプ商事	100	3,520.00	352,000	

東京エレクトロン	700	23,245.00	16,271,500	
日立ハイテク	400	7,940.00	3,176,000	
カメイ	100	982.00	98,200	
セイコーホールディングス	200	1,655.00	331,000	
山善	400	875.00	350,000	
住友商事	6,700	1,177.50	7,889,250	
日本ユニシス	300	3,045.00	913,500	
三菱商事	7,500	2,185.00	16,387,500	代用有価証券 5,200株
第一実業	100	3,495.00	349,500	
キヤノンマーケティングジャパン	300	2,086.00	625,800	
西華産業	100	1,086.00	108,600	
佐藤商事	100	769.00	76,900	
菱洋エレクトロ	100	2,465.00	246,500	
東京産業	100	488.00	48,800	
ユアサ商事	100	2,929.00	292,900	
トルク	100	299.00	29,900	
阪和興業	200	1,612.00	322,400	
正栄食品工業	100	3,820.00	382,000	
カナデン	100	1,251.00	125,100	
菱電商事	100	1,295.00	129,500	
ニプロ	700	1,191.00	833,700	
フルサト工業	100	1,323.00	132,300	
岩谷産業	200	3,695.00	739,000	
イワキ	100	420.00	42,000	
兼松エレクトロニクス	100	3,440.00	344,000	
三愛石油	300	1,087.00	326,100	
稲畑産業	200	1,163.00	232,600	
明和産業	100	473.00	47,300	
キムラタン	600	24.00	14,400	
ゴールドウイン	200	5,720.00	1,144,000	
ユニ・チャーム	2,100	4,074.00	8,555,400	
デサント	200	1,321.00	264,200	
キング	100	461.00	46,100	
ワキタ	200	976.00	195,200	
ヤマトインターナショナル	100	340.00	34,000	
東邦ホールディングス	300	2,223.00	666,900	
サンゲツ	300	1,574.00	472,200	
ミツウロコグループホールディングス	200	1,070.00	214,000	
伊藤忠エネクス	200	813.00	162,600	
サンリオ	300	1,559.00	467,700	
サンワ　テクノス	100	797.00	79,700	
リョーサン	100	2,309.00	230,900	
新光商事	200	863.00	172,600	
三信電気	100	1,449.00	144,900	
東陽テクニカ	100	994.00	99,400	
モスフードサービス	100	2,707.00	270,700	
加賀電子	100	1,827.00	182,700	
三益半導体工業	100	2,114.00	211,400	
ソーダニッカ	100	604.00	60,400	

立花エレテック	100	1,470.00	147,000	
木曽路	100	2,409.00	240,900	
ＳＲＳホールディングス	100	860.00	86,000	
千趣会	200	377.00	75,400	
タカキュー	100	126.00	12,600	
ケーヨー	200	524.00	104,800	
上新電機	100	1,946.00	194,600	
日本瓦斯	200	3,720.00	744,000	
ロイヤルホールディングス	200	1,723.00	344,600	
いなげや	100	1,599.00	159,900	
島忠	200	2,719.00	543,800	
チヨダ	100	995.00	99,500	
ライフコーポレーション	100	3,380.00	338,000	
リンガーハット	100	2,095.00	209,500	
ＭｒＭａｘＨＤ	100	441.00	44,100	
テンアライド	100	349.00	34,900	
ＡＯＫＩホールディングス	200	677.00	135,400	
オークワ	200	1,473.00	294,600	
コメリ	200	2,003.00	400,600	
青山商事	200	869.00	173,800	
しまむら	100	6,660.00	666,000	
はせがわ	100	404.00	40,400	
高島屋	800	907.00	725,600	
松屋	200	617.00	123,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	500	793.00	396,500	
丸井グループ	1,000	1,628.00	1,628,000	
クレディセゾン	700	1,107.00	774,900	
アクシアル　リテイリング	100	3,945.00	394,500	
井筒屋	100	161.00	16,100	
イオン	4,100	2,178.50	8,931,850	
イズミ	200	2,882.00	576,400	
平和堂	200	1,797.00	359,400	
フジ	100	1,618.00	161,800	
ヤオコー	100	6,760.00	676,000	
ゼビオホールディングス	100	861.00	86,100	
ケーズホールディングス	1,000	1,154.00	1,154,000	
ＰＡＬＴＡＣ	200	5,500.00	1,100,000	
三谷産業	100	320.00	32,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	100	612.00	61,200	
日産東京販売ホールディングス	200	206.00	41,200	
新生銀行	800	1,269.00	1,015,200	
あおぞら銀行	600	1,933.00	1,159,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	73,100	418.70	30,606,970	
りそなホールディングス	11,700	318.50	3,726,450	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,000	3,040.00	6,080,000	
三井住友フィナンシャルグループ	7,400	2,714.00	20,083,600	
千葉銀行	3,600	474.00	1,706,400	
群馬銀行	2,100	342.00	718,200	
武蔵野銀行	200	1,302.00	260,400	
千葉興業銀行	300	235.00	70,500	

筑波銀行	400	163.00	65,200	
七十七銀行	400	1,355.00	542,000	
青森銀行	100	1,992.00	199,200	
秋田銀行	100	1,278.00	127,800	
山形銀行	100	1,317.00	131,700	
岩手銀行	100	2,530.00	253,000	
東邦銀行	1,000	244.00	244,000	
東北銀行	100	866.00	86,600	
みちのく銀行	100	1,032.00	103,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	900	1,327.00	1,194,300	
静岡銀行	2,600	612.00	1,591,200	
十六銀行	100	1,832.00	183,200	
スルガ銀行	1,100	354.00	389,400	
八十二銀行	2,600	369.00	959,400	
山梨中央銀行	100	749.00	74,900	
大垣共立銀行	200	2,115.00	423,000	
福井銀行	100	1,455.00	145,500	
北國銀行	100	3,435.00	343,500	
滋賀銀行	200	2,530.00	506,000	
南都銀行	200	2,102.00	420,400	
百五銀行	1,000	305.00	305,000	
京都銀行	400	3,525.00	1,410,000	
紀陽銀行	400	1,539.00	615,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	700	842.00	589,400	
広島銀行	1,600	429.00	686,400	
山陰合同銀行	600	553.00	331,800	
中国銀行	900	979.00	881,100	
伊予銀行	1,500	601.00	901,500	
百十四銀行	100	1,891.00	189,100	
四国銀行	200	783.00	156,600	
阿波銀行	200	2,514.00	502,800	
大分銀行	100	2,053.00	205,300	
宮崎銀行	100	2,230.00	223,000	
佐賀銀行	100	1,013.00	101,300	
沖縄銀行	100	3,155.00	315,500	
琉球銀行	200	954.00	190,800	
セブン銀行	3,600	293.00	1,054,800	
みずほフィナンシャルグループ	145,200	122.30	17,757,960	
山口フィナンシャルグループ	1,300	550.00	715,000	
芙蓉総合リース	100	5,220.00	522,000	
みずほリース	200	2,105.00	421,000	
東京センチュリー	200	3,600.00	720,000	
ＳＢＩホールディングス	1,200	1,779.00	2,134,800	
日本証券金融	500	484.00	242,000	
アイフル	1,600	224.00	358,400	
日本アジア投資	100	215.00	21,500	
名古屋銀行	100	2,175.00	217,500	
北洋銀行	1,600	189.00	302,400	
愛媛銀行	100	1,109.00	110,900	
京葉銀行	500	506.00	253,000	

栃木銀行	500	152.00	76,000	
東和銀行	200	609.00	121,800	
福島銀行	100	155.00	15,500	
大東銀行	100	567.00	56,700	
リコーリース	100	2,813.00	281,300	
イオンフィナンシャルサービス	700	1,022.00	715,400	
アコム	2,100	420.00	882,000	
ジャックス	100	1,618.00	161,800	
オリエントコーポレーション	2,900	120.00	348,000	
日立キャピタル	300	2,075.00	622,500	
アプラスフィナンシャル	500	62.00	31,000	
オリックス	6,700	1,238.50	8,297,950	
三菱ＵＦＪリース	2,700	503.00	1,358,100	
ジャフコ	200	3,210.00	642,000	
九州リースサービス	100	419.00	41,900	
トモニホールディングス	800	393.00	314,400	
大和証券グループ本社	8,600	409.20	3,519,120	
野村ホールディングス	18,800	420.00	7,896,000	
岡三証券グループ	900	319.00	287,100	
丸三証券	300	429.00	128,700	
東洋証券	400	124.00	49,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,200	232.00	278,400	
水戸証券	300	199.00	59,700	
いちよし証券	200	421.00	84,200	
松井証券	600	793.00	475,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	2,000	3,375.00	6,750,000	
だいこう証券ビジネス	100	523.00	52,300	
日本取引所グループ	3,100	2,081.00	6,451,100	
マネックスグループ	800	198.00	158,400	
極東証券	100	512.00	51,200	
岩井コスモホールディングス	100	924.00	92,400	
藍澤證券	200	730.00	146,000	
フィデアホールディングス	1,000	97.00	97,000	
池田泉州ホールディングス	1,200	160.00	192,000	
アニコム　ホールディングス	100	3,945.00	394,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	2,800	2,939.00	8,229,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	900	1,879.00	1,691,100	
マネーパートナーズグループ	100	207.00	20,700	
スパークス・グループ	400	176.00	70,400	
第一生命ホールディングス	6,000	1,324.00	7,944,000	
東京海上ホールディングス	3,800	4,843.00	18,403,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	100	724.00	72,400	
イー・ギャランティ	100	1,911.00	191,100	
アサックス	100	621.00	62,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	3,200	880.00	2,816,000	
三井不動産	5,300	1,855.00	9,831,500	
三菱地所	7,500	1,742.50	13,068,750	

平和不動産	200	2,700.00	540,000	
東京建物	1,100	1,118.00	1,229,800	
ダイビル	300	869.00	260,700	
京阪神ビルディング	200	1,339.00	267,800	
住友不動産	2,400	2,703.00	6,487,200	
テーオーシー	200	610.00	122,000	
レオパレス２１	1,400	238.00	333,200	
スターツコーポレーション	100	2,044.00	204,400	
フジ住宅	100	472.00	47,200	
空港施設	100	423.00	42,300	
明和地所	100	417.00	41,700	
ゴールドクレスト	100	1,592.00	159,200	
リログループ	600	2,328.00	1,396,800	
日神グループホールディングス	200	390.00	78,000	
日本エスコン	200	616.00	123,200	
タカラレーベン	500	340.00	170,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	100	618.00	61,800	
イオンモール	500	1,267.00	633,500	
ランド	5,800	9.00	52,200	
カチタス	300	1,797.00	539,100	
東祥	100	958.00	95,800	
トーセイ	100	1,005.00	100,500	
サンフロンティア不動産	100	796.00	79,600	
エフ・ジェー・ネクスト	100	821.00	82,100	
グランディハウス	100	322.00	32,200	
東武鉄道	1,100	3,580.00	3,938,000	
相鉄ホールディングス	300	2,737.00	821,100	
東急	2,700	1,645.00	4,441,500	
京浜急行電鉄	1,400	1,800.00	2,520,000	
小田急電鉄	1,600	2,387.00	3,819,200	
京王電鉄	600	6,100.00	3,660,000	
京成電鉄	800	3,170.00	2,536,000	
富士急行	100	2,861.00	286,100	
東日本旅客鉄道	1,900	8,134.00	15,454,600	
西日本旅客鉄道	1,000	6,665.00	6,665,000	
東海旅客鉄道	900	17,185.00	15,466,500	
西武ホールディングス	1,500	1,251.00	1,876,500	
鴻池運輸	200	1,144.00	228,800	
西日本鉄道	300	2,511.00	753,300	
ハマキョウレックス	100	2,820.00	282,000	
サカイ引越センター	100	5,500.00	550,000	
近鉄グループホールディングス	1,000	5,090.00	5,090,000	
阪急阪神ホールディングス	1,400	3,655.00	5,117,000	
南海電気鉄道	500	2,323.00	1,161,500	
京阪ホールディングス	500	4,820.00	2,410,000	
名古屋鉄道	800	3,055.00	2,444,000	
山陽電気鉄道	100	1,998.00	199,800	
日本通運	400	5,040.00	2,016,000	
ヤマトホールディングス	1,800	1,901.00	3,421,800	
山九	300	3,930.00	1,179,000	

日新	100	1,822.00	182,200	
丸運	100	223.00	22,300	
丸全昭和運輸	100	2,327.00	232,700	
センコーグループホールディングス	600	842.00	505,200	
ニッコンホールディングス	400	2,028.00	811,200	
福山通運	100	3,660.00	366,000	
セイノーホールディングス	800	1,200.00	960,000	
日立物流	200	2,444.00	488,800	
丸和運輸機関	100	2,896.00	289,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	100	1,255.00	125,500	
日本郵船	900	1,332.00	1,198,800	
商船三井	600	1,756.00	1,053,600	
川崎汽船	300	974.00	292,200	
ＮＳユナイテッド海運	100	1,349.00	134,900	
明治海運	100	314.00	31,400	
飯野海運	500	302.00	151,000	
九州旅客鉄道	900	3,000.00	2,700,000	
ＳＧホールディングス	1,100	2,880.00	3,168,000	
日本航空	1,800	1,940.00	3,492,000	
ＡＮＡホールディングス	1,900	2,483.00	4,717,700	
国際紙パルプ商事	300	294.00	88,200	
ブックオフグループホールディングス	100	806.00	80,600	
三菱倉庫	300	2,233.00	669,900	
三井倉庫ホールディングス	100	1,408.00	140,800	
住友倉庫	400	1,212.00	484,800	
澁澤倉庫	100	2,049.00	204,900	
ヤマタネ	100	1,204.00	120,400	
東陽倉庫	200	326.00	65,200	
乾汽船	100	1,192.00	119,200	
日本トランスシティ	200	483.00	96,600	
中央倉庫	100	1,047.00	104,700	
安田倉庫	100	854.00	85,400	
宇徳	100	449.00	44,900	
上組	600	1,837.00	1,102,200	
近鉄エクスプレス	200	1,488.00	297,600	
東海運	100	248.00	24,800	
エーアイテイー	100	709.00	70,900	
東京放送ホールディングス	600	1,599.00	959,400	
日本テレビホールディングス	900	1,173.00	1,055,700	
朝日放送グループホールディングス	100	681.00	68,100	
テレビ朝日ホールディングス	300	1,566.00	469,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	700	393.00	275,100	
テレビ東京ホールディングス	100	2,245.00	224,500	
ビジョン	100	824.00	82,400	
ワイヤレスゲート	100	492.00	49,200	
コネクシオ	100	1,374.00	137,400	
日本通信	800	170.00	136,000	
日本電信電話	14,200	2,510.00	35,642,000	
ＫＤＤＩ	7,900	3,144.00	24,837,600	
ソフトバンク	9,700	1,381.50	13,400,550	

光通信	100	20,770.00	2,077,000	
ＮＴＴドコモ	7,900	3,220.00	25,438,000	
エムティーアイ	100	570.00	57,000	
ＧＭＯインターネット	400	2,355.00	942,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	300	1,566.00	469,800	
学研ホールディングス	100	1,805.00	180,500	
ゼンリン	200	1,071.00	214,200	
インプレスホールディングス	100	146.00	14,600	
東京電力ホールディングス	8,700	372.00	3,236,400	
中部電力	3,300	1,529.50	5,047,350	
関西電力	4,100	1,170.50	4,799,050	
中国電力	1,600	1,501.00	2,401,600	
北陸電力	1,000	713.00	713,000	
東北電力	2,700	1,050.00	2,835,000	
四国電力	1,000	833.00	833,000	
九州電力	2,200	899.00	1,977,800	
北海道電力	1,000	431.00	431,000	
沖縄電力	200	1,894.00	378,800	
電源開発	900	2,162.00	1,945,800	
エフオン	100	474.00	47,400	
イーレックス	200	1,442.00	288,400	
レノバ	200	1,045.00	209,000	
東京瓦斯	2,100	2,613.50	5,488,350	
大阪瓦斯	2,100	2,122.00	4,456,200	
東邦瓦斯	500	5,480.00	2,740,000	
北海道瓦斯	100	1,484.00	148,400	
広島ガス	200	341.00	68,200	
西部瓦斯	100	2,620.00	262,000	
静岡ガス	300	953.00	285,900	
メタウォーター	100	4,025.00	402,500	
アイネット	100	1,508.00	150,800	
松竹	100	11,490.00	1,149,000	
東宝	600	3,475.00	2,085,000	
エイチ・アイ・エス	200	1,373.00	274,600	
エヌ・ティ・ティ・データ	2,800	1,071.00	2,998,800	
共立メンテナンス	200	2,414.00	482,800	
イチネンホールディングス	100	1,077.00	107,700	
建設技術研究所	100	1,673.00	167,300	
スペース	100	1,011.00	101,100	
アインホールディングス	100	6,340.00	634,000	
東京都競馬	100	3,380.00	338,000	
カナモト	200	2,073.00	414,600	
東京ドーム	400	760.00	304,000	
ＤＴＳ	200	1,960.00	392,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	500	4,815.00	2,407,500	
シーイーシー	100	1,588.00	158,800	
カプコン	500	3,400.00	1,700,000	
西尾レントオール	100	2,109.00	210,900	

アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	700	21.00	14,700	
日本空港ビルデング	300	4,140.00	1,242,000	
トランス・コスモス	100	2,054.00	205,400	
乃村工藝社	400	752.00	300,800	
ジャステック	100	1,069.00	106,900	
ＳＣＳＫ	200	5,410.00	1,082,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	100	839.00	83,900	
日本管財	100	1,816.00	181,600	
トーカイ	100	2,707.00	270,700	
セコム	1,100	9,087.00	9,995,700	
アイネス	100	1,374.00	137,400	
丹青社	200	688.00	137,600	
メイテック	100	4,295.00	429,500	
ＴＫＣ	100	4,855.00	485,500	
富士ソフト	100	3,785.00	378,500	
応用地質	100	1,197.00	119,700	
船井総研ホールディングス	200	2,199.00	439,800	
ＮＳＤ	300	1,574.00	472,200	
オオバ	100	537.00	53,700	
コナミホールディングス	400	3,270.00	1,308,000	
ベネッセホールディングス	300	2,999.00	899,700	
イオンディライト	100	3,045.00	304,500	
ナック	100	846.00	84,600	
ニチイ学館	100	1,106.00	110,600	
ダイセキ	200	2,303.00	460,600	
日鉄物産	100	3,265.00	326,500	
トラスコ中山	200	2,249.00	449,800	
ヤマダ電機	3,300	504.00	1,663,200	
オートバックスセブン	400	1,272.00	508,800	
モリト	100	661.00	66,100	
アークランドサカモト	200	962.00	192,400	
ニトリホールディングス	500	16,535.00	8,267,500	
グルメ杵屋	100	905.00	90,500	
愛眼	100	212.00	21,200	
ケーユーホールディングス	100	771.00	77,100	
吉野家ホールディングス	400	2,234.00	893,600	
加藤産業	200	3,495.00	699,000	
イノテック	100	856.00	85,600	
イエローハット	200	1,446.00	289,200	
松屋フーズホールディングス	100	3,895.00	389,500	
ＪＢＣＣホールディングス	100	1,879.00	187,900	
ＪＫホールディングス	100	730.00	73,000	
サガミホールディングス	100	1,229.00	122,900	
日伝	100	1,992.00	199,200	
関西スーパーマーケット	100	1,057.00	105,700	
ミロク情報サービス	100	2,600.00	260,000	
北沢産業	100	276.00	27,600	
杉本商事	100	1,675.00	167,500	
因幡電機産業	300	2,183.00	654,900	

王将フードサービス	100	5,750.00	575,000	
プレナス	100	1,815.00	181,500	
ミニストップ	100	1,447.00	144,700	
アークス	200	2,090.00	418,000	
バローホールディングス	200	2,021.00	404,200	
ミスミグループ本社	1,300	2,498.00	3,247,400	
アルテック	100	193.00	19,300	
ベルク	100	6,020.00	602,000	
大　庄	100	1,204.00	120,400	
ファーストリテイリング	100	49,740.00	4,974,000	
ソフトバンクグループ	8,400	4,790.00	40,236,000	
スズケン	500	3,975.00	1,987,500	
サンドラッグ	400	3,655.00	1,462,000	
サックスバー　ホールディングス	100	584.00	58,400	
ジェコス	100	806.00	80,600	
グローセル	100	397.00	39,700	
ベルーナ	200	476.00	95,200	
合計	1,277,300		2,172,570,150	

（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2年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	98,311,911
国債証券	5,825,349,700
地方債証券	826,471,000
特殊債券	731,530,000
社債券	510,178,000
未収利息	12,342,220
前払費用	24,465
流動資産合計	8,004,207,296
資産合計	8,004,207,296
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,572,800
流動負債合計	1,572,800
負債合計	1,572,800
純資産の部	
元本等	
元本	6,214,435,719
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,788,198,777
元本等合計	8,002,634,496
純資産合計	8,002,634,496
負債純資産合計	8,004,207,296

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、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2年4月20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	7,433,503,720円
同期中追加設定元本額	477,907,451円
同期中一部解約元本額	1,696,975,452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	172,412,533円
新光７資産バランスファンド	414,421,755円
日本債券ファンド	4,966,234,405円
世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	495,801,024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）	37,764,317円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	69,390,285円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	36,411,211円
グローバル・ナビ	22,000,189円
計	6,214,435,719円
２．　受益権の総数	6,214,435,719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　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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2年4月20日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△60,461,000
地方債証券	△5,906,330
特殊債券	△5,444,000
社債券	△2,992,000
合計	△74,803,330

（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（令和1年11月12日から令和2年4月20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2年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2877円 (12,877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2年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	１２９回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	60,208,200	
	１３０回　利付国庫債券（５年）	80,000,000	80,327,200	
	１３１回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	60,287,400	
	１３２回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,208,400	
	１３３回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,303,000	
	１３４回　利付国庫債券（５年）	20,000,000	20,133,800	
	１３５回　利付国庫債券（５年）	30,000,000	30,219,300	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,397,000	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,411,500	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	30,000,000	30,254,100	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,432,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,351,200	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,372,400	
	１回　利付国債（４０年）	10,000,000	15,040,600	
	２回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	14,645,700	
	３回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	14,808,800	
	４回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	29,903,800	
	５回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	29,014,800	
	６回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	28,641,600	
	７回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	27,640,200	
	８回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	25,928,200	
	９回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	29,220,000	
	１０回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	34,273,200	
	１１回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	22,195,200	
	１２回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	10,049,100	

３１５回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	81,264,000	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,883,500	
３１９回　利付国庫債券（１０年）	30,000,000	30,626,100	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,960,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,097,500	
３２２回　利付国庫債券（１０年）	20,000,000	20,400,600	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	51,020,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	40,916,400	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	10,000,000	10,224,700	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	71,514,100	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	72,090,900	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	61,612,800	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	30,000,000	30,849,000	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	61,782,000	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	41,082,800	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	30,000,000	30,858,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	40,768,800	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	82,014,400	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	90,000,000	92,407,500	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	61,683,600	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	71,656,200	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	60,767,400	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,683,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,711,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,739,000	

３４６回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,749,000	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,758,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,766,000	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	60,926,400	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	71,059,800	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	60,862,200	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,947,100	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	50,630,500	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	40,464,400	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	60,633,000	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	40,395,600	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	40,366,800	
１０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,350,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	11,962,300	
１２回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,515,200	
１５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,317,800	
１７回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,106,500	
１９回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,033,200	
２０回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,369,700	
２１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,100,300	
２２回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,443,200	
２３回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,485,200	
２６回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,434,100	
２７回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	13,675,300	
２８回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	27,526,200	

２９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	27,329,800	
３０回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	40,701,600	
３１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,922,600	
３２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	41,196,300	
３３回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	39,658,800	
３４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	41,054,700	
３５回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	40,021,200	
３６回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,797,800	
３７回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	39,706,500	
３８回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,123,400	
３９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,613,800	
４０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	26,219,600	
４１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,816,200	
４２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,843,600	
４３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,900,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,927,600	
４５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,023,400	
４６回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,040,600	
４７回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,545,400	
４８回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	24,614,000	
４９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	24,626,400	
５０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,725,200	
５１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	19,252,600	
５２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	20,212,200	
５３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	20,714,200	

５４回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,706,400	
５５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,720,600	
５６回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,708,200	
５７回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,722,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	32,563,200	
５９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,196,800	
６０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,239,400	
６１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,188,800	
６２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	20,127,000	
６３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	19,590,600	
６４回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	9,781,100	
６５回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	9,792,200	
５１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,251,900	
５２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	20,639,800	
５３回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,374,800	
５５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,411,900	
５９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,492,300	
６４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,698,400	
７０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,095,400	
７２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,956,600	
７８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,087,800	
８１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,149,700	
８４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,202,900	
８８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,499,300	
９０回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,496,400	

９２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	34,463,400	
９５回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,472,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,694,900	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,822,100	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,687,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,898,000	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,032,700	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,881,800	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	35,949,000	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,023,900	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,168,600	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,139,200	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,008,400	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,205,400	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,871,200	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,349,600	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,320,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	12,103,200	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,041,000	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,878,200	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,826,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,844,900	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,920,600	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,980,100	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,862,500	

１３６回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,490,000	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,774,200	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,647,500	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,534,600	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	35,733,300	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,853,000	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	24,101,600	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,628,400	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,375,600	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	47,849,200	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	35,949,900	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	47,480,800	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	47,006,400	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	47,065,200	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	46,595,200	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	45,504,400	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	45,528,400	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	34,627,500	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	45,606,800	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	33,316,500	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,525,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	39,413,600	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,283,600	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,904,400	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	31,905,600	

	１６１回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	31,392,000	
	１６２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	31,385,700	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	20,918,800	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,150,000	
	１６５回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	20,565,000	
	１６６回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	31,899,300	
	１６７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,087,200	
	１６８回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,265,800	
	１６９回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	29,703,900	
	１７０回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	9,900,000	
	１７１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	9,898,800	
国債証券　合計		5,310,000,000	5,825,349,700	
地方債証券	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	118,413,000	
	２００回　神奈川県公募公債	35,000,000	35,944,300	
	２１８回　神奈川県公募公債	100,000,000	100,677,000	
	４１２回　大阪府公募公債　１０年	50,000,000	49,903,500	
	１２回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	105,827,000	
	２４年度３回　広島県公募公債	66,000,000	67,260,600	
	２４年度７回　広島県公募公債	100,000,000	101,861,000	
	２４年度１回　福岡県公募公債　３０年	10,000,000	13,387,100	
	１６９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,730,000	
	４８５回　名古屋市公募公債　１０年	30,000,000	30,691,500	
	２４年度２回　広島市公募公債	100,000,000	101,776,000	
地方債証券　合計		791,000,000	826,471,000	
特殊債券	１０４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,010,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	119,309,000	
	２４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,328,000	
	３２７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,899,000	
	３４回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,756,000	

	４９回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,752,000	
	５８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,476,000	
特殊債券　合計		700,000,000	731,530,000	
社債券	４回　第一三共社債	100,000,000	101,984,000	
	１１回　ブリヂストン社債	100,000,000	99,503,000	
	４４回　ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,687,000	
	４７回　野村ホールディングス社債	100,000,000	100,395,000	
	３６回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,609,000	
社債券　合計		500,000,000	510,178,000	
合計			7,893,528,700	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和2年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,777,638
投資証券	1,407,461,160
未収入金	1,641,916
未収配当金	14,144,435
流動資産合計	1,429,025,149
資産合計	1,429,025,149
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,874,000
流動負債合計	2,874,000
負債合計	2,874,000
純資産の部	
元本等	
元本	860,376,939
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	565,774,210
元本等合計	1,426,151,149
純資産合計	1,426,151,149
負債純資産合計	1,429,025,149

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所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2年4月20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	1,160,750,535円
同期中追加設定元本額	118,541,045円
同期中一部解約元本額	418,914,641円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	354,031,541円
グローバル・ナビ	5,906,794円
新光Ｊ－ＲＥＩＴオープン（年２回決算型）	500,438,604円
計	860,376,939円
２．　受益権の総数	860,376,939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　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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2年4月20日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	△515,470,443
合計	△515,470,443

（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2年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6576円 (16,576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2年4月20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	4,313,600	
	ＧＬＰ投資法人	426	54,485,400	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	220	15,994,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	27	6,291,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	38	4,582,800	
	いちごオフィスリート投資法人	132	9,226,800	
	いちごホテルリート投資法人	28	1,850,800	
	さくら総合リート投資法人	37	2,601,100	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	86	28,079,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	162	52,407,000	
	イオンリート投資法人	185	19,980,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,099	15,331,050	
	インヴィンシブル投資法人	751	22,530,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	21	1,961,400	
	オリックス不動産投資法人	341	47,262,600	
	グローバル・ワン不動産投資法人	119	10,757,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	53	29,998,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	112	19,219,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	66	11,404,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	74	23,828,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	34	3,100,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	25	2,207,500	
	ザイマックス・リート投資法人	25	2,330,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	551	22,095,100	
	ジャパンエクセレント投資法人	158	19,497,200	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	171	102,258,000	
	スターアジア不動産投資法人	57	4,685,400	
	スターツプロシード投資法人	27	5,062,500	
	タカラレーベン不動産投資法人	49	4,165,000	
	トーセイ・リート投資法人	37	3,663,000	
	ヒューリックリート投資法人	146	17,826,600	

	フロンティア不動産投資法人	61	19,520,000	
	プレミア投資法人	155	17,685,500	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	36	4,053,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	17	1,557,200	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	384	45,158,400	
	ラサールロジポート投資法人	159	23,850,000	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	36	4,161,600	
	阪急阪神リート投資法人	77	8,939,700	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	49	22,197,000	
	三菱地所物流リート投資法人	34	12,121,000	
	産業ファンド投資法人	220	32,098,000	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	40	3,480,000	
	森トラスト総合リート投資法人	122	15,140,200	
	森ヒルズリート投資法人	197	27,501,200	
	星野リゾート・リート投資法人	26	10,036,000	
	積水ハウス・リート投資法人	500	33,900,000	
	大江戸温泉リート投資法人	29	1,661,700	
	大和ハウスリート投資法人	244	60,731,600	
	大和証券オフィス投資法人	39	23,712,000	
	大和証券リビング投資法人	209	18,929,760	
	投資法人みらい	195	7,985,250	
	東急リアル・エステート投資法人	115	15,881,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	57	36,537,000	
	日本ビルファンド投資法人	166	105,244,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	112	35,728,000	
	日本プロロジスリート投資法人	257	72,499,700	
	日本リート投資法人	56	16,755,200	
	日本リテールファンド投資法人	323	40,439,600	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	112	27,888,000	
	福岡リート投資法人	88	9,433,600	
	平和不動産リート投資法人	107	10,058,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	552	73,581,600	
投資証券　合計		10,063	1,407,461,160	
合計			1,407,461,160	

（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2年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	102,483,318
コール・ローン	6,650,718
株式	1,783,731,257
投資信託受益証券	2,825,440
投資証券	46,248,241
派生商品評価勘定	14,784,212
未収配当金	1,845,670
差入委託証拠金	62,188,979
流動資産合計	2,020,757,835
資産合計	2,020,757,835
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,110
未払解約金	32,916,000
流動負債合計	32,917,110
負債合計	32,917,110
純資産の部	
元本等	
元本	874,534,772
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,113,305,953
元本等合計	1,987,840,725
純資産合計	1,987,840,725
負債純資産合計	2,020,757,835

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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	1,211,262,105円
	同期中追加設定元本額	134,888,918円
	同期中一部解約元本額	471,616,251円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	新光７資産バランスファンド	291,396,487円
	新光外国株式インデックスＶＡ	385,776,364円
	世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	142,331,004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）	7,195,781円
	ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	21,625,146円
	ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	13,618,935円
	グローバル・ナビ	12,591,055円
	計	874,534,772円
２．	受益権の総数	874,534,772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　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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2年4月20日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△161,869,214
投資信託受益証券	△837,665
投資証券	△5,507,028
合計	△168,213,907

（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（令和1年11月12日から令和2年4月20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2年4月20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	31,576,474	－	31,568,050	8,424
アメリカ・ドル	16,405,360	－	16,397,760	7,600
イギリス・ポンド	2,965,710	－	2,964,280	1,430
カナダ・ドル	538,314	－	537,810	504
スイス・フラン	1,114,050	－	1,114,800	△750
ユーロ	10,553,040	－	10,553,400	△360
合計	31,576,474	－	31,568,050	8,424

（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2年4月20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	138,015,387	－	152,790,065	14,774,678
合計	138,015,387	－	152,790,065	14,774,678

（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2年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2730円 (22,730円)

附属明細表
第１　有価証券明細表
（１）株式

令和2年4月20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	205	2,375.000	486,875.000	
	ABBOTT LABORATORIES	857	96.010	82,280.570	
	AES CORP	310	13.120	4,067.200	
	ABIOMED INC	30	166.020	4,980.600	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	435	120.120	52,252.200	
	ADVANCED MICRO DEVICES	486	56.600	27,507.600	
	ADOBE INC	238	344.110	81,898.180	
	CHUBB LTD	221	118.790	26,252.590	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	101	221.500	22,371.500	
	ALLEGHANY CORP	7	558.520	3,909.640	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	53	118.540	6,282.620	
	RALPH LAUREN CORP	7	72.680	508.760	
	ALLSTATE CORP	146	104.920	15,318.320	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	350	138.320	48,412.000	
	AMGEN INC	290	234.970	68,141.300	
	HESS CORP	110	37.350	4,108.500	
	AMERICAN EXPRESS CO	364	87.390	31,809.960	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	237	86.380	20,472.060	
	AFLAC INC	333	36.480	12,147.840	
	AMERICAN INTL GROUP	399	24.500	9,775.500	
	AMERCO	2	275.250	550.500	
	ANALOG DEVICES	167	102.800	17,167.600	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	118	103.480	12,210.640	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	425	29.540	12,554.500	
	JONES LANG LASALLE INC	21	107.000	2,247.000	
	VALERO ENERGY CORP	187	51.760	9,679.120	
	APACHE CORP	234	8.490	1,986.660	
	ANSYS INC	48	263.900	12,667.200	
	APPLE INC	2,162	282.800	611,413.600	
	APPLIED MATERIALS INC	433	53.200	23,035.600	
	ALBEMARLE CORP	71	61.470	4,364.370	

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	334	37.190	12,421.460	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	59	79.910	4,714.690	
AMEREN CORP	132	77.830	10,273.560	
ARROW ELECTRONICS INC	48	55.290	2,653.920	
AUTOLIV INC	50	56.250	2,812.500	
AUTODESK INC	105	180.940	18,998.700	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	221	141.080	31,178.680	
AUTOZONE INC	13	991.800	12,893.400	
AVERY DENNISON CORP	52	109.360	5,686.720	
BALL CORP	161	70.200	11,302.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	639	191.200	122,176.800	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	393	37.390	14,694.270	
BAXTER INTERNATIONAL INC	223	92.950	20,727.850	
BECTON DICKINSON & CO	133	261.400	34,766.200	
AMETEK INC	142	80.310	11,404.020	
VERIZON COMM INC	2,010	58.460	117,504.600	
WR BERKLEY CORP	85	56.990	4,844.150	
BEST BUY CO INC	117	70.400	8,236.800	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	8	427.210	3,417.680	
YUM! BRANDS INC	180	84.170	15,150.600	
FIRSTENERGY CORP	236	46.210	10,905.560	
BOEING CO	268	154.000	41,272.000	
ROBERT HALF INTL INC	4	43.240	172.960	
BORGWARNER INC	67	26.980	1,807.660	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	699	38.290	26,764.710	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	31	74.230	2,301.130	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	52	124.440	6,470.880	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	10	720.910	7,209.100	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,139	60.600	69,023.400	
INGREDION INC	34	80.690	2,743.460	
ONEOK INC	206	29.380	6,052.280	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24	71.360	1,712.640	
UNITED RENTALS INC	16	105.050	1,680.800	
SEMPRA ENERGY	126	124.440	15,679.440	
FEDEX CORP	120	124.850	14,982.000	
VERISIGN INC	44	209.930	9,236.920	
AMPHENOL CORP	127	84.220	10,695.940	
BROWN-FORMAN CORP	159	63.970	10,171.230	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	964	5.290	5,099.560	

CSX CORP	355	62.770	22,283.350	
CABOT OIL & GAS CORP	265	20.960	5,554.400	
CAMPBELL SOUP CO	106	50.340	5,336.040	
SEAGATE TECHNOLOGY	134	51.470	6,896.980	
CONSTELLATION BRANDS INC	91	162.700	14,805.700	
CARDINAL HEALTH INC	123	51.230	6,301.290	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	214	12.560	2,687.840	
CATERPILLAR INC	271	116.300	31,517.300	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	65	106.120	6,897.800	
CITRIX SYSTEMS INC	54	150.410	8,122.140	
CENTURYLINK INC	422	10.250	4,325.500	
CERNER CORP	166	70.010	11,621.660	
JPMORGAN CHASE & CO	1,522	95.180	144,863.960	
CHURCH & DWIGHT CO INC	122	73.550	8,973.100	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	83	85.800	7,121.400	
CINTAS CORP	44	204.160	8,983.040	
CISCO SYSTEMS INC	2,062	42.480	87,593.760	
CLOROX COMPANY	60	193.500	11,610.000	
COCA-COLA CO/THE	1,983	48.060	95,302.980	
COPART INC	106	72.100	7,642.600	
COGNEX CORP	116	47.040	5,456.640	
COLGATE-PALMOLIVE CO	396	73.420	29,074.320	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	166	84.260	13,987.160	
COMERICA INC	146	30.000	4,380.000	
NRG ENERGY, INC.	43	31.370	1,348.910	
COMCAST CORP-CL A	2,210	38.080	84,156.800	
CONAGRA BRANDS INC	235	33.580	7,891.300	
CONSOLIDATED EDISON INC	162	89.560	14,508.720	
CMS ENERGY CORP	159	63.170	10,044.030	
COOPER COS INC	24	306.280	7,350.720	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	66	44.380	2,929.080	
CORNING INC	355	20.720	7,355.600	
SEALED AIR CORP	49	29.500	1,445.500	
HEICO CORP-CL A	57	73.340	4,180.380	
CUMMINS INC	67	149.180	9,995.060	
DR HORTON INC	169	39.880	6,739.720	
DANAHER CORP	305	156.530	47,741.650	
MOODY'S CORP	79	239.360	18,909.440	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	250	53.810	13,452.500	
TARGET CORP	243	113.420	27,561.060	
DEERE & CO	141	138.460	19,522.860	
MORGAN STANLEY	657	39.090	25,682.130	
REPUBLIC SERVICES INC	127	80.280	10,195.560	
COSTAR GROUP INC	19	635.550	12,075.450	

THE WALT DISNEY CO	886	106.630	94,474.180	
DOLLAR TREE INC	121	81.730	9,889.330	
DOVER CORP	90	88.490	7,964.100	
OMNICOM GROUP	116	54.570	6,330.120	
DTE ENERGY CO	116	105.850	12,278.600	
DUKE ENERGY CORP	354	90.100	31,895.400	
FLOWSERVE CORP	94	24.800	2,331.200	
DARDEN RESTAURANTS INC	61	63.350	3,864.350	
EBAY INC	418	37.455	15,656.190	
BANK OF AMERICA CORP	4,170	23.280	97,077.600	
CITIGROUP INC	1,096	45.450	49,813.200	
EASTMAN CHEMICAL CO	115	55.100	6,336.500	
E*TRADE FINANCIAL CORP	83	39.870	3,309.210	
EATON CORP PLC	222	79.260	17,595.720	
EATON VANCE CORP	32	34.540	1,105.280	
CADENCE DESIGN SYS INC	138	78.650	10,853.700	
DISH NETWORK CORP	103	22.520	2,319.560	
ECOLAB INC	117	178.750	20,913.750	
PERKINELMER INC	41	83.630	3,428.830	
ELECTRONIC ARTS INC	149	115.150	17,157.350	
SALESFORCE.COM INC	412	162.620	66,999.440	
EMERSON ELECTRIC CO	342	50.540	17,284.680	
ATMOS ENERGY CORP	44	110.700	4,870.800	
ENTERGY CORP	118	101.270	11,949.860	
EOG RESOURCES INC	350	41.840	14,644.000	
EQUIFAX INC	61	127.970	7,806.170	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	112	174.260	19,517.120	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	50	71.740	3,587.000	
EXXON MOBIL CORP	2,054	43.220	88,773.880	
FMC CORP	75	86.100	6,457.500	
NEXTERA ENERGY INC	237	246.260	58,363.620	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	11	281.100	3,092.100	
ASSURANT INC	41	105.810	4,338.210	
FASTENAL CO	227	35.930	8,156.110	
FIFTH THIRD BANCORP	397	16.630	6,602.110	
M&T BANK CORP	58	105.480	6,117.840	
FISERV INC	272	100.630	27,371.360	
FLIR SYSTEMS INC	12	34.150	409.800	
FORD MOTOR CO	1,785	5.120	9,139.200	
FRANKLIN RESOURCES INC	22	16.340	359.480	
FREEPORT-MCMORAN INC	730	8.340	6,088.200	
FLEX LTD	276	8.165	2,253.540	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	88	83.600	7,356.800	
GAP INC/THE	73	8.350	609.550	
DENTSPLY SIRONA INC	89	40.860	3,636.540	
GENERAL DYNAMICS CORP	113	138.190	15,615.470	
GENERAL MILLS INC	303	60.670	18,383.010	
GENUINE PARTS CO	62	74.650	4,628.300	

GILEAD SCIENCES INC	608	83.990	51,065.920	
GARTNER INC	31	105.960	3,284.760	
MCKESSON CORP	66	141.610	9,346.260	
NVIDIA CORP	284	292.320	83,018.880	
GENERAL ELECTRIC CO	4,308	6.840	29,466.720	
WW GRAINGER INC	22	280.220	6,164.840	
HALLIBURTON CO	348	7.580	2,637.840	
MONSTER BEVERAGE CORP	211	62.190	13,122.090	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	170	183.490	31,193.300	
HARLEY-DAVIDSON INC	73	19.350	1,412.550	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	104	203.500	21,164.000	
HASBRO INC	54	75.200	4,060.800	
HENRY SCHEIN INC	106	53.640	5,685.840	
HERSHEY FOODS CORP	69	146.460	10,105.740	
HP INC	669	15.520	10,382.880	
F5 NETWORKS INC	32	124.110	3,971.520	
CROWN HOLDINGS INC NPR	52	62.900	3,270.800	
JUNIPER NETWORKS INC	279	22.570	6,297.030	
HOLLYFRONTIER CORP	107	27.020	2,891.140	
HOLOGIC INC	119	43.790	5,211.010	
UNUM GROUP	90	15.510	1,395.900	
HOME DEPOT INC	540	209.420	113,086.800	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	86	89.120	7,664.320	
HORMEL FOODS CORP	102	50.510	5,152.020	
CENTERPOINT ENERGY INC	182	16.530	3,008.460	
LENNOX INTERNATIONAL INC	15	183.880	2,758.200	
HUMANA INC	63	373.590	23,536.170	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	38	107.580	4,088.040	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	459	8.060	3,699.540	
BIOGEN INC	88	342.550	30,144.400	
IDEX CORP	47	152.730	7,178.310	
ILLINOIS TOOL WORKS	150	158.580	23,787.000	
INTUIT INC	130	265.360	34,496.800	
IDEXX LABORATORIES INC	42	265.160	11,136.720	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	83	55.070	4,570.810	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	106	89.910	9,530.460	
INTEL CORP	2,113	60.360	127,540.680	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	43	125.120	5,380.160	
INTERNATIONAL PAPER CO	184	31.850	5,860.400	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	144	15.060	2,168.640	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	48	84.200	4,041.600	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	29	169.660	4,920.140	
INCYTE CORP	91	100.000	9,100.000	
JOHNSON & JOHNSON	1,279	152.020	194,433.580	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	167	40.010	6,681.670	
KLA CORPORATION	73	161.210	11,768.330	
DEVON ENERGY CORP	232	9.220	2,139.040	
KELLOGG CO	134	65.020	8,712.680	
EAST WEST BANCORP INC	67	28.010	1,876.670	
KEYCORP	482	10.810	5,210.420	
KIMBERLY-CLARK CORP	171	141.940	24,271.740	
BLACKROCK INC/NEW YORK	55	476.870	26,227.850	
KOHLS CORP	11	18.480	203.280	
KROGER CO	435	31.930	13,889.550	
LAM RESEARCH CORP	67	279.020	18,694.340	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	19	318.080	6,043.520	
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	90.840	3,179.400	
AKAMAI TECHNOLOGIES	85	105.350	8,954.750	
LEGGETT & PLATT INC	50	28.890	1,444.500	
LENNAR CORP	118	42.930	5,065.740	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	198	13.200	2,613.600	
ELI LILLY & CO	421	157.290	66,219.090	
LINCOLN NATIONAL CORP	119	29.660	3,529.540	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	330	102.750	33,907.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	159	79.550	12,648.450	
LOCKHEED MARTIN CORP	124	401.510	49,787.240	
LOEWS CORP	66	36.140	2,385.240	
LOWE'S COS INC	396	97.100	38,451.600	
DOMINION ENERGY INC	378	81.510	30,810.780	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	243	14.080	3,421.440	
MCCORMICK & CO INC	54	156.890	8,472.060	
MCDONALD'S CORPORATION	378	186.100	70,345.800	
S&P GLOBAL INC	127	282.590	35,888.930	
EVEREST RE GROUP LTD	19	196.350	3,730.650	
MANPOWERGROUP INC	35	63.740	2,230.900	
MARKEL CORPORATION	5	954.390	4,771.950	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	100	228.410	22,841.000	
MARSH & MCLENNAN COS	243	98.540	23,945.220	
MASCO CORP	127	39.990	5,078.730	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	26	198.870	5,170.620	
METLIFE INC	384	33.060	12,695.040	

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	103	53.090	5,468.270	
MEDTRONIC PLC	653	103.330	67,474.490	
ACTIVISION BLIZZARD INC	374	66.880	25,013.120	
CVS HEALTH CORP	638	63.360	40,423.680	
MERCK & CO.INC.	1,238	83.460	103,323.480	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	184	13.730	2,526.320	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	48	148.520	7,128.960	
MICROSOFT CORP	3,524	178.600	629,386.400	
MICRON TECH INC	559	45.700	25,546.300	
MIDDLEBY CORP	39	51.680	2,015.520	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	122	80.340	9,801.480	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	360	25.955	9,343.800	
3M CO	264	146.460	38,665.440	
MOHAWK INDUSTRIES INC	41	79.600	3,263.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	68	157.770	10,728.360	
KANSAS CITY SOUTHERN	62	139.360	8,640.320	
MYLAN NV	314	16.110	5,058.540	
ILLUMINA INC	68	316.360	21,512.480	
XCEL ENERGY INC	256	67.150	17,190.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	45	98.960	4,453.200	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	198	11.670	2,310.660	
NETAPP INC	121	42.150	5,100.150	
NEWELL BRANDS INC	259	12.860	3,330.740	
NEWMONT CORP	393	59.230	23,277.390	
NVR INC	2	2,917.750	5,835.500	
NIKE INC-CL B	612	89.910	55,024.920	
NOBLE ENERGY INC	171	6.950	1,188.450	
NORDSTROM INC	35	18.800	658.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	124	160.670	19,923.080	
EVERSOURCE ENERGY	165	91.560	15,107.400	
NISOURCE INC	265	26.380	6,990.700	
TAPESTRY INC	151	15.220	2,298.220	
NORTHERN TRUST CORP	103	80.000	8,240.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	75	356.300	26,722.500	
WELLS FARGO & CO	1,955	28.380	55,482.900	
NUCOR CORP	125	37.330	4,666.250	
CHENIERE ENERGY INC	73	41.330	3,017.090	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	270	54.630	14,750.100	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	405	13.630	5,520.150	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	45	136.650	6,149.250	

OGE ENERGY CORP	108	31.710	3,424.680	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	35	373.510	13,072.850	
ORACLE CORP	1,117	54.620	61,010.540	
PACCAR INC	157	67.650	10,621.050	
PTC INC	57	66.660	3,799.620	
EXELON CORP	442	38.440	16,990.480	
PARKER HANNIFIN CORP	52	138.600	7,207.200	
PAYCHEX INC	193	67.500	13,027.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	43	193.000	8,299.000	
PPL CORPORATION	376	26.390	9,922.640	
PEPSICO INC	676	137.550	92,983.800	
PENTAIR PLC	39	31.660	1,234.740	
PFIZER INC	2,692	36.910	99,361.720	
ESSENTIAL UTILITIES INC	111	43.360	4,812.960	
CONOCOPHILLIPS	613	35.260	21,614.380	
PVH CORP	34	44.880	1,525.920	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	53	76.630	4,061.390	
ALTRIA GROUP INC	930	40.850	37,990.500	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	212	101.500	21,518.000	
BROWN & BROWN INC	112	38.100	4,267.200	
POLARIS INC	30	60.050	1,801.500	
GARMIN LTD	58	82.110	4,762.380	
PPG INDUSTRIES INC	115	93.310	10,730.650	
COSTCO WHOLESALE CORP	219	317.920	69,624.480	
T ROWE PRICE GROUP INC	93	103.490	9,624.570	
QUEST DIAGNOSTICS	46	95.400	4,388.400	
PROCTER & GAMBLE CO	1,209	124.690	150,750.210	
PROGRESSIVE CORP	272	82.500	22,440.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	271	54.620	14,802.020	
PULTE GROUP INC	54	25.520	1,378.080	
GLOBAL PAYMENTS INC	141	154.880	21,838.080	
QUALCOMM INC	558	76.170	42,502.860	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	54	63.670	3,438.180	
EXACT SCIENCES CORP	90	74.650	6,718.500	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	24	157.290	3,774.960	
REGENERON PHARMACEUTICALS	41	568.790	23,320.390	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	15	99.900	1,498.500	
RESMED INC	70	165.160	11,561.200	
US BANCORP	740	35.060	25,944.400	
SEATTLE GENETICS INC /WA	50	136.870	6,843.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	127	27.150	3,448.050	
ROSS STORES INC	166	91.720	15,225.520	

ROLLINS INC	113	38.960	4,402.480	
ROPER TECHNOLOGIES INC	52	321.970	16,742.440	
ROCKWELL AUTOMATION INC	66	168.590	11,126.940	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	93	37.390	3,477.270	
RPM INTERNATIONAL INC	63	65.860	4,149.180	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	34	37.860	1,287.240	
ACCENTURE PLC-CL A	313	175.090	54,803.170	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	658	53.480	35,189.840	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	67	195.390	13,091.130	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	126	105.070	13,238.820	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	313	127.960	40,051.480	
BOOKING HOLDINGS INC	22	1,470.870	32,359.140	
SCHLUMBERGER LTD	612	15.280	9,351.360	
SCHWAB (CHARLES) CORP	563	35.790	20,149.770	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	89	118.580	10,553.620	
BUNGE LTD	83	40.090	3,327.470	
SEI INVESTMENTS CO	23	50.200	1,154.600	
ANTHEM INC	125	267.820	33,477.500	
AMERISOURCEBERGEN CORP	86	89.190	7,670.340	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	206	30.535	6,290.210	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	38	516.750	19,636.500	
CENTENE CORP	302	71.290	21,529.580	
SVB FINANCIAL GROUP	20	173.690	3,473.800	
IAC INTERACTIVE CORP	39	223.720	8,725.080	
SMITH (A.O.) CORP	63	41.080	2,588.040	
ACUITY BRANDS INC	19	86.360	1,640.840	
SNAP-ON INC	10	118.330	1,183.300	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	177	56.600	10,018.200	
ADVANCE AUTO PARTS	42	118.860	4,992.120	
EDISON INTERNATIONAL	187	62.060	11,605.220	
SOUTHERN CO	506	57.470	29,079.820	
TRUIST FINANCIAL CORP	690	33.400	23,046.000	
SOUTHWEST AIRLINES	68	31.190	2,120.920	
AT&T INC	3,547	31.230	110,772.810	
CHEVRON CORP	926	87.170	80,719.420	
STANLEY BLACK & DECKER INC	77	112.540	8,665.580	
STATE STREET CORP	172	58.490	10,060.280	
STARBUCKS CORP	598	77.100	46,105.800	
STEEL DYNAMICS INC	170	23.470	3,989.900	
STRYKER CORP	168	189.510	31,837.680	
NETFLIX INC	214	422.960	90,513.440	

NORTONLIFELOCK INC	316	20.120	6,357.920	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	109	36.590	3,988.310	
SYNOPSYS INC	72	154.980	11,158.560	
SYSCO CORP	222	50.310	11,168.820	
INTUITIVE SURGICAL INC	58	526.330	30,527.140	
TELEFLEX INC	22	346.680	7,626.960	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	357	10.270	3,666.390	
TERADYNE INC	80	63.830	5,106.400	
TEXAS INSTRUMENTS INC	449	113.550	50,983.950	
TEXTRON INC	91	27.750	2,525.250	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	193	331.580	63,994.940	
TIFFANY & CO	49	129.150	6,328.350	
GLOBE LIFE INC	55	77.250	4,248.750	
DAVITA INC	48	78.160	3,751.680	
TRACTOR SUPPLY CO	47	92.720	4,357.840	
TRIMBLE INC	102	32.460	3,310.920	
TYLER TECHNOLOGIES INC	19	326.720	6,207.680	
TYSON FOODS INC	147	62.340	9,163.980	
UGI CORP	189	28.160	5,322.240	
MARATHON OIL CORP	481	4.350	2,092.350	
UNION PACIFIC CORP	337	149.890	50,512.930	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	663	66.070	43,804.410	
UNITEDHEALTH GROUP INC	461	290.560	133,948.160	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	37	107.790	3,988.230	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	54	115.750	6,250.500	
VF CORP	173	57.500	9,947.500	
VIACOMCBS INC	241	15.800	3,807.800	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	125	270.460	33,807.500	
VULCAN MATERIALS CO	67	112.030	7,506.010	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	347	44.500	15,441.500	
WALMART INC	690	132.120	91,162.800	
WASTE MANAGEMENT INC	193	100.270	19,352.110	
WATERS CORP	31	197.510	6,122.810	
ALLERGAN PLC	160	187.000	29,920.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	38	169.980	6,459.240	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	62	121.580	7,537.960	
VAIL RESORTS INC	26	162.710	4,230.460	
WESTERN DIGITAL CORP	124	42.320	5,247.680	
WABTEC CORP	80	49.250	3,940.000	

WHIRLPOOL CORP	16	105.330	1,685.280	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	92	95.400	8,776.800	
WYNN RESORTS LTD	43	78.460	3,373.780	
NASDAQ INC	53	111.240	5,895.720	
CME GROUP INC	169	191.620	32,383.780	
WILLIAMS COS INC	497	18.080	8,985.760	
LKQ CORP	82	20.935	1,716.670	
ALLIANT ENERGY CORP	133	52.870	7,031.710	
WEC ENERGY GROUP INC	160	100.340	16,054.400	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	121	37.320	4,515.720	
CARMAX INC	50	65.220	3,261.000	
XILINX INC	133	89.000	11,837.000	
TJX COMPANIES INC	637	49.730	31,678.010	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	24	202.980	4,871.520	
ZIONS BANCORP NA	36	29.080	1,046.880	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	643	4.280	2,752.040	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	400	53.670	21,468.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	500	23.770	11,885.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	44	138.480	6,093.120	
SIGNATURE BANK	19	88.790	1,687.010	
CBRE GROUP INC	156	44.500	6,942.000	
LIBERTY GLOBAL PLC	143	18.230	2,606.890	
REGIONS FINANCIAL CORP	392	9.520	3,731.840	
DOMINO'S PIZZA INC	17	362.970	6,170.490	
T-MOBILE US INC	221	90.990	20,108.790	
LAS VEGAS SANDS CORP	149	47.010	7,004.490	
MOSAIC CO/THE	166	11.450	1,900.700	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	16	429.780	6,876.480	
CELANESE CORP	56	78.160	4,376.960	
DEXCOM INC	49	323.400	15,846.600	
DISCOVERY INC-A	95	22.140	2,103.300	
EXPEDIA GROUP INC	62	63.220	3,919.640	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	129	28.290	3,649.410	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	58	110.950	6,435.100	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	224	17.290	3,872.960	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	266	90.400	24,046.400	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	167	9.850	1,644.950	
LIVE NATION	32	38.350	1,227.200	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	12	820.270	9,843.240	

UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	38	29.080	1,105.040	
TRANSDIGM GROUP INC	23	337.400	7,760.200	
MASTERCARD INC	438	259.970	113,866.860	
HANESBRANDS INC	186	9.210	1,713.060	
WESTERN UNION CO	240	19.930	4,783.200	
OWENS CORNING	51	40.010	2,040.510	
LEIDOS HOLDINGS INC	61	99.280	6,056.080	
AERCAP HOLDINGS NV	77	24.430	1,881.110	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	76	22.640	1,720.640	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	126	15.000	1,890.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	52	109.940	5,716.880	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	317	11.480	3,639.160	
DELTA AIR LINES INC	118	24.270	2,863.860	
INSULET CORP	31	199.340	6,179.540	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	95	11.220	1,065.900	
DISCOVER FINANCIAL	135	35.040	4,730.400	
TE CONNECTIVITY LTD	142	67.440	9,576.480	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	78	51.940	4,051.320	
WABCO HOLDING INC	22	135.360	2,977.920	
LULULEMON ATHLETICA INC	61	225.860	13,777.460	
VMWARE INC	37	136.480	5,049.760	
MERCADOLIBRE INC	18	597.500	10,755.000	
ULTA BEAUTY INC	18	215.510	3,879.180	
INVESCO LTD	193	9.070	1,750.510	
MSCI INC	43	317.180	13,638.740	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	759	77.960	59,171.640	
VISA INC	834	169.540	141,396.360	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	97	131.760	12,780.720	
DISCOVERY INC-C	176	20.200	3,555.200	
MARATHON PETROLEUM CORP	306	25.450	7,787.700	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	57	46.600	2,656.200	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,109	14.970	16,601.730	
XYLEM INC	78	69.590	5,428.020	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	109	52.190	5,688.710	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	22	195.960	4,311.120	
SPLUNK INC	77	135.150	10,406.550	

EPAM SYSTEMS INC	18	209.940	3,778.920	
HCA HEALTHCARE INC	130	115.660	15,035.800	
VERISK ANALYTICS INC	78	153.790	11,995.620	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	32	111.190	3,558.080	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	44	223.590	9,837.960	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	84	100.020	8,401.680	
NXP SEMICONDUCTOR NV	126	90.170	11,361.420	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	62	77.260	4,790.120	
TARGA RESOURCES CORP	133	7.930	1,054.690	
LEAR CORP	21	87.340	1,834.140	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	31	102.000	3,162.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	132	52.000	6,864.000	
DOLLAR GENERAL CORP	117	182.110	21,306.870	
FORTINET INC	62	112.960	7,003.520	
TESLA INC	68	753.890	51,264.520	
GENERAL MOTORS CO	735	22.480	16,522.800	
XPO LOGISTICS INC	59	58.960	3,478.640	
TRIPADVISOR INC	93	18.780	1,746.540	
ALLY FINANCIAL INC	107	15.370	1,644.590	
CAPRI HOLDINGS LTD	47	12.930	607.710	
VOYA FINANCIAL INC	76	43.520	3,307.520	
APTIV PLC	128	63.920	8,181.760	
PHILLIPS 66	200	59.530	11,906.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	42	88.770	3,728.340	
FACEBOOK INC	1,176	179.240	210,786.240	
IQVIA HOLDINGS INC	84	131.570	11,051.880	
DIAMONDBACK ENERGY INC	61	31.520	1,922.720	
SERVICENOW INC	89	299.590	26,663.510	
PALO ALTO NETWORKS INC	49	193.430	9,478.070	
WORKDAY INC	77	149.300	11,496.100	
ABBVIE INC	718	83.450	59,917.100	
ZOETIS INC	235	130.720	30,719.200	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	139	12.380	1,720.820	
COTY INC	89	5.750	511.750	
NEWS CORP/NEW-CL A	308	8.900	2,741.200	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	9	29.780	268.020	
CDW CORP	55	108.820	5,985.100	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	104	11.570	1,203.280	
HOWMET AEROSPACE INC	117	11.650	1,363.050	
TWILIO INC	67	107.880	7,227.960	
SNAP INC	322	12.980	4,179.560	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	90	25.280	2,275.200	

LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	78	31.360	2,446.080	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	47	31.960	1,502.120	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	57	8.890	506.730	
OKTA INC	48	148.090	7,108.320	
BLACK KNIGHT INC	68	67.480	4,588.640	
BAKER HUGHES CO	258	13.030	3,361.740	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	62	59.920	3,715.040	
TECHNIPFMC LTD	262	8.120	2,127.440	
BROADCOM INC	196	265.880	52,112.480	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	36	236.510	8,514.360	
MONGODB INC	20	154.190	3,083.800	
BURLINGTON STORES INC	32	182.610	5,843.520	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	205	24.290	4,979.450	
VEEVA SYSTEMS INC	59	181.120	10,686.080	
TWITTER INC	378	26.700	10,092.600	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	49	32.700	1,602.300	
EVERGY INC	123	60.980	7,500.540	
ALLEGION PLC	42	97.630	4,100.460	
STERIS PLC	37	154.970	5,733.890	
DOCUSIGN INC	53	100.350	5,318.550	
WIX.COM LTD	27	126.240	3,408.480	
KKR & CO INC	194	23.920	4,640.480	
PERRIGO CO PLC	50	51.870	2,593.500	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	138	75.620	10,435.560	
ARAMARK	70	21.970	1,537.900	
CIGNA CORP	176	194.130	34,166.880	
DELL TECHNOLOGIES INC	106	41.510	4,400.060	
DOW INC	393	33.420	13,134.060	
AMCOR PLC	795	8.780	6,980.100	
PINTEREST INC	82	17.450	1,430.900	
XEROX HOLDINGS CORP	123	18.120	2,228.760	
FOX CORP-A	156	26.875	4,192.500	
CARRIER GLOBAL CORP	358	13.740	4,918.920	
OTIS WORLDWIDE CORP	179	46.150	8,260.850	
UBER TECHNOLOGIES INC	144	28.000	4,032.000	
CORTEVA INC	367	25.510	9,362.170	
BLACKSTONE GROUP INC	313	50.010	15,653.130	
INGERSOLL RAND INC	93	26.810	2,493.330	
PAYCOM SOFTWARE INC	18	224.990	4,049.820	
SABRE CORP	84	5.995	503.580	
AON PLC	110	190.810	20,989.100	
ARISTA NETWORKS INC	23	210.020	4,830.460	
IHS MARKIT LTD	222	67.170	14,911.740	
FNF GROUP	127	27.460	3,487.420	
SYNCHRONY FINANCIAL	280	15.620	4,373.600	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	331	19.870	6,576.970	

	CDK GLOBAL INC	73	35.200	2,569.600	
	WAYFAIR INC	50	90.080	4,504.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	95	95.840	9,104.800	
	QORVO INC	57	86.270	4,917.390	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	57	124.870	7,117.590	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	124	18.260	2,264.240	
	GODADDY INC	119	66.820	7,951.580	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	131	13.260	1,737.060	
	TRANSUNION	90	76.180	6,856.200	
	SQUARE INC	157	61.090	9,591.130	
	DUPONT DE NEMOURS INC	326	38.360	12,505.360	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	87	41.620	3,620.940	
	WESTROCK CO	165	30.690	5,063.850	
	KRAFT HEINZ CO	335	29.330	9,825.550	
	FORTIVE CORP	121	60.360	7,303.560	
	WASTE CONNECTIONS INC	144	88.040	12,677.760	
	ALPHABET INC-CL A	148	1,279.000	189,292.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	863	9.710	8,379.730	
	PAYPAL HOLDINGS INC	551	111.850	61,629.350	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	196	15.750	3,087.000	
	DXC TECHNOLOGY CO	156	15.330	2,391.480	
	ZILLOW GROUP INC-C	37	36.330	1,344.210	
	ALPHABET INC-CL C	151	1,283.250	193,770.750	
	BEIGENE LTD ADR	18	157.430	2,833.740	
	LINDE PLC	258	188.550	48,645.900	
	ATHENE HOLDING LTD	44	25.460	1,120.240	
	ROKU INC	57	126.800	7,227.600	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	75	499.420	37,456.500	
	VISTRA ENERGY CORP	56	17.540	982.240	
アメリカ・ドル　小計		146,443		11,868,788.150 (1,280,523,549)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	144	7.826	1,126.940	
	ASHTEAD GROUP	207	17.670	3,657.690	
	SEVERN TRENT PLC	102	23.120	2,358.240	
	BHP GROUP PLC	1,018	13.158	13,394.840	
	BARCLAYS PLC	7,429	0.907	6,738.100	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	920	4.857	4,468.440	
	BT GROUP PLC	4,143	1.206	4,996.450	
	BUNZL PLC	246	16.705	4,109.430	
	EASYJET PLC	32	6.388	204.410	
	AVIVA PLC	2,610	2.478	6,467.580	
	CRODA INTERNATIONAL	44	46.200	2,032.800	

DIAGEO PLC	1,159	27.110	31,420.490	
SCHRODERS PLC	92	25.570	2,352.440	
DCC PLC	23	55.140	1,268.220	
NATIONAL GRID PLC	1,614	9.042	14,593.780	
KINGFISHER PLC	1,322	1.404	1,856.080	
BAE SYSTEMS PLC	1,215	5.584	6,784.560	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,138	29.435	33,497.030	
HALMA PLC	221	21.190	4,682.990	
NEXT PLC	64	44.350	2,838.400	
IMPERIAL BRANDS PLC	416	15.645	6,508.320	
JOHNSON MATTHEY PLC	113	19.725	2,228.920	
ANGLO AMERICAN PLC	642	14.224	9,131.800	
COMPASS GROUP PLC	703	13.320	9,363.960	
HSBC HOLDINGS PLC	9,828	4.143	40,717.400	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,930	2.054	6,018.220	
CENTRICA PLC	1,260	0.318	400.680	
UNILEVER PLC	496	41.150	20,410.400	
MEGGITT PLC	609	2.757	1,679.010	
MORRISON ＜WM.＞ SUPERMARKETS	706	1.859	1,312.450	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	449	8.898	3,995.200	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	651	3.588	2,335.780	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	145	19.840	2,876.800	
PEARSON PLC	565	4.880	2,757.200	
PERSIMMON PLC	154	19.980	3,076.920	
PRUDENTIAL PLC	1,351	10.420	14,077.420	
RIO TINTO PLC	517	38.165	19,731.300	
VODAFONE GROUP PLC	12,711	1.088	13,829.560	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	342	62.480	21,368.160	
RELX PLC	903	18.390	16,606.170	
RENTOKIL INITIAL PLC	905	4.354	3,940.370	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	672	3.345	2,247.840	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,193	1.062	2,328.960	
ST JAMES'S PLACE PLC	511	7.796	3,983.750	
SSE PLC	507	12.205	6,187.930	
BP PLC	10,436	3.035	31,673.260	
SAGE GROUP PLC(THE)	445	6.318	2,811.510	
SMITHS GROUP PLC	175	11.855	2,074.620	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	88.220	2,558.380	
STANDARD CHARTERED PLC	1,162	4.065	4,723.530	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	32,790	0.304	9,968.160	

	TAYLOR WIMPLEY PLC	1,666	1.363	2,270.750	
	TESCO PLC	5,083	2.381	12,102.620	
	3I GROUP PLC	721	7.698	5,550.250	
	SMITH & NEPHEW PLC	468	15.410	7,211.880	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	2,416	16.606	40,120.090	
	WEIR GROUP	158	8.164	1,289.910	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	176	74.820	13,168.320	
	WPP PLC	622	5.582	3,472.000	
	ASTRAZENECA PLC	634	79.700	50,529.800	
	WHITBREAD PLC	54	27.000	1,458.000	
	CARNIVAL PLC	110	9.120	1,003.200	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	98	0.981	96.130	
	INTERTEK GROUP PLC	85	49.590	4,215.150	
	BURBERRY GROUP PLC	184	14.715	2,707.560	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	84	35.630	2,992.920	
	ITV PLC	1,336	0.712	951.230	
	SAINSBURY (J) PLC	1,073	2.013	2,159.940	
	G4S PLC	528	0.959	506.350	
	ADMIRAL GROUP PLC	112	22.070	2,471.840	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	69	40.270	2,778.630	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,901	13.702	26,047.500	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,965	13.432	26,393.880	
	TUI AG-DI	220	3.312	728.640	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,109	2.172	2,408.740	
	EXPERIAN PLC	422	23.780	10,035.160	
	MONDI PLC	236	13.415	3,165.940	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	222	15.325	3,402.150	
	OCADO GROUP PLC	339	15.690	5,318.910	
	INFORMA PLC	667	4.494	2,997.490	
	GLENCORE PLC	5,098	1.412	7,198.370	
	GVC HOLDINGS PLC	288	6.832	1,967.610	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	372	2.686	999.190	
	COCA-COLA HBC AG	72	20.050	1,443.600	
	FERGUSON PLC	115	52.740	6,065.100	
	M&G PLC	1,649	1.305	2,151.940	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	123	3.678	452.390	
	AUTO TRADER GROUP PLC	571	4.387	2,504.970	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	1,277	0.911	1,163.340	
イギリス・ポンド　小計		141,382		681,274.380 (91,801,723)	

イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	682	21.300	14,526.600	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	760	19.330	14,690.800	
	ELBIT SYSTEMS LTD	8	440.100	3,520.800	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	577	11.540	6,658.580	
	NICE LTD	26	605.000	15,730.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	85	72.790	6,187.150	
	AZRIELI GROUP	35	183.500	6,422.500	
イスラエル・シュケル　小計		2,173		67,736.430 (2,035,480)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	99	67.200	6,652.800	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,605	16.560	26,578.800	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,608	15.870	25,518.960	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	746	11.280	8,414.880	
	TELSTRA CORP LTD	2,169	3.160	6,854.040	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	452	5.920	2,675.840	
	ASX LTD	95	83.000	7,885.000	
	BHP GROUP LTD	1,506	31.280	47,107.680	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	181	23.560	4,264.360	
	COMPUTERSHARE LT	212	11.570	2,452.840	
	CSL LIMITED	222	328.420	72,909.240	
	REA GROUP LTD	34	83.140	2,826.760	
	TRANSURBAN GROUP	1,535	13.180	20,231.300	
	COCHLEAR LTD	22	194.140	4,271.080	
	ORIGIN ENERGY LTD	776	5.170	4,011.920	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	886	61.060	54,099.160	
	BORAL LIMITED	694	2.790	1,936.260	
	RIO TINTO LIMITED	171	91.510	15,648.210	
	APA GROUP	787	11.180	8,798.660	
	ARISTOCRAT LEISU	199	23.600	4,696.400	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	925	6.320	5,846.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	73	10.520	767.960	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	307	19.240	5,906.680	
	ORICA LTD	272	17.190	4,675.680	
	CIMIC GROUP LTD	36	23.800	856.800	
	LEND LEASE CORP LTD	426	11.950	5,090.700	
	BLUESCOPE STEEL LTD	342	10.390	3,553.380	
	SYDNEY AIRPORT	525	6.280	3,297.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	150	100.410	15,061.500	
	SUNCORP GROUP LTD	547	9.320	5,098.040	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,331	16.390	21,815.090	
	NEWCREST MINING LTD	417	28.570	11,913.690	
	OIL SEARCH LTD	865	2.740	2,370.100	
	INCITEC PIVOT LTD	1,139	2.180	2,483.020	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,042	8.800	9,169.600	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	543	4.790	2,600.970	
	SANTOS LTD	714	4.290	3,063.060	
	SONIC HEALTHCARE	211	25.250	5,327.750	
	TABCORP HOLDINGS LTD	899	2.980	2,679.020	
	WESFARMERS LTD	584	38.120	22,262.080	
	ALUMINA LIMITED	1,597	1.575	2,515.270	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	439	21.080	9,254.120	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	556	37.400	20,794.400	
	SEEK LTD	158	17.040	2,692.320	
	AUSNET SERVICES	648	1.835	1,189.080	
	AGL ENERGY LTD	269	17.660	4,750.540	
	BRAMBLES LTD	669	11.580	7,747.020	
	CROWN RESORTS LTD	251	8.160	2,048.160	
	AURIZON HOLDINGS LTD	934	4.570	4,268.380	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	433	10.440	4,520.520	
	MEDIBANK PVT LTD	1,627	2.650	4,311.550	
	SOUTH32 LTD(AUD)	1,797	2.060	3,701.820	
	COLES GROUP LTD	541	16.430	8,888.630	
オーストラリア・ドル　小計		35,266		538,354.120 (36,866,490)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	112	75.550	8,461.600	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	509	40.380	20,553.420	
	BARRICK GOLD CORP	843	34.400	28,999.200	
	ATCO LTD	31	39.350	1,219.850	
	BANK OF MONTREAL	299	69.990	20,927.010	
	BANK OF NOVA SCOTIA	579	54.450	31,526.550	
	NATIONAL BANK OF CANADA	226	54.360	12,285.360	
	BCE INC	104	58.480	6,081.920	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	642	47.460	30,469.320	
	BAUSCH HEALTH COS INC	143	24.450	3,496.350	
	SAPUTO INC	83	34.800	2,888.400	
	BLACKBERRY LTD	522	5.980	3,121.560	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	248	19.810	4,912.880	
	CGI INC	132	84.790	11,192.280	
	CCL INDUSTRIES INC	117	43.000	5,031.000	
	CAE INC	111	21.880	2,428.680	
	CAMECO CORP	363	13.670	4,962.210	

ROGERS COMM-CL B	233	60.280	14,045.240	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	205	80.900	16,584.500	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	513	18.740	9,613.620	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	18	98.620	1,775.160	
CANADIAN UTILITIES LTD	69	35.420	2,443.980	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	344	111.870	38,483.280	
OPEN TEXT CORP	158	54.960	8,683.680	
EMPIRE CO LTD	111	32.250	3,579.750	
KINROSS GOLD CORP	923	8.500	7,845.500	
FORTIS INC	186	54.530	10,142.580	
TELUS CORP	88	22.770	2,003.760	
GREAT WEST LIFECO INC	46	23.060	1,060.760	
IMPERIAL OIL LTD	76	17.180	1,305.680	
ENBRIDGE INC	1,037	41.280	42,807.360	
IGM FINANCIAL INC	35	26.040	911.400	
MANULIFE FINANCIAL CORP	919	17.360	15,953.840	
LOBLAW CO LTD	137	73.930	10,128.410	
MAGNA INTERNATIONAL INC	215	50.810	10,924.150	
SUN LIFE FINANCIAL INC	252	46.250	11,655.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	422.160	5,065.920	
METRO INC	77	59.720	4,598.440	
HUSKY ENERGY INC	59	3.780	223.020	
EMERA INC	100	56.520	5,652.000	
METHANEX CORP	50	18.450	922.500	
ONEX CORP	45	60.000	2,700.000	
POWER CORP OF CANADA	202	21.450	4,332.900	
ROYAL BANK OF CANADA	661	87.470	57,817.670	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	72	313.950	22,604.400	
SHAW COMM INC-B	192	23.110	4,437.120	
SUNCOR ENERGY INC	735	21.370	15,706.950	
TECK RESOURCES LTD-CL B	339	11.070	3,752.730	
THOMSON REUTERS CORP	65	101.740	6,613.100	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	841	56.920	47,869.720	
TC ENERGY CORP	491	63.280	31,070.480	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9	29.800	268.200	
WESTON (GEORGE) LTD	36	105.100	3,783.600	
INTACT FINANCIAL CORP	66	136.350	8,999.100	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	210	48.160	10,113.600	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	10	1,369.950	13,699.500	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	94	173.850	16,341.900	
CI FINANCIAL CORP	68	13.970	949.960	

	ALTAGAS LTD	245	14.890	3,648.050	
	PEMBINA PIPELINE CORP	284	28.560	8,111.040	
	DOLLARAMA INC	126	44.050	5,550.300	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	223	3.840	856.320	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	144	48.450	6,976.800	
	INTER PIPELINE LTD	188	10.300	1,936.400	
	NUTRIEN LTD	351	50.250	17,637.750	
	WSP GLOBAL INC	50	86.100	4,305.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	57	44.020	2,509.140	
	OVINTIV INC	100	5.720	572.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	243	8.180	1,987.740	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	115	64.520	7,419.800	
	SHOPIFY INC	45	831.520	37,418.400	
	CANOPY GROWTH CORP	161	21.160	3,406.760	
	HYDRO ONE LTD	236	25.990	6,133.640	
カナダ・ドル　小計		17,631		784,497.190 (60,280,764)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	1,200	3.360	4,032.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	900	19.280	17,352.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	500	7.720	3,860.000	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	500	3.060	1,530.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	300	9.830	2,949.000	
	CAPITALAND LTD	1,000	2.980	2,980.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	5,300	0.755	4,001.500	
	KEPPEL CORP LTD	300	5.660	1,698.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	1,600	1.520	2,432.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,400	8.860	12,404.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,300	2.760	11,868.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	500	20.020	10,010.000	
	UOL GROUP LIMITED	300	6.880	2,064.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	500	3.420	1,710.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	3,169	1.010	3,200.690	
シンガポール・ドル　小計		21,769		82,091.190 (6,224,154)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	1,524	7.926	12,079.220	
	NESTLE SA-REGISTERED	1,437	106.040	152,379.480	
	CIE FINANC RICHEMONT	228	55.140	12,571.920	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	337	326.850	110,148.450	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	29	226.400	6,565.600	
	SIKA INHABER	57	160.550	9,151.350	
	SGS SA-REG	3	2,263.000	6,789.000	

	NOVARTIS AG-REG SHS	1,033	86.000	88,838.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	32	138.900	4,444.800	
	BARRY CALLEBAUT AG	2	1,896.000	3,792.000	
	CLARIANT AG-REG	237	17.850	4,230.450	
	SWISSCOM AG-REG	13	517.600	6,728.800	
	ABB LTD	831	16.980	14,110.380	
	ADECCO GROUP AG-REG	74	41.230	3,051.020	
	GEBERIT AG	13	411.800	5,353.400	
	LONZA GROUP AG-REG	38	407.700	15,492.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	1	8,050.000	8,050.000	
	GIVAUDAN-REG	4	3,214.000	12,856.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	69	303.200	20,920.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	201	37.000	7,437.000	
	TEMENOS GROUP	41	118.900	4,874.900	
	SONOVA HOLDING AG	22	175.200	3,854.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	27	140.800	3,801.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	4	767.800	3,071.200	
	THE SWATCH GROUP AG-B	22	198.550	4,368.100	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	38.640	386.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	17	328.400	5,582.800	
	VIFOR PHARMA AG	36	140.950	5,074.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING	5	621.500	3,107.500	
	SWISS PRIME SITE AG	61	91.400	5,575.400	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	37	66.000	2,442.000	
	DUFRY GROUP	6	27.150	162.900	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	9	736.200	6,625.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	63	35.090	2,210.670	
	SWISS RE LTD	131	77.220	10,115.820	
	ALCON INC	218	50.200	10,943.600	
	UBS GROUP AG	2,124	9.270	19,689.480	
スイス・フラン　小計		8,996		596,877.040 (66,539,852)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	316	348.100	109,999.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	201	304.100	61,124.100	
	ERICSSON LM-B SHS	1,506	86.600	130,419.600	
	LUNDBERGS B	37	424.600	15,710.200	
	SKF AB-B SHS	111	138.800	15,406.800	
	SANDVIK AB	588	141.300	83,084.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	714	67.520	48,209.280	
	SKANSKA AB-B SHS	112	171.400	19,196.800	
	SWEDBANK AB	270	107.580	29,046.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	686	79.700	54,674.200	
	VOLVO AB-B SHS	651	124.400	80,984.400	
	SWEDISH MATCH AB	112	602.800	67,513.600	

	TELE2 AB-B SHS	310	135.100	41,881.000	
	INDUSTRIVARDEN C	117	198.450	23,218.650	
	ELECTROLUX AB-SER B	58	128.250	7,438.500	
	SECURITAS AB-B SHS	237	112.000	26,544.000	
	INVESTOR AB-B SHS	212	485.900	103,010.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	355	135.450	48,084.750	
	ASSA ABLOY AB-B	525	191.850	100,721.250	
	TELIA CO AB	1,380	35.580	49,100.400	
	LUNDIN ENERGY AB	145	207.700	30,116.500	
	BOLIDEN AB	92	202.400	18,620.800	
	ALFA LAVAL AB	160	177.400	28,384.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	65	287.500	18,687.500	
	ICA GRUPPEN AB	38	431.200	16,385.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	400	55.900	22,360.000	
	HEXAGON AB	111	459.900	51,048.900	
	EPIROC AB-A	495	95.460	47,252.700	
	EPIROC AB-B	60	93.600	5,616.000	
	ESSITY AB-B	342	305.100	104,344.200	
	NORDEA BANK ABP	1,478	55.340	81,792.520	
スウェーデン・クローナ　小計		11,884		1,539,977.650 (16,631,759)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	58	836.400	48,511.200	
	A P MOLLER A/S	5	6,550.000	32,750.000	
	DANSKE BANK A/S	314	73.520	23,085.280	
	GENMAB A/S	39	1,550.500	60,469.500	
	NOVOZYMES-B SHS	61	326.600	19,922.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	857	431.050	369,409.850	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	102	588.600	60,037.200	
	COLOPLAST-B	64	1,055.000	67,520.000	
	DSV PANALPINA A S	108	655.000	70,740.000	
	DEMANT A/S	78	165.500	12,909.000	
	H LUNDBECK A/S	15	222.600	3,339.000	
	TRYG A/S	44	182.000	8,008.000	
	PANDORA A/S	66	228.900	15,107.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	35	592.000	20,720.000	
	ORSTED A/S	78	687.800	53,648.400	
デンマーク・クローネ　小計		1,924		866,177.430 (13,616,309)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	693	6.110	4,234.230	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	101	12.300	1,242.300	
	A2 MILK CO LTD	367	19.810	7,270.270	
	FISHER & PAYKEL	303	30.000	9,090.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	115	4.000	460.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,218	4.350	5,298.300	
	MERIDIAN ENERGY LTD	824	4.370	3,600.880	

ニュージーランド・ドル　小計		3,621		31,195.980 (2,024,307)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	88	184.800	16,262.400	
	DNB ASA	511	113.050	57,768.550	
	TELENOR ASA	438	161.700	70,824.600	
	ORKLA ASA	375	94.820	35,557.500	
	EQUINOR ASA	454	129.550	58,815.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	35	355.000	12,425.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	181	182.000	32,942.000	
	SCHIBSTED ASA	58	204.600	11,866.800	
ノルウェー・クローネ　小計		2,140		296,462.550 (3,086,175)	
ユーロ	CRH PLC	450	25.510	11,479.500	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	34	102.950	3,500.300	
	KERRY GROUP PLC-A	85	105.600	8,976.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	38	44.540	1,692.520	
	UMICORE	144	36.450	5,248.800	
	AIR LIQUIDE	217	120.800	26,213.600	
	AIRBUS SE	309	56.800	17,551.200	
	AXA	847	14.924	12,640.620	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	286	19.880	5,685.680	
	ADIDAS AG	84	218.700	18,370.800	
	ASSICURAZIONI GENERALI	386	12.530	4,836.580	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.000	0.000	
	DANONE	288	63.620	18,322.560	
	SAFRAN SA	154	80.500	12,397.000	
	INTESA SANPAOLO	6,375	1.376	8,772.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	140	51.910	7,267.400	
	ACCOR SA	56	26.840	1,503.040	
	BOUYGUES	81	26.330	2,132.730	
	BNP PARIBAS	622	25.470	15,842.340	
	THALES SA	36	72.200	2,599.200	
	CAPGEMINI SA	77	80.300	6,183.100	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	27	35.550	959.850	
	INGENICO GROUP	42	110.450	4,638.900	
	UNICREDIT SPA	989	6.863	6,787.500	
	NATIXIS	818	2.011	1,644.990	
	KONINKLIJKE DSM NV	90	112.100	10,089.000	
	COMMERZBANK AG	534	3.182	1,699.180	
	EIFFAGE	44	73.760	3,245.440	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	213	36.760	7,829.880	
	UNITED INTERNET	85	30.160	2,563.600	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	21	37.240	782.040	
	PUBLICIS GROUPE	98	26.370	2,584.260	

IBERDROLA SA	2,985	8.984	26,817.240	
ENI SPA	1,163	8.587	9,986.680	
JERONIMO MARTINS	220	15.875	3,492.500	
KBC GROUPE	73	44.780	3,268.940	
HANNOVER RUECK SE	13	134.200	1,744.600	
WARTSILA OYJ	111	7.060	783.660	
L'OREAL	117	247.600	28,969.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	136	358.000	48,688.000	
GEA GROUP AG	105	21.270	2,233.350	
BOLLORE	503	2.416	1,215.240	
MEDIOBANCA SPA	225	5.002	1,125.450	
MICHELIN(CGDE)-B	67	88.660	5,940.220	
CONTINENTAL AG	30	73.120	2,193.600	
DEUTSCHE POST AG-REG	547	26.190	14,325.930	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	225	13.570	3,053.250	
NOKIAN RENKAAT OYJ	73	19.070	1,392.110	
OMV AG	89	26.920	2,395.880	
PERNOD-RICARD	116	139.950	16,234.200	
PEUGEOT SA	384	11.700	4,492.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	92	43.680	4,018.560	
RENAULT SA	94	16.380	1,539.720	
REPSOL SA	718	7.786	5,590.340	
REMY COINTREAU	12	103.600	1,243.200	
MERCK KGAA	64	100.550	6,435.200	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	238	24.810	5,904.780	
RWE AG	268	25.210	6,756.280	
SEB SA	14	117.800	1,649.200	
SOCIETE GENERALE-A	532	13.942	7,417.140	
VINCI S.A.	243	76.460	18,579.780	
SODEXO	22	65.340	1,437.480	
SOLVAY SA	32	69.540	2,225.280	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	258	82.880	21,383.040	
VIVENDI SA	430	20.630	8,870.900	
SAP SE	487	113.060	55,060.220	
TELEFONICA S.A	1,932	4.109	7,938.580	
TOTAL SA	1,108	31.020	34,370.160	
VALEO	152	15.890	2,415.280	
E.ON SE	1,155	8.830	10,198.650	
VOEST-ALPINE AG	26	19.590	509.340	
HENKEL AG & CO KGAA	26	69.650	1,810.900	
SIEMENS AG-REG	400	80.510	32,204.000	
UPM-KYMMENE OYJ	294	24.610	7,235.340	
ING GROEP NV-CVA	2,320	4.839	11,226.480	
PUMA AG	75	57.540	4,315.500	
BAYER AG	494	58.570	28,933.580	

STORA ENSO OYJ-R SHS	281	10.120	2,843.720	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	100	78.200	7,820.000	
DAIMLER AG	402	29.040	11,674.080	
BASF SE	427	45.575	19,460.520	
BEIERSDORF AG	52	94.560	4,917.120	
HOCHTIEF AG	24	70.400	1,689.600	
HEIDELBERGCEMENT AG	59	40.450	2,386.550	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	105	64.840	6,808.200	
ORANGE	1,083	11.365	12,308.290	
SAMPO OYJ-A SHS	223	25.880	5,771.240	
RANDSTAD NV	22	34.790	765.380	
ALLIANZ SE	214	163.900	35,074.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	967	3.777	3,652.350	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	634	22.310	14,144.540	
HERMES INTL	17	684.800	11,641.600	
ENDESA S.A.	51	19.545	996.790	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	94	8.344	784.330	
ERSTE GROUP BANK AG	128	17.080	2,186.240	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	66	195.450	12,899.700	
ARCELOR MITTAL (NL)	263	8.880	2,335.440	
DASSAULT SYSTEMES SA	68	137.450	9,346.600	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	133	20.850	2,773.050	
HEINEKEN NV	111	78.440	8,706.840	
AKZO NOBEL	117	63.940	7,480.980	
ASML HOLDING NV	215	271.550	58,383.250	
AEGON NV	1,284	2.230	2,863.320	
BANKINTER S.A.	407	3.576	1,455.430	
VOLKSWAGEN AG PFD	82	124.600	10,217.200	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,970	2.664	10,576.080	
KERING	36	503.400	18,122.400	
CNP ASSURANCES	121	8.050	974.050	
FORTUM OYJ	149	15.820	2,357.180	
AGEAS	36	31.560	1,136.160	
UCB SA	48	85.200	4,089.600	
THYSSENKRUPP AG	236	5.890	1,390.040	
CARREFOUR SA	232	13.995	3,246.840	
NATURGY ENERGY GROUP SA	107	15.310	1,638.170	
ATOS SE	78	64.320	5,016.960	
NOKIA OYJ	2,655	3.188	8,464.140	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	427	37.450	15,991.150	
WOLTERS KLUWER-CVA	128	66.880	8,560.640	
SANOFI	549	86.570	47,526.930	
STMICROELECTRONICS NV	278	21.370	5,940.860	

ELISA OYJ	74	54.260	4,015.240	
BANCO SANTANDER SA	7,596	1.959	14,880.560	
METSO OYJ	93	23.330	2,169.690	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	277	15.230	4,218.710	
QIAGEN N.V.	153	37.230	5,696.190	
DEUTSCHE BANK AG-REG	615	5.971	3,672.160	
BMW VORZUG	19	43.960	835.240	
ENEL SPA	4,268	6.209	26,500.010	
VOPAK (KON.)	38	50.500	1,919.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,452	12.510	18,164.520	
SARTORIUS AG	15	230.000	3,450.000	
LEONARDO SPA	270	6.662	1,798.740	
UBISOFT ENTERTAINMENT	23	70.000	1,610.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	753	16.550	12,462.150	
KONINKLIJKE KPN NV	1,753	2.104	3,688.310	
EUROFINS SCIENTIFIC	8	476.000	3,808.000	
TELEPERFORMANCE	40	197.450	7,898.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	80	139.600	11,168.000	
EURAZEO	23	42.260	971.980	
BANCO SABADELL	4,414	0.390	1,721.460	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	60	71.540	4,292.400	
HEINEKEN HOLDING NV-A	30	70.950	2,128.500	
INDITEX	619	25.550	15,815.450	
JC DECAUX SA	24	17.170	412.080	
ANDRITZ AG	7	29.860	209.020	
MAPFRE SA	646	1.725	1,114.350	
ESSILORLUXOTTICA	128	111.100	14,220.800	
SNAM SPA	1,091	3.826	4,174.160	
CREDIT AGRICOLE SA	428	6.530	2,794.840	
ENAGAS	61	19.555	1,192.850	
WENDEL	13	76.500	994.500	
WIRECARD AG	63	120.200	7,572.600	
TENARIS SA	388	5.800	2,250.400	
TELECOM ITALIA-RNC	5,589	0.341	1,905.840	
ATLANTIA SPA	206	12.720	2,620.320	
PROXIMUS	129	21.210	2,736.090	
SES FDR	252	6.528	1,645.050	
TERNA SPA	664	5.496	3,649.340	
GRIFOLS SA	143	30.280	4,330.040	
FERROVIAL SA	331	23.460	7,765.260	
LANXESS AG	69	42.630	2,941.470	
NESTE OYJ	229	29.270	6,702.830	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	116	14.310	1,659.960	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	74	38.330	2,836.420	

GALAPAGOS NV	22	193.550	4,258.100	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	18	117.500	2,115.000	
KONE OYJ	153	52.780	8,075.340	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	20	191.400	3,828.000	
ENGIE	725	9.492	6,881.700	
ALSTOM	72	39.890	2,872.080	
TELENET GROUP HOLDING NV	12	34.780	417.360	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	159	10.250	1,629.750	
ELECTRICITE DE FRANCE	195	7.252	1,414.140	
IPSEN SA	33	55.500	1,831.500	
DEUTSCHE WOHNEN	115	35.500	4,082.500	
ARKEMA SA	69	73.740	5,088.060	
LEGRAND SA	167	59.360	9,913.120	
UNILEVER NV	743	45.680	33,940.240	
ADP	21	88.400	1,856.400	
ORION OYJ	88	41.770	3,675.760	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	236	9.626	2,271.730	
SYMRISE AG	57	93.440	5,326.080	
SCOR SE	71	21.560	1,530.760	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	109	26.060	2,840.540	
PRYSMIAN SPA	5	15.400	77.000	
CAIXABANK	1,966	1.607	3,159.360	
BUREAU VERITAS SA	164	18.825	3,087.300	
GETLINK	68	11.220	762.960	
SUEZ SA	272	9.578	2,605.210	
AMADEUS IT GROUP SA	241	46.140	11,119.740	
BRENNTAG AG	28	38.200	1,069.600	
EVONIK INDUSTRIES AG	149	21.870	3,258.630	
EDENRED	109	36.790	4,010.110	
BANKIA SA	187	0.937	175.210	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	899	2.522	2,267.270	
KION GROUP AG	28	44.470	1,245.160	
VONOVIA SE	269	45.420	12,217.980	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	659	1.417	933.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	84	37.115	3,117.660	
FERRARI NV	62	148.600	9,213.200	
METRO AG	96	7.714	740.540	
CNH INDUSTRIAL NV	625	5.590	3,493.750	
AROUNDTOWN SA	443	4.909	2,174.680	
MONCLER SPA	88	34.520	3,037.760	
PROSUS NV	222	65.440	14,527.680	
WORLDLINE SA	38	60.340	2,292.920	
NN GROUP NV	82	23.450	1,922.900	
FINECOBANK SPA	300	8.700	2,610.000	
ZALANDO SE	109	43.700	4,763.300	

	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	585	7.322	4,283.370	
	AENA SME SA	37	122.400	4,528.800	
	CELLNEX TELECOM SAU	100	49.590	4,959.000	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	54	89.500	4,833.000	
	ABN AMRO BANK NV	203	7.096	1,440.480	
	EXOR NV	22	49.180	1,081.960	
	COVESTRO AG	103	31.070	3,200.210	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	372	41.800	15,549.600	
	POSTE ITALIANE SPA	406	7.700	3,126.200	
	ADYEN NV	5	780.400	3,902.000	
	UNIPER SE	111	24.100	2,675.100	
	DELIVERY HERO SE	59	69.240	4,085.160	
ユーロ　小計		111,308		1,576,088.840 (184,827,938)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	100	84.100	8,410.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	864	16.480	14,238.720	
	BANK OF EAST ASIA	867	16.760	14,530.920	
	CLP HOLDINGS LTD	735	81.500	59,902.500	
	PCCW LTD	884	4.700	4,154.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	47.750	23,875.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	566	247.000	139,802.000	
	MTR CORP	903	43.150	38,964.450	
	HANG SENG BANK LTD	400	137.000	54,800.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,086	32.250	35,023.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	567	51.300	29,087.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	5,094	14.380	73,251.720	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	49.950	26,823.150	
	KERRY PROPERTIES LTD	452	22.000	9,944.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,684	24.200	40,752.800	
	NWS HOLDINGS LTD	500	8.140	4,070.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	338	13.000	4,394.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	3,562	9.020	32,129.240	
	SINO LAND CO	576	10.480	6,036.480	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	108.900	54,450.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	773	57.750	44,640.750	
	SJM HOLDINGS LTD	1,000	7.900	7,900.000	
	WYNN MACAU LTD	699	13.720	9,590.280	
	AIA GROUP LTD	5,551	72.600	403,002.600	
	HKT TRUST / HKT LTD	2,080	12.020	25,001.600	
	SANDS CHINA LTD	574	31.850	18,281.900	

	SWIRE PROPERTIES LTD	432	22.000	9,504.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,000	31.300	31,300.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	800	21.500	17,200.000	
	WH GROUP LTD	4,500	7.550	33,975.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,034	58.100	60,075.400	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	1,034	47.800	49,425.200	
香港・ドル　小計		40,192		1,384,537.110 (19,272,757)	
合計		544,729		1,783,731,257 (1,783,731,257)	

（２）株式以外の有価証券

令和2年4月20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	5,614.290	
		GOODMAN GROUP	703.000	9,645.160	
		GPT GROUP	956.000	3,919.600	
		MIRVAC GROUP	827.000	1,918.640	
		SCENTRE GROUP	1,418.000	3,048.700	
		STOCKLAND	1,002.000	3,056.100	
		VICINITY CENTRES	1,672.000	2,324.080	
	オーストラリア・ドル　小計		7,161.000	29,526.570 (2,021,979)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	2,000.000	5,780.000	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	869.000	1,346.950	
		CAPITALAND MALL TRUST	1,500.000	2,775.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	500.000	695.000	
	シンガポール・ドル　小計		4,869.000	10,596.950 (803,461)	
投資信託受益証券　合計			12,030	2,825,440 (2,825,440)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	464.000	5,690.960	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	72.000	11,182.320	
		AMERICAN TOWER CORP	218.000	55,385.080	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	549.000	3,304.980	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	70.000	11,925.900	
		BOSTON PROPERTIES INC	66.000	6,303.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	33.000	2,898.060	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	208.000	34,746.400	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	133.000	19,843.600	
	DUKE REALTY TRUST	250.000	8,730.000	
	EQUINIX INC	39.000	27,103.050	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	85.000	5,389.000	
	EQUITY RESIDENTIAL	193.000	13,469.470	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	32.000	8,346.880	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	58.000	5,399.800	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	46.000	3,466.560	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	189.000	4,963.140	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	326.000	3,706.620	
	INVITATION HOMES INC	271.000	6,455.220	
	IRON MOUNTAIN INC	70.000	1,749.300	
	KIMCO REALTY	44.000	392.480	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	198.000	3,399.660	
	MID AMERICA	54.000	6,129.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	88.000	2,744.720	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	113.000	3,663.460	
	PROLOGIS INC	373.000	33,652.060	
	PUBLIC STORAGE	70.000	13,753.600	
	REALTY INCOME CORP	159.000	8,326.830	
	REGENCY CENTERS CORP	140.000	5,412.400	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	58.000	18,260.140	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	147.000	8,249.640	
	SL GREEN	17.000	871.420	
	SUN COMMUNITIES INC	41.000	5,226.680	
	UDR INC	161.000	6,269.340	
	VENTAS INC	180.000	5,632.200	
	VEREIT INC	549.000	2,701.080	
	VICI PROPERTIES INC	207.000	3,330.630	
	VORNADO REALTY TRUST	57.000	2,396.850	
	WELLTOWER INC	178.000	8,739.800	
	WEYERHAEUSER CO	339.000	6,813.900	
	WP CAREY INC	123.000	7,744.080	
アメリカ・ドル　小計		6,668.000	393,769.310 (42,483,769)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	255.000	993.220	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	322.000	2,062.080	
	SEGRO PLC	290.000	2,383.220	
イギリス・ポンド　小計		867.000	5,438.520 (732,841)	

	カナダ・ドル	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	175.000	2,464.000	
		H & R REAL ESTATE INVESTMENT	152.000	1,460.720	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	147.000	2,444.610	
	カナダ・ドル　小計		474.000	6,369.330 (489,419)	
	ユーロ	COVIVIO	34.000	2,014.500	
		GECINA SA	34.000	4,097.000	
		ICADE	19.000	1,406.950	
		KLEPIERRE	82.000	1,387.030	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	61.000	3,522.140	
	ユーロ　小計		230.000	12,427.620 (1,457,387)	
	香港・ドル	LINK REIT	1,107.000	77,932.800	
	香港・ドル　小計		1,107.000	77,932.800 (1,084,825)	
投資証券　合計			9,346	46,248,241 (46,248,241)	
合計				49,073,681 (49,073,681)	

（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	597銘柄	64.42	－	－	72.18
	投資証券	41銘柄	－	－	2.14	
イギリス・ポンド	株式	89銘柄	4.62	－	－	5.05
	投資証券	3銘柄	－	－	0.04	
イスラエル・シュケル	株式	7銘柄	0.10	－	－	0.11
オーストラリア・ドル	株式	53銘柄	1.85	－	－	2.12
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.10	－	
カナダ・ドル	株式	73銘柄	3.03	－	－	3.32
	投資証券	3銘柄	－	－	0.02	
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	0.31	－	－	0.38
	投資信託受益証券	4銘柄	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式	37銘柄	3.35	－	－	3.63
スウェーデン・クローナ	株式	31銘柄	0.84	－	－	0.91
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	0.68	－	－	0.74
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.10	－	－	0.11
ノルウェー・クローネ	株式	8銘柄	0.16	－	－	0.17
ユーロ	株式	222銘柄	9.30	－	－	10.16
	投資証券	5銘柄	－	－	0.07	
香港・ドル	株式	32銘柄	0.97	－	－	1.11
	投資証券	1銘柄	－	－	0.05	

（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2年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	10,067,267
コール・ローン	262,693,300
国債証券	16,947,449,272
未収利息	126,480,622
前払費用	8,700,716
流動資産合計	17,355,391,177
資産合計	17,355,391,177
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	7,182,998,461
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,172,392,716
元本等合計	17,355,391,177
純資産合計	17,355,391,177
負債純資産合計	17,355,391,177

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（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2年4月20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	7,820,719,594円
同期中追加設定元本額	7,891,859円
同期中一部解約元本額	645,612,992円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	5,287,394,806円
海外国債ファンド（３ヵ月決算型）	954,120,018円
新光７資産バランスファンド	230,356,162円
海外国債ファンド（１年決算型）	21,641,201円
海外国債ファンド（変額年金）	677,708,726円
グローバル・ナビ	11,777,548円
計	7,182,998,461円
２．　受益権の総数	7,182,998,461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　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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2年4月20日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	477,609,444
合計	477,609,444

（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（令和1年11月5日から令和2年4月20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2年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4162円 (24,162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2年4月20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 1.5 02/15/30	5,000,000.000	5,400,390.600	
		US T N/B 1.625 08/15/29	6,000,000.000	6,538,125.000	
		US T N/B 1.75 11/15/29	5,500,000.000	6,063,750.000	
		US T N/B 2.25 08/15/27	5,000,000.000	5,615,625.000	
		US T N/B 2.25 11/15/27	5,000,000.000	5,629,687.500	
		US T N/B 2.375 05/15/27	7,500,000.000	8,461,523.400	
		US T N/B 2.375 05/15/29	6,000,000.000	6,925,312.500	
		US T N/B 2.375 11/15/49	500,000.000	634,765.620	
		US T N/B 2.625 02/15/29	6,000,000.000	7,034,531.210	
		US T N/B 2.625 08/15/20	1,000,000.000	1,008,242.180	
		US T N/B 2.75 02/15/28	5,000,000.000	5,835,937.500	
		US T N/B 2.875 05/15/28	6,000,000.000	7,086,562.500	
		US T N/B 2.875 08/15/28	6,000,000.000	7,110,468.710	
		US T N/B 3.125 11/15/28	6,000,000.000	7,261,406.220	
	アメリカ・ドル　小計		70,500,000.000 (7,606,245,000)	80,606,327.940 (8,696,616,721)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.875 10/22/29	2,000,000.000	2,119,014.400	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,300,000.000	1,404,156.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,000,000.000	1,124,287.500	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,200,000.000	1,571,172.000	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,200,000.000	1,798,884.000	
	イギリス・ポンド　小計		6,700,000.000 (902,825,000)	8,017,513.900 (1,080,359,998)	
	カナダ・ドル	CANADA 1.0 06/01/27	1,500,000.000	1,554,390.000	
		CANADA 2.0 06/01/28	2,000,000.000	2,238,820.000	
		CANADA 2.25 06/01/29	2,000,000.000	2,306,620.000	
	カナダ・ドル　小計		5,500,000.000 (422,620,000)	6,099,830.000 (468,710,937)	
	ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,000,000.000	1,048,710.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,700,000.000	1,821,777.800	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,000,000.000	2,138,620.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,500,000.000	1,628,460.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,500,000.000	2,706,937.500	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	2,500,000.000	2,622,312.500	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	900,000.000	1,299,888.000	

		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,000,000.000	1,487,580.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	900,000.000	1,503,882.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,000,000.000	1,521,930.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,300,000.000	2,296,152.100	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,000,000.000	3,143,475.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,000,000.000	3,204,366.000	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,500,000.000	3,742,571.000	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,500,000.000	1,620,975.000	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,871,064.000	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	4,502,463.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,000,000.000	2,053,488.000	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,000,000.000	2,059,799.600	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,000,000.000	1,040,800.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,000,000.000	2,171,014.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,000,000.000	2,207,942.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.000	2,472,326.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,000,000.000	1,300,000.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,000,000.000	2,681,600.000	
	ユーロ　小計		49,300,000.000 (5,781,411,000)	57,148,133.500 (6,701,761,616)	
国債証券　合計			14,713,101,000 (14,713,101,000)	16,947,449,272 (16,947,449,272)	
合計				16,947,449,272 (16,947,449,272)	

（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　14銘柄	50.11	51.32
イギリス・ポンド	国債証券　5銘柄	6.22	6.37
カナダ・ドル	国債証券　3銘柄	2.70	2.77
ユーロ	国債証券　25銘柄	38.61	39.54

（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2年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	5,633,397
コール・ローン	5,078,958
投資証券	684,881,278
未収配当金	862,872
流動資産合計	696,456,505
資産合計	696,456,505
負債の部	
流動負債	
未払解約金	750,000
流動負債合計	750,000
負債合計	750,000
純資産の部	
元本等	
元本	433,900,439
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	261,806,066
元本等合計	695,706,505
純資産合計	695,706,505
負債純資産合計	696,456,505

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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	378,234,559円
同期中追加設定元本額	97,359,824円
同期中一部解約元本額	41,693,944円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	428,106,157円
グローバル・ナビ	5,794,282円
計	433,900,439円
２．　受益権の総数	433,900,439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　令和1年10月22日 至　令和2年4月20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2年4月20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2年4月20日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	△105,761,377
合計	△105,761,377

（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2年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6034円 (16,034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2年4月20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	523.000	6,014.500	
		AGREE REALTY CORP	254.000	15,821.660	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	420.000	4,880.400	
		ALEXANDER'S INC.	13.000	3,877.120	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	766.000	118,967.460	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	296.000	7,770.000	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	841.000	28,316.470	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	654.000	4,447.200	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	1,623.000	40,331.550	
		AMERICAN TOWER CORP	2,779.000	706,032.740	
		AMERICOLD REALTY TRUST	1,209.000	41,432.430	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	933.000	36,526.950	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,292.000	10,646.080	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	342.000	3,057.480	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	551.000	381.840	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	880.000	149,925.600	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	144.000	849.600	
		BOSTON PROPERTIES INC	977.000	93,303.500	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	184.000	463.680	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	1,072.000	11,331.040	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,826.000	17,127.880	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	404.000	3,842.040	
		BRT APARTMENTS CORP	60.000	531.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	589.000	51,725.980	
		CARETRUST REIT INC	584.000	10,068.160	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	300.000	2,196.000	
		CEDAR REALTY TRUST INC	525.000	443.620	
		CHATHAM LODGING TRUST	281.000	2,006.340	
		CITY OFFICE REIT INC	326.000	2,741.660	
		CLIPPER REALTY INC	88.000	440.000	
		COLONY CAPITAL INC	2,939.000	6,083.730	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	706.000	9,467.460	

		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	1,132.000	5,778.860	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	117.000	4,153.500	
		CORECIVIC INC	729.000	8,485.560	
		CORENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	79.000	1,003.300	
		COREPOINT LODGING INC	245.000	784.000	
		CORESITE REALTY CORP	230.000	27,427.500	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	689.000	17,920.890	
		COUSINS PROPERTIES INC	896.000	28,492.800	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2,622.000	438,005.100	
		CUBESMART	1,212.000	30,966.600	
		CYRUSONE INC	706.000	48,678.700	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,232.000	5,999.840	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,649.000	246,030.800	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	1,449.000	3,984.750	
		DOUGLAS EMMETT INC	1,047.000	32,320.890	
		DUKE REALTY TRUST	2,321.000	81,049.320	
		EAST GROUP	235.000	25,248.400	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	455.000	12,339.600	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	920.000	8,188.000	
		EPR PROPERTIES	479.000	11,773.820	
		EQUINIX INC	538.000	373,883.100	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,095.000	69,423.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	2,311.000	161,284.690	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	560.000	6,283.200	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	413.000	107,726.920	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	793.000	73,828.300	
		FARMLAND PARTNERS INC	170.000	1,052.300	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	471.000	35,494.560	
		FIRST INDUSTRIAL RT	772.000	27,460.040	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	429.000	8,369.790	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	635.000	3,562.350	
		FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	303.000	3,669.330	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,277.000	33,738.340	
		GEO GROUP INC	728.000	9,376.640	

GETTY REALTY CORP	204.000	4,922.520	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	199.000	2,837.740	
GLADSTONE LAND CORP	113.000	1,432.840	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	236.000	2,650.280	
GLOBAL NET LEASE INC	551.000	7,091.370	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	810.000	24,413.400	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,357.000	33,775.730	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3,197.000	83,953.220	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	210.000	1,054.200	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	628.000	23,989.600	
HOST HOTELS & RESORTS INC	4,490.000	51,051.300	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	934.000	23,004.420	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	557.000	5,024.140	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	397.000	7,018.960	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	71.000	4,174.800	
INVITATION HOMES INC	3,376.000	80,416.320	
IRON MOUNTAIN INC	1,799.000	44,957.010	
JBG SMITH PROPERTIES	752.000	24,643.040	
KILROY REALTY CORP	656.000	42,193.920	
KIMCO REALTY	2,541.000	22,665.720	
KITE REALTY GROUP TRUST	507.000	4,294.290	
LAMAR ADVERTISING CO	523.000	27,488.880	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,480.000	15,184.800	
LIFE STORAGE INC	285.000	26,564.850	
LTC PROPERTIES INC	241.000	8,654.310	
MACK CALI	530.000	8,533.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,240.000	55,630.800	
MID AMERICA	717.000	81,379.500	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	579.000	7,237.500	
NATIONAL HEALTH INVS INC	261.000	14,187.960	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,079.000	33,654.010	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	363.000	9,637.650	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	512.000	1,448.960	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	121.000	3,431.560	

		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	292.000	7,510.240	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	1,425.000	46,198.500	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	95.000	1,379.400	
		OUTFRONT MEDIA INC	878.000	11,694.960	
		PARAMOUNT GROUP INC	1,201.000	10,977.140	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	1,467.000	12,014.730	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	796.000	8,485.360	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	425.000	388.450	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	1,155.000	18,295.200	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	766.000	13,466.280	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	80.000	980.000	
		POTLATCH CORP	405.000	12,571.200	
		PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	280.000	1,962.800	
		PROLOGIS INC	4,633.000	417,989.260	
		PS BUSINESS PARKS	122.000	16,318.720	
		PUBLIC STORAGE	936.000	183,905.280	
		QTS REALTY TRUST INC	352.000	22,573.760	
		RAYONIER INC	796.000	19,438.320	
		REALTY INCOME CORP	2,060.000	107,882.200	
		REGENCY CENTERS CORP	1,050.000	40,593.000	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	699.000	5,668.890	
		RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,310.000	6,759.600	
		RETAIL VALUE INC	91.000	1,071.070	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	695.000	28,918.950	
		RLJ LODGING TRUST	1,035.000	8,528.400	
		RPT REALTY	478.000	2,652.900	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	300.000	8,385.000	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,234.000	16,239.440	
		SAFEHOLD INC	78.000	4,229.160	
		SAUL CENTERS INC	74.000	2,291.040	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	709.000	223,214.470	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	1,002.000	5,881.740	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	1,943.000	109,041.160	
		SITE CENTERS CORP	922.000	5,310.720	
		SL GREEN	486.000	24,912.360	

		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	610.000	16,280.900	
		STAG INDUSTRIAL INC	916.000	23,889.280	
		STORE CAPITAL CORP	1,318.000	22,353.280	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	633.000	3,101.700	
		SUN COMMUNITIES INC	572.000	72,918.560	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,374.000	11,885.100	
		TANGER FACTORY OUTLET	552.000	3,146.400	
		TAUBMAN CENTERS INC	359.000	14,726.180	
		TERRENO REALTY CORP	404.000	22,147.280	
		THE MACERICH COMPANY	869.000	6,056.930	
		UDR INC	1,832.000	71,338.080	
		UMH PROPERTIES INC	222.000	2,524.140	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	78.000	8,180.640	
		URBAN EDGE PROPERTIES	704.000	6,082.560	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES	181.000	2,324.040	
		VENTAS INC	2,353.000	73,625.370	
		VEREIT INC	6,575.000	32,349.000	
		VICI PROPERTIES INC	2,916.000	46,918.440	
		VORNADO REALTY TRUST	1,091.000	45,876.550	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,143.000	868.680	
		WASHINGTON REIT	504.000	11,546.640	
		WEINGARTEN REALTY INVST	744.000	11,107.920	
		WELLTOWER INC	2,595.000	127,414.500	
		WEYERHAEUSER CO	4,706.000	94,590.600	
		WHITESTONE REIT	234.000	1,368.900	
		WP CAREY INC	1,079.000	67,933.840	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	694.000	6,239.060	
	アメリカ・ドル　小計		152,364.000	6,347,958.830 (684,881,278)	
投資証券　合計			152,364	684,881,278 (684,881,278)	
合計				684,881,278 (684,881,278)	

（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　162銘柄	98.44	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」の状況

「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2年4月30日現在

Ⅰ　資産総額	4,241,137,296円
Ⅱ　負債総額	1,200,815円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,239,936,481円
Ⅳ　発行済数量	5,037,914,210口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8416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2年4月30日現在

Ⅰ　資産総額	2,296,221,396円
Ⅱ　負債総額	3,466,740円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,292,754,656円
Ⅳ　発行済数量	1,145,314,759口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0019円

新光日本債券インデックスマザーファンド

令和2年4月30日現在

Ⅰ　資産総額	8,232,667,510円
Ⅱ　負債総額	116,043,600円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	8,116,623,910円
Ⅳ　発行済数量	6,271,508,795口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2942円

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

令和2年4月30日現在

Ⅰ　資産総額	1,416,240,500円
Ⅱ　負債総額	2,553,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,413,687,500円
Ⅳ　発行済数量	858,639,932口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6464円

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和2年4月30日現在

Ⅰ　資産総額	2,022,211,402円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,022,211,402円
Ⅳ　発行済数量	873,115,216口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3161円

海外国債マザーファンド

令和2年4月30日現在

Ⅰ　資産総額	17,200,631,159円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,200,631,159円
Ⅳ　発行済数量	7,174,656,595口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3974円

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

令和2年4月30日現在

Ⅰ　資産総額	694,665,024円
Ⅱ　負債総額	77,000,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	617,665,024円
Ⅳ　発行済数量	385,020,860口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6042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（2020年4月30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（2020年4月30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。

2020年4月30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	1,147,569,054,025
追加型株式投資信託	858	12,752,574,416,317
単位型公社債投資信託	37	96,812,263,974
単位型株式投資信託	183	1,275,450,528,810
合計	1,104	15,272,406,263,126

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。

2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第35期事業年度（自2019年4月1日至2020年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	△7
評価・換算差額等計	846,755	△7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第34期（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
						その他利益剰余金			
		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	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	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

第35期（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	（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。
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1．有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

※1．固定資産除却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

2020年6月17日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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	－

第35期（2020年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
①非上場株式	276,764	259,369
②関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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34期（2019年3月31日現在）

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

第35期（2020年3月31日現在）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
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276,764千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第35期（2020年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計			
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	2,988	3,000	△ 11
小計	2,988	3,000	△ 11
合計	2,988	3,000	△ 11

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

区分	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
株式	394,222	353,644	―
投資信託	―	―	―

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

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

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

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

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～4.42%	1.00%～4.42%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

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

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

（2）損益計算書項目

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

（注）営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,241,252千円	5,149,555千円

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

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34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	5,793,912	未払手数料	1,112,061
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	－	－	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	10,294,840	未払手数料	1,231,431

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

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

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

（1株当たり情報）

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	―	―
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

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

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 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	2020年 1月21日
有価証券報告書	2020年 1月21日
臨時報告書	2019年 11月6日、2020年 2月3日

独立監査人の監査報告書

２０２０年5月２７日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　山野　　浩　　印

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　長谷川　敬　　印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

（注２）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２年６月５日

アセットマネジメントOne株式会社

取　締　役　会　御　　中

EY新日本有限責任監査法人

東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　　長　谷　川　　敬　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「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令和１年１０月２２日から令和２年４月２０日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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２年４月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメント0ne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。