

## 【表紙】

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

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

グローバル・ナビ

愛称として「世界の潮流」という名称を用いることがあります。

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

(イ) 追加型株式投資信託(契約型)の受益権です。

(ロ) 当初元本は1口当たり1円です。

(ハ) アセットマネジメントOne株式会社(以下「委託者」または「委託会社」といいます。)

の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付け、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

3兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

(イ) 発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時~午後5時です。)

インターネットホームページ

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

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

**(5) 【申込手数料】**

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.75%（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および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

**(6) 【申込単位】**

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

(7) 【申込期間】

2020年9月17日から2021年3月15日までです。

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所(販売会社)については、下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### a. ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属し、主としてマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」という場合があります。）および上場投資信託証券（以下「ETF」という場合があります。）に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

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

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類の定義

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

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分の定義

資産複合（株式一般、その他資産（株式一般、債券一般、不動産投信）（資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、複数資産（株式一般、投資信託証券への投資を通じて実質的に株式一般、債券一般、不動産投信）を投資対象とするものをいう。 資産配分変更型とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（含む日本） エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（含む日本）・エマージング地域（複数の新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり （部分ヘッジ）（注）	目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

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

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

## b. ファンドの特色

1 国内外の株式、債券、REIT\*<sup>1</sup>に分散投資を行います。

- 当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

※詳しくは後述「ファンドの仕組み」をご覧ください。

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

- 新興国株式については、ETF\*<sup>2</sup>への投資を行います。  
ETFについては、規模、流動性、ベンチマーク指数などを総合的に判断して、銘柄を決定します。
- 効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、国債先物取引などを利用することがあります。

\*1「REIT」とは、不動産投資信託証券を指します。

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

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

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

## 当ファンドの資産配分について

## Step1 株式と債券の配分比率決定・見直し

- ◆主に株式を中心とする投資環境見通しに基づいて、株式(REITを含む)と債券(現預金などを含む)の配分比率を決定します。
- ◆配分比率は、株式比率で概ね10%~90%の範囲で、投資環境の変化に応じて機動的に見直しを行います。

<配分比率決定・見直しのイメージ>



## Step2 各資産の配分比率決定

- ◆Step1の株式・債券の配分比率に基づき、各資産の魅力度評価とリスク判断に応じて、それぞれの配分比率を決定します。
- ◆株式・債券の配分比率内において、各資産の配分比率に制限はありません。



**(参考)当ファンドが投資する各マザーファンドの運用方針****国内株式****●ニュートピックス インデックス マザーファンド**

- 東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資し、東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。

**先進国株式****●新光外国株式インデックスマザーファンド**

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

**国内債券****●新光日本債券インデックスマザーファンド**

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

**先進国債券****●海外国債マザーファンド**

- 主として日本を除く世界主要先進国(アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国)が発行する公社債に投資し、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、7~10年、円ベース)をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指します。
- 外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。

**●新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)**

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

**新興国債券****●グローバル高金利通貨マザーファンド**

- 新興国を中心とする世界の国の中から、主として地域分散と金利水準の観点により選定した複数の通貨建ての国際機関債などに分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- 通貨配分は、北米・中南米、欧州、アジア・オセアニア、中東・アフリカの4地域について、それぞれ25%程度とすることを基本とします。各地域内における通貨配分は、金利水準や金利・為替動向、流動性などを勘案して決定します。  
※流動性の低下、市場規模の縮小、通貨制度の変更などにより、各地域に対する通貨配分比率を25%程度にできない場合があります。
- 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

**国内REIT****●新光J-REITマザーファンド**

- 主として東証REIT指数の採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うことにより、東証REIT指数(配当込み)に連動する投資成果を目指した運用を行います。

**先進国REIT****●新光米国REITマザーファンド**

- 主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券(REIT)に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。
- 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

上記の各マザーファンドの運用方針は、各マザーファンドの内容を要約したものであり、そのすべてではありません。

また、記載内容は2020年9月16日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

**(参考)当ファンドの投資対象候補であるETFの概要(2020年9月16日現在)****新興国株式**

下記の投資対象候補およびその概要は2020年9月16日現在のものであり、今後予告なく変更する場合があります。

**●名称:iシェアーズ・コア MSCI エマージング・マーケット ETF**

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

**■ 分配方針**

原則として、年1回(毎年12月15日。休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。

- ◆分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。
- ◆分配金額は、基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。
- ◆留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

※運用状況により分配金額は変動します。

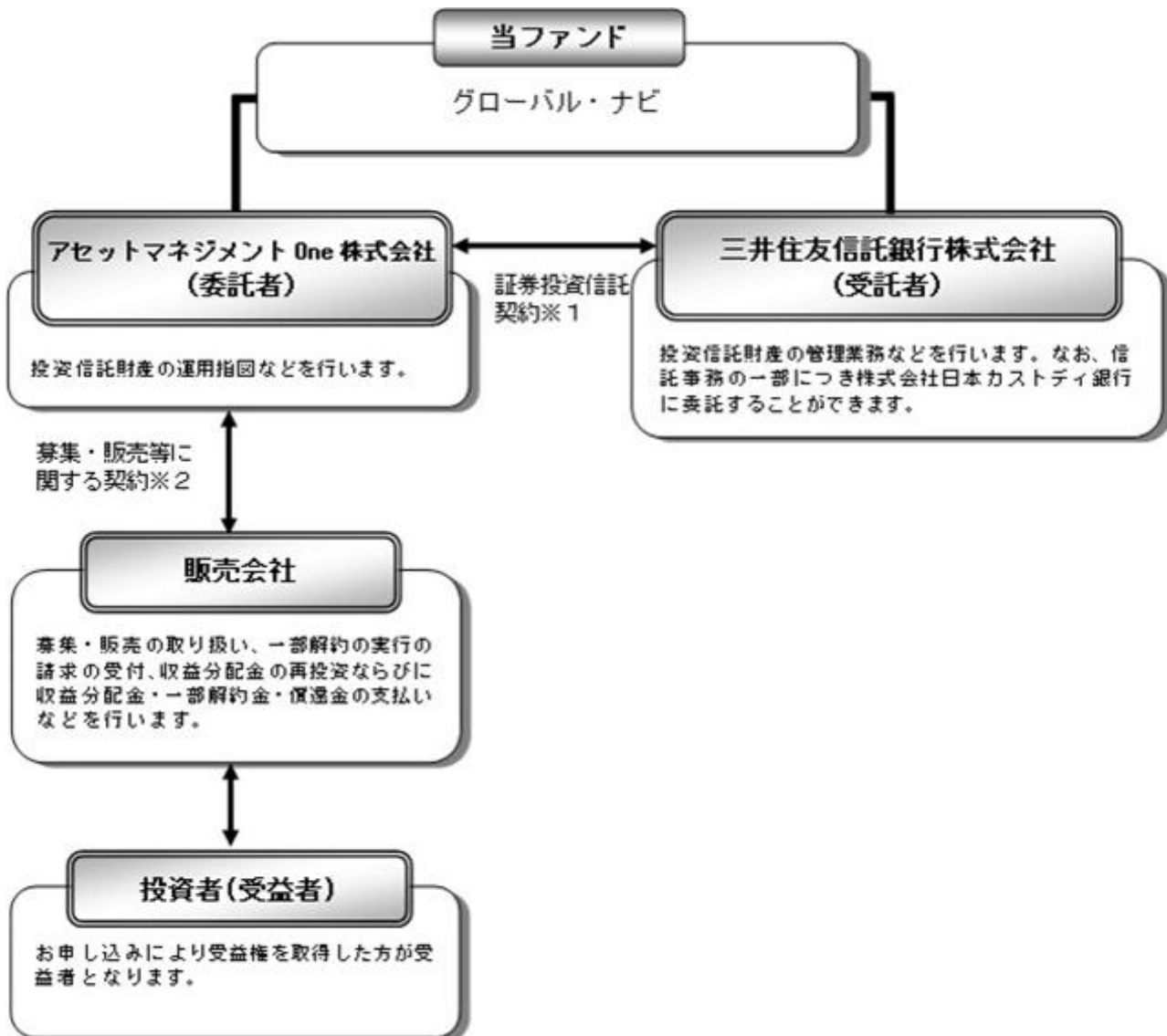
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

**(2) 【ファンドの沿革】**

2014年1月6日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

## (3) 【ファンドの仕組み】

## a. ファンドの仕組み



## 1 証券投資信託契約

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

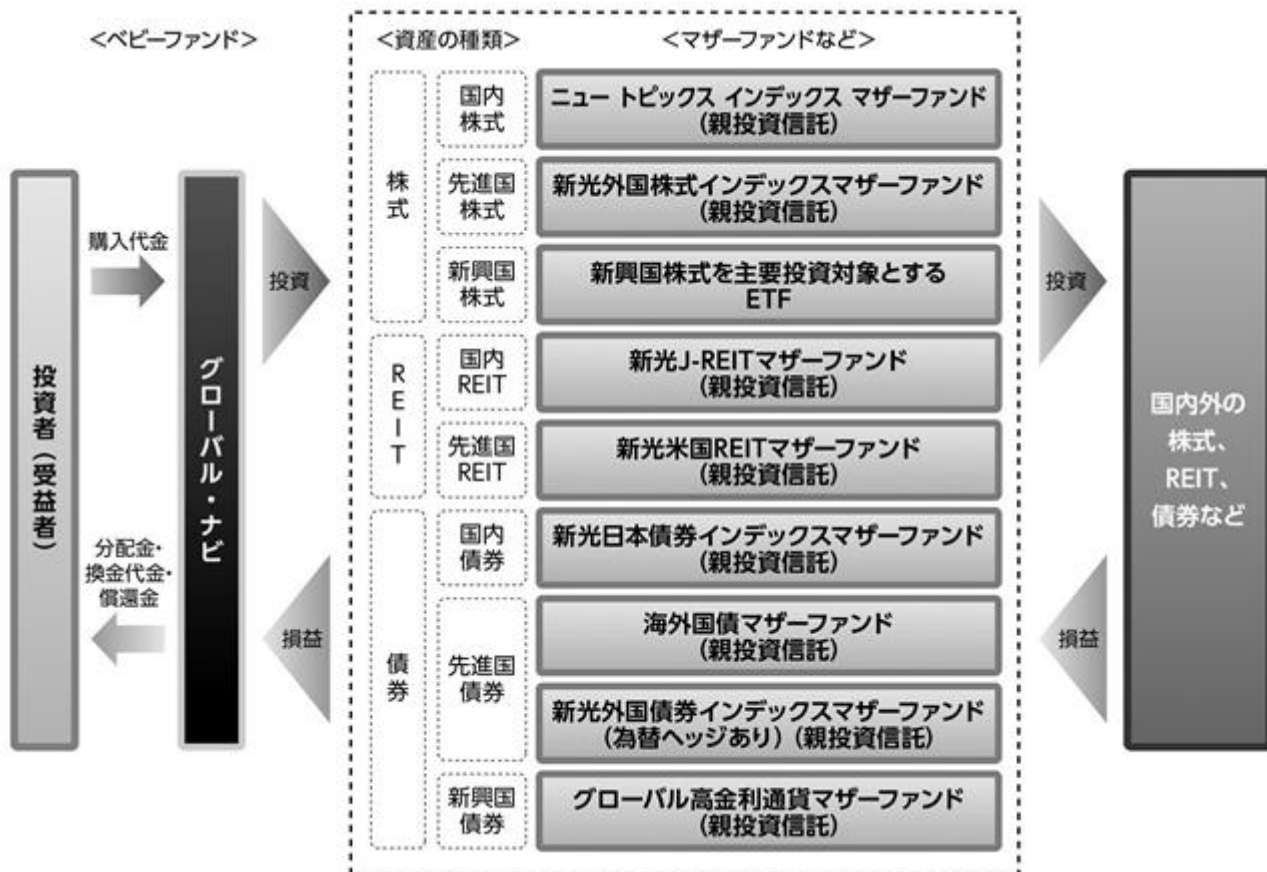
## 2 募集・販売等に関する契約

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

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

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

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



## b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2020年6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ルリュ・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6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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### a. 基本方針

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

#### b. 運用の方法

##### (イ) 主要投資対象

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

##### (ロ) 投資態度

主としてマザーファンド受益証券、および新興国株 E T F に投資することにより、実質的にわが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券に分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。投資対象のマザーファンド、および上場投資信託証券は以下の通りとします。

内国証券投資信託(親投資信託)	ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光外国株式インデックス マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光日本債券インデックス マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	海外国債 マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光外国債券インデックス マザーファンド(為替ヘッジあり) 受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	グローバル高金利通貨 マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光 J - R E I T マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光米国 R E I T マザーファンド受益証券
新興国株 E T F	

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

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

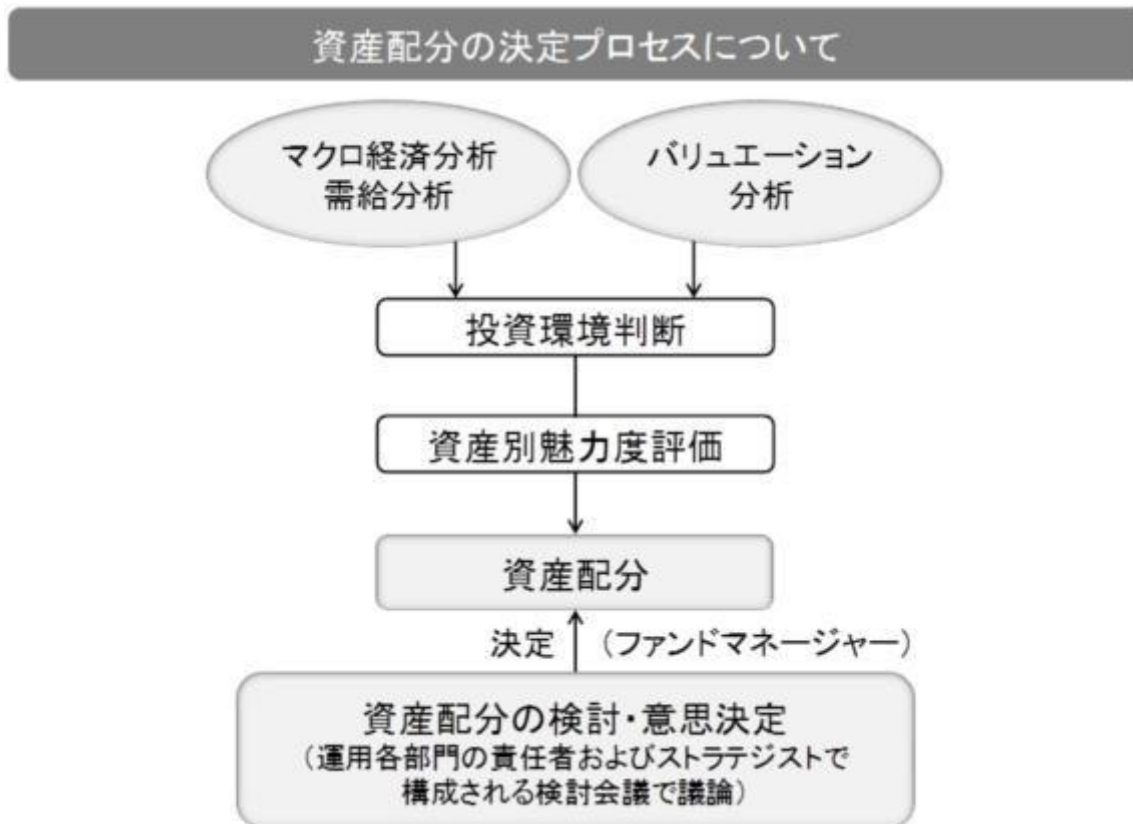
各マザーファンド受益証券と上場投資信託証券を合算した投資比率は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げることがあります。

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

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

## 運用プロセス

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



運用プロセスは2020年6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。

### 各マザーファンドの運用方針

#### ニュー トピックス インデックス マザーファンド

##### 1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数に連動する投資成果をめざした運用を行います。

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。

###### (2) 投資態度

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。

資金の流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。

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

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

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

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資は行いません。

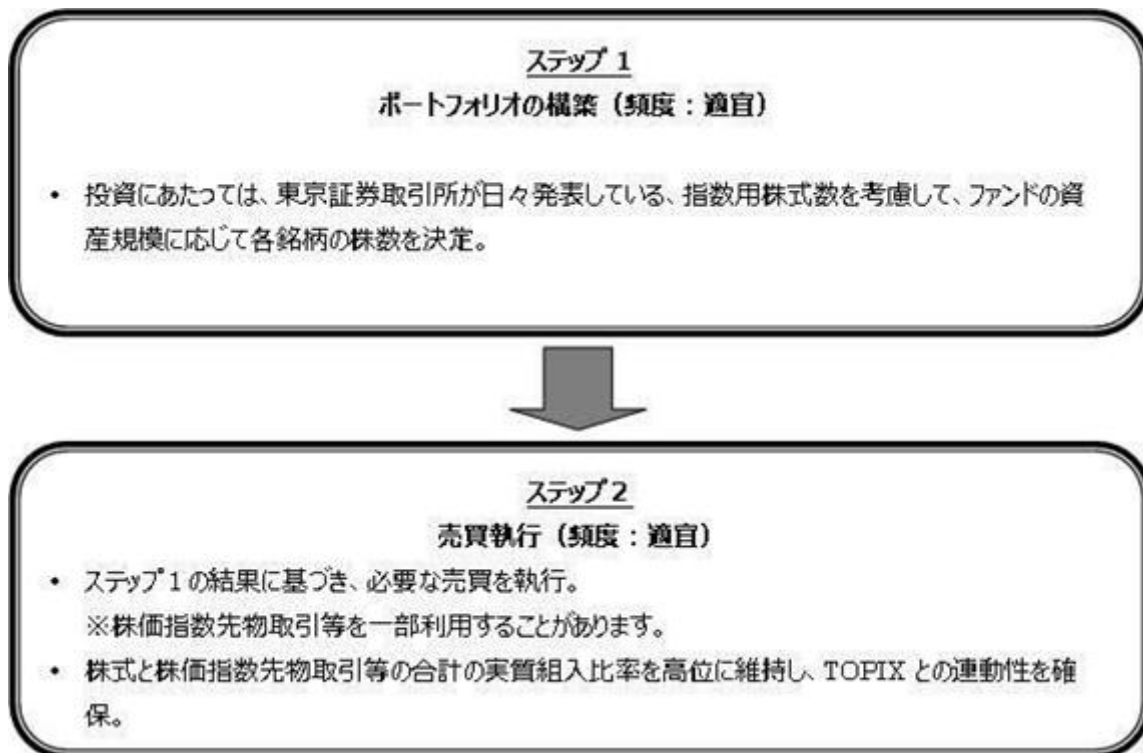
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

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

## 運用プロセス

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



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6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。



## 新光外国株式インデックスマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### 3. 収益分配方針

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

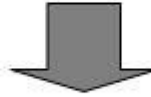
## 運用プロセス

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

### 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6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。

## 新光日本債券インデックスマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA - BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方針

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

#### (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

### 3. 収益分配方針

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

## 運用プロセス

新光日本債券インデックスマザーファンドは、以下のプロセスにより「NOMURA-BPI総合」指数に連動する投資成果をめざした運用を行います。



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2020年6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。

### 海外国債マザーファンド

#### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

日本を除く、FTSE世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

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

運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。

(イ) 超過収益獲得の観点から

- ・通貨アロケーション： 投資環境判断に基づいて、通貨圏毎にオーバーウエイトやアンダーウエイトを行うこと。
- ・イールドカーブ戦略： 市場別のイールドカーブの形状予測に基づいて、ポートフォリオの構成を変化させること。
- ・セクターアロケーション： ある公社債と同等の格付けがありながら上乗せ金利のある他の公社債へ投資すること。アメリカを中心に、国債と格付けが同等で上乗せ金利のある政府機関債へ投資します。

(ロ) リスク管理の観点から

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

外貨建資産については、ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。

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

3. 収益分配方針

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

## 運用プロセス

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



運用プロセスは2020年6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。

### 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 1．基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。

#### 2．運用方法

##### （1）投資対象

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

##### （2）投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

##### （3）投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

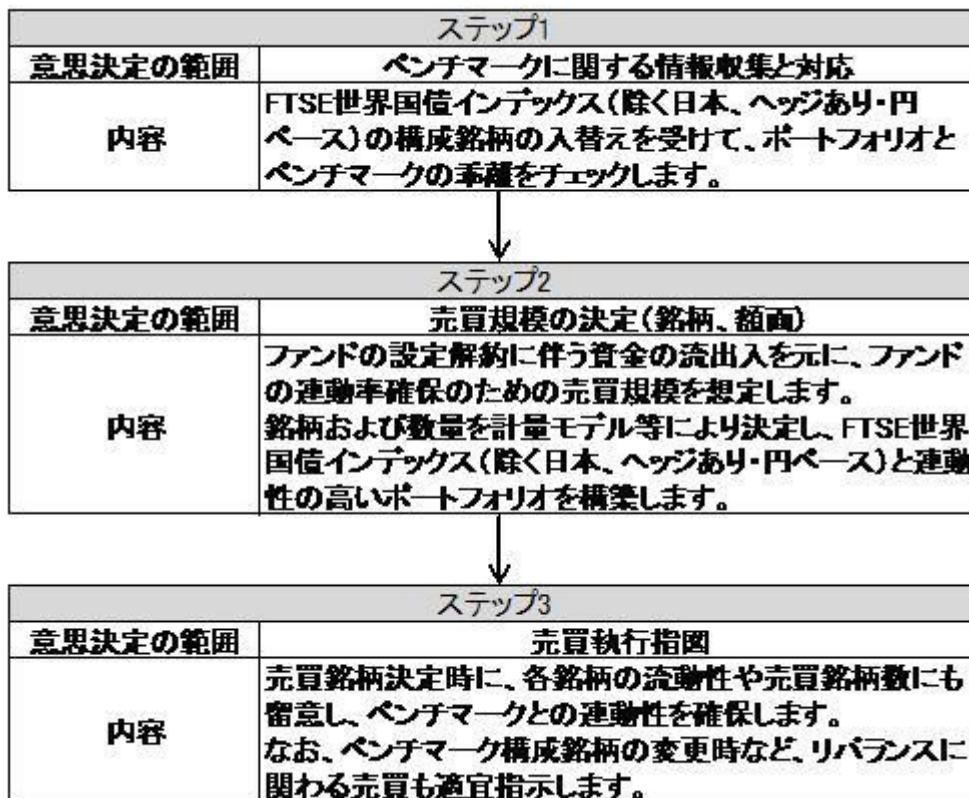
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

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

### 運用プロセス

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)は、以下のプロセスにより「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)」に連動する投資成果をめざした運用を行います。



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2020年6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。

## グローバル高金利通貨マザーファンド

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

世界各国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

通貨配分は、北米・中南米、欧州、アジア・オセアニア、中東・アフリカの4地域についてそれぞれ25%程度とすることを基本とします。ただし、流動性の低下、市場規模の縮小、通貨制度の変更等により、各地域に対する通貨配分比率を25%程度とできない場合があります。

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

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

組入公社債の平均残存期間は、1～3年程度とします。

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

#### (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

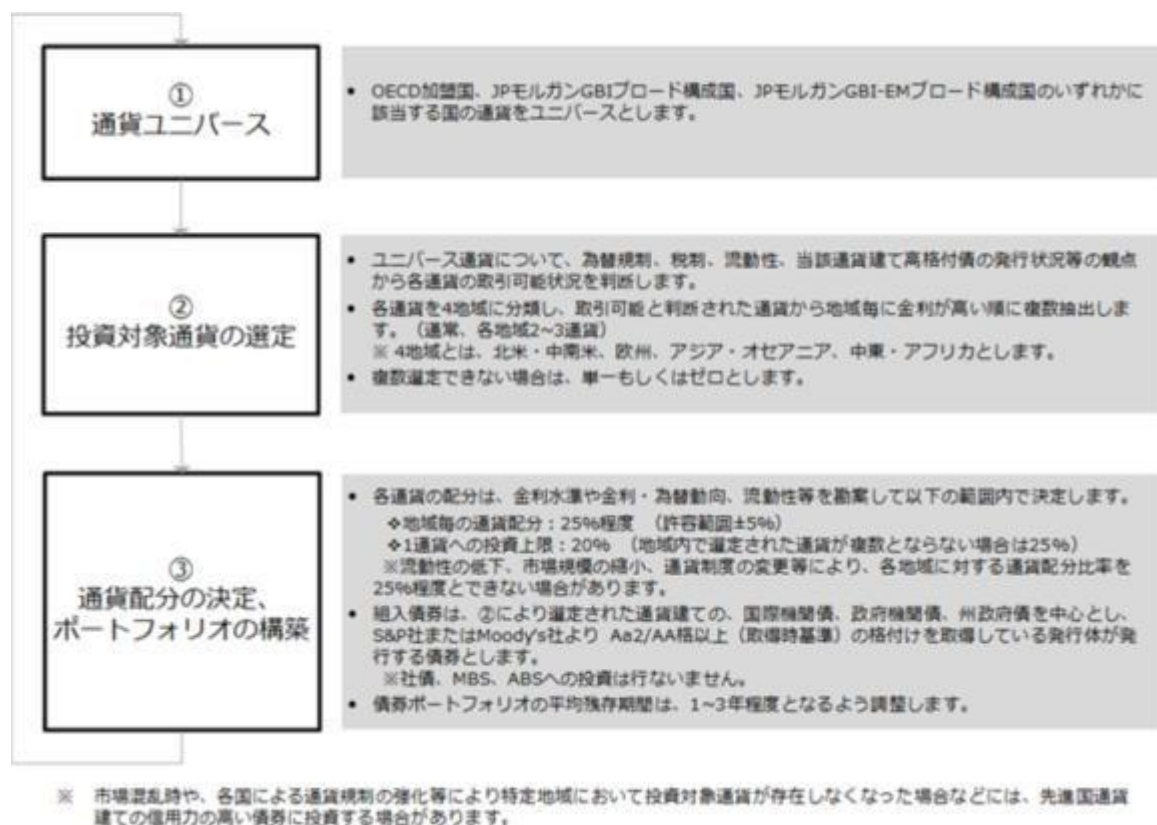
### 3. 収益分配方針

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



## 運用プロセス

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



運用プロセスは2020年6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。

## 新光J - R E I Tマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、東証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。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

主として東証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・解約が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

### （３）投資制限

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

不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資は行いません。

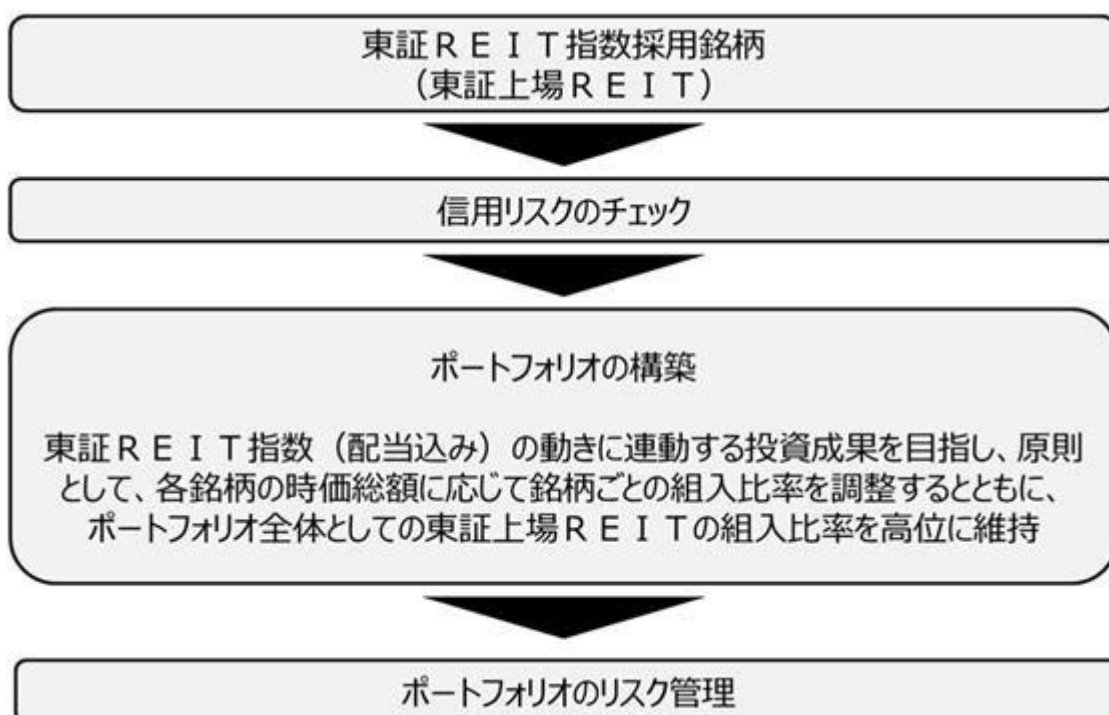
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

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

### 運用プロセス

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



1. 原則として、東証REIT指数採用銘柄をすべてポートフォリオに組入れます。ただし、財務データ分析等に基づき信用リスクをチェックし、信用リスクが高いと判断される銘柄については、東証REIT指数（配当込み）に対する連動性を勘案しつつ、投資対象から除外する場合があります。

2. 東証REIT指数採用銘柄に対して投資を行い、ポートフォリオを構築します。ポートフォリオの構築にあたっては、原則として、各銘柄の時価総額に応じて銘柄ごとの組入比率を調整するとともに、ポートフォリオ全体としての東証上場REIT指数の組入比率(各銘柄の組入比率の合計)を、でき得る限り100%に近づけるよう高位に維持し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。
3. 東証REIT指数(配当込み)の動きと当ファンドの基準価額の値動きの乖離(トラッキングエラー)を日々管理し、修正が必要な場合は速やかにポートフォリオの見直しを実施します。

運用プロセスは2020年6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。

## 新光米国REITマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券(以下「REIT」といいます。)を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

REITの組入比率については、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

大量の追加設定・解約が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

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

REITへの投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

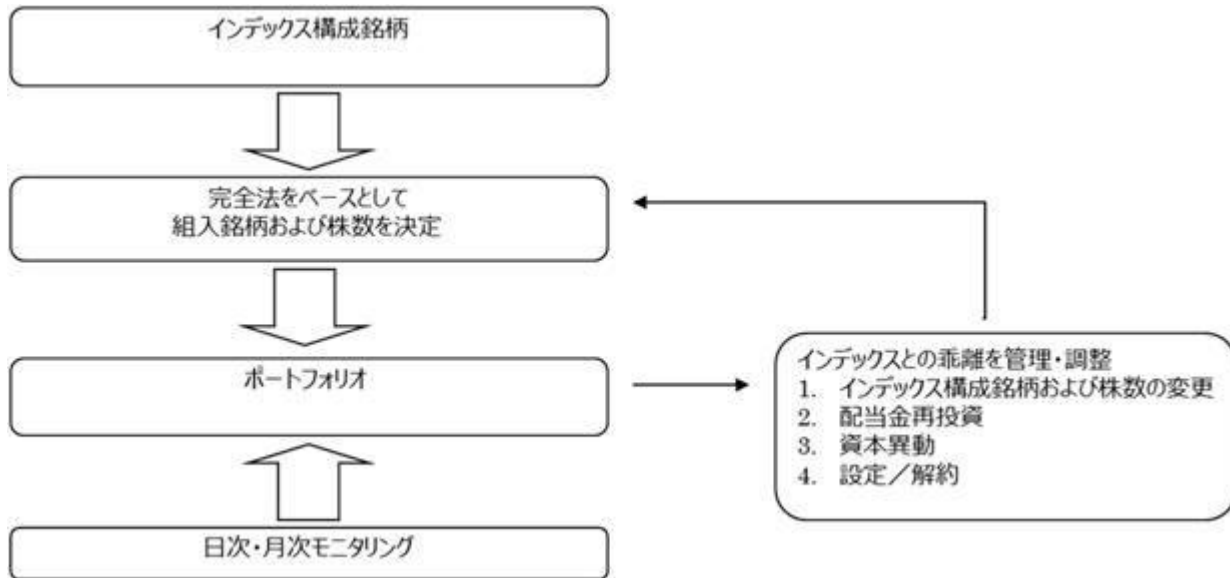
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

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

## 運用プロセス

新光米国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6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。

## (2) 【投資対象】

## a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款に定めるものに限ります。）
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

## b．有価証券および金融商品の指図範囲等

(イ) 委託者は、信託金を、主として第1号から第8号に掲げるアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下第1号から第8号までの親投資信託を総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第9号から第29号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券
- 2．新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券
- 3．新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券
- 4．海外国債マザーファンド受益証券
- 5．新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券
- 6．グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券
- 7．新光J - R E I Tマザーファンド受益証券
- 8．新光米国R E I Tマザーファンド受益証券
- 9．株券または新株引受権証書
- 10．国債証券
- 11．地方債証券
- 12．特別の法律により法人の発行する債券
- 13．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 14．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 15．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 16．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 17．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 18．コマーシャル・ペーパー
- 19．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 20．外国または外国の者の発行する証券または証書で、第9号から第19号までの証券または証書の性質を有するもの
- 21．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 22．投資証券、新投資口予約権証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 23．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 24．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）

25. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)

26. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

27. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

28. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

29. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第25号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

c. 先物

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

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

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

d. スワップ

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

- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとし、
- (ニ) 上記(ハ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
- (ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとし、

e. 金利先渡取引および為替先渡取引

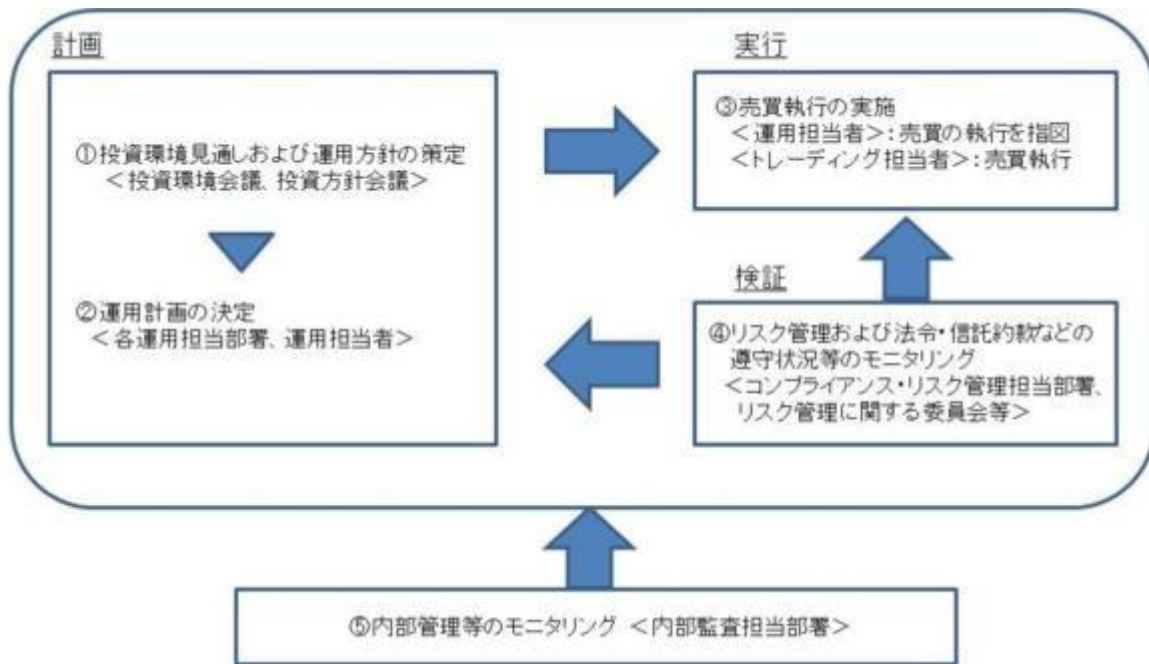
- (イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとし、なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が当該保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとし、

- (二) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産にかかる保有外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が当該保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ホ) 上記(ハ)(二)においてマザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ヘ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ト) 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。
- f. 直物為替先渡取引
- (イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 直物為替先渡取引の評価は、金融商品取引業者または銀行等が提示する価額もしくは価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。



## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

## 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2020年6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。  
上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

a. 収益分配は年1回、原則として、12月15日（該当日が休業日の場合は翌営業日。）の決算時に以下の方針に基づき行います。

1. 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
2. 分配金額は、基準価額水準や市況動向などを勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。
3. 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

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

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

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

## (5) 【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

## a. 株式等への投資割合

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

## b. 新株引受権証券等への投資割合

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

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

## c. 投資信託証券への投資割合

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

## d. 同一銘柄への投資割合

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

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

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

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

## e. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

## f. 投資する株式等の範囲

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

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

## g. 信用取引の指図範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。)の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

## h. 有価証券の貸し付けの指図および範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。

1. 株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
2. 公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託者は、有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

i．公社債の空売りの指図範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売り付けにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

j．公社債の借り入れ

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

k．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

l．外国為替予約の指図および範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図することができます。
- (ロ) 上記（イ）の予約取引の指図は、投資信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額（投資信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの投資信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記（ロ）の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

m. 資金の借入れ

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の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。

n. 利害関係人等との取引等

- (イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において投資信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- (ロ) 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- (ハ) 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- (ニ) 上記（イ）（ロ）（ハ）の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

o. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

p . 信用リスク集中回避のための投資制限

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

法令に定める投資制限

a . 同一の法人の発行する株式

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

（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

### 3【投資リスク】

#### （1）ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

a . 資産配分リスク

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

当ファンドの実質資産配分において、配分比率が大きい資産の収益率が低下した場合や、一つあるいは複数またはすべての資産価値が下落する場合にはその影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

b . 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、金利動向、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係などの影響を受け変動します。一般に、株価が下落した場合にはその影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

c . R E I Tの価格変動リスク

R E I Tの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

R E I Tの保有不動産の評価の下落、R E I Tの配当金の減少、企業体としてのR E I Tに対する評価の悪化などの原因によりR E I Tの価格が下落する場合があります。その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

## d．為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

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

## e．カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制などの要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。これらの影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。一般に新興国市場は、先進国市場に比べて規模が小さく、流動性も低く、金融インフラが未発達であり、様々な地政学的問題を抱えていることから、カントリーリスクはより高くなる可能性があります。

## f．金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

公社債の価格は、金利水準の変化にともない変動します。一般に、金利が上昇した場合には公社債の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

## g．信用リスク

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

有価証券などの発行体が業績悪化・経営不振あるいは倒産に陥った場合、当該有価証券の価値が大きく減少すること、もしくは無くなる場合があります。また、有価証券の信用力の低下や格付けの引き下げ、債務不履行が生じた場合には、当該有価証券の価格は下落します。これらの影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

## h．流動性リスク

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

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



i . 他のベビーファンドの影響

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

j . 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

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

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

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

## 東証株価指数について

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

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

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

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

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

ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社またはニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所はニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

## MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

本ファンドは、MSCI、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、アセットマネジメントOne株式会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

### **NOMURA - BPI総合について**

NOMURA - BPI総合とは、野村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。

### **FTSE世界国債インデックスについて**

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

### **東証REIT指数（配当込み）について**

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

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

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

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

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

新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

(株)東京証券取引所は、新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

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

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

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

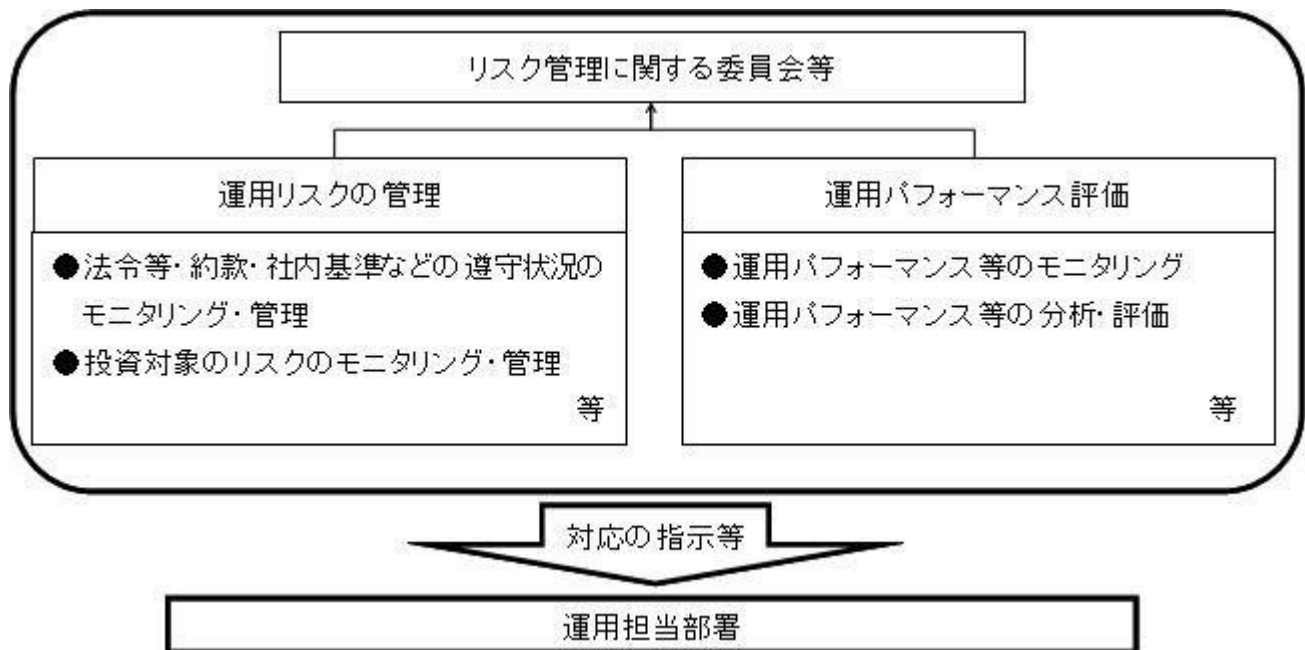
FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスとは、ニューヨーク証券取引所、アメリカン証券取引所、NASDAQ登録のすべてのEquity(エクイティ)型REITで構成される総合収益指数であり、FTSE International Limited(以下「FTSE」といいます。)が算出、公表しています。

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

## （２）リスク管理体制

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

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



リスク管理体制は2020年6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>

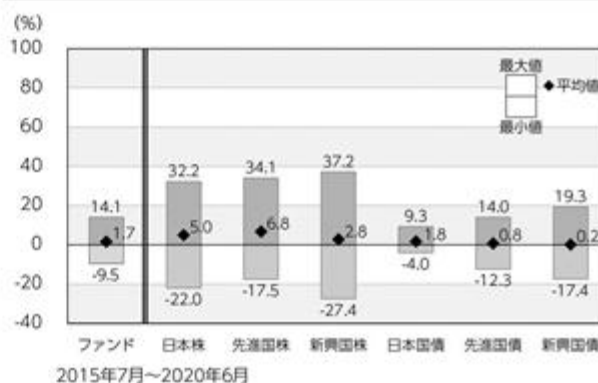
### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

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

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

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

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

###### a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

###### b. 信託財産留保額

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

「信託財産留保額」とは、ご解約による組入有価証券などの売却等費用について受益者間の公平を期するため、投資信託を途中解約される投資家にご負担いただくものです。

なお、これは運用資金の一部として投資信託財産に組み入れられます。

##### (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.562%（税抜1.42%）

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.67%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

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

#### （４）【その他の手数料等】

- a．投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、監査法人に支払うファンドの監査報酬、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。
- b．投資信託財産にかかる監査報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額とともに投資信託財産中から支払われます。
- c．証券取引に伴う手数料・税金等、当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税および資産を外国で保管する場合の費用、先物取引・オプション取引等に要する費用ならびに特定資産の価格調査費用についても投資信託財産が負担します。
- d．「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

- a．個人の受益者に対する課税

##### （イ）収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### （ロ）解約時および償還時

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



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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### (八) 損益通算について

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

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

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

#### b. 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 個別元本方式について

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

### c．個別元本について

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

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

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

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

### d．収益分配金の課税について

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

令和2年6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	10,153,934	5.13
内 アメリカ	10,153,934	5.13
親投資信託受益証券	177,846,528	89.85
内 日本	177,846,528	89.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,934,835	5.02
純資産総額	197,935,297	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6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	2,266,075,510	97.01
内 日本	2,266,075,510	97.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	69,955,933	2.99
純資産総額	2,336,031,443	100.00

その他資産の投資状況

令和2年6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）	62,340,000	2.67
内 日本	62,340,000	2.67

（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。

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和2年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,884,134,034	93.53
内 アメリカ	1,281,377,489	63.61
内 イギリス	90,148,958	4.47
内 スイス	73,046,000	3.63
内 フランス	67,268,642	3.34
内 カナダ	66,719,008	3.31
内 ドイツ	60,470,297	3.00
内 オーストラリア	41,088,035	2.04
内 オランダ	36,875,629	1.83
内 アイルランド	34,901,546	1.73
内 スウェーデン	19,130,409	0.95
内 スペイン	16,412,581	0.81
内 香港	15,791,294	0.78
内 デンマーク	15,730,630	0.78
内 イタリア	12,469,792	0.62

内	フィンランド	8,052,682	0.40
内	バミューダ	6,863,132	0.34
内	シンガポール	6,265,878	0.31
内	ジャージー	6,137,702	0.30
内	ベルギー	5,643,707	0.28
内	イスラエル	3,957,484	0.20
内	ケイマン諸島	3,765,011	0.19
内	ノルウェー	3,528,533	0.18
内	ニュージーランド	2,257,889	0.11
内	ルクセンブルグ	1,566,750	0.08
内	ポルトガル	1,215,232	0.06
内	オランダ領キュラソー	1,187,523	0.06
内	オーストリア	959,882	0.05
内	リベリア	438,965	0.02
内	パナマ	386,885	0.02
内	マン島	283,473	0.01
内	パプアニューギニア	192,996	0.01
投資信託受益証券		3,146,745	0.16
	内 オーストラリア	2,259,152	0.11
	内 シンガポール	887,593	0.04
投資証券		44,454,735	2.21
	内 アメリカ	40,776,734	2.02
	内 フランス	1,033,105	0.05
	内 香港	979,401	0.05
	内 イギリス	934,972	0.05
	内 オランダ	369,441	0.02
	内 カナダ	361,082	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		82,793,722	4.11
純資産総額		2,014,529,236	100.00

## その他資産の投資状況

令和2年6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）	73,078,409	3.63
内 アメリカ	49,254,687	2.44
内 ドイツ	15,604,790	0.77
内 イギリス	8,218,932	0.41

（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6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	6,222,173,200	74.01
内 日本	6,222,173,200	74.01
地方債証券	825,940,590	9.82
内 日本	825,940,590	9.82
特殊債券	730,599,000	8.69
内 日本	730,599,000	8.69
社債券	510,677,000	6.07
内 日本	510,677,000	6.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	117,822,043	1.40
純資産総額	8,407,211,833	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。

## 海外国債マザーファンド

令和2年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	17,180,594,098	98.04
内 アメリカ	7,339,180,601	41.88
内 フランス	3,258,954,598	18.60
内 イタリア	2,711,515,837	15.47
内 ドイツ	2,480,126,205	14.15
内 イギリス	909,155,797	5.19
内 カナダ	481,661,060	2.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	343,001,043	1.96
純資産総額	17,523,595,141	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。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

令和2年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	302,854,163	93.77
内 アメリカ	143,491,511	44.43
内 フランス	31,853,429	9.86
内 イタリア	27,560,864	8.53
内 イギリス	19,223,115	5.95
内 スペイン	17,363,426	5.38
内 ドイツ	16,871,901	5.22
内 オーストリア	9,958,386	3.08
内 ベルギー	6,722,098	2.08
内 オランダ	6,094,617	1.89
内 カナダ	5,608,612	1.74
内 オーストラリア	5,288,958	1.64
内 フィンランド	2,826,250	0.88
内 アイルランド	2,817,719	0.87
内 メキシコ	1,988,142	0.62
内 ポーランド	1,852,740	0.57
内 デンマーク	1,096,749	0.34
内 シンガポール	913,804	0.28
内 ノルウェー	713,034	0.22
内 スウェーデン	608,808	0.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	20,126,973	6.23
純資産総額	322,981,136	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。

## グローバル高金利通貨マザーファンド

令和2年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
特殊債券	3,725,589,606	94.96
内 国際機関	3,725,589,606	94.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	197,789,732	5.04
純資産総額	3,923,379,338	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6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	1,443,206,810	98.91
内 日本	1,443,206,810	98.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,948,290	1.09
純資産総額	1,459,155,100	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6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	625,324,114	98.96
内 アメリカ	625,324,114	98.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,574,270	1.04
純資産総額	631,898,384	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】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

令和2年6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	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	18,387,906	2.2766 41,863,575	2.1334 39,228,758	- -	19.82
2	海外国債マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	12,142,387	2.3759 28,849,150	2.4831 30,150,761	- -	15.23
3	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	23,258,726	1.2950 30,121,633	1.2838 29,859,552	- -	15.09
4	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	11,970,421	2.5845 30,938,336	2.4622 29,473,570	- -	14.89
5	新光外国債券インデックス マザーファンド（為替ヘッ ジあり） 日本	親投資 信託受 益証券	13,526,474	1.4280 19,316,576	1.4846 20,081,403	- -	10.15
6	ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	1,970	5,574.77 10,982,307	5,154.28 10,153,934	- -	5.13
7	グローバル高金利通貨マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	9,427,436	1.1600 10,936,500	1.0587 9,980,826	- -	5.04
8	新光J-REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,530,749	2.0319 11,238,218	1.7514 9,686,553	- -	4.89
9	新光米国REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,717,396	1.7926 10,249,407	1.6415 9,385,105	- -	4.74

（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6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	5.13
親投資信託受益証券	89.85
合計	94.98

（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6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	11,700	7,720.81 90,333,490	6,762.00 79,115,400	- -	3.39
2	ソニー 日本	株式 電気機器	6,600	8,012.21 52,880,641	7,384.00 48,734,400	- -	2.09
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	8,100	5,049.00 40,896,900	5,450.00 44,145,000	- -	1.89
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	900	40,470.00 36,423,000	45,030.00 40,527,000	- -	1.73
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	13,700	2,790.60 38,231,341	2,515.50 34,462,350	- -	1.48
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	8,700	4,405.07 38,324,151	3,848.00 33,477,600	- -	1.43
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	70,600	577.65 40,782,767	421.60 29,764,960	- -	1.27
8	任天堂 日本	株式 その他製品	600	43,200.00 25,920,000	48,010.00 28,806,000	- -	1.23
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	7,200	4,214.00 30,340,800	3,682.00 26,510,400	- -	1.13
10	第一三共 日本	株式 医薬品	3,000	7,200.00 21,600,000	8,806.00 26,418,000	- -	1.13
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	7,500	3,283.00 24,622,500	3,234.00 24,255,000	- -	1.04
12	信越化学工業 日本	株式 化学	1,800	12,365.00 22,257,000	12,595.00 22,671,000	- -	0.97
13	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	8,200	3,074.00 25,206,800	2,755.50 22,595,100	- -	0.97



14	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,300	15,580.00 20,254,000	17,335.00 22,535,500	- -	0.96
15	HOYA 日本	株式 精密機器	2,100	10,730.00 22,533,000	10,260.00 21,546,000	- -	0.92
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	7,100	3,979.38 28,253,628	3,032.00 21,527,200	- -	0.92
17	花王 日本	株式 化学	2,500	9,131.00 22,827,500	8,540.00 21,350,000	- -	0.91
18	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	7,300	3,113.47 22,728,373	2,882.00 21,038,600	- -	0.90
19	村田製作所 日本	株式 電気機器	3,100	6,870.00 21,297,000	6,316.00 19,579,600	- -	0.84
20	ファナック 日本	株式 電気機器	1,000	20,915.00 20,915,000	19,260.00 19,260,000	- -	0.82
21	中外製薬 日本	株式 医薬品	3,300	3,483.33 11,495,000	5,765.00 19,024,500	- -	0.81
22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	140,200	166.26 23,310,943	132.20 18,534,440	- -	0.79
23	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	700	25,300.00 17,710,000	26,440.00 18,508,000	- -	0.79
24	日本電産 日本	株式 電気機器	2,500	7,770.00 19,425,000	7,196.00 17,990,000	- -	0.77
25	日立製作所 日本	株式 電気機器	5,000	4,568.63 22,843,186	3,403.00 17,015,000	- -	0.73
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,600	6,147.00 22,129,200	4,698.00 16,912,800	- -	0.72
27	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	7,200	2,573.30 18,527,815	2,321.50 16,714,800	- -	0.72
28	S M C 日本	株式 機械	300	53,950.00 16,185,000	55,180.00 16,554,000	- -	0.71
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	9,100	1,895.50 17,249,050	1,799.50 16,375,450	- -	0.70
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	14,240.00 15,664,000	- -	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年6月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	97.01
合計	97.01

（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6月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	14.80
情報・通信業		9.64
化学		7.17
輸送用機器		7.11
医薬品		6.78
サービス業		5.09
機械		4.90
銀行業		4.84
小売業		4.69
卸売業		4.33
陸運業		3.89
食料品		3.86
精密機器		2.58
建設業		2.51
その他製品		2.33
不動産業		1.95
保険業		1.94
電気・ガス業		1.53
その他金融業		1.11
証券、商品先物取引業		0.78
ガラス・土石製品		0.73
非鉄金属		0.68
ゴム製品		0.61
鉄鋼		0.56
金属製品		0.53
繊維製品		0.48
石油・石炭製品		0.41
空運業		0.34
パルプ・紙		0.24
鉱業		0.19
倉庫・運輸関連業		0.17
海運業		0.13
水産・農林業		0.09
合計	97.01	

（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。

## 新光外国株式インデックスマザーファンド

令和2年6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	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,066	27,819.66 57,475,419	38,978.17 80,528,914	- -	4.00
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	3,411	15,792.74 53,869,065	21,379.92 72,926,926	- -	3.62
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	200	193,756.24 38,751,248	288,784.14 57,756,828	- -	2.87
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	1,136	20,191.98 22,938,097	23,771.75 27,004,712	- -	1.34
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	146	138,791.97 20,263,629	150,294.06 21,942,933	- -	1.09
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	140	138,622.40 19,407,137	150,531.09 21,074,353	- -	1.05
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	1,237	14,283.60 17,668,823	14,980.16 18,530,469	- -	0.92
8	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	805	18,988.33 15,285,607	20,619.28 16,598,521	- -	0.82
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	1,396	11,741.31 16,390,870	11,879.04 16,583,143	- -	0.82
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	1,158	12,785.64 14,805,773	12,676.68 14,679,605	- -	0.73
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	1,453	13,578.07 19,728,949	10,019.81 14,558,798	- -	0.72

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	444	27,451.87 12,188,633	31,218.74 13,861,121	- -	0.69
13	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	515	24,404.89 12,568,519	26,516.96 13,656,238	- -	0.68
14	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	423	29,058.96 12,291,944	31,560.27 13,349,997	- -	0.66
15	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,007	6,205.71 12,454,863	6,278.00 12,599,965	- -	0.63
16	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	333	33,909.06 11,291,718	37,526.76 12,496,414	- -	0.62
17	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	650	23,335.29 15,167,943	19,090.44 12,408,792	- -	0.62
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	1,927	6,315.13 12,169,258	5,892.30 11,354,463	- -	0.56
19	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	284	22,841.55 6,487,001	39,648.31 11,260,122	- -	0.56
20	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	3,373	4,107.91 13,855,985	3,222.50 10,869,503	- -	0.54
21	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	227	31,628.67 7,179,709	45,703.30 10,374,650	- -	0.51
22	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	846	14,303.85 12,101,065	12,015.16 10,164,829	- -	0.50
23	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	207	32,326.62 6,691,611	48,185.63 9,974,426	- -	0.50
24	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	2,000	5,138.62 10,277,249	4,972.20 9,944,402	- -	0.49
25	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	1,186	8,886.75 10,539,689	8,201.16 9,726,586	- -	0.48
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	1,018	9,816.30 9,992,996	9,439.15 9,609,056	- -	0.48

27	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,999	7,192.38 14,377,573	4,775.03 9,545,298	- -	0.47
28	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	526	10,773.93 5,667,089	18,138.02 9,540,603	- -	0.47
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	3,718	3,432.17 12,760,838	2,520.03 9,369,503	- -	0.47
30	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	1,918	5,512.74 10,573,447	4,779.34 9,166,786	- -	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6月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	93.53
投資信託受益証券	0.16
投資証券	2.21
合計	95.89

(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6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.19
医薬品		5.50
銀行		5.27
情報技術サービス		4.60
コンピュータ・周辺機器		4.25
半導体・半導体製造装置		3.74
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.74
インターネット販売・通信販売		3.54
石油・ガス・消耗燃料		3.20
保険		3.06
ヘルスケア機器・用品		2.95
資本市場		2.91
バイオテクノロジー		2.22
化学		2.08
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.99
電力		1.98
食品		1.89
各種電気通信サービス		1.82
飲料		1.72
専門小売り		1.70
航空宇宙・防衛		1.55
機械		1.53
食品・生活必需品小売り		1.46
金属・鉱業		1.45
娯楽		1.44
家庭用品		1.40

ホテル・レストラン・レジャー	1.37
繊維・アパレル・贅沢品	1.33
コングロマリット	1.10
メディア	1.05
陸運・鉄道	1.02
総合公益事業	0.99
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.93
自動車	0.89
各種金融サービス	0.85
タバコ	0.76
通信機器	0.75
専門サービス	0.75
電気設備	0.72
パーソナル用品	0.69
航空貨物・物流サービス	0.49
電子装置・機器・部品	0.49
複合小売り	0.48
建設関連製品	0.48
不動産管理・開発	0.46
商業サービス・用品	0.44
家庭用耐久財	0.34
消費者金融	0.32
商社・流通業	0.28
無線通信サービス	0.28
建設・土木	0.28
容器・包装	0.28
建設資材	0.23
自動車部品	0.22
ガス	0.18
運送インフラ	0.17
ヘルスケア・テクノロジー	0.17
エネルギー設備・サービス	0.13
水道	0.12
紙製品・林産品	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08
海運業	0.05
旅客航空輸送業	0.04
販売	0.04
レジャー用品	0.02
合計	93.53

(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6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	118.82 118,825,000	2.1 2029/12/28	1.41
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	118.23 118,230,000	2.22 2029/3/19	1.41
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	108.83 108,832,000	2.11 2024/12/20	1.29
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	105.81 105,817,000	0.781 2030/12/6	1.26
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	102.70 102,703,000	0.882 2023/6/16	1.22
6	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	102.36 102,361,000	0.484 2025/6/30	1.22
7	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	102.35 102,353,000	0.645 2024/3/15	1.22
8	4回 第一三共社債 日本	社債券	100,000,000	102.52 102,526,000	101.94 101,945,000	0.846 2023/9/15	1.21
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	101.88 101,889,000	0.715 2023/3/20	1.21
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	101.77 101,779,000	0.67 2023/3/27	1.21
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	101.68 101,684,000	0.7 2022/12/22	1.21
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	101.62 101,628,000	0.9 2022/3/14	1.21
13	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	100.84 100,847,000	0.205 2027/4/23	1.20
14	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	100.84 100,840,000	0.17 2027/10/29	1.20
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	100.73 100,730,000	0.195 2025/12/19	1.20
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	100.40 100,407,000	0.472 2021/12/24	1.19

17	11回 プリヂストーン社債 日本	社債券	100,000,000	100.07 100,075,000	99.75 99,754,000	0.295 2027/4/21	1.19
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	99.73 99,739,000	0.08 2022/9/20	1.19
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	102.52 92,269,800	0.4 2025/6/20	1.10
20	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	90,000,000	101.64 91,477,800	101.26 91,134,900	0.1 2026/6/20	1.08
21	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	103.24 82,596,000	102.39 81,915,200	0.4 2025/3/20	0.97
22	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.69 81,352,200	101.30 81,041,600	0.1 2026/12/20	0.96
23	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.77 81,421,600	101.28 81,026,400	0.1 2026/9/20	0.96
24	130回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	80,000,000	100.62 80,498,400	100.38 80,306,400	0.1 2021/12/20	0.96
25	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	70,000,000	103.59 72,513,700	102.80 71,962,100	0.8 2023/6/20	0.86
26	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	70,000,000	103.05 72,139,900	102.25 71,579,200	0.3 2025/12/20	0.85
27	328回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	70,000,000	102.68 71,876,700	102.03 71,422,400	0.6 2023/3/20	0.85
28	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	70,000,000	102.11 71,479,400	101.35 70,950,600	0.1 2028/3/20	0.84
29	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	70,000,000	101.93 71,351,100	101.35 70,946,400	0.1 2027/3/20	0.84
30	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	70,000,000	102.01 71,409,800	101.28 70,896,000	0.1 2028/9/20	0.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。



## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	74.01
地方債証券	9.82
特殊債券	8.69
社債券	6.07
合計	98.60

（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。

## 海外国債マザーファンド

令和2年6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 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	646,440,000	111.77 722,543,056	121.06 782,596,425	3.125 2028/11/15	4.47
2	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	646,440,000	109.85 710,173,004	118.57 766,536,431	2.875 2028/8/15	4.37
3	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	646,440,000	109.70 709,164,881	118.17 763,910,268	2.875 2028/5/15	4.36
4	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	646,440,000	107.74 696,518,057	117.36 758,708,442	2.625 2029/2/15	4.33
5	US T N/B 2.375 05/15/29 アメリカ	国債証券	646,440,000	106.04 685,523,762	115.58 747,193,731	2.375 2029/5/15	4.26
6	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	538,700,000	108.57 584,910,224	116.79 629,184,765	2.75 2028/2/15	3.59
7	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	614,118,000	97.89 601,163,948	99.89 613,446,307	0.625 2030/5/15	3.50
8	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	538,700,000	104.65 563,782,949	112.78 607,552,593	2.25 2027/11/15	3.47
9	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	484,320,000	124.66 603,765,904	123.26 596,999,953	2.75 2027/10/25	3.41
10	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	363,240,000	154.42 560,916,660	151.61 550,744,124	5.5 2029/4/25	3.14
11	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	430,960,000	104.57 450,689,887	112.44 484,594,316	2.25 2027/8/15	2.77
12	FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス	国債証券	423,780,000	108.58 460,145,409	108.78 461,026,024	0.75 2028/11/25	2.63
13	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	363,240,000	124.91 453,733,981	126.88 460,879,638	2.5 2030/5/25	2.63
14	FRANCE OAT 0.0 11/25/29 フランス	国債証券	399,564,000	101.11 404,030,883	101.91 407,216,449	- 2029/11/25	2.32
15	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	363,240,000	108.51 394,180,783	108.57 394,374,026	0.75 2028/5/25	2.25
16	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	363,240,000	106.20 385,787,033	106.73 387,714,384	0.5 2029/5/25	2.21

17	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 ドイツ	国債証券	230,052,000	166.39 382,798,415	166.32 382,624,786	6.25 2030/1/4	2.18
18	US T N/B 1.75 11/15/29 アメリカ	国債証券	323,220,000	100.83 325,930,166	110.57 357,410,614	1.75 2029/11/15	2.04
19	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証券	323,220,000	99.41 321,325,930	109.28 353,218,856	1.625 2029/8/15	2.02
20	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証券	323,220,000	103.69 335,162,979	108.27 349,961,403	1.5 2030/2/15	2.00
21	ITALY BTPS 6.5 11/01/27 イタリア	国債証券	242,160,000	144.62 350,211,792	138.19 334,640,904	6.5 2027/11/1	1.91
22	DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 ドイツ	国債証券	302,700,000	108.28 327,770,219	108.42 328,213,069	0.5 2027/8/15	1.87
23	ITALY BTPS 5.25 11/01/29 イタリア	国債証券	242,160,000	133.14 322,425,142	135.28 327,594,048	5.25 2029/11/1	1.87
24	DEUTSCHLAND 08/15/29 ドイツ	国債証券	302,700,000	102.74 311,019,770	105.09 318,116,208	- 2029/8/15	1.82
25	ITALY BTPS 4.75 09/01/28 イタリア	国債証券	242,160,000	131.74 319,025,942	128.31 310,730,025	4.75 2028/9/1	1.77
26	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証券	242,160,000	114.58 277,471,771	120.23 291,163,255	3.5 2030/3/1	1.66
27	UK TREASURY 0.875 10/22/29 イギリス	国債証券	265,020,000	101.75 269,667,125	107.09 283,821,578	0.875 2029/10/22	1.62
28	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	242,160,000	117.63 284,852,808	115.45 279,589,896	3 2029/8/1	1.60
29	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証券	242,160,000	115.49 279,677,848	113.31 274,404,814	2.8 2028/12/1	1.57
30	ITALY BTPS 2.05 08/01/27 イタリア	国債証券	242,160,000	110.03 266,450,585	107.11 259,386,293	2.05 2027/8/1	1.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.04
合計	98.04

(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。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

令和2年6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 8.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	8,619,200	112.39 9,687,463	110.72 9,543,406	8 2021/11/15	2.95
2	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	8,619,200	100.62 8,673,328	102.49 8,834,342	2 2021/11/15	2.74
3	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	4,309,600	102.35 4,410,918	108.71 4,685,343	2.25 2024/11/15	1.45
4	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	4,309,600	103.96 4,480,604	108.57 4,679,282	2.75 2023/11/15	1.45
5	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	4,309,600	101.16 4,359,763	107.99 4,654,030	2 2025/2/15	1.44
6	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証券	4,309,600	102.85 4,432,466	107.25 4,622,382	2.5 2023/8/15	1.43
7	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	4,309,600	101.63 4,379,932	107.17 4,618,679	2.125 2024/3/31	1.43
8	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	4,309,600	100.94 4,350,325	104.81 4,516,999	2 2023/2/15	1.40
9	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	4,309,600	100.13 4,315,633	104.54 4,505,552	1.75 2023/5/15	1.39
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	4,309,600	100.19 4,318,184	102.98 4,438,382	1.75 2022/5/15	1.37
11	FRANCE OAT 2.25 10/25/22 フランス	国債証券	3,632,400	108.43 3,938,901	106.71 3,876,245	2.25 2022/10/25	1.20
12	US T N/B 3.0 10/31/25 アメリカ	国債証券	3,232,200	106.69 3,448,595	114.14 3,689,505	3 2025/10/31	1.14
13	US T N/B 2.875 11/30/23 アメリカ	国債証券	3,232,200	104.44 3,375,871	109.07 3,525,370	2.875 2023/11/30	1.09
14	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	3,232,200	101.02 3,265,265	108.62 3,510,977	2 2025/8/15	1.09
15	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	3,232,200	98.79 3,193,284	107.06 3,460,474	1.625 2026/2/15	1.07
16	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	3,232,200	100.87 3,260,481	104.42 3,375,123	2 2022/11/30	1.04
17	US T N/B 5.375 02/15/31 アメリカ	国債証券	2,154,800	134.52 2,898,701	148.88 3,208,126	5.375 2031/2/15	0.99
18	US T N/B 3.0 02/15/49 アメリカ	国債証券	2,154,800	112.26 2,419,086	138.70 2,988,774	3 2049/2/15	0.93
19	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	2,421,600	119.06 2,883,399	116.35 2,817,592	4.25 2023/10/25	0.87
20	SPAIN 5.4 01/31/23 スペイン	国債証券	2,421,600	118.33 2,865,551	114.96 2,783,997	5.4 2023/1/31	0.86
21	ITALY BTPS 4.5 03/01/24 イタリア	国債証券	2,421,600	117.28 2,840,137	114.71 2,777,875	4.5 2024/3/1	0.86
22	ITALY BTPS 3.75 09/01/24 イタリア	国債証券	2,421,600	115.14 2,788,278	113.05 2,737,638	3.75 2024/9/1	0.85

23	AUSTRIA 3.4 11/22/22 オーストリア	国債証券	2,421,600	112.03 2,713,136	109.71 2,656,950	3.4 2022/11/22	0.82
24	UK TREASURY 4.25 12/07/49 イギリス	国債証券	1,325,100	173.39 2,297,723	198.16 2,625,950	4.25 2049/12/7	0.81
25	FRANCE OAT 1.0 11/25/25 フランス	国債証券	2,421,600	107.97 2,614,654	108.26 2,621,762	1 2025/11/25	0.81
26	AUSTRIA 1.75 10/20/23 オーストリア	国債証券	2,421,600	108.90 2,637,267	107.88 2,612,589	1.75 2023/10/20	0.81
27	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	2,154,800	107.67 2,320,094	118.17 2,546,367	2.875 2028/5/15	0.79
28	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	2,154,800	106.62 2,297,555	116.79 2,516,738	2.75 2028/2/15	0.78
29	US T N/B 2.875 11/30/25 アメリカ	国債証券	2,154,800	106.06 2,285,423	113.67 2,449,401	2.875 2025/11/30	0.76
30	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	2,154,800	102.79 2,215,048	112.78 2,430,210	2.25 2027/11/15	0.75

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	93.77
合計	93.77

（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。

#### グローバル高金利通貨マザーファンド

令和2年6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	IFC 8.25 01/30/23 国際機関	特殊債券	308,915,000	112.36 347,109,250	110.72 342,046,133	8.25 2023/1/30	8.72
2	EIB 2.25 05/25/21 国際機関	特殊債券	285,390,000	101.46 289,556,694	101.81 290,561,266	2.25 2021/5/25	7.41
3	EIB 8.375 07/29/22 国際機関	特殊債券	264,775,000	105.29 278,794,836	108.57 287,482,104	8.375 2022/7/29	7.33
4	ASIAN DEV BANK 5.9 12/20/22 国際機関	特殊債券	276,480,000	101.72 281,243,750	101.92 281,802,240	5.9 2022/12/20	7.18
5	IFC 6.375 04/11/22 国際機関	特殊債券	252,560,000	102.31 258,394,136	104.54 264,039,104	6.375 2022/4/11	6.73
6	EIB 3.0 05/24/24 国際機関	特殊債券	163,080,000	107.69 175,627,375	108.96 177,700,122	3 2024/5/24	4.53
7	ASIAN DEV BANK 7.0 03/14/22 国際機関	特殊債券	149,380,000	103.35 154,384,230	105.47 157,551,086	7 2022/3/14	4.02
8	EBRD 27.5 09/18/20 国際機関	特殊債券	149,435,000	107.12 160,081,197	103.42 154,559,126	27.5 2020/9/18	3.94

9	EIB 4.75 01/19/21 国際機関	特殊債 券	149,120,000	99.12 147,818,182	99.95 149,054,387	4.75 2021/1/19	3.80
10	EBRD 7.5 05/15/22 国際機関	特殊債 券	144,400,000	102.33 147,771,740	100.17 144,654,144	7.5 2022/5/15	3.69
11	EBRD 8.3 10/02/20 国際機関	特殊債 券	136,800,000	101.02 138,198,232	100.00 136,800,000	8.3 2020/10/2	3.49
12	IADB 7.875 03/14/23 国際機関	特殊債 券	133,000,000	103.21 137,274,525	102.11 135,809,625	7.875 2023/3/14	3.46
13	IFC 5.5 03/20/23 国際機関	特殊債 券	123,200,000	101.37 124,887,840	103.87 127,967,840	5.5 2023/3/20	3.26
14	EIB 7.75 01/30/25 国際機関	特殊債 券	116,500,000	111.45 129,840,415	109.23 127,258,775	7.75 2025/1/30	3.24
15	EBRD 24.0 10/05/22 国際機関	特殊債 券	102,245,000	124.74 127,540,413	118.14 120,802,467	24 2022/10/5	3.08
16	EIB 8.5 09/17/24 国際機関	特殊債 券	99,680,000	113.49 113,126,832	114.04 113,682,049	8.5 2024/9/17	2.90
17	EIB 7.625 01/12/22 国際機関	特殊債 券	100,190,000	102.76 102,964,261	104.06 104,265,729	7.625 2022/1/12	2.66
18	EBRD 24.0 09/10/21 国際機関	特殊債 券	86,515,000	115.49 99,924,392	109.73 94,936,802	24 2021/9/10	2.42
19	EIB 5.5 01/23/23 国際機関	特殊債 券	84,346,000	99.27 83,737,865	102.17 86,180,525	5.5 2023/1/23	2.20
20	IADB 5.5 08/23/21 国際機関	特殊債 券	83,520,000	99.83 83,383,862	100.77 84,167,271	5.5 2021/8/23	2.15
21	EBRD 6.45 12/13/22 国際機関	特殊債 券	68,400,000	100.96 69,062,563	98.57 67,428,610	6.45 2022/12/13	1.72
22	IADB 26.5 10/25/21 国際機関	特殊債 券	55,055,000	120.24 66,198,132	113.91 62,715,903	26.5 2021/10/25	1.60
23	EIB 9.0 03/31/21 国際機関	特殊債 券	55,322,400	102.90 56,932,281	103.50 57,258,684	9 2021/3/31	1.46
24	EBRD 6.0 02/07/23 国際機関	特殊債 券	51,840,000	101.20 52,462,080	103.04 53,415,936	6 2023/2/7	1.36
25	IBRD 8.0 01/31/22 国際機関	特殊債 券	49,825,000	108.67 54,147,318	106.49 53,061,133	8 2022/1/31	1.35
26	IFC 6.45 08/10/20 国際機関	特殊債 券	50,256,000	100.41 50,464,552	100.26 50,388,545	6.45 2020/8/10	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6月30日現在

種類	投資比率（％）
特殊債券	94.96
合計	94.96

（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6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	162	810,500.01 131,301,003	614,000.00 99,468,000	- -	6.82
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	167	722,372.67 120,636,236	553,000.00 92,351,000	- -	6.33
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	252	303,701.09 76,532,677	328,000.00 82,656,000	- -	5.66
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	540	194,846.19 105,216,946	129,400.00 69,876,000	- -	4.79
5	GLP投資法人 日本	投資証券	433	144,364.97 62,510,034	156,500.00 67,764,500	- -	4.64
6	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	239	307,933.53 73,596,116	254,000.00 60,706,000	- -	4.16
7	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	159	355,295.36 56,491,963	321,500.00 51,118,500	- -	3.50
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	333	225,764.58 75,179,607	141,400.00 47,086,200	- -	3.23
9	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	375	203,407.07 76,277,654	115,800.00 43,425,000	- -	2.98
10	日本リテールファンド投資 法人 日本	投資証券	316	230,890.61 72,961,433	134,500.00 42,502,000	- -	2.91
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	215	166,569.00 35,812,337	173,600.00 37,324,000	- -	2.56
12	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証券	56	684,520.23 38,333,133	624,000.00 34,944,000	- -	2.39
13	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	110	494,535.85 54,398,944	316,000.00 34,760,000	- -	2.38
14	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	489	98,150.73 47,995,709	69,200.00 33,838,800	- -	2.32

15	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証 券	109	275,297.38 30,007,415	292,800.00 31,915,200	- -	2.19
16	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証 券	52	824,062.11 42,851,230	601,000.00 31,252,000	- -	2.14
17	アクティブピア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証 券	84	549,710.41 46,175,675	371,500.00 31,206,000	- -	2.14
18	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証 券	192	177,496.47 34,079,324	136,200.00 26,150,400	- -	1.79
19	ラサールロジポート投資法 人 日本	投資証 券	155	161,023.14 24,958,587	166,200.00 25,761,000	- -	1.77
20	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証 券	539	79,377.05 42,784,232	44,500.00 23,985,500	- -	1.64
21	コンフォリア・レジデン シャル投資法人 日本	投資証 券	73	346,026.54 25,259,938	322,000.00 23,506,000	- -	1.61
22	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証 券	39	799,551.23 31,182,498	597,000.00 23,283,000	- -	1.60
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	48	465,225.89 22,330,843	480,500.00 23,064,000	- -	1.58
24	イオンリート投資法人 日本	投資証 券	180	149,800.03 26,964,006	114,400.00 20,592,000	- -	1.41
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証 券	205	103,854.74 21,290,222	100,400.00 20,582,000	- -	1.41
26	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証 券	733	62,971.71 46,158,267	27,790.00 20,370,070	- -	1.40
27	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	109	215,008.05 23,435,878	186,100.00 20,284,900	- -	1.39
28	フロンティア不動産投資法 人 日本	投資証 券	59	464,147.91 27,384,727	340,500.00 20,089,500	- -	1.38
29	ジャパンエクセレント投資 法人 日本	投資証 券	155	173,701.70 26,923,765	125,200.00 19,406,000	- -	1.33
30	ヒューリックリート投資法 人 日本	投資証 券	142	196,509.76 27,904,387	134,000.00 19,028,000	- -	1.30

(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6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.91
合計	98.91

（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6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	2,458	24,026.34 59,056,753	27,344.41 67,212,564	- -	10.64
2	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	2,315	15,194.70 35,175,738	17,486.20 40,480,557	- -	6.41
3	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	4,099	9,070.42 37,179,656	9,822.65 40,263,066	- -	6.37
4	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	490	62,094.74 30,426,427	74,224.23 36,369,877	- -	5.76
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,490	14,021.67 20,892,296	15,097.60 22,495,433	- -	3.56
6	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証券	615	26,421.61 16,249,296	31,156.25 19,161,095	- -	3.03
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	839	24,360.56 20,438,511	20,589.11 17,274,266	- -	2.73
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	785	21,709.90 17,042,272	16,484.21 12,940,112	- -	2.05
9	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	2,333	8,682.34 20,255,911	5,522.75 12,884,581	- -	2.04
10	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	2,051	8,686.64 17,816,309	6,213.36 12,743,613	- -	2.02
11	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	1,698	13,871.03 23,553,024	7,340.32 12,463,873	- -	1.97
12	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	1,917	7,849.36 15,047,234	6,440.69 12,346,816	- -	1.95
13	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	696	16,113.00 11,214,649	17,414.01 12,120,155	- -	1.92
14	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証券	4,165	2,780.84 11,582,237	2,389.67 9,952,988	- -	1.58
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	364	32,501.35 11,830,494	24,395.56 8,879,986	- -	1.41
16	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	3,008	3,562.40 10,715,711	2,928.37 8,808,546	- -	1.39
17	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	3,013	3,035.41 9,145,691	2,918.67 8,793,972	- -	1.39



18	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	867	12,862.38 11,151,684	9,661.04 8,376,126	- -	1.33
19	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	2,079	6,730.82 13,993,377	3,954.05 8,220,486	- -	1.30
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	535	15,630.23 8,362,177	14,484.56 7,749,242	- -	1.23
21	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証 券	2,055	3,533.49 7,261,326	3,725.64 7,656,209	- -	1.21
22	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	636	13,645.33 8,678,430	12,015.16 7,641,644	- -	1.21
23	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	699	11,558.81 8,079,613	9,893.76 6,915,741	- -	1.09
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	954	9,157.26 8,736,031	7,204.57 6,873,163	- -	1.09
25	UDR INC アメリカ	投資証 券	1,635	4,947.86 8,089,752	3,963.75 6,480,738	- -	1.03
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	967	6,976.16 6,745,948	6,642.17 6,422,979	- -	1.02
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証 券	2,892	2,059.74 5,956,788	1,986.72 5,745,610	- -	0.91
28	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	2,618	2,301.42 6,025,134	2,154.79 5,641,266	- -	0.89
29	CYRUSONE INC アメリカ	投資証 券	639	7,633.11 4,877,558	8,023.39 5,126,951	- -	0.81
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証 券	526	11,369.25 5,980,227	9,684.74 5,094,177	- -	0.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.96
合計	98.96

(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。

#### 【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。

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。

海外国債マザーファンド  
該当事項はありません。

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）  
該当事項はありません。

グローバル高金利通貨マザーファンド  
該当事項はありません。

新光J-REIT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。

### 【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6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 0209月	買建	4	64,346,320	62,340,000	2.67

（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。

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和2年6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 Sep20	買建	3	48,864,399	49,254,687	2.44
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep20	買建	4	14,923,715	15,604,790	0.77
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep20	買建	1	7,938,011	8,218,932	0.41

（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。

海外国債マザーファンド  
該当事項はありません。

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)  
該当事項はありません。

グローバル高金利通貨マザーファンド  
該当事項はありません。

新光J-REIT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】

## 【純資産の推移】

直近日（令和2年6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1計算期間末 (平成26年12月15日)	156	156	1.0986	1.0986
第2計算期間末 (平成27年12月15日)	192	192	1.1107	1.1107
第3計算期間末 (平成28年12月15日)	185	185	1.1246	1.1246
第4計算期間末 (平成29年12月15日)	156	156	1.1917	1.1917
第5計算期間末 (平成30年12月17日)	211	211	1.1409	1.1409
第6計算期間末 (令和1年12月16日)	209	209	1.2304	1.2304
令和1年6月末日	204	-	1.1728	-
7月末日	206	-	1.1843	-
8月末日	203	-	1.1686	-
9月末日	207	-	1.1932	-
10月末日	210	-	1.2194	-
11月末日	209	-	1.2280	-
12月末日	211	-	1.2375	-
令和2年1月末日	210	-	1.2357	-
2月末日	199	-	1.1863	-
3月末日	186	-	1.1047	-
4月末日	191	-	1.1331	-
5月末日	196	-	1.1651	-
6月末日	197	-	1.1750	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
令和1年12月17日～令和2年6月16日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.9
第2計算期間	1.1
第3計算期間	1.3
第4計算期間	6.0
第5計算期間	4.3
第6計算期間	7.8
令和1年12月17日～令和2年6月16日	4.0

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	145,283,614	3,105,708
第2計算期間	46,534,790	15,084,083
第3計算期間	7,924,566	16,949,228
第4計算期間	1,346,866	34,711,182
第5計算期間	86,746,251	32,517,890
第6計算期間	1,025,105	16,014,002
令和1年12月17日～ 令和2年6月16日	510,638	2,620,613

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## 参考情報

データの基準日:2020年6月30日

## 基準価額・純資産の推移 (2014年1月6日~2020年6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、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2014年1月6日)

## 分配の推移(税引前)

2015年12月	0円
2016年12月	0円
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
設定来累計	0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	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	19.82
2	海外国債マザーファンド	15.23
3	新光日本債券インデックスマザーファンド	15.09
4	新光外国株式インデックスマザーファンド	14.89
5	新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	10.15
6	ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF	5.13
7	グローバル高金利通貨マザーファンド	5.04
8	新光J-REITマザーファンド	4.89
9	新光米国REITマザーファンド	4.74

## ■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	3.39
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.09
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.89
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.73
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.48

## ■新光外国株式インデックスマザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.00
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.62
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.87
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	1.34
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	1.09

○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6月30日

## ■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	1.41
2	18回 東京都公募公債 20年	地方債証券	日本	2.22	2029/3/19	1.41
3	36回 東日本旅客鉄道社債	社債券	日本	2.11	2024/12/20	1.29
4	12回 兵庫県公募公債 15年	地方債証券	日本	0.781	2030/12/6	1.26
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	1.22

## ■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 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	4.47
2	US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/8/15	4.37
3	US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/5/15	4.36
4	US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	アメリカ	2.625	2029/2/15	4.33
5	US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	アメリカ	2.375	2029/5/15	4.26

## ■新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

※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 8.0 11/15/21	国債証券	アメリカ	8	2021/11/15	2.95
2	US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	アメリカ	2	2021/11/15	2.74
3	US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	アメリカ	2.25	2024/11/15	1.45
4	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	1.45
5	US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	アメリカ	2	2025/2/15	1.44

## ■グローバル高金利通貨マザーファンド

※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	IFC 8.25 01/30/23	特殊債券	国際機関	8.25	2023/1/30	8.72
2	EIB 2.25 05/25/21	特殊債券	国際機関	2.25	2021/5/25	7.41
3	EIB 8.375 07/29/22	特殊債券	国際機関	8.375	2022/7/29	7.33
4	ASIAN DEV BANK 5.9 12/20/22	特殊債券	国際機関	5.9	2022/12/20	7.18
5	IFC 6.375 04/11/22	特殊債券	国際機関	6.375	2022/4/11	6.73

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### ■新光J-REITマザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.82
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	6.33
3	日本プロロジスリート投資法人	日本	5.66
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.79
5	GLP投資法人	日本	4.64

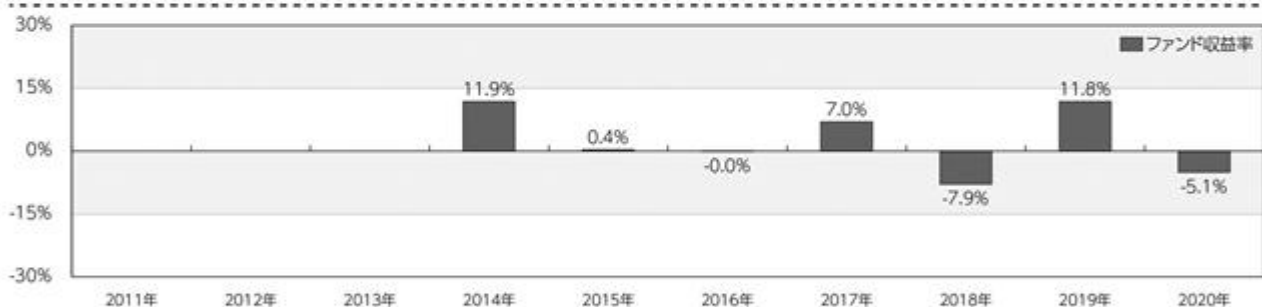
### ■新光米国REITマザーファンド

※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	10.64
2	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	アメリカ	6.41
3	PROLOGIS INC	アメリカ	6.37
4	EQUINIX INC	アメリカ	5.76
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.56

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2014年は設定日から年末までの収益率、および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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

(ロ) 「分配金再投資コース」での取得申込者は、販売会社との間で「グローバル・ナビ自動継続投資約款」（別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

(イ) 受益者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」の両コースとも、販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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

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

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

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

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

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

(ホ)一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。

(ヘ)委託者は、以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を受け付けられないものとします。

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

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

(チ)上記(ト)により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日(この日が一部解約の実行の請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。)に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記(二)の規定に準じて計算された価額とします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における取引所の最終相場
上場投資信託証券	計算日における取引所の最終相場
外貨建資産の 円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の 円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値
直物為替先渡取引	金融商品取引業者または銀行等が提示する価額もしくは価格情報会社の提供する価額

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2028年12月15日までです。

委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、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、原則として毎年12月16日から翌年12月15日までとします。

上記にかかわらず、上記の原則による該当日が休業日のとき、各計算期間終了日は該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、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしたがいます。

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

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

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

(ホ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、下記「b. 投資信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

## b. 投資信託約款の変更等

(イ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

c．書面決議の手続き

- (イ) 委託者は、上記「a．信託の終了（投資信託契約の解約）」（イ）について、または「b．投資信託約款の変更等」（イ）の事項のうち重大な約款の変更等について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由または重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドにかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- (ロ) 上記（イ）の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ハ) 上記（イ）の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- (ニ) 重大な約款の変更等における書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (ホ) 上記（イ）から（ニ）までの規定は、委託者が投資信託契約の解約または重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドにかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記（イ）から（ハ）までに規定する当ファンドの解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
- (ヘ) 上記（イ）から（ホ）の規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

d．反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

e．運用報告書

委託者は、毎決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知れている受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

運用報告書（全体版）は、下記「f．公告」に記載の委託者のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

f．公告

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

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

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

g. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

h. 信託事務処理の再信託

(イ) 受託者は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行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)における株式会社日本カストディ銀行に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

i. 信託業務の委託等

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

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

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

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

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

j. 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

k．関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

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

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(平成30年12月18日から令和1年12月16日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。



## 1【財務諸表】

## 【グローバル・ナビ】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 平成30年12月17日現在	第6期 令和1年12月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	-	2,662
コール・ローン	9,574,645	11,828,901
投資信託受益証券	10,544,710	10,825,598
親投資信託受益証券	191,374,777	188,687,785
派生商品評価勘定	43	-
未収入金	1,900,000	-
流動資産合計	213,394,175	211,344,946
資産合計	213,394,175	211,344,946
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	63,245	56,033
未払委託者報酬	1,732,804	1,535,741
未払利息	22	-
その他未払費用	4,889	4,173
流動負債合計	1,800,960	1,595,947
負債合計	1,800,960	1,595,947
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	185,467,996	170,479,099
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	26,125,219	39,269,900
(分配準備積立金)	18,255,994	24,424,845
元本等合計	211,593,215	209,748,999
純資産合計	211,593,215	209,748,999
負債純資産合計	213,394,175	211,344,946

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	平成29年12月16日 平成30年12月17日	自	平成30年12月18日 令和1年12月16日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		212,159		255,690
有価証券売買等損益		4,008,768		19,468,820
為替差損益		345,250		346,363
その他収益		2,071		-
営業収益合計		3,449,288		19,378,147
<b>営業費用</b>				
支払利息		8,689		6,773
受託者報酬		121,298		111,962
委託者報酬		3,323,505		3,068,154
その他費用		420,672		414,752
営業費用合計		3,874,164		3,601,641
営業利益又は営業損失（ ）		7,323,452		15,776,506
経常利益又は経常損失（ ）		7,323,452		15,776,506
当期純利益又は当期純損失（ ）		7,323,452		15,776,506
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（ ）		369,897		583,251
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		25,152,349		26,125,219
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,652,922		176,862
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,652,922		176,862
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,726,497		2,225,436
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,726,497		2,225,436
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		26,125,219		39,269,900

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期	
	自 平成30年12月18日	至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所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。</p> <p>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。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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。</p> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年12月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年12月17日、当計算期間末日を令和1年12月16日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期
	平成30年12月17日現在	令和1年12月16日現在
1. 期首元本額	131,239,635円	185,467,996円
期中追加設定元本額	86,746,251円	1,025,105円
期中一部解約元本額	32,517,890円	16,014,002円
2. 受益権の総数	185,467,996口	170,479,099口

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第5期	第6期
	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. その他費用	主に、海外カストディアンに対するカストディフィーであります。	その他費用の内訳は、監査費用（8,354円）、保管費用（395,598円）、その他（10,800円）となっております。
2. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,234,500円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（16,898,926円）及び分配準備積立金（17,021,494円）より分配対象収益は35,154,920円（1万口当たり1,895.46円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,000,981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（3,709,474円）、信託約款に規定される収益調整金（15,631,949円）及び分配準備積立金（16,714,390円）より分配対象収益は40,056,794円（1万口当たり2,349.66円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第5期	第6期
	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	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。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期
	平成30年12月17日現在	令和1年12月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>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。</p>

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第5期	第6期
	平成30年12月17日現在	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	1,664,378	1,031,427
親投資信託受益証券	2,263,504	15,549,770
合計	3,927,882	16,581,197

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第5期 平成30年12月17日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 米ドル	113,407	-	113,450	43
	113,407	-	113,450	43
合計	113,407	-	113,450	43

## 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 第6期

令和1年12月16日現在

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)

	第5期 平成30年12月17日現在	第6期 令和1年12月16日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1409円 (11,409円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年12月16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	アメリカ・ドル	ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF	1,855.000	98,927.150	
	アメリカ・ドル	小計	1,855.000	98,927.150 (10,825,598)	
投資信託受益証券 合計			1,855	10,825,598 (10,825,598)	
親投資信託受益証券	日本円	海外国債マザーファンド	13,313,581	31,562,506	
		ニュー トピックス インデックス マザーファンド	18,094,356	42,326,317	
		新光外国株式インデックスマザーファンド	12,076,000	31,883,055	
		新光日本債券インデックスマザーファンド	24,073,708	31,197,118	
		新光J-REITマザーファンド	4,659,241	10,033,209	
		新光米国REITマザーファンド	5,441,229	10,230,598	
		新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	14,622,559	20,810,825	
	グローバル高金利通貨マザーファンド	9,099,126	10,644,157		
日本円 小計			101,379,800	188,687,785	
親投資信託受益証券 合計			101,379,800	188,687,785	
合計				199,513,383 (10,825,598)	

(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。

(注)

- 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。
- 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。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	5.16	5.43

(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）

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」受益証券、「新光外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「新光日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「海外国債マザーファンド」受益証券、「新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」受益証券、「グローバル高金利通貨マザーファンド」受益証券、「新光」- R E I Tマザーファンド」受益証券及び「新光米国 R E I T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「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

#### ニュー トピックス インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

（単位：円）

令和1年12月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	123,129,589
株式	3,009,788,030
派生商品評価勘定	1,378,020
未収配当金	451,500
流動資産合計	3,134,747,139
資産合計	
3,134,747,139	
負債の部	
流動負債	
前受金	1,710,000
未払解約金	1,439,000
流動負債合計	3,149,000
負債合計	
3,149,000	
純資産の部	
元本等	
元本	1,338,753,892
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,792,844,247
元本等合計	3,131,598,139
純資産合計	
3,131,598,139	
負債純資産合計	
3,134,747,139	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年12月16日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,369,016,755円
同期中追加設定元本額	157,408,147円
同期中一部解約元本額	2,187,671,010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	235,360,039円
新光7資産バランスファンド	307,526,097円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	95,172,690円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	404,202,414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)	34,276,422円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	31,399,860円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	191,351,358円
グローバル・ナビ	18,094,356円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,842,913円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	13,766,982円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	2,760,761円
計	1,338,753,892円
2. 受益権の総数	1,338,753,892口
3. 差入代用有価証券	
株式	164,070,550円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年12月16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ぬ。
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つた場合、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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	352,406,580
合計	352,406,580

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年1月15日から令和1年12月16日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	令和1年12月16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	102,690,000	-	104,070,000	1,380,000
合計	102,690,000	-	104,070,000	1,380,000

(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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和1年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3392円 (23,392円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和1年12月16日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	100	2,858.00	285,800	
日本水産	1,700	670.00	1,139,000	
マルハニチロ	200	2,825.00	565,000	
カネコ種苗	100	1,497.00	149,700	
サカタのタネ	200	3,570.00	714,000	
ホクト	100	1,992.00	199,200	
ショーボンドホールディングス	200	4,520.00	904,000	
ミライト・ホールディングス	500	1,682.00	841,000	
タマホーム	100	1,665.00	166,500	
日本アクア	100	651.00	65,100	
ファーストコーポレーション	100	632.00	63,200	
TATERU	300	226.00	67,800	
スペースバリューホールディングス	200	527.00	105,400	
住石ホールディングス	300	152.00	45,600	
三井松島ホールディングス	100	1,217.00	121,700	
国際石油開発帝石	6,700	1,095.00	7,336,500	
石油資源開発	200	3,005.00	601,000	
K&Oエナジーグループ	100	1,659.00	165,900	
安藤・間	1,000	966.00	966,000	

東急建設	500	780.00	390,000	
コムシスホールディングス	600	3,165.00	1,899,000	
ミサワホーム	100	1,205.00	120,500	
ビーアールホールディングス	200	498.00	99,600	
高松コンストラクショングループ	100	2,865.00	286,500	
東建コーポレーション	100	7,380.00	738,000	
ヤマウラ	100	895.00	89,500	
大成建設	1,300	4,540.00	5,902,000	
大林組	3,900	1,249.00	4,871,100	
清水建設	3,900	1,119.00	4,364,100	
飛島建設	100	1,537.00	153,700	
長谷工コーポレーション	1,500	1,474.00	2,211,000	
松井建設	200	814.00	162,800	
鹿島建設	3,000	1,480.00	4,440,000	
不動テトラ	100	1,669.00	166,900	
鉄建建設	100	2,928.00	292,800	
西松建設	300	2,501.00	750,300	
三井住友建設	900	645.00	580,500	
大豊建設	100	2,975.00	297,500	
前田建設工業	1,000	1,082.00	1,082,000	
佐田建設	100	434.00	43,400	
ナカノフドー建設	100	478.00	47,800	
奥村組	200	3,025.00	605,000	
東鉄工業	200	3,265.00	653,000	
富士ピー・エス	100	614.00	61,400	
戸田建設	1,600	738.00	1,180,800	
熊谷組	200	3,300.00	660,000	
矢作建設工業	200	821.00	164,200	
ピーエス三菱	100	730.00	73,000	
日本ハウスホールディングス	300	503.00	150,900	
大東建託	500	13,605.00	6,802,500	
新日本建設	200	977.00	195,400	
N I P P O	300	2,380.00	714,000	
前田道路	400	2,664.00	1,065,600	
東亜建設工業	100	1,624.00	162,400	
日本国土開発	200	645.00	129,000	
若築建設	100	1,740.00	174,000	
東洋建設	400	530.00	212,000	
五洋建設	1,500	678.00	1,017,000	
世紀東急工業	200	900.00	180,000	
住友林業	1,000	1,628.00	1,628,000	
日本基礎技術	100	413.00	41,300	
巴コーポレーション	200	462.00	92,400	
大和ハウス工業	3,800	3,435.00	13,053,000	
ライト工業	200	1,609.00	321,800	
積水ハウス	4,200	2,367.50	9,943,500	
日特建設	100	854.00	85,400	
北陸電気工事	100	1,136.00	113,600	
ユアテック	200	712.00	142,400	
中電工	200	2,624.00	524,800	

関電工	500	1,088.00	544,000
きんでん	900	1,725.00	1,552,500
東京エネシス	100	911.00	91,100
住友電設	100	2,631.00	263,100
日本電設工業	200	2,304.00	460,800
協和エクシオ	600	2,841.00	1,704,600
新日本空調	100	2,231.00	223,100
日本工営	100	3,820.00	382,000
九電工	300	3,525.00	1,057,500
三機工業	300	1,548.00	464,400
日揮ホールディングス	1,200	1,746.00	2,095,200
ヤマト	100	774.00	77,400
太平電業	100	2,325.00	232,500
高砂熱学工業	300	1,986.00	595,800
N E C ネットエスアイ	100	3,580.00	358,000
明星工業	200	979.00	195,800
大気社	200	4,030.00	806,000
ダイダン	100	2,858.00	285,800
日比谷総合設備	100	1,997.00	199,700
東芝プラントシステム	300	2,666.00	799,800
日本製粉	400	1,709.00	683,600
日清製粉グループ本社	1,400	2,005.00	2,807,000
昭和産業	100	3,145.00	314,500
鳥越製粉	100	924.00	92,400
中部飼料	200	1,550.00	310,000
フィード・ワン	800	180.00	144,000
日本甜菜製糖	100	2,042.00	204,200
三井製糖	100	2,329.00	232,900
塩水港精糖	100	220.00	22,000
日新製糖	100	2,046.00	204,600
L I F U L L	400	547.00	218,800
ジェイエイシーリクルートメント	100	2,065.00	206,500
日本M & Aセンター	900	3,780.00	3,402,000
タケエイ	100	1,298.00	129,800
トラスト・テック	100	1,307.00	130,700
コシダカホールディングス	300	1,511.00	453,300
パソナグループ	100	1,665.00	166,500
リンクアンドモチベーション	300	644.00	193,200
G C A	100	938.00	93,800
エス・エム・エス	400	3,055.00	1,222,000
パーソルホールディングス	1,200	1,999.00	2,398,800
リニカル	100	1,144.00	114,400
クックパッド	400	364.00	145,600
アイ・ケイ・ケイ	100	716.00	71,600
森永製菓	300	5,430.00	1,629,000
江崎グリコ	400	4,950.00	1,980,000
名糖産業	100	1,320.00	132,000
井村屋グループ	100	1,990.00	199,000
不二家	100	2,156.00	215,600
山崎製パン	900	1,939.00	1,745,100

亀田製菓	100	4,960.00	496,000	
寿スピリッツ	100	7,260.00	726,000	
カルビー	600	3,565.00	2,139,000	
森永乳業	200	4,415.00	883,000	
六甲バター	100	1,795.00	179,500	
ヤクルト本社	900	6,190.00	5,571,000	
明治ホールディングス	800	7,460.00	5,968,000	
雪印メグミルク	300	2,563.00	768,900	
プリマハム	200	2,538.00	507,600	
日本ハム	500	4,580.00	2,290,000	
丸大食品	100	2,361.00	236,100	
S Foods	100	2,837.00	283,700	
伊藤ハム米久ホールディングス	800	721.00	576,800	
スタジオアリス	100	1,924.00	192,400	
シミックホールディングス	100	1,892.00	189,200	
システナ	400	1,763.00	705,200	
デジタルアーツ	100	5,350.00	535,000	
日鉄ソリューションズ	200	3,605.00	721,000	
総合警備保障	500	5,860.00	2,930,000	
キューブシステム	100	793.00	79,300	
いちご	1,500	460.00	690,000	
日本駐車場開発	1,300	161.00	209,300	
コア	100	1,417.00	141,700	
カカクコム	900	2,703.00	2,432,700	
セントケア・ホールディング	100	464.00	46,400	
ルネサンス	100	1,735.00	173,500	
ディップ	200	3,195.00	639,000	
SBSホールディングス	100	1,984.00	198,400	
オプトホールディング	100	1,682.00	168,200	
新日本科学	100	774.00	77,400	
ツクイ	300	560.00	168,000	
ベネフィット・ワン	300	2,244.00	673,200	
エムスリー	2,600	3,085.00	8,021,000	
ツカダ・グローバルホールディング	100	621.00	62,100	
アウトソーシング	700	1,203.00	842,100	
ウェルネット	100	780.00	78,000	
ディー・エヌ・エー	600	1,780.00	1,068,000	
博報堂DYホールディングス	1,600	1,779.00	2,846,400	
ぐるなび	200	997.00	199,400	
タカミヤ	100	705.00	70,500	
ジャパンベストレスキューシステム	100	1,150.00	115,000	
ファンコミュニケーションズ	300	502.00	150,600	
エスプール	200	742.00	148,400	
WDBホールディングス	100	2,549.00	254,900	
ティア	100	606.00	60,600	
パリュコマース	100	2,380.00	238,000	
インフォマート	600	1,926.00	1,155,600	
サッポロホールディングス	400	2,725.00	1,090,000	
アサヒグループホールディングス	2,600	5,154.00	13,400,400	
麒麟ホールディングス	5,200	2,491.00	12,953,200	



宝ホールディングス	900	1,035.00	931,500	
オエノンホールディングス	300	401.00	120,300	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	900	2,813.00	2,531,700	
サントリー食品インターナショナル	800	4,790.00	3,832,000	
ダイドーグループホールディングス	100	4,605.00	460,500	
伊藤園	400	5,740.00	2,296,000	
キーコーヒー	100	2,365.00	236,500	
日清オイリオグループ	200	3,765.00	753,000	
不二製油グループ本社	300	2,998.00	899,400	
J・オイルミルズ	100	4,335.00	433,500	
ローソン	300	6,290.00	1,887,000	
サンエー	100	4,955.00	495,500	
カワチ薬品	100	2,156.00	215,600	
エービーシー・マート	200	7,530.00	1,506,000	
アスクル	100	2,971.00	297,100	
ゲオホールディングス	200	1,318.00	263,600	
アダストリア	200	2,581.00	516,200	
ジーフット	100	623.00	62,300	
くら寿司	100	4,915.00	491,500	
キャンドウ	100	1,655.00	165,500	
エレマテック	100	1,204.00	120,400	
パルグループホールディングス	100	3,480.00	348,000	
エディオン	600	1,229.00	737,400	
あらた	100	4,455.00	445,500	
サーラコーポレーション	200	634.00	126,800	
ワッツ	100	605.00	60,500	
J Pホールディングス	400	317.00	126,800	
フジオフードシステム	100	3,640.00	364,000	
ひらまつ	200	305.00	61,000	
フィールズ	100	543.00	54,300	
双日	6,700	358.00	2,398,600	
アルフレッサ ホールディングス	1,300	2,288.00	2,974,400	
ハニーズホールディングス	100	1,575.00	157,500	
キッコーマン	900	5,550.00	4,995,000	
味の素	2,700	1,811.00	4,889,700	
キューピー	700	2,477.00	1,733,900	
ハウス食品グループ本社	500	3,785.00	1,892,500	
カゴメ	500	2,660.00	1,330,000	
焼津水産化学工業	100	1,049.00	104,900	
アリアケジャパン	100	7,730.00	773,000	
ニチレイ	600	2,570.00	1,542,000	
横浜冷凍	300	1,027.00	308,100	
東洋水産	600	4,665.00	2,799,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	1,071.00	107,100	
日清食品ホールディングス	500	8,160.00	4,080,000	
永谷園ホールディングス	100	2,171.00	217,100	
フジッコ	100	1,967.00	196,700	
ロック・フィールド	100	1,526.00	152,600	
日本たばこ産業	7,100	2,514.50	17,852,950	

ケンコーマヨネーズ	100	2,570.00	257,000	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,732.00	173,200	
なとり	100	1,714.00	171,400	
北の達人コーポレーション	400	682.00	272,800	
ユーグレナ	500	783.00	391,500	
スター・マイカ・ホールディングス	100	1,666.00	166,600	
片倉工業	200	1,365.00	273,000	
ゲンゼ	100	5,060.00	506,000	
ヒューリック	2,600	1,330.00	3,458,000	
ラサ商事	100	942.00	94,200	
アルペン	100	1,848.00	184,800	
ラクーンホールディングス	100	820.00	82,000	
クオールホールディングス	200	1,529.00	305,800	
アルコニックス	100	1,477.00	147,700	
神戸物産	400	3,650.00	1,460,000	
ソリトンシステムズ	100	1,255.00	125,500	
ジンズホールディングス	100	7,240.00	724,000	
ビックカメラ	700	1,242.00	869,400	
DCMホールディングス	700	1,065.00	745,500	
ペッパーフードサービス	100	1,361.00	136,100	
MonotaRO	900	2,803.00	2,522,700	
あいホールディングス	200	1,976.00	395,200	
アークランドサービスホールディングス	100	1,893.00	189,300	
J.フロントリテイリング	1,400	1,492.00	2,088,800	
ドトール・日レスホールディングス	200	2,180.00	436,000	
マツモトキヨシホールディングス	500	4,175.00	2,087,500	
ブロンコビリー	100	2,751.00	275,100	
ZOZO	800	2,085.00	1,668,000	
ココカラファイン	100	6,260.00	626,000	
三越伊勢丹ホールディングス	2,100	1,028.00	2,158,800	
東洋紡	500	1,633.00	816,500	
ユニチカ	400	395.00	158,000	
富士紡ホールディングス	100	3,495.00	349,500	
日清紡ホールディングス	800	1,080.00	864,000	
倉敷紡績	100	2,635.00	263,500	
ダイワボウホールディングス	100	6,370.00	637,000	
シキボウ	100	1,007.00	100,700	
日東紡績	200	4,250.00	850,000	
トヨタ紡織	400	1,826.00	730,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	300	1,938.00	581,400	
ウエルシアホールディングス	400	6,600.00	2,640,000	
クリエイトSDホールディングス	200	2,708.00	541,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	1,079.00	215,800	
八洲電機	100	916.00	91,600	
メディアスホールディングス	100	818.00	81,800	
レスターホールディングス	100	2,038.00	203,800	
丸善CHIホールディングス	100	377.00	37,700	
大光	100	683.00	68,300	

TOKAIホールディングス	600	1,140.00	684,000
三洋貿易	100	2,369.00	236,900
シュッピン	100	1,121.00	112,100
ウイン・パートナーズ	100	1,528.00	152,800
ネクステージ	200	1,247.00	249,400
ジョイフル本田	400	1,441.00	576,400
ホットランド	100	1,363.00	136,300
すかいらくホールディングス	1,400	2,189.00	3,064,600
SFPホールディングス	100	2,256.00	225,600
日本毛織	400	1,132.00	452,800
ダイトウボウ	200	86.00	17,200
ダイドーリミテッド	200	279.00	55,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	400	968.00	387,200
野村不動産ホールディングス	700	2,660.00	1,862,000
三重交通グループホールディングス	200	623.00	124,600
サムティ	200	2,114.00	422,800
ディア・ライフ	200	567.00	113,400
エー・ディー・ワークス	2,300	31.00	71,300
日本商業開発	100	1,626.00	162,600
プレサンスコーポレーション	200	1,769.00	353,800
ユニゾホールディングス	200	4,900.00	980,000
THEグローバル社	100	487.00	48,700
日本管理センター	100	1,310.00	131,000
フージャースホールディングス	200	735.00	147,000
オープンハウス	400	3,080.00	1,232,000
東急不動産ホールディングス	3,300	765.00	2,524,500
飯田グループホールディングス	1,000	1,943.00	1,943,000
ムゲンエステート	100	798.00	79,800
帝国繊維	100	2,138.00	213,800
日本コークス工業	1,000	77.00	77,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	688.00	68,800
あさひ	100	1,310.00	131,000
コスモス薬品	100	22,920.00	2,292,000
シップヘルスケアホールディングス	200	4,790.00	958,000
トーエル	100	790.00	79,000
ソフトクリエイトホールディングス	100	1,803.00	180,300
セブン&アイ・ホールディングス	4,700	4,068.00	19,119,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	300	1,807.00	542,100
ツルハホールディングス	300	12,830.00	3,849,000
サンマルクホールディングス	100	2,316.00	231,600
トリドールホールディングス	100	2,731.00	273,100
帝人	1,000	2,105.00	2,105,000
東レ	8,700	763.40	6,641,580
クラレ	1,900	1,375.00	2,612,500
旭化成	8,000	1,258.50	10,068,000
TOKYO BASE	100	659.00	65,900
稲葉製作所	100	1,447.00	144,700
トーカロ	300	1,152.00	345,600

SUMCO	1,500	1,837.00	2,755,500	
信和	100	1,080.00	108,000	
ハウストゥ	100	1,526.00	152,600	
日本フェルト	100	500.00	50,000	
エコナックホールディングス	200	140.00	28,000	
アツギ	100	841.00	84,100	
ジャパンミート	100	2,126.00	212,600	
コメダホールディングス	300	2,084.00	625,200	
アレンザホールディングス	100	931.00	93,100	
バロックジャパンリミテッド	100	960.00	96,000	
クスリのアオキホールディングス	100	7,150.00	715,000	
共和レザー	100	825.00	82,500	
力の源ホールディングス	100	876.00	87,600	
スシローグローバルホールディングス	100	8,740.00	874,000	
LIXILピバ	100	1,917.00	191,700	
セーレン	300	1,576.00	472,800	
小松マテーレ	200	839.00	167,800	
ワコールホールディングス	300	3,030.00	909,000	
ホギメディカル	100	3,650.00	365,000	
レナウン	300	116.00	34,800	
T S Iホールディングス	400	554.00	221,600	
ワールド	200	2,777.00	555,400	
T I S	400	6,530.00	2,612,000	
グリー	800	503.00	402,400	
コーエーテクモホールディングス	200	2,701.00	540,200	
三菱総合研究所	100	4,200.00	420,000	
A G S	100	792.00	79,200	
ファインデックス	100	1,324.00	132,400	
K L a b	200	827.00	165,400	
ポルトゥウィン・ビットクルーホールディングス	100	979.00	97,900	
ネクソン	3,400	1,439.00	4,892,600	
アイスタイル	300	715.00	214,500	
エイチーム	100	1,123.00	112,300	
エニグモ	100	917.00	91,700	
テクノスジャパン	100	499.00	49,900	
e n i s h	100	635.00	63,500	
コロブラ	400	1,206.00	482,400	
オルトプラス	100	1,046.00	104,600	
ブロードリーフ	600	676.00	405,600	
クロス・マーケティンググループ	100	368.00	36,800	
デジタルハーツホールディングス	100	1,051.00	105,100	
システム情報	100	1,009.00	100,900	
じげん	300	527.00	158,100	
ブイキューブ	100	590.00	59,000	
フィックスターズ	100	1,457.00	145,700	
C A R T A H O L D I N G S	100	1,281.00	128,100	
特種東海製紙	100	4,130.00	413,000	
ティーガイア	100	2,654.00	265,400	
日本アジアグループ	100	369.00	36,900	

豆蔵ホールディングス	100	1,416.00	141,600
テクマトリックス	100	2,327.00	232,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	300	2,400.00	720,000
GMOペイメントゲートウェイ	200	7,230.00	1,446,000
ザッパラス	100	414.00	41,400
インターネットイニシアティブ	200	2,679.00	535,800
さくらインターネット	100	688.00	68,800
SRAホールディングス	100	2,614.00	261,400
朝日ネット	100	628.00	62,800
eBASE	100	1,158.00	115,800
アバント	100	975.00	97,500
フリービット	100	851.00	85,100
コムチュア	100	2,417.00	241,700
アステリア	100	630.00	63,000
王子ホールディングス	5,000	643.00	3,215,000
日本製紙	500	1,882.00	941,000
三菱製紙	100	491.00	49,100
北越コーポレーション	800	579.00	463,200
中越パルプ工業	100	1,703.00	170,300
大王製紙	500	1,504.00	752,000
マークライنز	100	2,028.00	202,800
メディカル・データ・ビジョン	100	861.00	86,100
gumi	200	906.00	181,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	100	1,608.00	160,800
オーブンドア	100	1,597.00	159,700
LINE	300	5,200.00	1,560,000
カナミックネットワーク	100	715.00	71,500
レンゴー	1,100	817.00	898,700
トーモク	100	1,836.00	183,600
ザ・パック	100	4,125.00	412,500
シンクロ・フード	100	555.00	55,500
オークネット	100	1,421.00	142,100
AOI TYO HOLDINGS	100	745.00	74,500
マクロミル	200	986.00	197,200
昭和電工	900	3,005.00	2,704,500
住友化学	8,900	506.00	4,503,400
住友精化	100	3,575.00	357,500
日産化学	700	4,755.00	3,328,500
クレハ	100	6,680.00	668,000
テイカ	100	1,938.00	193,800
石原産業	200	1,127.00	225,400
日本曹達	200	3,060.00	612,000
東ソー	1,900	1,670.00	3,173,000
トクヤマ	300	2,969.00	890,700
セントラル硝子	200	2,752.00	550,400
東亜合成	800	1,293.00	1,034,400
大阪ソーダ	100	3,225.00	322,500
関東電化工業	300	1,005.00	301,500

デンカ	400	3,345.00	1,338,000
イビデン	800	2,607.00	2,085,600
信越化学工業	2,100	12,270.00	25,767,000
堺化学工業	100	2,564.00	256,400
第一稀元素化学工業	100	882.00	88,200
エア・ウォーター	1,100	1,636.00	1,799,600
大陽日酸	1,200	2,461.00	2,953,200
日本パーカライジング	600	1,172.00	703,200
高压ガス工業	200	863.00	172,600
四国化成工業	200	1,294.00	258,800
ステラ ケミファ	100	3,155.00	315,500
日本触媒	200	6,960.00	1,392,000
大日精化工業	100	3,415.00	341,500
カネカ	300	3,660.00	1,098,000
協和キリン	1,200	2,417.00	2,900,400
三菱瓦斯化学	1,100	1,706.00	1,876,600
三井化学	1,100	2,754.00	3,029,400
J S R	1,100	2,096.00	2,305,600
東京応化工業	200	4,500.00	900,000
大阪有機化学工業	100	1,438.00	143,800
三菱ケミカルホールディングス	8,100	824.70	6,680,070
K Hネオケム	200	2,405.00	481,000
ダイセル	1,700	1,071.00	1,820,700
住友ベークライト	200	4,300.00	860,000
積水化学工業	2,600	1,913.00	4,973,800
日本ゼオン	1,100	1,423.00	1,565,300
アイカ工業	400	3,595.00	1,438,000
宇部興産	600	2,450.00	1,470,000
積水樹脂	200	2,370.00	474,000
タキロンシーアイ	300	718.00	215,400
旭有機材	100	1,727.00	172,700
日立化成	600	4,050.00	2,430,000
ニチパン	100	1,976.00	197,600
リケンテクノス	300	542.00	162,600
大倉工業	100	2,022.00	202,200
積水化成品工業	200	831.00	166,200
タイガースポリマー	100	607.00	60,700
ダイキョーニシカワ	300	899.00	269,700
森六ホールディングス	100	2,453.00	245,300
日本化薬	700	1,395.00	976,500
カーリットホールディングス	100	650.00	65,000
E P Sホールディングス	200	1,442.00	288,400
ソルクシーズ	100	931.00	93,100
プレステージ・インターナショナル	400	975.00	390,000
プロトコーポレーション	100	1,181.00	118,100
アミューズ	100	3,025.00	302,500
野村総合研究所	2,000	2,289.00	4,578,000
サイバネットシステム	100	811.00	81,100
クイック	100	1,677.00	167,700
T A C	100	231.00	23,100

CEホールディングス	100	448.00	44,800	
ケネディクス	1,100	582.00	640,200	
電通	1,200	4,140.00	4,968,000	
インテージホールディングス	200	948.00	189,600	
ソースネクスト	600	430.00	258,000	
シーティーエス	100	783.00	78,300	
インフォコム	100	2,496.00	249,600	
メディカルシステムネットワーク	100	539.00	53,900	
日本精化	100	1,294.00	129,400	
扶桑化学工業	100	3,130.00	313,000	
ラクスル	100	3,575.00	357,500	
F I G	100	312.00	31,200	
A D E K A	600	1,685.00	1,011,000	
日油	500	3,735.00	1,867,500	
新日本理化	200	211.00	42,200	
ハリマ化成グループ	100	1,190.00	119,000	
アルテリア・ネットワークス	100	1,657.00	165,700	
花王	2,900	8,972.00	26,018,800	
三洋化成工業	100	5,620.00	562,000	
武田薬品工業	10,200	4,438.00	45,267,600	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	10,800	1,850.00	19,980,000	
大日本住友製薬	900	2,100.00	1,890,000	
塩野義製薬	1,600	6,427.00	10,283,200	
田辺三菱製薬	1,500	2,005.00	3,007,500	
わかもと製薬	100	271.00	27,100	
あすか製薬	100	1,262.00	126,200	
日本新薬	300	8,870.00	2,661,000	
中外製薬	1,300	10,045.00	13,058,500	
科研製薬	200	6,080.00	1,216,000	
エーザイ	1,500	8,272.00	12,408,000	
理研ビタミン	100	4,000.00	400,000	
ロート製薬	600	3,360.00	2,016,000	
小野薬品工業	2,800	2,462.00	6,893,600	
久光製薬	400	5,280.00	2,112,000	
有機合成薬品工業	100	302.00	30,200	
持田製薬	200	4,510.00	902,000	
参天製薬	2,300	1,978.00	4,549,400	
ツムラ	400	3,190.00	1,276,000	
日医工	300	1,377.00	413,100	
テルモ	3,500	3,875.00	13,562,500	
みらかホールディングス	300	2,625.00	787,500	
キッセイ薬品工業	200	3,080.00	616,000	
生化学工業	200	1,270.00	254,000	
栄研化学	200	2,013.00	402,600	
日水製薬	100	1,306.00	130,600	
鳥居薬品	100	2,987.00	298,700	
J C Rファーマ	100	8,770.00	877,000	
東和薬品	200	2,904.00	580,800	
富士製薬工業	100	1,391.00	139,100	

沢井製薬	300	6,800.00	2,040,000	
ゼリア新薬工業	200	2,114.00	422,800	
第一三共	3,500	7,281.00	25,483,500	
キョーリン製薬ホールディングス	300	1,905.00	571,500	
ダイト	100	3,190.00	319,000	
大塚ホールディングス	2,300	4,960.00	11,408,000	
大正製薬ホールディングス	300	8,040.00	2,412,000	
ペプチドリーム	600	5,060.00	3,036,000	
大日本塗料	100	1,204.00	120,400	
日本ペイントホールディングス	1,000	5,440.00	5,440,000	
関西ペイント	1,400	2,696.00	3,774,400	
神東塗料	100	226.00	22,600	
中国塗料	300	1,057.00	317,100	
日本特殊塗料	100	1,492.00	149,200	
藤倉化成	200	576.00	115,200	
太陽ホールディングス	100	4,315.00	431,500	
D I C	500	3,090.00	1,545,000	
サカタインクス	300	1,222.00	366,600	
東洋インキS Cホールディングス	300	2,722.00	816,600	
T & K T O K A	100	1,032.00	103,200	
アルプス技研	100	1,990.00	199,000	
サニックス	200	370.00	74,000	
日本空調サービス	100	824.00	82,400	
オリエンタルランド	1,300	14,795.00	19,233,500	
フォーカスシステムズ	100	885.00	88,500	
ダスキン	300	3,045.00	913,500	
パーク24	700	2,487.00	1,740,900	
明光ネットワークジャパン	100	1,015.00	101,500	
ファルコホールディングス	100	1,756.00	175,600	
フジ・メディア・ホールディングス	1,200	1,572.00	1,886,400	
ラウンドワン	300	1,044.00	313,200	
リゾートトラスト	500	1,853.00	926,500	
オービック	400	14,470.00	5,788,000	
ジャストシステム	200	5,950.00	1,190,000	
T D C ソフト	100	913.00	91,300	
Zホールディングス	16,600	414.00	6,872,400	
ビー・エム・エル	200	3,100.00	620,000	
トレンドマイクロ	500	5,800.00	2,900,000	
りらいあコミュニケーションズ	200	1,405.00	281,000	
リソー教育	500	384.00	192,000	
日本オラクル	200	10,070.00	2,014,000	
フューチャー	100	1,826.00	182,600	
C A C H o l d i n g s	100	1,614.00	161,400	
ユー・エス・エス	1,300	2,098.00	2,727,400	
オービックビジネスコンサルタント	100	4,970.00	497,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	600	3,040.00	1,824,000	
アイティフォー	100	859.00	85,900	
サイバーエージェント	700	3,885.00	2,719,500	
楽天	5,500	937.00	5,153,500	
クリーク・アンド・リバー社	100	1,139.00	113,900	



テー・オー・ダブリュー	100	884.00	88,400	
大塚商会	700	4,660.00	3,262,000	
サイボウズ	100	1,197.00	119,700	
ソフトブレーン	100	576.00	57,600	
山田コンサルティンググループ	100	1,682.00	168,200	
電通国際情報サービス	100	4,205.00	420,500	
デジタルガレージ	200	4,420.00	884,000	
イーエムシステムズ	100	2,069.00	206,900	
C I J	100	973.00	97,300	
日本エンタープライズ	100	230.00	23,000	
WOWOW	100	2,780.00	278,000	
スカラ	100	744.00	74,400	
フルキャストホールディングス	100	2,398.00	239,800	
エン・ジャパン	200	5,370.00	1,074,000	
富士フイルムホールディングス	2,400	5,298.00	12,715,200	
コニカミノルタ	2,700	723.00	1,952,100	
資生堂	2,400	7,830.00	18,792,000	
ライオン	1,600	2,161.00	3,457,600	
高砂香料工業	100	2,645.00	264,500	
マンダム	300	3,000.00	900,000	
ミルボン	200	6,140.00	1,228,000	
ファンケル	500	2,831.00	1,415,500	
コーセー	200	16,530.00	3,306,000	
コタ	100	1,520.00	152,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	500	2,720.00	1,360,000	
ノエビアホールディングス	100	5,840.00	584,000	
エステー	100	1,733.00	173,300	
コニシ	200	1,515.00	303,000	
長谷川香料	200	1,995.00	399,000	
星光P M C	100	1,058.00	105,800	
小林製薬	300	9,060.00	2,718,000	
荒川化学工業	100	1,702.00	170,200	
メック	100	1,625.00	162,500	
タカラバイオ	300	2,072.00	621,600	
J C U	100	3,160.00	316,000	
新田ゼラチン	100	692.00	69,200	
デクセリアルズ	300	1,111.00	333,300	
アース製薬	100	5,730.00	573,000	
北興化学工業	100	601.00	60,100	
クミアイ化学工業	500	1,055.00	527,500	
日本農薬	200	583.00	116,600	
ニチレキ	100	1,319.00	131,900	
ユシロ化学工業	100	1,457.00	145,700	
富士石油	300	246.00	73,800	
出光興産	1,400	3,005.00	4,207,000	
J X T Gホールディングス	19,100	502.10	9,590,110	
コスモエネルギーホールディングス	400	2,566.00	1,026,400	
横浜ゴム	700	2,307.00	1,614,900	
T O Y O T I R E	700	1,644.00	1,150,800	
ブリヂストン	3,800	4,277.00	16,252,600	

住友ゴム工業	1,100	1,419.00	1,560,900
藤倉コンポジット	100	507.00	50,700
オカモト	100	4,140.00	414,000
アキレス	100	1,896.00	189,600
フコク	100	740.00	74,000
ニッタ	100	3,305.00	330,500
住友理工	200	1,065.00	213,000
三ツ星ベルト	200	2,170.00	434,000
パンドー化学	200	953.00	190,600
A G C	1,200	4,020.00	4,824,000
日本板硝子	600	664.00	398,400
有沢製作所	200	1,026.00	205,200
日本山村硝子	100	1,285.00	128,500
日本電気硝子	500	2,432.00	1,216,000
住友大阪セメント	200	4,870.00	974,000
太平洋セメント	800	3,345.00	2,676,000
日本ヒューム	100	869.00	86,900
日本コンクリート工業	300	290.00	87,000
三谷セキサン	100	3,790.00	379,000
アジアパイルホールディングス	200	623.00	124,600
東海カーボン	1,300	1,128.00	1,466,400
日本カーボン	100	4,400.00	440,000
東洋炭素	100	2,402.00	240,200
ノリタケカンパニーリミテド	100	4,710.00	471,000
T O T O	900	4,850.00	4,365,000
日本碍子	1,500	1,908.00	2,862,000
日本特殊陶業	1,000	2,171.00	2,171,000
ダントーホールディングス	100	119.00	11,900
ヨータイ	100	750.00	75,000
イソライト工業	100	692.00	69,200
東京窯業	200	349.00	69,800
ニッカトー	100	835.00	83,500
フジインコーポレーテッド	100	2,994.00	299,400
ニチアス	300	2,731.00	819,300
日本製鉄	5,500	1,760.50	9,682,750
神戸製鋼所	2,200	624.00	1,372,800
中山製鋼所	200	582.00	116,400
合同製鉄	100	2,847.00	284,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	3,300	1,505.00	4,966,500
東京製鉄	600	792.00	475,200
共英製鋼	100	2,125.00	212,500
大和工業	300	2,812.00	843,600
東京製鋼	100	1,610.00	161,000
大阪製鉄	100	1,421.00	142,100
淀川製鋼所	200	2,088.00	417,600
丸一鋼管	400	3,155.00	1,262,000
大同特殊鋼	200	4,980.00	996,000
日本冶金工業	100	2,405.00	240,500
山陽特殊製鋼	100	1,643.00	164,300

愛知製鋼	100	3,920.00	392,000	
日立金属	1,300	1,539.00	2,000,700	
大平洋金属	100	2,608.00	260,800	
新日本電工	800	187.00	149,600	
栗本鐵工所	100	2,113.00	211,300	
日本製鋼所	400	2,222.00	888,800	
三菱製鋼	100	1,112.00	111,200	
日亜鋼業	200	356.00	71,200	
大紀アルミニウム工業所	200	785.00	157,000	
日本軽金属ホールディングス	3,100	240.00	744,000	
三井金属鉱業	300	2,896.00	868,800	
東邦亜鉛	100	2,208.00	220,800	
三菱マテリアル	800	3,085.00	2,468,000	
住友金属鉱山	1,600	3,663.00	5,860,800	
DOWAホールディングス	300	4,175.00	1,252,500	
古河機械金属	200	1,507.00	301,400	
エス・サイエンス	500	48.00	24,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	1,570.00	157,000	
東邦チタニウム	200	1,007.00	201,400	
UACJ	200	2,607.00	521,400	
古河電気工業	400	3,070.00	1,228,000	
住友電気工業	4,600	1,674.00	7,700,400	
フジクラ	1,500	486.00	729,000	
昭和電線ホールディングス	100	1,231.00	123,100	
タツタ電線	200	620.00	124,000	
リョービ	100	2,174.00	217,400	
アーレスティ	200	570.00	114,000	
アサヒホールディングス	200	2,670.00	534,000	
東洋製罐グループホールディングス	800	1,986.00	1,588,800	
ホッカインホールディングス	100	1,965.00	196,500	
コロナ	100	1,139.00	113,900	
横河ブリッジホールディングス	200	2,005.00	401,000	
OSJBホールディングス	600	273.00	163,800	
三和ホールディングス	1,200	1,267.00	1,520,400	
文化シャッター	400	1,000.00	400,000	
三協立山	200	1,288.00	257,600	
アルインコ	100	1,297.00	129,700	
LIXILグループ	1,800	1,914.00	3,445,200	
日本フィルコン	100	513.00	51,300	
ノーリツ	300	1,520.00	456,000	
長府製作所	100	2,510.00	251,000	
リンナイ	200	8,620.00	1,724,000	
ユニプレス	200	1,595.00	319,000	
ダイニチ工業	100	697.00	69,700	
日東精工	200	646.00	129,200	
岡部	200	964.00	192,800	
ジーテクト	200	1,820.00	364,000	
東プレ	200	1,826.00	365,200	
高周波熱錬	200	906.00	181,200	
東京製網	100	1,348.00	134,800	

サンコール	100	584.00	58,400
モリテックスチール	100	440.00	44,000
パイオラックス	200	2,216.00	443,200
エイチワン	100	866.00	86,600
日本発条	1,300	1,015.00	1,319,500
三浦工業	500	3,790.00	1,895,000
タクマ	400	1,332.00	532,800
テクノプロ・ホールディングス	200	7,640.00	1,528,000
Gunosy	100	1,520.00	152,000
イー・ガーディアン	100	1,974.00	197,400
リブセンス	100	304.00	30,400
ジャパンマテリアル	400	1,741.00	696,400
ベクトル	100	1,023.00	102,300
ウチヤマホールディングス	100	543.00	54,300
I B J	100	1,072.00	107,200
N・フィールド	100	689.00	68,900
M&Aキャピタルパートナーズ	100	4,275.00	427,500
シグマクシス	100	2,174.00	217,400
ウィルグループ	100	1,203.00	120,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	200	234.00	46,800
リクルートホールディングス	8,400	4,139.00	34,767,600
エラン	100	1,607.00	160,700
ツガミ	300	1,123.00	336,900
オークマ	100	6,120.00	612,000
東芝機械	100	3,130.00	313,000
アマダホールディングス	1,500	1,300.00	1,950,000
アイダエンジニアリング	300	1,027.00	308,100
F U J I	500	2,050.00	1,025,000
牧野フライス製作所	100	5,200.00	520,000
オーエスジー	600	2,150.00	1,290,000
旭ダイヤモンド工業	300	667.00	200,100
D M G 森精機	800	1,777.00	1,421,600
ソディック	300	1,015.00	304,500
ディスコ	200	25,680.00	5,136,000
日東工器	100	2,396.00	239,600
パンチ工業	100	563.00	56,300
富士ダイス	100	678.00	67,800
土木管理総合試験所	100	479.00	47,900
日本郵政	9,600	1,060.00	10,176,000
ベルシステム24ホールディングス	200	1,663.00	332,600
鎌倉新書	100	1,647.00	164,700
エボラブルアジア	100	2,001.00	200,100
ソラスト	300	1,193.00	357,900
インソース	100	3,405.00	340,500
豊田自動織機	1,000	6,570.00	6,570,000
豊和工業	100	848.00	84,800
東洋機械金属	100	562.00	56,200
島精機製作所	200	2,772.00	554,400
オプトラン	100	3,075.00	307,500
イワキ	100	1,178.00	117,800

フリー	100	1,047.00	104,700
ヤマシンフィルタ	300	859.00	257,700
日阪製作所	200	1,032.00	206,400
やまびこ	200	1,242.00	248,400
平田機工	100	7,650.00	765,000
ペガサスミシン製造	100	522.00	52,200
タツモ	100	1,319.00	131,900
ナブテスコ	700	3,530.00	2,471,000
三井海洋開発	100	2,679.00	267,900
レオン自動機	100	1,646.00	164,600
S M C	400	51,800.00	20,720,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	100	617.00	61,700
オイレス工業	200	1,703.00	340,600
サトーホールディングス	200	3,470.00	694,000
技研製作所	100	5,010.00	501,000
日精樹脂工業	100	1,030.00	103,000
ワイエイシイホールディングス	100	760.00	76,000
小松製作所	5,600	2,711.00	15,181,600
住友重機械工業	700	3,195.00	2,236,500
日立建機	500	3,280.00	1,640,000
日工	200	893.00	178,600
巴工業	100	2,313.00	231,300
井関農機	100	1,686.00	168,600
T O W A	100	1,200.00	120,000
北川鉄工所	100	2,419.00	241,900
シンニッタン	200	447.00	89,400
ローツェ	100	4,330.00	433,000
クボタ	6,500	1,786.00	11,609,000
東洋エンジニアリング	200	718.00	143,600
月島機械	200	1,668.00	333,600
帝国電機製作所	100	1,388.00	138,800
東京機械製作所	100	374.00	37,400
新東工業	300	1,093.00	327,900
澁谷工業	100	3,200.00	320,000
アイチコーポレーション	200	766.00	153,200
小森コーポレーション	300	1,161.00	348,300
鶴見製作所	100	2,047.00	204,700
荏原製作所	500	3,450.00	1,725,000
西島製作所	100	951.00	95,100
北越工業	100	1,298.00	129,800
ダイキン工業	1,600	15,900.00	25,440,000
トーヨーカネツ	100	2,379.00	237,900
栗田工業	700	3,220.00	2,254,000
椿本チエイン	200	3,945.00	789,000
大同工業	100	838.00	83,800
日機装	400	1,417.00	566,800
木村化工機	100	685.00	68,500
レイズネクスト	200	1,398.00	279,600
アネスト岩田	200	1,084.00	216,800

ダイフク	600	6,680.00	4,008,000	
加藤製作所	100	1,790.00	179,000	
タダノ	600	1,056.00	633,600	
フジテック	400	1,798.00	719,200	
C K D	300	1,933.00	579,900	
キトー	100	1,717.00	171,700	
平和	300	2,248.00	674,400	
理想科学工業	100	1,942.00	194,200	
S A N K Y O	300	3,640.00	1,092,000	
日本金銭機械	100	920.00	92,000	
マースグループホールディングス	100	2,101.00	210,100	
フクシマガリレイ	100	4,090.00	409,000	
オーイズミ	100	584.00	58,400	
ダイコク電機	100	1,665.00	166,500	
竹内製作所	200	1,682.00	336,400	
アマノ	300	3,375.00	1,012,500	
J U K I	200	912.00	182,400	
サンデンホールディングス	200	856.00	171,200	
蛇の目ミシン工業	100	416.00	41,600	
ブラザー工業	1,500	2,333.00	3,499,500	
マックス	200	2,136.00	427,200	
モリタホールディングス	200	1,767.00	353,400	
グローリー	300	3,360.00	1,008,000	
新晃工業	100	2,024.00	202,400	
大和冷機工業	200	1,315.00	263,000	
セガサミーホールディングス	1,200	1,616.00	1,939,200	
リケン	100	4,365.00	436,500	
T P R	200	2,155.00	431,000	
ツバキ・ナカシマ	300	1,682.00	504,600	
ホシザキ	400	10,010.00	4,004,000	
大豊工業	100	902.00	90,200	
日本精工	2,300	1,083.00	2,490,900	
N T N	2,900	362.00	1,049,800	
ジェイテクト	1,200	1,379.00	1,654,800	
不二越	100	5,050.00	505,000	
ミネベアミツミ	2,300	2,312.00	5,317,600	
日本トムソン	400	509.00	203,600	
T H K	700	3,085.00	2,159,500	
ユーシン精機	100	1,045.00	104,500	
イーグル工業	200	1,142.00	228,400	
前澤工業	100	391.00	39,100	
日本ピラー工業	100	1,538.00	153,800	
キッツ	500	755.00	377,500	
日立製作所	5,900	4,318.00	25,476,200	
三菱電機	12,300	1,549.00	19,052,700	
富士電機	700	3,475.00	2,432,500	
安川電機	1,300	4,315.00	5,609,500	
シンフォニア テクノロジー	200	1,388.00	277,600	
明電舎	200	2,259.00	451,800	
山洋電気	100	5,620.00	562,000	

デンヨー	100	2,119.00	211,900	
ベイカレント・コンサルティング	100	5,300.00	530,000	
グレイステクノロジー	100	2,759.00	275,900	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	100	2,746.00	274,600	
日総工産	100	1,015.00	101,500	
キュービーネットホールディングス	100	2,345.00	234,500	
R P Aホールディングス	100	1,161.00	116,100	
三櫻工業	200	1,296.00	259,200	
マキタ	1,600	3,765.00	6,024,000	
東芝テック	200	4,550.00	910,000	
マブチモーター	300	4,205.00	1,261,500	
日本電産	1,500	15,610.00	23,415,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	566.00	56,600	
トレックス・セミコンダクター	100	1,563.00	156,300	
東光高岳	100	1,217.00	121,700	
ダブル・スコープ	200	993.00	198,600	
ダイヘン	100	3,770.00	377,000	
ヤーマン	200	714.00	142,800	
J V Cケンウッド	1,000	274.00	274,000	
ミマキエンジニアリング	100	530.00	53,000	
第一精工	100	2,645.00	264,500	
日新電機	300	1,339.00	401,700	
大崎電気工業	200	730.00	146,000	
オムロン	1,100	6,700.00	7,370,000	
日東工業	200	2,576.00	515,200	
I D E C	200	2,325.00	465,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	400	2,426.00	970,400	
日本電気	1,500	4,455.00	6,682,500	
富士通	1,200	10,100.00	12,120,000	
沖電気工業	500	1,563.00	781,500	
岩崎通信機	100	829.00	82,900	
電気興業	100	3,185.00	318,500	
サンケン電気	100	3,355.00	335,500	
アイホン	100	1,919.00	191,900	
ルネサスエレクトロニクス	5,900	744.00	4,389,600	
セイコーエプソン	1,500	1,738.00	2,607,000	
ワコム	800	484.00	387,200	
アルバック	200	4,550.00	910,000	
アクセル	100	784.00	78,400	
E I Z O	100	4,055.00	405,500	
ジャパンディスプレイ	3,600	73.00	262,800	
日本信号	300	1,493.00	447,900	
京三製作所	300	583.00	174,900	
能美防災	200	2,484.00	496,800	
ホーチキ	100	1,803.00	180,300	
星和電機	100	582.00	58,200	
エレコム	100	4,280.00	428,000	
パナソニック	14,100	1,036.50	14,614,650	代用有価証券 7,500株

シャープ	1,400	1,780.00	2,492,000	
アンリツ	800	2,173.00	1,738,400	
富士通ゼネラル	300	2,418.00	725,400	
ソニー	7,800	7,466.00	58,234,800	代用有価証券 3,700株
T D K	600	12,610.00	7,566,000	
帝国通信工業	100	1,216.00	121,600	
タムラ製作所	400	695.00	278,000	
アルプスアルパイン	1,100	2,549.00	2,803,900	
日本電波工業	100	540.00	54,000	
鈴木	100	820.00	82,000	
ローランド ディー . ジー .	100	2,245.00	224,500	
フォスター電機	100	2,035.00	203,500	
ヨコオ	100	3,280.00	328,000	
ティアック	100	222.00	22,200	
ホシデン	300	1,421.00	426,300	
ヒロセ電機	200	13,930.00	2,786,000	
日本航空電子工業	300	2,281.00	684,300	
T O A	100	1,144.00	114,400	
マクセルホールディングス	300	1,509.00	452,700	
古野電気	200	1,368.00	273,600	
スミダコーポレーション	100	1,319.00	131,900	
アイコム	100	2,738.00	273,800	
リオン	100	2,908.00	290,800	
本多通信工業	100	568.00	56,800	
船井電機	100	702.00	70,200	
横河電機	1,100	1,944.00	2,138,400	
アズビル	800	3,205.00	2,564,000	
東亜ディーケーケー	100	985.00	98,500	
日本光電工業	500	2,905.00	1,452,500	
共和電業	100	442.00	44,200	
堀場製作所	200	7,720.00	1,544,000	
アドバンテスト	900	5,790.00	5,211,000	
小野測器	100	558.00	55,800	
エスベック	100	2,266.00	226,600	
キーエンス	1,100	40,100.00	44,110,000	
日置電機	100	3,920.00	392,000	
シスメックス	900	7,532.00	6,778,800	
日本マイクロニクス	200	1,157.00	231,400	
メガチップス	100	2,060.00	206,000	
O B A R A G R O U P	100	3,820.00	382,000	
I M A G I C A G R O U P	100	601.00	60,100	
デンソー	2,700	5,108.00	13,791,600	
原田工業	100	1,045.00	104,500	
コーセル	200	1,321.00	264,200	
イリソ電子工業	100	5,120.00	512,000	
オブテックスグループ	200	1,581.00	316,200	
千代田インテグレ	100	2,475.00	247,500	
レーザーテック	300	9,920.00	2,976,000	
スタンレー電気	900	3,175.00	2,857,500	



ウシオ電機	700	1,671.00	1,169,700
岡谷電機産業	100	402.00	40,200
ヘリオス テクノ ホールディング	100	475.00	47,500
日本セラミック	100	2,882.00	288,200
遠藤照明	100	726.00	72,600
古河電池	100	850.00	85,000
双信電機	100	508.00	50,800
山一電機	100	1,695.00	169,500
図研	100	2,542.00	254,200
日本電子	200	3,230.00	646,000
カシオ計算機	1,100	2,161.00	2,377,100
ファナック	1,200	21,700.00	26,040,000
日本シイエムケイ	300	657.00	197,100
エンプラス	100	3,625.00	362,500
ローム	500	9,070.00	4,535,000
浜松ホトニクス	900	4,570.00	4,113,000
三井ハイテック	100	1,629.00	162,900
新光電気工業	400	1,233.00	493,200
京セラ	1,700	7,492.00	12,736,400
太陽誘電	500	3,125.00	1,562,500
村田製作所	3,600	6,610.00	23,796,000
双葉電子工業	200	1,429.00	285,800
日東電工	800	6,310.00	5,048,000
東海理化電機製作所	300	2,245.00	673,500
ニチコン	400	1,138.00	455,200
日本ケミコン	100	2,145.00	214,500
K O A	200	1,464.00	292,800
三井E & Sホールディングス	400	1,000.00	400,000
日立造船	1,000	440.00	440,000
三菱重工業	2,100	4,237.00	8,897,700
川崎重工業	1,000	2,564.00	2,564,000
I H I	900	2,614.00	2,352,600
名村造船所	400	273.00	109,200
サノヤスホールディングス	100	180.00	18,000
三菱ロジスネクスト	200	1,328.00	265,600
F P G	400	1,015.00	406,000
じもとホールディングス	800	112.00	89,600
全国保証	300	4,600.00	1,380,000
めぶきフィナンシャルグループ	6,300	284.00	1,789,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	200	1,576.00	315,200
九州フィナンシャルグループ	2,000	487.00	974,000
かんぽ生命保険	400	1,978.00	791,200
ゆうちょ銀行	3,400	1,072.00	3,644,800
富山第一銀行	300	365.00	109,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	7,100	458.00	3,251,800
西日本フィナンシャルホールディングス	800	877.00	701,600
マーキュリアインベストメント	100	761.00	76,100
アルヒ	200	2,351.00	470,200

プレミアグループ	100	2,266.00	226,600	
日産自動車	14,500	678.00	9,831,000	
いすゞ自動車	3,600	1,383.50	4,980,600	
トヨタ自動車	13,700	7,785.00	106,654,500	代用有価証券 9,000株
日野自動車	1,500	1,168.00	1,752,000	
三菱自動車工業	4,600	483.00	2,221,800	
エフテック	100	776.00	77,600	
武蔵精密工業	300	1,498.00	449,400	
日産車体	200	1,062.00	212,400	
新明和工業	300	1,500.00	450,000	
極東開発工業	200	1,653.00	330,600	
日信工業	300	2,222.00	666,600	
トピー工業	100	2,169.00	216,900	
曙ブレーキ工業	700	243.00	170,100	
タチエス	200	1,499.00	299,800	
NOK	700	1,746.00	1,222,200	
フタバ産業	300	802.00	240,600	
KYB	100	3,335.00	333,500	
市光工業	200	827.00	165,400	
大同メタル工業	200	782.00	156,400	
プレス工業	600	444.00	266,400	
ミクニ	200	349.00	69,800	
太平洋工業	300	1,505.00	451,500	
ケーヒン	300	2,568.00	770,400	
河西工業	200	919.00	183,800	
アイシン精機	1,000	4,195.00	4,195,000	
マツダ	3,600	957.00	3,445,200	
今仙電機製作所	100	992.00	99,200	
本田技研工業	9,700	3,206.00	31,098,200	代用有価証券 6,000株
スズキ	2,400	4,730.00	11,352,000	
SUBARU	3,800	2,821.00	10,719,800	
安永	100	1,302.00	130,200	
ヤマハ発動機	1,600	2,317.00	3,707,200	
ショーワ	300	2,272.00	681,600	
小糸製作所	700	5,490.00	3,843,000	
TBK	100	445.00	44,500	
エクセディ	200	2,547.00	509,400	
ミツバ	200	800.00	160,000	
豊田合成	400	2,738.00	1,095,200	
愛三工業	200	850.00	170,000	
日本プラスト	100	744.00	74,400	
ヨロズ	100	1,459.00	145,900	
エフ・シー・シー	200	2,422.00	484,400	
シマノ	500	17,630.00	8,815,000	
テイ・エス テック	300	3,495.00	1,048,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	700	710.00	497,000	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,748.00	174,800	
第四北越フィナンシャルグループ	200	3,090.00	618,000	

ジャムコ	100	1,511.00	151,100
小野建	100	1,385.00	138,500
はるやまホールディングス	100	864.00	86,400
ノジマ	200	2,279.00	455,800
佐鳥電機	100	943.00	94,300
カッパ・クリエイト	200	1,508.00	301,600
伯東	100	1,390.00	139,000
コンドーテック	100	1,131.00	113,100
中山福	100	539.00	53,900
ライトオン	100	608.00	60,800
ナガイレーベン	200	2,631.00	526,200
三菱食品	100	3,105.00	310,500
良品計画	1,600	2,532.00	4,051,200
三城ホールディングス	100	287.00	28,700
松田産業	100	1,621.00	162,100
第一興商	200	5,440.00	1,088,000
メディバルホールディングス	1,300	2,389.00	3,105,700
アドヴァン	200	1,334.00	266,800
アズワン	100	9,830.00	983,000
シモジマ	100	1,269.00	126,900
ドウシシャ	100	1,828.00	182,800
コナカ	100	421.00	42,100
高速	100	1,234.00	123,400
イオン北海道	100	785.00	78,500
コジマ	200	506.00	101,200
コーナン商事	200	2,575.00	515,000
ネットワークシステムズ	500	2,770.00	1,385,000
ワタミ	100	1,305.00	130,500
システムソフト	300	111.00	33,300
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	2,900	1,819.00	5,275,100
丸文	100	620.00	62,000
西松屋チェーン	300	940.00	282,000
ゼンショーホールディングス	600	2,440.00	1,464,000
ハピネット	100	1,396.00	139,600
幸楽苑ホールディングス	100	2,039.00	203,900
日本ライフライン	400	1,532.00	612,800
サイゼリヤ	200	2,617.00	523,400
タカショー	100	503.00	50,300
VTホールディングス	500	486.00	243,000
アルゴグラフィックス	100	3,430.00	343,000
IDOM	300	604.00	181,200
日本エム・ディ・エム	100	2,151.00	215,100
ユナイテッドアローズ	100	3,235.00	323,500
進和	100	2,481.00	248,100
ダイトロン	100	1,884.00	188,400
ハイデイ日高	200	2,213.00	442,600
シークス	200	1,644.00	328,800
京都きもの友禅	100	353.00	35,300
コロワイド	400	2,191.00	876,400

ピーシーデポコーポレーション	200	530.00	106,000	
オーハシテクニカ	100	1,501.00	150,100	
壱番屋	100	5,510.00	551,000	
スギホールディングス	200	6,000.00	1,200,000	
薬王堂ホールディングス	100	2,530.00	253,000	
島津製作所	1,500	3,390.00	5,085,000	
JMS	100	823.00	82,300	
長野計器	100	834.00	83,400	
ブイ・テクノロジー	100	6,110.00	611,000	
スター精密	200	1,576.00	315,200	
東京計器	100	1,046.00	104,600	
インターアクション	100	2,762.00	276,200	
オーバル	100	254.00	25,400	
東京精密	200	4,210.00	842,000	
マニー	500	2,950.00	1,475,000	
ニコン	2,000	1,466.00	2,932,000	
トプコン	600	1,468.00	880,800	
オリンパス	6,800	1,607.00	10,927,600	
理研計器	100	2,327.00	232,700	
SCREENホールディングス	200	7,960.00	1,592,000	
キヤノン電子	100	2,165.00	216,500	
タムロン	100	2,654.00	265,400	
HOYA	2,500	9,722.00	24,305,000	
シード	100	1,060.00	106,000	
ノーリツ鋼機	100	1,718.00	171,800	
エー・アンド・デイ	100	1,062.00	106,200	
朝日インテック	1,000	3,125.00	3,125,000	
キヤノン	6,600	3,080.00	20,328,000	代用有価証券 4,100株
リコー	3,100	1,187.00	3,679,700	
シチズン時計	1,400	616.00	862,400	
大研医器	100	620.00	62,000	
メニコン	200	4,370.00	874,000	
スノーピーク	100	1,062.00	106,200	
パラマウントベッドホールディングス	100	4,560.00	456,000	
トランザクション	100	1,018.00	101,800	
ニホンフラッシュ	100	2,896.00	289,600	
前田工織	100	2,106.00	210,600	
永大産業	200	353.00	70,600	
アートネイチャー	100	816.00	81,600	
バンダイナムコホールディングス	1,300	6,700.00	8,710,000	
共立印刷	200	169.00	33,800	
SHOEI	100	5,360.00	536,000	
フランスベッドホールディングス	200	989.00	197,800	
マーベラス	200	750.00	150,000	
パイロットコーポレーション	200	4,655.00	931,000	
萩原工業	100	1,702.00	170,200	
エイベックス	200	1,260.00	252,000	
トッパン・フォームズ	300	1,218.00	365,400	
フジシールインターナショナル	300	2,504.00	751,200	

タカラトミー	600	1,287.00	772,200
廣濟堂	100	826.00	82,600
アーク	500	95.00	47,500
レック	100	1,343.00	134,300
三光合成	100	451.00	45,100
プロネクサス	100	1,230.00	123,000
ホクシン	100	170.00	17,000
大建工業	100	2,000.00	200,000
きもと	200	180.00	36,000
凸版印刷	1,700	2,259.00	3,840,300
大日本印刷	1,600	3,050.00	4,880,000
N I S S H A	300	1,177.00	353,100
藤森工業	100	3,505.00	350,500
ヴィア・ホールディングス	100	678.00	67,800
TAKARA & COMPANY	100	1,718.00	171,800
前澤化成工業	100	1,212.00	121,200
未来工業	100	2,193.00	219,300
アシックス	1,000	1,804.00	1,804,000
J S P	100	1,949.00	194,900
ニチハ	200	2,783.00	556,600
エフピコ	100	6,690.00	669,000
ヤマハ	700	6,180.00	4,326,000
クリナップ	100	765.00	76,500
ビジョン	700	4,085.00	2,859,500
天馬	100	2,022.00	202,200
キングジム	100	887.00	88,700
象印マホービン	400	1,843.00	737,200
リンテック	300	2,494.00	748,200
信越ポリマー	200	1,003.00	200,600
東リ	300	338.00	101,400
イトーキ	300	581.00	174,300
任天堂	800	45,460.00	36,368,000
三菱鉛筆	200	1,709.00	341,800
松風	100	1,717.00	171,700
タカラスタンダード	300	2,059.00	617,700
コクヨ	600	1,722.00	1,033,200
ナカバヤシ	100	614.00	61,400
ニフコ	500	3,090.00	1,545,000
立川ブラインド工業	100	1,409.00	140,900
グローブライド	100	2,618.00	261,800
オカムラ	400	1,090.00	436,000
バルカー	100	2,610.00	261,000
伊藤忠商事	8,500	2,539.50	21,585,750
丸紅	12,600	829.00	10,445,400
スクロール	200	359.00	71,800
ヨンドシーホールディングス	100	2,625.00	262,500
三陽商会	100	1,391.00	139,100
長瀬産業	700	1,666.00	1,166,200
蝶理	100	2,227.00	222,700
豊田通商	1,400	4,000.00	5,600,000

オンワードホールディングス	700	660.00	462,000	
三共生興	200	597.00	119,400	
兼松	500	1,476.00	738,000	
美津濃	100	2,793.00	279,300	
ファミリーマート	1,000	2,682.00	2,682,000	
三井物産	10,700	1,983.00	21,218,100	
日本紙パルプ商事	100	4,280.00	428,000	
東京エレクトロン	800	24,910.00	19,928,000	
日立ハイテクノロジーズ	400	7,470.00	2,988,000	
カメイ	200	1,374.00	274,800	
セイコーホールディングス	200	2,849.00	569,800	
山善	500	1,087.00	543,500	
住友商事	7,700	1,668.50	12,847,450	
日本ユニシス	400	3,545.00	1,418,000	
内田洋行	100	8,150.00	815,000	
三菱商事	8,500	2,924.00	24,854,000	代用有価証券 5,200株
第一実業	100	3,895.00	389,500	
キヤノンマーケティングジャパン	300	2,598.00	779,400	
西華産業	100	1,391.00	139,100	
佐藤商事	100	994.00	99,400	
菱洋エレクトロ	100	2,059.00	205,900	
東京産業	100	609.00	60,900	
ユアサ商事	100	3,715.00	371,500	
小林産業	100	299.00	29,900	
阪和興業	200	2,938.00	587,600	
正栄食品工業	100	3,745.00	374,500	
カナデン	100	1,348.00	134,800	
菱電商事	100	1,683.00	168,300	
ニプロ	900	1,319.00	1,187,100	
フルサト工業	100	1,700.00	170,000	
岩谷産業	300	3,725.00	1,117,500	
イワキ	200	467.00	93,400	
兼松エレクトロニクス	100	3,655.00	365,500	
三愛石油	300	1,183.00	354,900	
稲畑産業	300	1,613.00	483,900	
明和産業	100	638.00	63,800	
キムラタン	600	31.00	18,600	
ゴールドウイン	200	8,080.00	1,616,000	
ユニ・チャーム	2,400	3,640.00	8,736,000	
デサント	200	2,041.00	408,200	
キング	100	524.00	52,400	
ワキタ	300	1,143.00	342,900	
ヤマトインターナショナル	100	402.00	40,200	
東邦ホールディングス	400	2,467.00	986,800	
サンゲツ	300	2,089.00	626,700	
ミツウロコグループホールディングス	200	1,444.00	288,800	
伊藤忠エネクス	300	911.00	273,300	
サンリオ	300	2,189.00	656,700	
サンワテクノス	100	1,210.00	121,000	

リョーサン	100	2,866.00	286,600
新光商事	200	886.00	177,200
トーホー	100	1,919.00	191,900
三信電気	100	1,751.00	175,100
東陽テクニカ	100	1,210.00	121,000
モスフードサービス	200	3,075.00	615,000
加賀電子	100	2,622.00	262,200
三益半導体工業	100	2,176.00	217,600
ソーダニッカ	100	622.00	62,200
立花エレテック	100	1,830.00	183,000
木曽路	200	3,000.00	600,000
S R S ホールディングス	100	1,046.00	104,600
千趣会	200	489.00	97,800
タカキュー	100	191.00	19,100
ケーヨー	200	549.00	109,800
上新電機	100	2,620.00	262,000
日本瓦斯	200	3,610.00	722,000
ロイヤルホールディングス	200	2,517.00	503,400
いなげや	200	1,505.00	301,000
島忠	200	3,025.00	605,000
チヨダ	100	1,619.00	161,900
ライフコーポレーション	100	2,535.00	253,500
リンガーハット	100	2,528.00	252,800
MrMaxHD	200	500.00	100,000
テンアライド	100	443.00	44,300
AOKIホールディングス	200	1,131.00	226,200
オークワ	200	1,481.00	296,200
コメリ	200	2,366.00	473,200
青山商事	300	1,578.00	473,400
しまむら	100	9,090.00	909,000
はせがわ	100	402.00	40,200
高島屋	900	1,288.00	1,159,200
松屋	200	900.00	180,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	600	1,324.00	794,400
パルコ	100	1,339.00	133,900
丸井グループ	1,100	2,699.00	2,968,900
クレディセゾン	900	1,888.00	1,699,200
アクシアル リテイリング	100	3,970.00	397,000
井筒屋	100	258.00	25,800
イオン	4,700	2,293.00	10,777,100
イズミ	200	4,070.00	814,000
フォーバル	100	1,023.00	102,300
平和堂	200	2,096.00	419,200
フジ	100	1,979.00	197,900
ヤオコー	100	5,440.00	544,000
ゼビオホールディングス	100	1,339.00	133,900
ケーズホールディングス	1,200	1,408.00	1,689,600
PALTAC	200	5,130.00	1,026,000
三谷産業	200	342.00	68,400
Olympicグループ	100	661.00	66,100

日産東京販売ホールディングス	200	288.00	57,600	
新生銀行	900	1,720.00	1,548,000	
あおぞら銀行	700	2,890.00	2,023,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	83,600	593.00	49,574,800	
りそなホールディングス	13,300	486.90	6,475,770	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,300	4,291.00	9,869,300	
三井住友フィナンシャルグループ	8,400	4,062.00	34,120,800	
千葉銀行	4,200	646.00	2,713,200	
群馬銀行	2,400	387.00	928,800	
武蔵野銀行	200	1,954.00	390,800	
千葉興業銀行	300	369.00	110,700	
筑波銀行	500	240.00	120,000	
七十七銀行	400	1,838.00	735,200	
青森銀行	100	2,920.00	292,000	
秋田銀行	100	2,233.00	223,300	
山形銀行	100	1,660.00	166,000	
岩手銀行	100	2,906.00	290,600	
東邦銀行	1,100	281.00	309,100	
東北銀行	100	1,043.00	104,300	
みちのく銀行	100	1,533.00	153,300	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,000	2,167.00	2,167,000	
静岡銀行	3,000	841.00	2,523,000	
十六銀行	200	2,626.00	525,200	
スルガ銀行	1,200	541.00	649,200	
八十二銀行	2,900	484.00	1,403,600	
山梨中央銀行	100	1,186.00	118,600	
大垣共立銀行	200	2,472.00	494,400	
福井銀行	100	1,886.00	188,600	
北國銀行	100	3,720.00	372,000	
清水銀行	100	2,156.00	215,600	
滋賀銀行	200	2,805.00	561,000	
南都銀行	200	2,776.00	555,200	
百五銀行	1,100	358.00	393,800	
京都銀行	400	4,850.00	1,940,000	
紀陽銀行	400	1,691.00	676,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	800	1,155.00	924,000	
広島銀行	1,800	545.00	981,000	
山陰合同銀行	700	687.00	480,900	
中国銀行	1,000	1,127.00	1,127,000	
伊予銀行	1,700	620.00	1,054,000	
百十四銀行	100	2,206.00	220,600	
四国銀行	200	1,068.00	213,600	
阿波銀行	200	2,603.00	520,600	
大分銀行	100	2,800.00	280,000	
宮崎銀行	100	2,733.00	273,300	
佐賀銀行	100	1,803.00	180,300	
沖縄銀行	100	3,660.00	366,000	
琉球銀行	300	1,231.00	369,300	
セブン銀行	4,100	359.00	1,471,900	
みずほフィナンシャルグループ	165,100	170.20	28,100,020	



山口フィナンシャルグループ	1,500	777.00	1,165,500	
芙蓉総合リース	100	7,270.00	727,000	
みずほリース	200	3,370.00	674,000	
東京センチュリー	200	5,940.00	1,188,000	
SBIホールディングス	1,400	2,317.00	3,243,800	
日本証券金融	500	540.00	270,000	
アイフル	1,900	243.00	461,700	
日本アジア投資	100	291.00	29,100	
名古屋銀行	100	3,400.00	340,000	
北洋銀行	1,800	253.00	455,400	
愛媛銀行	200	1,198.00	239,600	
京葉銀行	500	639.00	319,500	
栃木銀行	600	240.00	144,000	
東和銀行	200	926.00	185,200	
福島銀行	100	271.00	27,100	
大東銀行	100	650.00	65,000	
リコーリース	100	4,100.00	410,000	
イオンフィナンシャルサービス	700	1,710.00	1,197,000	
アコム	2,400	482.00	1,156,800	
ジャックス	100	2,765.00	276,500	
オリエントコーポレーション	3,300	163.00	537,900	
日立キャピタル	300	2,817.00	845,100	
アプラスフィナンシャル	600	92.00	55,200	
オリックス	7,600	1,844.50	14,018,200	
三菱UFJリース	3,100	703.00	2,179,300	
ジャフコ	200	4,315.00	863,000	
九州リースサービス	100	600.00	60,000	
トモニホールディングス	900	433.00	389,700	
大和証券グループ本社	9,700	557.00	5,402,900	
野村ホールディングス	21,400	556.20	11,902,680	
岡三証券グループ	1,000	402.00	402,000	
丸三証券	400	526.00	210,400	
東洋証券	400	158.00	63,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,400	333.00	466,200	
水戸証券	400	234.00	93,600	
いちよし証券	200	659.00	131,800	
松井証券	700	885.00	619,500	
SOMPOホールディングス	2,300	4,440.00	10,212,000	
だいこう証券ビジネス	100	695.00	69,500	
日本取引所グループ	3,500	1,960.00	6,860,000	
マネックスグループ	900	275.00	247,500	
極東証券	200	775.00	155,000	
岩井コスモホールディングス	100	1,297.00	129,700	
藍澤證券	200	755.00	151,000	
フィデアホールディングス	1,200	137.00	164,400	
池田泉州ホールディングス	1,400	220.00	308,000	
アニコムホールディングス	100	3,535.00	353,500	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3,200	3,730.00	11,936,000	

ソニーフィナンシャルホールディングス	1,000	2,670.00	2,670,000	
マネーパートナーズグループ	100	241.00	24,100	
スパークス・グループ	400	260.00	104,000	
第一生命ホールディングス	6,900	1,865.00	12,868,500	
東京海上ホールディングス	4,300	6,232.00	26,797,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	100	1,019.00	101,900	
イー・ギャランティ	100	1,322.00	132,200	
アサックス	100	665.00	66,500	
T&Dホールディングス	3,800	1,374.00	5,221,200	
三井不動産	6,100	2,739.00	16,707,900	
三菱地所	8,500	2,125.00	18,062,500	
平和不動産	200	2,973.00	594,600	
東京建物	1,300	1,715.00	2,229,500	
ダイビル	300	1,219.00	365,700	
京阪神ビルディング	200	1,452.00	290,400	
住友不動産	2,700	3,934.00	10,621,800	
テーオーシー	200	915.00	183,000	
レオパレス21	1,600	367.00	587,200	
スターツコーポレーション	200	2,766.00	553,200	
フジ住宅	100	686.00	68,600	
空港施設	100	555.00	55,500	
明和地所	100	615.00	61,500	
ゴールドクレスト	100	2,142.00	214,200	
リログループ	600	2,953.00	1,771,800	
日神不動産	200	559.00	111,800	
日本エスコン	200	1,010.00	202,000	
タカラレーベン	600	510.00	306,000	
サンヨーハウジング名古屋	100	1,023.00	102,300	
イオンモール	600	1,896.00	1,137,600	
ファースト住建	100	1,262.00	126,200	
ランド	6,600	12.00	79,200	
カチタス	200	4,640.00	928,000	
東祥	100	2,523.00	252,300	
トーセイ	200	1,516.00	303,200	
サンフロンティア不動産	200	1,346.00	269,200	
エフ・ジェー・ネクスト	100	1,138.00	113,800	
ランドビジネス	100	751.00	75,100	
グランディハウス	100	485.00	48,500	
東武鉄道	1,300	4,060.00	5,278,000	
相鉄ホールディングス	400	3,010.00	1,204,000	
東急	3,100	2,072.00	6,423,200	
京浜急行電鉄	1,600	2,116.00	3,385,600	
小田急電鉄	1,800	2,594.00	4,669,200	
京王電鉄	600	6,730.00	4,038,000	
京成電鉄	900	4,325.00	3,892,500	
富士急行	200	4,260.00	852,000	
東日本旅客鉄道	2,200	9,903.00	21,786,600	
西日本旅客鉄道	1,100	9,570.00	10,527,000	
東海旅客鉄道	1,000	22,130.00	22,130,000	

西武ホールディングス	1,700	1,847.00	3,139,900	
鴻池運輸	200	1,702.00	340,400	
西日本鉄道	300	2,593.00	777,900	
ハマキョウレックス	100	3,535.00	353,500	
サカイ引越センター	100	7,020.00	702,000	
近鉄グループホールディングス	1,200	5,930.00	7,116,000	
阪急阪神ホールディングス	1,600	4,745.00	7,592,000	
南海電気鉄道	600	2,994.00	1,796,400	
京阪ホールディングス	500	5,320.00	2,660,000	
名古屋鉄道	1,000	3,410.00	3,410,000	
山陽電気鉄道	100	2,181.00	218,100	
日本通運	400	6,590.00	2,636,000	
ヤマトホールディングス	2,000	1,881.00	3,762,000	
山九	300	5,570.00	1,671,000	
日新	100	1,876.00	187,600	
丸運	100	307.00	30,700	
丸全昭和運輸	100	3,105.00	310,500	
センコーグループホールディングス	600	929.00	557,400	
ニッコンホールディングス	400	2,749.00	1,099,600	
福山通運	100	4,095.00	409,500	
セイノーホールディングス	900	1,497.00	1,347,300	
日立物流	200	3,010.00	602,000	
丸和運輸機関	100	2,446.00	244,600	
C & F ロジホールディングス	100	1,455.00	145,500	
日本郵船	1,000	2,013.00	2,013,000	
商船三井	700	2,997.00	2,097,900	
川崎汽船	400	1,897.00	758,800	
NSユナイテッド海運	100	2,277.00	227,700	
明治海運	100	361.00	36,100	
飯野海運	600	372.00	223,200	
九州旅客鉄道	1,000	3,675.00	3,675,000	
SGホールディングス	1,200	2,541.00	3,049,200	
日本航空	2,100	3,383.00	7,104,300	
ANAホールディングス	2,100	3,706.00	7,782,600	
Genky DrugStores	100	2,447.00	244,700	
国際紙パルプ商事	300	311.00	93,300	
総合メディカルホールディングス	100	2,040.00	204,000	
ブックオフグループホールディングス	100	1,071.00	107,100	
三菱倉庫	400	2,892.00	1,156,800	
三井倉庫ホールディングス	100	1,985.00	198,500	
住友倉庫	400	1,509.00	603,600	
澁澤倉庫	100	2,345.00	234,500	
ヤマタネ	100	1,551.00	155,100	
東陽倉庫	200	343.00	68,600	
乾汽船	100	1,150.00	115,000	
日本トランスシティ	300	561.00	168,300	
中央倉庫	100	1,255.00	125,500	
安田倉庫	100	1,045.00	104,500	
宇徳	100	545.00	54,500	
上組	700	2,404.00	1,682,800	

近鉄エクスプレス	200	1,877.00	375,400
東海運	100	289.00	28,900
エーアイティー	100	961.00	96,100
東京放送ホールディングス	700	1,815.00	1,270,500
日本テレビホールディングス	1,000	1,478.00	1,478,000
朝日放送グループホールディングス	100	762.00	76,200
テレビ朝日ホールディングス	300	2,113.00	633,900
スカパーJ S A Tホールディングス	800	480.00	384,000
テレビ東京ホールディングス	100	2,434.00	243,400
ビジョン	100	1,743.00	174,300
ワイヤレスゲート	100	641.00	64,100
コネクシオ	100	1,558.00	155,800
日本通信	900	234.00	210,600
日本電信電話	8,100	5,586.00	45,246,600
K D D I	9,000	3,214.00	28,926,000
ソフトバンク	11,000	1,451.00	15,961,000
光通信	100	26,800.00	2,680,000
N T T ドコモ	8,900	3,028.00	26,949,200
エムティーアイ	100	727.00	72,700
G M O インターネット	500	2,172.00	1,086,000
K A D O K A W A	300	1,935.00	580,500
ゼンリン	200	1,955.00	391,000
昭文社	100	413.00	41,300
インプレスホールディングス	100	189.00	18,900
東京電力ホールディングス	9,800	484.00	4,743,200
中部電力	3,800	1,555.50	5,910,900
関西電力	4,700	1,266.50	5,952,550
中国電力	1,700	1,468.00	2,495,600
北陸電力	1,100	816.00	897,600
東北電力	3,100	1,106.00	3,428,600
四国電力	1,100	1,096.00	1,205,600
九州電力	2,500	967.00	2,417,500
北海道電力	1,200	531.00	637,200
沖縄電力	200	2,028.00	405,600
電源開発	1,000	2,726.00	2,726,000
エフオン	100	751.00	75,100
イーレックス	200	1,787.00	357,400
レノバ	200	1,120.00	224,000
東京瓦斯	2,400	2,672.00	6,412,800
大阪瓦斯	2,400	2,191.00	5,258,400
東邦瓦斯	600	4,465.00	2,679,000
北海道瓦斯	100	1,647.00	164,700
広島ガス	300	364.00	109,200
西部瓦斯	100	2,603.00	260,300
静岡ガス	300	996.00	298,800
メタウォーター	100	4,285.00	428,500
アイネット	100	1,557.00	155,700
松竹	100	16,330.00	1,633,000
東宝	700	4,435.00	3,104,500
エイチ・アイ・エス	200	3,160.00	632,000

エヌ・ティ・ティ・データ	3,200	1,469.00	4,700,800
共立メンテナンス	200	4,985.00	997,000
イチネンホールディングス	100	1,506.00	150,600
建設技術研究所	100	2,176.00	217,600
スペース	100	1,314.00	131,400
アインホールディングス	200	6,480.00	1,296,000
燦ホールディングス	100	1,410.00	141,000
東京都競馬	100	3,500.00	350,000
カナモト	200	2,945.00	589,000
東京ドーム	500	1,055.00	527,500
D T S	300	2,481.00	744,300
スクウェア・エニックス・ホールディングス	500	5,480.00	2,740,000
シーイーシー	100	2,107.00	210,700
カプコン	600	2,911.00	1,746,600
西尾レントオール	100	3,235.00	323,500
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	800	34.00	27,200
日本空港ビルデング	400	6,070.00	2,428,000
トランス・コスモス	100	2,974.00	297,400
乃村工藝社	500	1,413.00	706,500
ジャステック	100	1,126.00	112,600
S C S K	300	5,800.00	1,740,000
藤田観光	100	2,919.00	291,900
K N T - C Tホールディングス	100	1,496.00	149,600
日本管財	100	1,970.00	197,000
トーカイ	100	2,895.00	289,500
セコム	1,200	9,855.00	11,826,000
セントラル警備保障	100	6,300.00	630,000
アイネス	100	1,324.00	132,400
丹青社	200	1,292.00	258,400
メイテック	100	6,170.00	617,000
T K C	100	5,380.00	538,000
富士ソフト	200	4,170.00	834,000
応用地質	100	1,529.00	152,900
船井総研ホールディングス	200	2,511.00	502,200
N S D	200	3,585.00	717,000
オオバ	100	909.00	90,900
コナミホールディングス	400	4,470.00	1,788,000
ベネッセホールディングス	400	2,910.00	1,164,000
イオンディライト	100	3,900.00	390,000
ナック	100	1,036.00	103,600
ニチイ学館	200	1,541.00	308,200
ダイセキ	200	3,245.00	649,000
日鉄物産	100	5,210.00	521,000
トラスコ中山	300	2,932.00	879,600
ヤマダ電機	3,700	552.00	2,042,400
オートバックスセブン	400	1,741.00	696,400
モリト	100	801.00	80,100
アークランドサカモト	200	1,282.00	256,400

ニトリホールディングス	500	17,490.00	8,745,000	
グルメ杵屋	100	1,214.00	121,400	
愛眼	100	243.00	24,300	
ケーユーホールディングス	100	936.00	93,600	
吉野家ホールディングス	400	2,712.00	1,084,800	
加藤産業	200	3,750.00	750,000	
イノテック	100	1,054.00	105,400	
イエローハット	200	1,969.00	393,800	
松屋フーズホールディングス	100	4,390.00	439,000	
JBCホールディングス	100	1,872.00	187,200	
JKホールディングス	100	670.00	67,000	
サガミホールディングス	200	1,380.00	276,000	
日伝	100	2,127.00	212,700	
関西スーパーマーケット	100	1,068.00	106,800	
ミロク情報サービス	100	3,450.00	345,000	
北沢産業	100	281.00	28,100	
杉本商事	100	2,078.00	207,800	
因幡電機産業	300	2,844.00	853,200	
王将フードサービス	100	6,470.00	647,000	
プレナス	100	1,953.00	195,300	
ミニストップ	100	1,470.00	147,000	
アークス	200	2,292.00	458,400	
バローホールディングス	300	2,065.00	619,500	
ミスミグループ本社	1,500	2,777.00	4,165,500	
アルテック	100	230.00	23,000	
ベルク	100	5,380.00	538,000	
大 庄	100	1,645.00	164,500	
ファーストリテイリング	200	66,990.00	13,398,000	
ソフトバンクグループ	9,600	4,456.00	42,777,600	
スズケン	500	4,605.00	2,302,500	
サンドラッグ	500	3,975.00	1,987,500	
サックスパー ホールディングス	100	911.00	91,100	
ジェコス	100	1,076.00	107,600	
グローセル	100	458.00	45,800	
ペルーナ	300	701.00	210,300	
合計	1,444,000		3,009,788,030	

## (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。

## 新光外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

令和1年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	84,236,964
コール・ローン	6,051,884
株式	2,345,860,092
投資信託受益証券	5,191,453
投資証券	58,819,252
派生商品評価勘定	3,307,629
未収入金	3,618
未収配当金	3,320,614
差入委託証拠金	79,973,658
流動資産合計	2,586,765,164
資産合計	2,586,765,164
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,451
未払解約金	1,010,000
流動負債合計	1,012,451
負債合計	1,012,451
純資産の部	
元本等	
元本	979,392,436
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,606,360,277
元本等合計	2,585,752,713
純資産合計	2,585,752,713
負債純資産合計	2,586,765,164

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>



## (貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年12月16日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,268,835,856円
同期中追加設定元本額	119,524,286円
同期中一部解約元本額	1,408,967,706円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	266,812,170円
新光外国株式インデックスVA	359,712,891円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	140,456,374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)	10,013,881円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	18,202,735円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	172,118,385円
グローバル・ナビ	12,076,000円
計	979,392,436円
2. 受益権の総数	979,392,436口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年12月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	42,074,452
投資信託受益証券	145,318
投資証券	651,307
合計	41,277,827

(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1年12月16日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和1年12月16日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	9,155,444	-	9,154,960	484
アメリカ・ドル	5,471,280	-	5,471,000	280
イギリス・ポンド	584,502	-	584,480	22
オーストラリア・ドル	526,894	-	526,820	74
スイス・フラン	1,111,884	-	1,111,900	16
ユーロ	1,460,884	-	1,460,760	124
合計	9,155,444	-	9,154,960	484

(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。

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。

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

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	令和1年12月16日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	160,685,795	-	163,990,489	3,304,694
合計	160,685,795	-	163,990,489	3,304,694

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和1年12月16日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2,6402円 (26,402円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和1年12月16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	230	1,760.940	405,016.200	
	ABBOTT LABORATORIES	957	86.350	82,636.950	
	AES CORP	310	18.920	5,865.200	
	ABIOMED INC	30	181.850	5,455.500	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	475	134.210	63,749.750	
	ADVANCED MICRO DEVICES	553	41.150	22,755.950	
	ADOBE INC	262	317.940	83,300.280	
	CHUBB LTD	258	154.640	39,897.120	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	119	230.740	27,458.060	
	ALLEGHANY CORP	7	794.680	5,562.760	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	53	132.050	6,998.650	
	RALPH LAUREN CORP	43	116.920	5,027.560	
	ALLSTATE CORP	170	109.700	18,649.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	372	176.980	65,836.560	
	AMGEN INC	325	236.740	76,940.500	
	HESS CORP	171	62.320	10,656.720	
	AMERICAN EXPRESS CO	377	124.720	47,019.440	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	282	92.050	25,958.100	
	AFLAC INC	423	53.170	22,490.910	
	AMERICAN INTL GROUP	463	51.600	23,890.800	
	AMERCO	2	359.890	719.780	
	ANALOG DEVICES	219	118.770	26,010.630	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	118	110.420	13,029.560	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	407	40.440	16,459.080	
	JONES LANG LASALLE INC	21	170.100	3,572.100	
	VALERO ENERGY CORP	225	93.810	21,107.250	
APACHE CORP	234	21.350	4,995.900		
ANSYS INC	46	253.930	11,680.780		
APPLE INC	2,465	275.150	678,244.750		
APPLIED MATERIALS INC	510	59.870	30,533.700		
ALBEMARLE CORP	71	66.630	4,730.730		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	342	45.200	15,458.400	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	59	86.140	5,082.260	
AMEREN CORP	141	75.020	10,577.820	
ARROW ELECTRONICS INC	48	84.450	4,053.600	
AUTOLIV INC	50	84.620	4,231.000	
AUTODESK INC	129	179.410	23,143.890	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	243	168.260	40,887.180	
AUTOZONE INC	13	1,235.320	16,059.160	
AVERY DENNISON CORP	54	129.990	7,019.460	
BALL CORP	161	63.340	10,197.740	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	721	225.370	162,491.770	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	464	50.220	23,302.080	
BAXTER INTERNATIONAL INC	274	83.960	23,005.040	
BECTON DICKINSON & CO	154	268.720	41,382.880	
AMETEK INC	130	98.560	12,812.800	
VERIZON COMM INC	2,249	60.810	136,761.690	
WR BERKLEY CORP	85	69.560	5,912.600	
BEST BUY CO INC	117	84.790	9,920.430	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	8	354.620	2,836.960	
YUM! BRANDS INC	158	100.110	15,817.380	
FIRSTENERGY CORP	329	47.950	15,775.550	
BOEING CO	291	341.670	99,425.970	
ROBERT HALF INTL INC	91	61.640	5,609.240	
BORGWARNER INC	67	43.800	2,934.600	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	773	45.090	34,854.570	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	95	76.550	7,272.250	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	77	121.820	9,380.140	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	16	769.700	12,315.200	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,366	63.820	87,178.120	
INGREDION INC	54	87.690	4,735.260	
ONEOK INC	206	73.170	15,073.020	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	57	109.820	6,259.740	
UNITED RENTALS INC	48	162.740	7,811.520	
SEMPRA ENERGY	150	148.780	22,317.000	
FEDEX CORP	120	165.670	19,880.400	
VERISIGN INC	61	191.490	11,680.890	
AMPHENOL CORP	174	107.140	18,642.360	
BROWN-FORMAN CORP	159	63.850	10,152.150	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	964	6.920	6,670.880	

CSX CORP	421	72.780	30,640.380	
CABOT OIL & GAS CORP	265	16.100	4,266.500	
CAMPBELL SOUP CO	106	47.860	5,073.160	
SEAGATE TECHNOLOGY	134	58.760	7,873.840	
CONSTELLATION BRANDS INC	87	182.060	15,839.220	
CARDINAL HEALTH INC	179	53.660	9,605.140	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	214	47.450	10,154.300	
CATERPILLAR INC	316	145.530	45,987.480	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	65	113.310	7,365.150	
CITRIX SYSTEMS INC	86	110.350	9,490.100	
CENTURYLINK INC	658	13.600	8,948.800	
CERNER CORP	166	72.230	11,990.180	
JPMORGAN CHASE & CO	1,745	136.810	238,733.450	
CHURCH & DWIGHT CO INC	122	69.990	8,538.780	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	93	105.450	9,806.850	
CINTAS CORP	44	261.810	11,519.640	
CISCO SYSTEMS INC	2,303	45.300	104,325.900	
CLOROX COMPANY	60	151.700	9,102.000	
COCA-COLA CO/THE	2,210	54.420	120,268.200	
COPART INC	106	88.620	9,393.720	
COGNEX CORP	121	54.530	6,598.130	
COLGATE-PALMOLIVE CO	469	68.690	32,215.610	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	146	146.160	21,339.360	
COMERICA INC	102	71.930	7,336.860	
NRG ENERGY, INC.	169	39.370	6,653.530	
COMCAST CORP-CL A	2,454	43.580	106,945.320	
CONAGRA BRANDS INC	235	28.380	6,669.300	
CONSOLIDATED EDISON INC	162	87.830	14,228.460	
CMS ENERGY CORP	99	60.990	6,038.010	
COOPER COS INC	24	316.920	7,606.080	
MOLSON COORS BREWING CO	66	50.810	3,353.460	
CORNING INC	355	28.740	10,202.700	
SEALED AIR CORP	49	38.010	1,862.490	
HEICO CORP-CL A	57	97.000	5,529.000	
CUMMINS INC	87	182.480	15,875.760	
DR HORTON INC	169	54.810	9,262.890	
DANAHER CORP	363	148.520	53,912.760	
MOODY'S CORP	100	235.080	23,508.000	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	302	61.640	18,615.280	
TARGET CORP	289	127.220	36,766.580	
DEERE & CO	157	172.500	27,082.500	
MORGAN STANLEY	655	50.240	32,907.200	
REPUBLIC SERVICES INC	121	89.150	10,787.150	
COSTAR GROUP INC	19	580.560	11,030.640	

THE WALT DISNEY CO	981	146.380	143,598.780	
DOLLAR TREE INC	121	93.590	11,324.390	
DOVER CORP	85	113.650	9,660.250	
OMNICOM GROUP	116	82.040	9,516.640	
DTE ENERGY CO	100	124.860	12,486.000	
DUKE ENERGY CORP	422	90.100	38,022.200	
FLOWSERVE CORP	94	48.410	4,550.540	
DARDEN RESTAURANTS INC	61	115.580	7,050.380	
EBAY INC	413	35.480	14,653.240	
BANK OF AMERICA CORP	4,816	34.440	165,863.040	
CITIGROUP INC	1,220	76.390	93,195.800	
EASTMAN CHEMICAL CO	84	78.570	6,599.880	
E*TRADE FINANCIAL CORP	83	45.150	3,747.450	
EATON CORP PLC	211	93.600	19,749.600	
EATON VANCE CORP	32	47.310	1,513.920	
CADENCE DESIGN SYS INC	138	67.920	9,372.960	
DISH NETWORK CORP	178	34.125	6,074.250	
ECOLAB INC	149	185.500	27,639.500	
PERKINELMER INC	73	94.390	6,890.470	
ELECTRONIC ARTS INC	161	104.550	16,832.550	
SALESFORCE.COM INC	452	161.130	72,830.760	
EMERSON ELECTRIC CO	308	75.980	23,401.840	
ATMOS ENERGY CORP	80	107.050	8,564.000	
ENTERGY CORP	122	118.300	14,432.600	
EOG RESOURCES INC	299	75.490	22,571.510	
EQUIFAX INC	61	138.700	8,460.700	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	117	203.210	23,775.570	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	118	76.150	8,985.700	
EXXON MOBIL CORP	2,304	69.230	159,505.920	
FMC CORP	81	99.180	8,033.580	
NEXTERA ENERGY INC	262	236.950	62,080.900	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	27	271.280	7,324.560	
ASSURANT INC	41	130.150	5,336.150	
FASTENAL CO	343	37.030	12,701.290	
FIFTH THIRD BANCORP	397	30.970	12,295.090	
M&T BANK CORP	58	170.100	9,865.800	
FISERV INC	305	116.750	35,608.750	
FLIR SYSTEMS INC	103	53.170	5,476.510	
FORD MOTOR CO	2,306	9.230	21,284.380	
FRANKLIN RESOURCES INC	223	25.990	5,795.770	
FREEMONT-MCMORAN INC	730	12.870	9,395.100	
FLEX LTD	276	12.000	3,312.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	88	94.450	8,311.600	
GAP INC/THE	73	16.690	1,218.370	
DENTSPLY SIRONA INC	149	56.380	8,400.620	
GENERAL DYNAMICS CORP	135	179.030	24,169.050	
GENERAL MILLS INC	303	51.600	15,634.800	
GENUINE PARTS CO	98	105.160	10,305.680	



GILEAD SCIENCES INC	676	65.770	44,460.520	
GARTNER INC	58	157.670	9,144.860	
MCKESSON CORP	97	140.600	13,638.200	
NVIDIA CORP	315	223.990	70,556.850	
GENERAL ELECTRIC CO	4,663	11.340	52,878.420	
WW GRAINGER INC	22	332.310	7,310.820	
HALLIBURTON CO	509	23.990	12,210.910	
MONSTER BEVERAGE CORP	211	62.210	13,126.310	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	182	225.000	40,950.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	73	37.350	2,726.550	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	126	200.180	25,222.680	
HASBRO INC	81	103.920	8,417.520	
HENRY SCHEIN INC	101	68.490	6,917.490	
HERSHEY FOODS CORP	69	147.150	10,153.350	
HP INC	865	20.350	17,602.750	
F5 NETWORKS INC	32	139.250	4,456.000	
CROWN HOLDINGS INC NPR	97	71.740	6,958.780	
JUNIPER NETWORKS INC	253	24.130	6,104.890	
HOLLYFRONTIER CORP	107	50.190	5,370.330	
HOLOGIC INC	119	53.150	6,324.850	
UNUM GROUP	90	30.340	2,730.600	
HOME DEPOT INC	596	214.080	127,591.680	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	86	80.170	6,894.620	
HORMEL FOODS CORP	194	44.900	8,710.600	
CENTERPOINT ENERGY INC	339	25.940	8,793.660	
LENNOX INTERNATIONAL INC	15	255.390	3,830.850	
HUMANA INC	75	353.130	26,484.750	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	38	113.000	4,294.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	459	15.350	7,045.650	
BIOGEN INC	100	296.830	29,683.000	
IDEX CORP	47	167.370	7,866.390	
ILLINOIS TOOL WORKS	177	177.270	31,376.790	
INTUIT INC	147	259.640	38,167.080	
IDEXX LABORATORIES INC	42	252.900	10,621.800	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	83	63.050	5,233.150	
INGERSOLL-RAND PLC	141	133.810	18,867.210	
INTEL CORP	2,420	57.790	139,851.800	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	66	133.980	8,842.680	
INTERNATIONAL PAPER CO	184	46.360	8,530.240	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	144	23.030	3,316.320	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	94	90.030	8,462.820	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	49	145.860	7,147.140	
INCYTE CORP	91	91.510	8,327.410	
JOHNSON & JOHNSON	1,435	141.380	202,880.300	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	167	61.070	10,198.690	
KLA CORPORATION	93	171.240	15,925.320	
DEVON ENERGY CORP	232	23.480	5,447.360	
KELLOGG CO	134	66.250	8,877.500	
EAST WEST BANCORP INC	67	47.770	3,200.590	
KEYCORP	482	20.060	9,668.920	
KIMBERLY-CLARK CORP	178	135.940	24,197.320	
BLACKROCK INC/NEW YORK	62	498.610	30,913.820	
KOHL'S CORP	120	48.280	5,793.600	
KROGER CO	435	28.090	12,219.150	
LAM RESEARCH CORP	77	281.950	21,710.150	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	19	347.710	6,606.490	
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	111.040	3,886.400	
AKAMA I TECHNOLOGIES	85	84.690	7,198.650	
LEGGETT & PLATT INC	50	50.720	2,536.000	
LENNAR CORP	171	58.300	9,969.300	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	198	21.490	4,255.020	
ELI LILLY & CO	484	121.530	58,820.520	
LINCOLN NATIONAL CORP	119	59.730	7,107.870	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	379	118.620	44,956.980	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	159	83.710	13,309.890	
LOCKHEED MARTIN CORP	136	386.470	52,559.920	
LOEWS CORP	156	50.610	7,895.160	
LOWE'S COS INC	419	118.500	49,651.500	
DOMINION ENERGY INC	431	80.880	34,859.280	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	243	32.750	7,958.250	
MCCORMICK & CO INC	75	167.500	12,562.500	
MCDONALD'S CORPORATION	411	197.120	81,016.320	
S&P GLOBAL INC	137	271.200	37,154.400	
EVEREST RE GROUP LTD	19	274.670	5,218.730	
MANPOWERGROUP INC	35	96.670	3,383.450	
MARKEL CORPORATION	9	1,137.330	10,235.970	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	117	232.640	27,218.880	
MARSH & MCLENNAN COS	281	110.540	31,061.740	
MASCO CORP	187	47.010	8,790.870	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	39	276.300	10,775.700	
METLIFE INC	465	50.380	23,426.700	

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	165	59.590	9,832.350	
MEDTRONIC PLC	729	113.520	82,756.080	
ACTIVISION BLIZZARD INC	451	58.650	26,451.150	
CVS HEALTH CORP	701	73.590	51,586.590	
MERCK & CO. INC.	1,381	89.190	123,171.390	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	184	23.130	4,255.920	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	48	166.590	7,996.320	
MICROSOFT CORP	3,968	154.530	613,175.040	
MICRON TECH INC	607	51.200	31,078.400	
MIDDLEBY CORP	39	108.260	4,222.140	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	122	102.090	12,454.980	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	360	25.720	9,259.200	
3M CO	296	168.790	49,961.840	
MOHAWK INDUSTRIES INC	41	137.940	5,655.540	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	95	160.500	15,247.500	
KANSAS CITY SOUTHERN	60	151.440	9,086.400	
MYLAN NV	314	19.140	6,009.960	
ILLUMINA INC	79	324.720	25,652.880	
XCEL ENERGY INC	256	62.260	15,938.560	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	45	110.590	4,976.550	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	198	23.800	4,712.400	
NETAPP INC	121	63.240	7,652.040	
NEWELL BRANDS INC	259	19.210	4,975.390	
NEWMONT GOLDCORP CORP	434	41.290	17,919.860	
NVR INC	2	3,798.350	7,596.700	
NIKE INC-CL B	675	97.770	65,994.750	
NOBLE ENERGY INC	344	22.380	7,698.720	
NORDSTROM INC	35	38.380	1,343.300	
NORFOLK SOUTHERN CORP	141	190.070	26,799.870	
EVERSOURCE ENERGY	165	81.340	13,421.100	
NISOURCE INC	241	26.880	6,478.080	
TAPESTRY INC	151	25.940	3,916.940	
NORTHERN TRUST CORP	103	108.040	11,128.120	
NORTHROP GRUMMAN CORP	84	344.650	28,950.600	
WELLS FARGO & CO	2,280	53.790	122,641.200	
NUCOR CORP	203	56.470	11,463.410	
CHENIERE ENERGY INC	157	60.990	9,575.430	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	246	104.370	25,675.020	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	528	37.710	19,910.880	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	30	186.410	5,592.300	

OGE ENERGY CORP	108	43.310	4,677.480	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	42	441.350	18,536.700	
ORACLE CORP	1,265	54.510	68,955.150	
PACCAR INC	200	82.010	16,402.000	
PTC INC	57	74.630	4,253.910	
EXELON CORP	515	43.820	22,567.300	
PARKER HANNIFIN CORP	74	206.490	15,280.260	
PAYCHEX INC	161	85.080	13,697.880	
ALIGN TECHNOLOGY INC	43	266.060	11,440.580	
PPL CORPORATION	376	35.640	13,400.640	
PEPSICO INC	759	137.940	104,696.460	
PENTAIR PLC	39	45.850	1,788.150	
PFIZER INC	2,991	38.330	114,645.030	
AQUA AMERICA INC	111	45.020	4,997.220	
CONOCOPHILLIPS	605	62.700	37,933.500	
PVH CORP	34	104.410	3,549.940	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	84	139.990	11,759.160	
ALTRIA GROUP INC	1,062	50.160	53,269.920	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	247	158.640	39,184.080	
BROWN & BROWN INC	112	38.860	4,352.320	
POLARIS INC	30	98.860	2,965.800	
GARMIN LTD	58	97.430	5,650.940	
PPG INDUSTRIES INC	115	133.010	15,296.150	
COSTCO WHOLESALE CORP	240	291.870	70,048.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	124	123.220	15,279.280	
QUEST DIAGNOSTICS	46	105.200	4,839.200	
PROCTER & GAMBLE CO	1,365	125.470	171,266.550	
PROGRESSIVE CORP	323	72.170	23,310.910	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	263	58.550	15,398.650	
PULTE GROUP INC	158	40.380	6,380.040	
GLOBAL PAYMENTS INC	172	178.930	30,775.960	
QUALCOMM INC	659	87.830	57,879.970	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	54	90.880	4,907.520	
EXACT SCIENCES CORP	90	87.200	7,848.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	24	194.800	4,675.200	
REGENERON PHARMACEUTICALS	41	376.420	15,433.220	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	44	164.680	7,245.920	
RESMED INC	70	153.630	10,754.100	
US BANCORP	799	60.270	48,155.730	
SEATTLE GENETICS INC /WA	78	113.870	8,881.860	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	245	41.750	10,228.750	
ROSS STORES INC	202	115.490	23,328.980	

ROLLINS INC	113	32.950	3,723.350	
ROPER TECHNOLOGIES INC	52	350.500	18,226.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	67	203.470	13,632.490	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	93	125.640	11,684.520	
RPM INTERNATIONAL INC	63	75.100	4,731.300	
RAYTHEON COMPANY	156	217.400	33,914.400	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	34	110.050	3,741.700	
ACCENTURE PLC-CL A	347	206.660	71,711.020	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	761	53.240	40,515.640	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	67	200.040	13,402.680	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	137	135.660	18,585.420	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	344	138.190	47,537.360	
BOOKING HOLDINGS INC	24	1,973.600	47,366.400	
SCHLUMBERGER LTD	744	39.000	29,016.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	661	49.950	33,016.950	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	110	148.070	16,287.700	
BUNGE LTD	83	55.770	4,628.910	
SEI INVESTMENTS CO	96	65.800	6,316.800	
ANTHEM INC	146	284.120	41,481.520	
AMERISOURCEBERGEN CORP	89	84.850	7,551.650	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	167	54.290	9,066.430	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	43	572.230	24,605.890	
CENTENE CORP	252	57.710	14,542.920	
SVB FINANCIAL GROUP	36	249.310	8,975.160	
IAC INTERACTIVE CORP	39	224.640	8,760.960	
SMITH (A.O.) CORP	63	46.520	2,930.760	
ACUITY BRANDS INC	19	130.800	2,485.200	
SNAP-ON INC	10	170.380	1,703.800	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	214	94.140	20,145.960	
ADVANCE AUTO PARTS	42	155.210	6,518.820	
EDISON INTERNATIONAL	187	72.690	13,593.030	
SOUTHERN CO	580	60.760	35,240.800	
TRUIST FINANCIAL CORP	744	56.020	41,678.880	
SOUTHWEST AIRLINES	68	54.150	3,682.200	
AT&T INC	3,981	38.260	152,313.060	
CHEVRON CORP	1,033	117.960	121,852.680	
STANLEY BLACK & DECKER INC	77	164.540	12,669.580	
STATE STREET CORP	214	79.130	16,933.820	
STARBUCKS CORP	646	88.670	57,280.820	
STEEL DYNAMICS INC	170	34.680	5,895.600	
STRYKER CORP	190	202.930	38,556.700	

NETFLIX INC	238	298.500	71,043.000	
NORTONLIFELOCK INC	316	26.000	8,216.000	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	109	37.400	4,076.600	
SYNOPSYS INC	72	136.700	9,842.400	
SYSCO CORP	277	83.540	23,140.580	
INTUITIVE SURGICAL INC	66	579.650	38,256.900	
TELEFLEX INC	22	359.880	7,917.360	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	728	9.640	7,017.920	
TERADYNE INC	80	66.690	5,335.200	
TEXAS INSTRUMENTS INC	508	126.640	64,333.120	
TEXTRON INC	91	43.450	3,953.950	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	217	320.500	69,548.500	
TIFFANY & CO	49	133.700	6,551.300	
GLOBE LIFE INC	55	105.620	5,809.100	
DAVITA INC	48	72.710	3,490.080	
TRACTOR SUPPLY CO	81	94.930	7,689.330	
TRIMBLE INC	102	40.350	4,115.700	
TYLER TECHNOLOGIES INC	19	284.700	5,409.300	
TYSON FOODS INC	147	87.970	12,931.590	
UGI CORP	31	43.960	1,362.760	
MARATHON OIL CORP	481	12.720	6,118.320	
UNION PACIFIC CORP	383	177.030	67,802.490	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	444	149.070	66,187.080	
UNITEDHEALTH GROUP INC	515	285.480	147,022.200	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	37	144.340	5,340.580	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	54	141.530	7,642.620	
VF CORP	173	93.150	16,114.950	
VIACOMCBS INC	371	38.640	14,335.440	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	137	218.980	30,000.260	
VULCAN MATERIALS CO	67	143.000	9,581.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	417	57.880	24,135.960	
WALMART INC	780	120.290	93,826.200	
WASTE MANAGEMENT INC	232	112.020	25,988.640	
WATERS CORP	31	234.110	7,257.410	
ALLERGAN PLC	183	188.340	34,466.220	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	38	146.370	5,562.060	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	62	101.510	6,293.620	
VAIL RESORTS INC	26	242.890	6,315.140	
WESTERN DIGITAL CORP	197	54.300	10,697.100	
WABTEC CORP	118	75.160	8,868.880	

WHIRLPOOL CORP	46	148.420	6,827.320	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	92	111.860	10,291.120	
WYNN RESORTS LTD	67	129.780	8,695.260	
NASDAQ INC	53	104.480	5,537.440	
CME GROUP INC	192	204.590	39,281.280	
WILLIAMS COS INC	701	22.710	15,919.710	
LKQ CORP	82	36.110	2,961.020	
ALLIANT ENERGY CORP	133	52.925	7,039.020	
WEC ENERGY GROUP INC	190	89.180	16,944.200	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	121	52.060	6,299.260	
CARMAX INC	98	97.880	9,592.240	
XILINX INC	133	96.230	12,798.590	
TJX COMPANIES INC	687	60.370	41,474.190	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	37	257.800	9,538.600	
ZIONS BANCORP NA	133	51.150	6,802.950	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	643	5.540	3,562.220	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	400	54.000	21,600.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	500	31.080	15,540.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	79	117.740	9,301.460	
SIGNATURE BANK	19	134.990	2,564.810	
CBRE GROUP INC	156	58.260	9,088.560	
LIBERTY GLOBAL PLC	143	22.030	3,150.290	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	33	312.490	10,312.170	
REGIONS FINANCIAL CORP	656	17.170	11,263.520	
DOMINO'S PIZZA INC	28	294.930	8,258.040	
T-MOBILE US INC	174	75.470	13,131.780	
LAS VEGAS SANDS CORP	222	69.040	15,326.880	
MOSAIC CO/THE	166	18.630	3,092.580	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	26	373.890	9,721.140	
CELANESE CORP	56	124.470	6,970.320	
DEXCOM INC	49	203.830	9,987.670	
DISCOVERY INC-A	95	32.340	3,072.300	
EXPEDIA GROUP INC	62	112.760	6,991.120	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	129	45.140	5,823.060	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	58	167.440	9,711.520	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	224	21.050	4,715.200	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	313	91.910	28,767.830	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	167	19.530	3,261.510	
LIVE NATION	97	64.340	6,240.980	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	16	815.320	13,045.120	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	38	87.580	3,328.040	
TRANSDIGM GROUP INC	27	575.810	15,546.870	
MASTERCARD INC	490	296.090	145,084.100	
HANESBRANDS INC	186	14.400	2,678.400	
WESTERN UNION CO	240	27.230	6,535.200	
OWENS CORNING	51	64.580	3,293.580	
LEIDOS HOLDINGS INC	61	91.840	5,602.240	
AERCAP HOLDINGS NV	77	61.910	4,767.070	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	76	80.140	6,090.640	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	126	23.580	2,971.080	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	52	119.720	6,225.440	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	317	16.650	5,278.050	
DELTA AIR LINES INC	118	56.730	6,694.140	
INSULET CORP	31	175.650	5,445.150	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	95	33.380	3,171.100	
DISCOVER FINANCIAL	186	86.680	16,122.480	
TE CONNECTIVITY LTD	196	94.000	18,424.000	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	120	78.750	9,450.000	
WABCO HOLDING INC	22	135.340	2,977.480	
LULULEMON ATHLETICA INC	59	223.550	13,189.450	
VMWARE INC	55	151.300	8,321.500	
MERCADOLIBRE INC	24	567.670	13,624.080	
ULTA BEAUTY INC	33	253.500	8,365.500	
INVESCO LTD	193	17.620	3,400.660	
MSCI INC	43	260.090	11,183.870	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	839	84.670	71,038.130	
VISA INC	940	185.140	174,031.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	108	119.200	12,873.600	
DISCOVERY INC-C	176	30.060	5,290.560	
MARATHON PETROLEUM CORP	393	58.610	23,033.730	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	57	65.090	3,710.130	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,069	20.200	21,593.800	
XYLEM INC	114	77.720	8,860.080	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	153	92.620	14,170.860	



HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	22	251.240	5,527.280	
SPLUNK INC	77	143.510	11,050.270	
EPAM SYSTEMS INC	38	210.020	7,980.760	
HCA HEALTHCARE INC	161	142.860	23,000.460	
VERISK ANALYTICS INC	78	149.190	11,636.820	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	32	147.880	4,732.160	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	44	304.720	13,407.680	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	84	114.880	9,649.920	
NXP SEMICONDUCTOR NV	149	123.880	18,458.120	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	62	70.560	4,374.720	
TARGA RESOURCES CORP	133	37.110	4,935.630	
LEAR CORP	45	129.350	5,820.750	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	73	115.500	8,431.500	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	132	59.050	7,794.600	
DOLLAR GENERAL CORP	142	154.630	21,957.460	
FORTINET INC	100	105.640	10,564.000	
AON PLC	124	206.150	25,562.600	
TESLA INC	71	358.390	25,445.690	
GENERAL MOTORS CO	672	35.650	23,956.800	
XPO LOGISTICS INC	59	83.310	4,915.290	
TRIPADVISOR INC	93	29.250	2,720.250	
ALLY FINANCIAL INC	256	31.460	8,053.760	
CAPRI HOLDINGS LTD	126	38.780	4,886.280	
VOYA FINANCIAL INC	76	57.920	4,401.920	
APTIV PLC	128	93.550	11,974.400	
PHILLIPS 66	232	112.990	26,213.680	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	42	104.730	4,398.660	
FACEBOOK INC	1,314	194.110	255,060.540	
IQVIA HOLDINGS INC	84	144.850	12,167.400	
DIAMONDBACK ENERGY INC	61	85.090	5,190.490	
SERVICENOW INC	107	272.980	29,208.860	
PALO ALTO NETWORKS INC	49	226.990	11,122.510	
WORKDAY INC	94	159.460	14,989.240	
ABBVIE INC	802	87.840	70,447.680	
ZOETIS INC	261	124.450	32,481.450	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	139	55.780	7,753.420	
COTY INC	89	11.080	986.120	
NEWS CORP/NEW-CL A	308	13.590	4,185.720	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	114	40.220	4,585.080	
CDW CORP	88	137.770	12,123.760	
SPRINT CORP	465	5.210	2,422.650	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	104	27.480	2,857.920	

ARCONIC INC	266	31.650	8,418.900	
TWILIO INC	67	97.980	6,564.660	
SNAP INC	476	15.090	7,182.840	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	90	43.850	3,946.500	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	78	47.590	3,712.020	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	47	47.110	2,214.170	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	57	17.780	1,013.460	
OKTA INC	72	116.690	8,401.680	
BLACK KNIGHT INC	68	63.140	4,293.520	
BAKER HUGHES CO	430	23.640	10,165.200	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	97	84.100	8,157.700	
TECHNIPFMC LTD	262	20.000	5,240.000	
BROADCOM INC	217	315.420	68,446.140	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	36	163.750	5,895.000	
MONGODB INC	20	128.410	2,568.200	
BURLINGTON STORES INC	32	225.900	7,228.800	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	205	27.780	5,694.900	
VEEVA SYSTEMS INC	84	146.100	12,272.400	
TWITTER INC	378	30.390	11,487.420	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	49	51.980	2,547.020	
EVERGY INC	123	62.760	7,719.480	
ALLEGION PLC	66	123.010	8,118.660	
STERIS PLC	37	151.930	5,621.410	
DOCUSIGN INC	53	73.720	3,907.160	
WIX.COM LTD	27	119.080	3,215.160	
KKR & CO INC	332	29.150	9,677.800	
PERRIGO CO PLC	98	53.930	5,285.140	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	138	107.200	14,793.600	
ARAMARK	171	43.780	7,486.380	
CIGNA CORP	200	189.870	37,974.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	106	49.350	5,231.100	
DOW INC	392	53.280	20,885.760	
AMCOR PLC	795	10.560	8,395.200	
XEROX HOLDINGS CORP	123	36.840	4,531.320	
FOX CORP-A	247	36.770	9,082.190	
CORTEVA INC	367	26.490	9,721.830	
BLACKSTONE GROUP INC	362	53.630	19,414.060	
PAYCOM SOFTWARE INC	34	256.990	8,737.660	
SABRE CORP	215	22.525	4,842.870	
ARISTA NETWORKS INC	37	192.920	7,138.040	
IHS MARKIT LTD	198	74.600	14,770.800	
FNF GROUP	127	47.060	5,976.620	
SYNCHRONY FINANCIAL	280	37.690	10,553.200	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	285	40.120	11,434.200	
CDK GLOBAL INC	73	54.960	4,012.080	

	WAYFAIR INC	50	89.930	4,496.500	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	95	107.810	10,241.950	
	QORVO INC	57	113.410	6,464.370	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	175	34.250	5,993.750	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	57	121.890	6,947.730	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	124	30.240	3,749.760	
	GODADDY INC	101	67.250	6,792.250	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	269	19.950	5,366.550	
	TRANSUNION	90	85.400	7,686.000	
	SQUARE INC	219	64.800	14,191.200	
	DUPONT DE NEMOURS INC	386	64.800	25,012.800	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	147	50.040	7,355.880	
	WESTROCK CO	165	40.890	6,746.850	
	KRAFT HEINZ CO	335	31.600	10,586.000	
	FORTIVE CORP	176	75.190	13,233.440	
	WASTE CONNECTIONS INC	156	89.670	13,988.520	
	ALPHABET INC-CL A	163	1,346.870	219,539.810	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	762	16.030	12,214.860	
	PAYPAL HOLDINGS INC	599	107.650	64,482.350	
	AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	196	24.640	4,829.440	
	DXC TECHNOLOGY CO	156	37.520	5,853.120	
	ZILLOW GROUP INC-C	110	42.270	4,649.700	
	ALPHABET INC-CL C	171	1,347.830	230,478.930	
	BEIGENE LTD ADR	18	176.030	3,168.540	
	LINDE PLC	293	209.050	61,251.650	
	ATHENE HOLDING LTD	44	45.320	1,994.080	
	ROKU INC	57	132.490	7,551.930	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	88	475.270	41,823.760	
	VISTRA ENERGY CORP	259	23.710	6,140.890	
アメリカ・ドル	小計	165,310		14,777,869.000 (1,617,142,204)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	144	9.290	1,337.760	
	ASHTED GROUP	207	23.130	4,787.910	
	SEVERN TRENT PLC	102	24.200	2,468.400	
	BHP GROUP PLC	1,254	17.382	21,797.020	
	BARCLAYS PLC	10,152	1.824	18,517.240	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	747	7.650	5,714.550	
	BT GROUP PLC	4,143	2.016	8,352.280	
	BUNZL PLC	215	20.610	4,431.150	
	EASYJET PLC	32	14.700	470.400	
	AVIVA PLC	2,210	4.158	9,189.180	

CRODA INTERNATIONAL	44	48.760	2,145.440	
DIAGEO PLC	1,320	30.510	40,273.200	
SCHRODERS PLC	92	33.600	3,091.200	
DCC PLC	61	64.700	3,946.700	
NATIONAL GRID PLC	1,936	9.281	17,968.010	
KINGFISHER PLC	1,322	2.219	2,933.510	
BAE SYSTEMS PLC	1,757	5.746	10,095.720	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,305	30.390	39,658.950	
HALMA PLC	221	20.740	4,583.540	
NEXT PLC	64	71.900	4,601.600	
IMPERIAL BRANDS PLC	540	17.652	9,532.080	
JOHNSON MATTHEY PLC	113	28.810	3,255.530	
ANGLO AMERICAN PLC	611	21.340	13,038.740	
COMPASS GROUP PLC	903	18.385	16,601.650	
HSBC HOLDINGS PLC	10,985	5.746	63,119.810	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,930	3.053	8,945.290	
CENTRICA PLC	4,673	0.878	4,102.890	
UNILEVER PLC	578	45.450	26,270.100	
MEGGITT PLC	609	6.570	4,001.130	
MORRISON SUPERMARKETS	706	1.958	1,382.340	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	449	9.058	4,067.040	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	651	5.702	3,712.000	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	236	25.990	6,133.640	
PEARSON PLC	598	6.600	3,946.800	
PERSIMMON PLC	154	28.160	4,336.640	
PRUDENTIAL PLC	1,343	13.880	18,640.840	
RIO TINTO PLC	623	43.205	26,916.710	
VODAFONE GROUP PLC	14,979	1.462	21,899.290	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	398	60.370	24,027.260	
RELX PLC	1,008	18.045	18,189.360	
RENTOKIL INITIAL PLC	905	4.265	3,859.820	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,147	6.864	7,873.000	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,163	2.518	7,964.430	
ST JAMES'S PLACE PLC	363	11.485	4,169.050	
SSE PLC	507	14.155	7,176.580	
BP PLC	11,196	4.624	51,770.300	
SAGE GROUP PLC(THE)	773	7.324	5,661.450	
SMITHS GROUP PLC	175	16.195	2,834.120	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	86.000	2,494.000	
STANDARD CHARTERED PLC	1,716	7.048	12,094.360	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	36,894	0.643	23,722.840	

TAYLOR WIMPLEY PLC	1,666	1.996	3,325.330	
TESCO PLC	5,083	2.513	12,773.570	
3I GROUP PLC	608	10.715	6,514.720	
SMITH & NEPHEW PLC	468	17.345	8,117.460	
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,775	17.250	47,868.750	
WEIR GROUP	158	15.215	2,403.970	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	175	71.720	12,551.000	
WPP PLC	622	10.230	6,363.060	
ASTRAZENECA PLC	705	72.170	50,879.850	
WHITBREAD PLC	54	49.610	2,678.940	
CARNIVAL PLC	110	33.120	3,643.200	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	98	2.236	219.120	
INTERTEK GROUP PLC	85	55.100	4,683.500	
BURBERRY GROUP PLC	184	21.200	3,900.800	
INTERCONTINENTAL HOTELS	84	48.900	4,107.600	
ITV PLC	1,336	1.526	2,038.730	
SAINSBURY (J) PLC	1,073	2.232	2,394.930	
G4S PLC	528	2.159	1,139.950	
ADMIRAL GROUP PLC	112	22.020	2,466.240	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	69	51.420	3,547.980	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,413	21.525	51,939.820	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,000	21.355	42,710.000	
TUI AG-DI	220	9.744	2,143.680	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,109	3.150	3,493.350	
EXPERIAN PLC	506	24.470	12,381.820	
MONDI PLC	236	16.965	4,003.740	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	222	19.530	4,335.660	
OCADO GROUP PLC	339	12.395	4,201.900	
INFORMA PLC	667	8.050	5,369.350	
GLENCORE PLC	6,429	2.258	14,516.680	
GVC HOLDINGS PLC	288	8.692	2,503.290	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	372	3.136	1,166.590	
COCA-COLA HBC AG	157	24.780	3,890.460	
FERGUSON PLC	115	66.520	7,649.800	
M&G PLC	1,649	2.440	4,023.560	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	57,822	0.001	57.820	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	123	10.526	1,294.690	
AUTO TRADER GROUP PLC	571	5.738	3,276.390	
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,954	2.343	6,921.220	
イギリス・ボンド 小計	221,468		975,601.370	

(142,564,628)

イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	682	27.500	18,755.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	760	24.600	18,696.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	8	570.000	4,560.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	577	15.330	8,845.410	
	NICE LTD	26	540.000	14,040.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	85	94.560	8,037.600	
	AZRIELI GROUP	35	271.800	9,513.000	
イスラエル・シュケル 小計		2,173		82,447.010 (2,588,836)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	99	71.540	7,082.460	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,479	24.710	36,546.090	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,822	24.480	44,602.560	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	746	10.720	7,997.120	
	TELSTRA CORP LTD	2,169	3.670	7,960.230	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	452	9.870	4,461.240	
	ASX LTD	95	79.850	7,585.750	
	BHP GROUP LTD	1,711	39.350	67,327.850	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	181	34.090	6,170.290	
	COMPUTERSHARE LT	212	17.280	3,663.360	
	CSL LIMITED	255	278.120	70,920.600	
	REA GROUP LTD	34	106.020	3,604.680	
	TRANSURBAN GROUP	1,357	15.150	20,558.550	
	COCHLEAR LTD	40	225.100	9,004.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	776	8.700	6,751.200	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	986	80.060	78,939.160	
	BORAL LIMITED	694	4.500	3,123.000	
	RIO TINTO LIMITED	240	100.600	24,144.000	
	APA GROUP	787	10.820	8,515.340	
	ARISTOCRAT LEISU	397	34.190	13,573.430	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,593	7.980	12,712.140	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	73	44.040	3,214.920	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	307	27.860	8,553.020	
	ORICA LTD	272	22.810	6,204.320	
	CIMIC GROUP LTD	36	34.320	1,235.520	
	LEND LEASE CORP LTD	426	18.940	8,068.440	
BLUESCOPE STEEL LTD	342	15.210	5,201.820		
SYDNEY AIRPORT	525	8.750	4,593.750		
MACQUARIE GROUP LTD	188	136.310	25,626.280		

	SUNCORP GROUP LTD	547	13.190	7,214.930	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,619	25.150	40,717.850	
	NEWCREST MINING LTD	458	28.050	12,846.900	
	OIL SEARCH LTD	865	7.350	6,357.750	
	INCITEC PIVOT LTD	1,139	3.150	3,587.850	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	814	12.970	10,557.580	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	543	8.200	4,452.600	
	SANTOS LTD	714	8.250	5,890.500	
	SONIC HEALTHCARE	211	28.930	6,104.230	
	TABCORP HOLDINGS LTD	899	4.710	4,234.290	
	WESFARMERS LTD	584	40.950	23,914.800	
	ALUMINA LIMITED	1,597	2.380	3,800.860	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	439	34.630	15,202.570	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	707	37.420	26,455.940	
	SEEK LTD	158	22.160	3,501.280	
	AUSNET SERVICES	648	1.695	1,098.360	
	AGL ENERGY LTD	269	20.610	5,544.090	
	BRAMBLES LTD	1,036	12.070	12,504.520	
	CROWN RESORTS LTD	251	12.220	3,067.220	
	AURIZON HOLDINGS LTD	934	5.450	5,090.300	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	433	16.890	7,313.370	
	MEDIBANK PVT LTD	1,627	3.270	5,320.290	
	SOUTH32 LTD(AUD)	3,598	2.880	10,362.240	
	COLES GROUP LTD	541	15.090	8,163.690	
	オーストラリア・ドル 小計	38,925		741,245.130 (55,793,521)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	112	80.640	9,031.680	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	470	42.680	20,059.600	
	BARRICK GOLD CORP	920	23.240	21,380.800	
	ATCO LTD	31	50.370	1,561.470	
	BANK OF MONTREAL	366	101.470	37,138.020	
	BANK OF NOVA SCOTIA	667	73.820	49,237.940	
	NATIONAL BANK OF CANADA	213	72.200	15,378.600	
	BCE INC	104	62.690	6,519.760	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	476	75.700	36,033.200	
	BAUSCH HEALTH COS INC	143	40.890	5,847.270	
	SAPUTO INC	180	39.980	7,196.400	
	BLACKBERRY LTD	522	7.470	3,899.340	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	248	18.590	4,610.320	
	CGI INC	132	109.440	14,446.080	
	CCL INDUSTRIES INC	117	57.080	6,678.360	
	CAE INC	204	34.250	6,987.000	

CAMECO CORP	363	12.030	4,366.890	
ROGERS COMM-CL B	222	63.910	14,188.020	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	252	109.430	27,576.360	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	639	40.080	25,611.120	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	46	142.960	6,576.160	
CANADIAN UTILITIES LTD	69	39.770	2,744.130	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	419	118.720	49,743.680	
FIRST CAPITAL REALTY INC	175	20.990	3,673.250	
OPEN TEXT CORP	158	56.910	8,991.780	
EMPIRE CO LTD	111	30.480	3,383.280	
KINROSS GOLD CORP	923	5.710	5,270.330	
FORTIS INC	270	53.840	14,536.800	
TELUS CORP	44	49.930	2,196.920	
GREAT WEST LIFECO INC	46	33.620	1,546.520	
IMPERIAL OIL LTD	76	33.360	2,535.360	
ENBRIDGE INC	1,099	50.570	55,576.430	
IGM FINANCIAL INC	35	38.210	1,337.350	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,161	25.400	29,489.400	
LOBLAW CO LTD	121	69.250	8,379.250	
MAGNA INTERNATIONAL INC	184	72.410	13,323.440	
SUN LIFE FINANCIAL INC	328	58.760	19,273.280	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	593.650	7,123.800	
METRO INC	170	55.420	9,421.400	
HUSKY ENERGY INC	59	9.930	585.870	
EMERA INC	100	54.910	5,491.000	
METHANEX CORP	50	50.330	2,516.500	
ONEX CORP	45	80.220	3,609.900	
POWER CORP OF CANADA	83	34.420	2,856.860	
POWER FINANCIAL CORP	114	36.020	4,106.280	
ROYAL BANK OF CANADA	842	104.840	88,275.280	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	72	331.380	23,859.360	
SHAW COMM INC-B	192	26.650	5,116.800	
SUNCOR ENERGY INC	834	41.900	34,944.600	
ENCANA CORP	501	5.560	2,785.560	
TECK RESOURCES LTD-CL B	339	22.210	7,529.190	
THOMSON REUTERS CORP	136	95.230	12,951.280	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,010	74.310	75,053.100	
TC ENERGY CORP	491	67.220	33,005.020	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9	54.050	486.450	
WESTON (GEORGE) LTD	36	105.540	3,799.440	
INTACT FINANCIAL CORP	66	136.790	9,028.140	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	210	37.210	7,814.100	



	CONSTELLATION SOFTWARE INC	10	1,266.870	12,668.700	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	94	129.900	12,210.600	
	CI FINANCIAL CORP	68	21.610	1,469.480	
	KEYERA CORP	168	33.610	5,646.480	
	ALTAGAS LTD	245	18.780	4,601.100	
	PEMBINA PIPELINE CORP	284	47.120	13,382.080	
	DOLLARAMA INC	213	44.910	9,565.830	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	748	12.760	9,544.480	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	144	56.640	8,156.160	
	INTER PIPELINE LTD	188	22.460	4,222.480	
	NUTRIEN LTD	339	62.810	21,292.590	
	WSP GLOBAL INC	50	88.030	4,401.500	
	IA FINANCIAL CORP INC	57	68.930	3,929.010	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	243	14.650	3,559.950	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	162	87.840	14,230.080	
	SHOPIFY INC	58	508.430	29,488.940	
	CANOPY GROWTH CORP	161	27.280	4,392.080	
	HYDRO ONE LTD	236	25.730	6,072.280	
カナダ・ドル 小計		20,485		1,055,519.340 (87,650,326)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	1,200	4.000	4,800.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,100	25.820	28,402.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	500	10.700	5,350.000	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	500	5.110	2,555.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	700	9.030	6,321.000	
	CAPITALAND LTD	1,000	3.680	3,680.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	5,300	0.930	4,929.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	1,600	2.410	3,856.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,800	10.970	19,746.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,300	3.390	14,577.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	500	9.130	4,565.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	700	26.370	18,459.000	
	UOL GROUP LIMITED	300	8.050	2,415.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,600	4.190	6,704.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	3,169	1.130	3,580.970	
シンガポール・ドル 小計		24,269		129,939.970 (10,500,449)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	1,325	13.120	17,384.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	1,612	102.940	165,939.280	
	CIE FINANC RICHEMONT	289	75.300	21,761.700	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	380	300.550	114,209.000	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	29	251.500	7,293.500	
	SIKA INHABER	72	178.000	12,816.000	
	SGS SA-REG	3	2,602.000	7,806.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	1,158	91.210	105,621.180	
	BALOISE HOLDING AG -R	32	174.100	5,571.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	2	2,054.000	4,108.000	
	SWISSCOM AG-REG	15	517.600	7,764.000	
	ABB LTD	1,063	23.270	24,736.010	
	ADECCO GROUP AG-REG	74	61.620	4,559.880	
	GEBERIT AG	24	539.800	12,955.200	
	LONZA GROUP AG-REG	38	335.600	12,752.800	
	GIVAUDAN-REG	5	2,900.000	14,500.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	80	394.100	31,528.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	310	52.480	16,268.800	
	TEMENOS GROUP	41	152.000	6,232.000	
	SONOVA HOLDING AG	34	214.700	7,299.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	27	163.900	4,425.300	
	STRAUMANN HOLDING AG	7	934.200	6,539.400	
	THE SWATCH GROUP AG-B	22	276.900	6,091.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	52.300	523.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	17	488.400	8,302.800	
	VIFOR PHARMA AG	32	173.900	5,564.800	
	EMS-CHEMIE HOLDING	5	626.000	3,130.000	
	SWISS PRIME SITE AG	57	106.700	6,081.900	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	37	80.500	2,978.500	
	DUFREY GROUP	6	96.000	576.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	9	861.400	7,752.600	
	JULIUS BAER GROUP LTD	153	48.310	7,391.430	
	SWISS RE LTD	165	107.850	17,795.250	
	ALCON INC	218	54.840	11,955.120	
	UBS GROUP AG	1,963	12.070	23,693.410	
スイス・フラン	小計	9,314		713,907.660 (79,379,393)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	371	377.200	139,941.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	264	328.400	86,697.600	
	ERICSSON LM-B SHS	1,506	85.040	128,070.240	
	LUNDBERGS B	37	396.200	14,659.400	
	SKF AB-B SHS	111	194.650	21,606.150	
	SANDVIK AB	588	187.000	109,956.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	714	88.240	63,003.360	
	SKANSKA AB-B SHS	112	211.500	23,688.000	
	SWEDBANK AB	601	129.050	77,559.050	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	686	101.000	69,286.000	

	VOLVO AB-B SHS	841	148.150	124,594.150	
	SWEDISH MATCH AB	112	459.000	51,408.000	
	TELE2 AB-B SHS	310	137.050	42,485.500	
	INDUSTRIVARDEN C	117	221.600	25,927.200	
	ELECTROLUX AB-SER B	178	250.800	44,642.400	
	SECURITAS AB-B SHS	237	161.500	38,275.500	
	INVESTOR AB-B SHS	275	513.200	141,130.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	524	190.620	99,884.880	
	ASSA ABLOY AB-B	550	220.000	121,000.000	
	TELIA CO AB	1,380	40.540	55,945.200	
	LUNDIN PETROLEUM AB	145	304.100	44,094.500	
	BOLIDEN AB	92	250.400	23,036.800	
	ALFA LAVAL AB	160	233.200	37,312.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	65	431.000	28,015.000	
	ICA GRUPPEN AB	38	418.000	15,884.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	400	76.680	30,672.000	
	HEXAGON AB	174	575.000	100,050.000	
	EPIROC AB-A	495	115.200	57,024.000	
	EPIROC AB-B	60	111.750	6,705.000	
	ESSITY AB-B	337	291.500	98,235.500	
	NORDEA BANK ABP	1,844	71.790	132,380.760	
	スウェーデン・クローナ 小計	13,324		2,053,169.390 (23,939,955)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	58	962.400	55,819.200	
	A P MOLLER A/S	5	10,060.000	50,300.000	
	DANSKE BANK A/S	314	104.000	32,656.000	
	GENMAB A/S	40	1,469.000	58,760.000	
	NOVOZYMES-B SHS	152	326.000	49,552.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	994	383.000	380,702.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	102	681.000	69,462.000	
	COLOPLAST-B	70	773.400	54,138.000	
	DSV PANALPINA A S	108	757.200	81,777.600	
	DEMANT A/S	78	211.000	16,458.000	
	H LUNDBECK A/S	15	261.500	3,922.500	
	TRYG A/S	44	194.400	8,553.600	
	PANDORA A/S	66	275.200	18,163.200	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	78	523.000	40,794.000	
	ORSTED A/S	120	653.800	78,456.000	
	デンマーク・クローネ 小計	2,244		999,514.100 (16,282,085)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	693	8.750	6,063.750	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	101	15.900	1,605.900	
	A2 MILK CO LTD	367	15.340	5,629.780	
	FISHER & PAYKEL	303	21.560	6,532.680	
	FLETCHER BUILDING LTD	904	5.250	4,746.000	

	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,218	4.290	5,225.220	
	MERIDIAN ENERGY LTD	824	4.995	4,115.880	
ニュージーランド・ドル 小計		4,410		33,919.210 (2,447,949)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	309	228.600	70,637.400	
	DNB ASA	511	157.550	80,508.050	
	TELENOR ASA	438	160.050	70,101.900	
	ORKLA ASA	375	88.080	33,030.000	
	EQUINOR ASA	454	169.800	77,089.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	135	357.500	48,262.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	181	184.150	33,331.150	
	SCHIBSTED ASA	58	243.600	14,128.800	
ノルウェー・クローネ 小計		2,461		427,089.000 (5,172,048)	
ユーロ	CRH PLC	436	35.720	15,573.920	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	58	106.100	6,153.800	
	KERRY GROUP PLC-A	85	112.900	9,596.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	114	53.400	6,087.600	
	UMICORE	144	42.580	6,131.520	
	AIR LIQUIDE	251	123.750	31,061.250	
	AIRBUS SE	314	125.900	39,532.600	
	AXA	1,141	24.780	28,273.980	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	286	23.310	6,666.660	
	ADIDAS AG	96	278.600	26,745.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	622	18.340	11,407.480	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.000	0.000	
	DANONE	354	73.380	25,976.520	
	SAFRAN SA	177	144.750	25,620.750	
	INTESA SANPAOLO	8,104	2.328	18,866.110	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	191	75.870	14,491.170	
	ACCOR SA	56	40.790	2,284.240	
	BOUYGUES	81	38.220	3,095.820	
	BNP PARIBAS	604	52.050	31,438.200	
	THALES SA	76	86.260	6,555.760	
	CAPGEMINI SA	77	104.950	8,081.150	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	27	41.970	1,133.190	
	INGENICO GROUP	42	94.000	3,948.000	
	UNICREDIT SPA	989	13.086	12,942.050	
	NATIXIS	818	3.900	3,190.200	
	KONINKLIJKE DSM NV	90	114.850	10,336.500	
	COMMERZBANK AG	534	5.473	2,922.580	
	EIFFAGE	44	100.900	4,439.600	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	213	50.810	10,822.530	
	UNITED INTERNET	85	29.380	2,497.300	

FUCHS PETROLUB SE PEF	21	42.920	901.320	
PUBLICIS GROUPE	98	40.060	3,925.880	
IBERDROLA SA	3,265	8.998	29,378.470	
ENI SPA	1,442	13.604	19,616.960	
JERONIMO MARTINS	220	14.865	3,270.300	
KBC GROUPE	138	66.640	9,196.320	
HANNOVER RUECK SE	43	171.700	7,383.100	
WARTSILA OYJ	111	9.630	1,068.930	
L'OREAL	142	256.300	36,394.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	151	403.800	60,973.800	
GEA GROUP AG	105	29.540	3,101.700	
BOLLORE	503	3.932	1,977.790	
MEDIOBANCA SPA	225	9.934	2,235.150	
MICHELIN(CGDE) -B	111	111.150	12,337.650	
CONTINENTAL AG	74	119.140	8,816.360	
DEUTSCHE POST AG-REG	526	34.620	18,210.120	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	225	15.215	3,423.370	
NOKIAN RENKAAT OYJ	73	24.820	1,811.860	
OMV AG	89	50.060	4,455.340	
PERNOD-RICARD	111	161.000	17,871.000	
PEUGEOT SA	384	21.890	8,405.760	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	92	68.880	6,336.960	
RENAULT SA	94	42.460	3,991.240	
REPSOL SA	697	14.325	9,984.520	
REMY COINTREAU	12	113.000	1,356.000	
MERCK KGAA	64	102.700	6,572.800	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	238	38.070	9,060.660	
RWE AG	364	25.970	9,453.080	
SEB SA	14	135.800	1,901.200	
SOCIETE GENERALE-A	436	30.295	13,208.620	
VINCI S.A.	269	98.260	26,431.940	
SODEXO	22	104.950	2,308.900	
SOLVAY SA	32	104.700	3,350.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	287	92.500	26,547.500	
VIVENDI SA	430	25.210	10,840.300	
SAP SE	535	124.160	66,425.600	
TELEFONICA S.A	2,638	6.726	17,743.180	
TOTAL SA	1,301	47.820	62,213.820	
VALEO	152	33.960	5,161.920	
E.ON SE	1,155	9.371	10,823.500	
VOEST-ALPINE AG	26	25.140	653.640	
HENKEL AG & CO KGAA	74	84.250	6,234.500	
SIEMENS AG-REG	395	117.780	46,523.100	
UPM-KYMMENE OYJ	294	30.960	9,102.240	
ING GROEP NV-CVA	2,005	10.700	21,453.500	

PUMA AG	65	66.100	4,296.500	
BAYER AG	500	71.010	35,505.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	281	12.285	3,452.080	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	100	90.920	9,092.000	
DAIMLER AG	536	50.630	27,137.680	
BASF SE	498	68.380	34,053.240	
BEIERSDORF AG	52	102.950	5,353.400	
HOCHTIEF AG	24	115.600	2,774.400	
HEIDELBERGCEMENT AG	59	67.540	3,984.860	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	105	65.960	6,925.800	
ORANGE	1,031	13.275	13,686.520	
SAMPO OYJ-A SHS	223	37.700	8,407.100	
RANDSTAD NV	92	54.560	5,019.520	
ALLIANZ SE	232	219.700	50,970.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,781	3.750	6,678.750	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	632	22.440	14,182.080	
HERMES INTL	17	664.400	11,294.800	
ENDESA S.A.	218	24.280	5,293.040	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	94	16.795	1,578.730	
ERSTE GROUP BANK AG	212	32.580	6,906.960	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	85	263.900	22,431.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	263	16.276	4,280.580	
DASSAULT SYSTEMES SA	68	141.600	9,628.800	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	133	35.340	4,700.220	
HEINEKEN NV	143	93.260	13,336.180	
AKZO NOBEL	123	90.450	11,125.350	
ASML HOLDING NV	232	259.850	60,285.200	
AEGON NV	1,284	4.154	5,333.730	
BANKINTER S.A.	407	6.660	2,710.620	
VOLKSWAGEN AG PFD	109	183.300	19,979.700	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,914	4.949	19,370.380	
KERING	45	562.000	25,290.000	
CNP ASSURANCES	121	17.940	2,170.740	
FORTUM OYJ	149	21.360	3,182.640	
AGEAS	36	54.020	1,944.720	
UCB SA	48	71.740	3,443.520	
THYSSENKRUPP AG	236	11.645	2,748.220	
CARREFOUR SA	422	14.915	6,294.130	
NATURGY ENERGY GROUP SA	223	22.790	5,082.170	
ATOS SE	74	75.000	5,550.000	
NOKIA OYJ	2,655	3.216	8,538.480	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	526	42.515	22,362.890	
WOLTERS KLUWER-CVA	128	63.140	8,081.920	

SANOFI	626	89.150	55,807.900	
STMICROELECTRONICS NV	458	24.580	11,257.640	
ELISA OYJ	106	47.790	5,065.740	
BANCO SANTANDER SA	8,584	3.711	31,855.220	
METSO OYJ	93	35.280	3,281.040	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	277	17.485	4,843.340	
QIAGEN N.V.	153	37.000	5,661.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	934	6.721	6,277.410	
BMW VORZUG	19	57.150	1,085.850	
ENEL SPA	4,499	6.925	31,155.570	
VOPAK (KON.)	38	47.330	1,798.540	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,772	14.762	26,158.260	
SARTORIUS AG	27	184.500	4,981.500	
LEONARDO SPA	270	10.535	2,844.450	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	638	21.045	13,426.710	
KONINKLIJKE KPN NV	1,753	2.611	4,577.080	
EUROFINS SCIENTIFIC	8	492.200	3,937.600	
TELEPERFORMANCE	35	210.200	7,357.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	110	137.750	15,152.500	
EURAZEO	23	61.000	1,403.000	
BANCO SABADELL	4,349	1.082	4,705.610	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	60	93.240	5,594.400	
HEINEKEN HOLDING NV-A	81	85.250	6,905.250	
INDITEX	576	30.550	17,596.800	
JC DECAUX SA	24	26.820	643.680	
ANDRITZ AG	7	38.380	268.660	
MAPFRE SA	646	2.567	1,658.280	
ESSILORLUXOTTICA	151	140.600	21,230.600	
SNAM SPA	1,091	4.442	4,846.220	
CREDIT AGRICOLE SA	761	13.055	9,934.850	
ENAGAS	61	22.260	1,357.860	
WENDEL	13	121.200	1,575.600	
WIRECARD AG	63	104.450	6,580.350	
TENARIS SA	388	10.185	3,951.780	
TELECOM ITALIA-RNC	5,589	0.542	3,029.230	
ATLANTIA SPA	337	20.880	7,036.560	
ILIAD SA	27	114.500	3,091.500	
PROXIMUS	129	25.900	3,341.100	
SES FDR	252	12.500	3,150.000	
TERNA SPA	664	5.662	3,759.560	
GRIFOLS SA	143	31.240	4,467.320	
FERROVIAL SA	332	27.180	9,023.760	
LANXESS AG	69	61.020	4,210.380	
NESTE OYJ	229	28.160	6,448.640	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	116	22.440	2,603.040	

IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	74	36.390	2,692.860	
GALAPAGOS NV	22	188.050	4,137.100	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	34	247.300	8,408.200	
KONE OYJ	192	57.260	10,993.920	
ENGIE	969	14.585	14,132.860	
ALSTOM	72	41.380	2,979.360	
TELENET GROUP HOLDING NV	12	38.880	466.560	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	159	15.180	2,413.620	
ELECTRICITE DE FRANCE	195	9.664	1,884.480	
IPSEN SA	33	78.400	2,587.200	
DEUTSCHE WOHNEN	227	35.650	8,092.550	
ARKEMA SA	52	94.840	4,931.680	
LEGRAND SA	162	72.480	11,741.760	
UNILEVER NV	826	54.180	44,752.680	
ADP	21	177.100	3,719.100	
ORION OYJ	88	39.500	3,476.000	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	236	14.615	3,449.140	
SYMRISE AG	57	88.120	5,022.840	
SCOR SE	71	38.220	2,713.620	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	109	33.020	3,599.180	
PRYSMIAN SPA	193	21.170	4,085.810	
CAIXABANK	1,966	2.754	5,414.360	
BUREAU VERITAS SA	164	23.110	3,790.040	
GETLINK	331	15.620	5,170.220	
SUEZ SA	272	13.300	3,617.600	
AMADEUS IT GROUP SA	222	72.660	16,130.520	
BRENNTAG AG	28	49.510	1,386.280	
EVONIK INDUSTRIES AG	149	26.750	3,985.750	
EDENRED	165	44.310	7,311.150	
BANKIA SA	187	1.857	347.250	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	899	2.662	2,393.130	
KION GROUP AG	28	64.480	1,805.440	
VONOVIA SE	269	46.000	12,374.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	659	5.055	3,331.240	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	84	42.180	3,543.120	
FERRARI NV	62	147.500	9,145.000	
METRO AG	96	13.950	1,339.200	
CNH INDUSTRIAL NV	625	9.792	6,120.000	
AROUNDTOWN SA	443	7.808	3,458.940	
MONCLER SPA	88	40.900	3,599.200	
PROSUS NV	287	61.780	17,730.860	
AXEL SPRINGER SE	21	62.500	1,312.500	
WORLDLINE SA	38	60.250	2,289.500	



	NN GROUP NV	210	34.350	7,213.500	
	FINECOBANK SPA	300	10.990	3,297.000	
	ZALANDO SE	109	42.690	4,653.210	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	585	13.326	7,795.710	
	AENA SME SA	37	174.950	6,473.150	
	CELLNEX TELECOM SAU	100	37.650	3,765.000	
	ABN AMRO BANK NV	203	16.115	3,271.340	
	EXOR NV	80	68.780	5,502.400	
	COVESTRO AG	103	42.820	4,410.460	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	429	70.210	30,120.090	
	POSTE ITALIANE SPA	406	10.170	4,129.020	
	ADYEN NV	8	699.200	5,593.600	
	UNIPER SE	111	29.580	3,283.380	
	DELIVERY HERO SE	59	61.840	3,648.560	
ユーロ 小計		120,808		2,262,742.650 (275,466,290)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	100	110.700	11,070.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,864	16.680	31,091.520	
	BANK OF EAST ASIA	867	18.080	15,675.360	
	CLP HOLDINGS LTD	735	82.550	60,674.250	
	PCCW LTD	884	4.610	4,075.240	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	55.850	27,925.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	666	255.400	170,096.400	
	MTR CORP	903	46.400	41,899.200	
	HANG SENG BANK LTD	400	163.000	65,200.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,086	38.700	42,028.200	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	567	56.150	31,837.050	
	HONG KONG & CHINA GAS	5,094	15.140	77,123.160	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,537	57.950	89,069.150	
	KERRY PROPERTIES LTD	452	25.750	11,639.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,184	27.600	60,278.400	
	NWS HOLDINGS LTD	500	10.840	5,420.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	338	22.700	7,672.600	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	3,562	10.620	37,828.440	
	SINO LAND CO	2,576	11.540	29,727.040	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,000	118.300	118,300.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	773	63.450	49,046.850	
	SJM HOLDINGS LTD	1,000	8.820	8,820.000	
	WYNN MACAU LTD	699	18.260	12,763.740	
	AIA GROUP LTD	6,751	82.650	557,970.150	

HKT TRUST / HKT LTD	2,080	11.360	23,628.800	
SANDS CHINA LTD	1,374	39.650	54,479.100	
SWIRE PROPERTIES LTD	432	25.800	11,145.600	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,000	44.000	44,000.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	800	28.000	22,400.000	
WH GROUP LTD	4,500	8.150	36,675.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,034	74.250	76,774.500	
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,534	54.300	83,296.200	
香港・ドル 小計	47,792		1,919,629.950 (26,932,408)	
合計	672,983		2,345,860,092 (2,345,860,092)	

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年12月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益 証券	オーストラリア ・ドル	DEXUS	583.000	6,826.930	
		GOODMAN GROUP	1,025.000	14,011.750	
		GPT GROUP	956.000	5,439.640	
		MIRVAC GROUP	2,856.000	8,967.840	
		SCENTRE GROUP	3,169.000	11,883.750	
		STOCKLAND	1,002.000	4,689.360	
		VICINITY CENTRES	1,672.000	4,196.720	
	オーストラリア・ドル 小計		11,263.000	56,015.990 (4,216,324)	
	シンガポール・ ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	2,000.000	5,820.000	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	869.000	1,711.930	
		CAPITALAND MALL TRUST	1,500.000	3,630.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	500.000	905.000	
	シンガポール・ドル 小計		4,869.000	12,066.930 (975,129)	
投資信託受益証券 合計		16,132	5,191,453 (5,191,453)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	144.000	2,521.440	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64.000	10,014.080	
		AMERICAN TOWER CORP	236.000	50,154.720	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	997.000	9,461.530	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	70.000	14,604.800	
		BOSTON PROPERTIES INC	97.000	13,105.670	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	66.000	6,946.500	

	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	233.000	30,914.440	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	107.000	12,166.970	
	DUKE REALTY TRUST	219.000	7,491.990	
	EQUINIX INC	47.000	25,936.480	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	85.000	5,937.250	
	EQUITY RESIDENTIAL	193.000	15,634.930	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	32.000	9,616.320	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	58.000	5,932.820	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	46.000	5,877.420	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	309.000	9,965.250	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	326.000	5,851.700	
	INVITATION HOMES INC	271.000	7,867.130	
	IRON MOUNTAIN INC	206.000	6,507.540	
	KIMCO REALTY	295.000	5,991.450	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	95.000	5,670.550	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	198.000	3,934.260	
	MID AMERICA	54.000	7,047.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	88.000	4,551.360	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	113.000	4,636.390	
	PROLOGIS INC	355.000	31,431.700	
	PUBLIC STORAGE	88.000	18,077.840	
	REALTY INCOME CORP	159.000	11,527.500	
	REGENCY CENTERS CORP	105.000	6,395.550	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	63.000	14,835.240	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	177.000	25,549.950	
	SL GREEN	17.000	1,507.900	
	SUN COMMUNITIES INC	41.000	6,278.740	
	UDR INC	161.000	7,447.860	
	VENTAS INC	180.000	9,990.000	
	VEREIT INC	549.000	5,023.350	
	VICI PROPERTIES INC	207.000	5,036.310	
	VORNADO REALTY TRUST	120.000	7,832.400	
	WELLTOWER INC	229.000	18,015.430	
	WEYERHAEUSER CO	483.000	14,316.120	
	WP CAREY INC	102.000	7,880.520	
アメリカ・ドル	小計	7,685.000	479,486.400 (52,470,195)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	322.000	3,224.830	
	SEGRO PLC	760.000	6,596.800	
イギリス・ポンド	小計	1,082.000	9,821.630 (1,435,235)	

カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	152.000	3,150.960	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	147.000	3,921.960	
カナダ・ドル 小計		299.000	7,072.920 (587,335)	
ユーロ	COVIVIO	34.000	3,367.700	
	GECINA SA	34.000	5,215.600	
	ICADE	19.000	1,756.550	
	KLEPIERRE	82.000	2,646.960	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	89.000	12,282.000	
ユーロ 小計		258.000	25,268.810 (3,076,225)	
香港・ドル	LINK REIT	1,107.000	89,113.500	
香港・ドル 小計		1,107.000	89,113.500 (1,250,262)	
投資証券 合計		10,431	58,819,252 (58,819,252)	
合計			64,010,705 (64,010,705)	

(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	596銘柄	62.54	-	-	69.28
	投資証券	42銘柄	-	-	2.03	
イギリス・ポンド	株式	90銘柄	5.51	-	-	5.98
	投資証券	2銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式	7銘柄	0.10	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式	53銘柄	2.16	-	-	2.49
	投資信託受益証券	7銘柄	-	0.16	-	
カナダ・ドル	株式	76銘柄	3.39	-	-	3.66
	投資証券	2銘柄	-	-	0.02	
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	0.41	-	-	0.48
	投資信託受益証券	4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式	35銘柄	3.07	-	-	3.29
スウェーデン・クローナ	株式	31銘柄	0.93	-	-	0.99
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	0.63	-	-	0.68
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.09	-	-	0.10
ノルウェー・クローネ	株式	8銘柄	0.20	-	-	0.21
ユーロ	株式	221銘柄	10.65	-	-	11.56
	投資証券	5銘柄	-	-	0.12	
香港・ドル	株式	32銘柄	1.04	-	-	1.17
	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。

新光日本債券インデックスマザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和1年12月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	47,345,850
国債証券	6,588,963,800
地方債証券	983,903,970
特殊債券	835,299,000
社債券	513,251,000
未収利息	23,396,359
前払費用	331,966
流動資産合計	8,992,491,945
資産合計	
8,992,491,945	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,000,000
流動負債合計	1,000,000
負債合計	
1,000,000	
純資産の部	
元本等	
元本	6,938,461,315
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,053,030,630
元本等合計	8,991,491,945
純資産合計	
8,991,491,945	
負債純資産合計	
8,992,491,945	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年12月16日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,741,019,132円
同期中追加設定元本額	2,140,068,762円
同期中一部解約元本額	4,942,626,579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	148,475,860円
新光7資産バランスファンド	520,033,360円
日本債券ファンド	4,984,562,822円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	562,674,296円
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	61,150,737円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	73,716,873円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	563,773,659円
グローバル・ナビ	24,073,708円
計	6,938,461,315円
2. 受益権の総数	6,938,461,315口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年12月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,770,000
地方債証券	1,246,360
特殊債券	1,755,000
社債券	81,000
合計	4,690,360

(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1年12月16日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和1年12月16日現在
1口当たり純資産額	1.2959円
(1万口当たり純資産額)	(12,959円)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年12月16日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	128回 利付国庫債券(5年)	120,000,000	120,434,400	
	129回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,253,800	
	130回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	80,378,400	
	131回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,332,400	
	132回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,251,600	
	133回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,374,000	
	134回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	20,160,200	
	135回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,260,100	
	136回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,467,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,472,500	
	138回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,290,100	
	139回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,502,500	
	140回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,416,800	
	141回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,440,400	
	1回 利付国債(40年)	10,000,000	15,389,600	
	2回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,969,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	15,102,500	
	4回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	30,509,800	
	5回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	29,607,200	
	6回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	29,234,200	
	7回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	28,215,400	
	8回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	26,465,600	
9回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	29,811,000		
10回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	34,976,700		
11回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	22,654,200		

12回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	10,252,300	
315回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,618,400	
317回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	51,093,000	
319回 利付国庫債券(10年)	30,000,000	30,742,800	
320回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	51,137,500	
321回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	51,283,500	
322回 利付国庫債券(10年)	20,000,000	20,468,000	
324回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	51,182,000	
325回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	41,046,800	
326回 利付国庫債券(10年)	10,000,000	10,255,300	
327回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	51,427,500	
328回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,717,100	
329回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	72,344,300	
332回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,789,200	
333回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	82,533,600	
334回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,999,200	
335回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	82,432,800	
336回 利付国庫債券(10年)	30,000,000	30,968,100	
337回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,887,600	
338回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	82,264,800	
339回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	92,671,200	
340回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,863,000	
341回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,843,800	
342回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,870,000	
343回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,180,800	

344回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,766,500	
345回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,795,000	
346回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,823,500	
347回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,852,500	
348回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,206,100	
349回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,017,600	
350回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	101,664,000	
351回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,951,000	
352回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,079,400	
353回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,046,500	
354回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,557,600	
355回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,801,600	
356回 利付国庫債券(10年)	20,000,000	20,254,400	
7回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,523,800	
10回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,645,800	
11回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,140,300	
12回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,705,800	
13回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,214,600	
15回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,768,000	
17回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,663,600	
19回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,516,200	
20回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,607,300	
21回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,329,800	
22回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,685,500	
23回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,730,000	
26回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	41,076,600	

27回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,944,400	
28回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	42,078,000	
29回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,829,600	
30回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	41,411,700	
31回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,369,000	
32回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	41,896,500	
33回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,360,500	
34回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	41,764,500	
35回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,749,900	
36回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,292,200	
37回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	53,979,600	
38回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,637,200	
39回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,145,800	
40回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,742,400	
41回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,329,600	
42回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,390,200	
43回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,422,000	
44回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,483,600	
45回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,553,200	
46回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,604,200	
47回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,129,400	
48回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,170,000	
49回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	37,824,600	
50回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,326,100	
51回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,528,700	

5 2 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,025,100	
5 3 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,207,600	
5 4 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,239,200	
5 5 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,230,200	
5 6 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,373,200	
5 7 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,358,200	
5 8 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,342,300	
5 9 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,552,700	
6 0 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,784,800	
6 1 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,672,000	
6 2 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,577,600	
6 3 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,000,000	
6 4 回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	9,986,700	
5 0 回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,776,400	
5 1 回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,323,700	
5 2 回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	20,791,000	
5 3 回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,450,000	
5 5 回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,485,800	
5 9 回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,557,400	
6 3 回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,371,000	
6 4 回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,768,800	
7 0 回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,293,800	
7 2 回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,135,600	
7 6 回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	33,222,000	
7 8 回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,251,800	

81回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,235,800	
84回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,289,800	
88回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,587,000	
90回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,580,800	
92回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	34,707,000	
95回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,666,200	
99回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,780,700	
105回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,737,200	
108回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,775,200	
110回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,999,000	
111回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,137,600	
112回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,084,400	
113回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	36,271,800	
114回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,125,900	
116回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,268,600	
117回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,331,800	
118回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,101,300	
120回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,362,000	
121回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,062,400	
123回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,569,200	
125回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	37,302,000	
126回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,209,700	
128回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,260,800	
130回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,105,600	
131回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,935,800	

132回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,962,300	
133回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,163,200	
134回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,116,700	
135回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,995,100	
136回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,746,800	
137回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,056,600	
138回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,780,200	
139回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,808,600	
140回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	36,160,800	
141回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,171,200	
142回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,428,600	
143回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,955,600	
144回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,693,600	
145回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	48,561,200	
146回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	36,489,600	
147回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	48,188,800	
148回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,736,000	
149回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,802,400	
150回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	59,152,500	
151回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,198,400	
152回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,263,600	
153回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,201,400	
154回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,358,800	
155回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	56,423,000	
156回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,993,300	

157回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,000,000	
158回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,945,600	
159回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,596,400	
160回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,447,700	
161回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,921,500	
162回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,920,900	
163回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,559,200	
164回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,818,800	
165回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,805,600	
166回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,418,900	
167回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,738,800	
168回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,713,700	
169回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,138,600	
170回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,037,400	
国債証券 合計	5,950,000,000	6,588,963,800	
地方債証券			
783回 東京都公募公債	100,000,000	101,483,000	
18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	119,820,000	
200回 神奈川県公募公債	35,000,000	36,089,550	
218回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,080,000	
412回 大阪府公募公債 10年	50,000,000	50,101,500	
12回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	106,701,000	
24年度3回 広島県公募公債	66,000,000	67,506,120	
24年度7回 広島県公募公債	100,000,000	102,192,000	
24年度1回 福岡県公募公債 30年	10,000,000	13,644,600	
105回 共同発行市場公募地方債	50,000,000	51,082,000	
169回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,296,000	
485回 名古屋市公募公債 10年	30,000,000	30,799,200	
24年度2回 広島市公募公債	100,000,000	102,109,000	
地方債証券 合計	941,000,000	983,903,970	



特殊債券	104回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,296,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	120,160,000	
	249回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,907,000	
	327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,559,000	
	34回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,119,000	
	49回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,251,000	
	58回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,933,000	
	317回 利附信金中金債（5年）	100,000,000	100,074,000	
特殊債券 合計		800,000,000	835,299,000	
社債券	4回 第一三共社債	100,000,000	102,643,000	
	11回 プリヂストン社債	100,000,000	100,436,000	
	44回 ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,883,000	
	47回 野村ホールディングス社債	100,000,000	100,541,000	
	36回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,748,000	
社債券 合計		500,000,000	513,251,000	
合計			8,921,417,770	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外国債マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

令和1年12月16日現在

資産の部		
流動資産		
預金		50,734,912
コール・ローン		91,148,412
国債証券		17,795,573,865
派生商品評価勘定		587,820
未収入金		761,720,989
未収利息		84,975,068
前払費用		7,850,716
流動資産合計		18,792,591,782
資産合計		18,792,591,782
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,029,600
未払金		664,103,917
未払解約金		4,000,000
流動負債合計		669,133,517

負債合計	669,133,517
純資産の部	
元本等	
元本	7,644,675,360
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	10,478,782,905
元本等合計	18,123,458,265
純資産合計	18,123,458,265
負債純資産合計	18,792,591,782

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年12月16日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,716,097,955円
同期中追加設定元本額	1,779,173円
同期中一部解約元本額	1,073,201,768円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	5,559,736,278円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	981,287,353円
新光7資産バランスファンド	294,983,390円
海外国債ファンド（1年決算型）	21,764,777円
海外国債ファンド（変額年金）	773,589,981円
グローバル・ナビ	13,313,581円
計	7,644,675,360円
2. 受益権の総数	7,644,675,360口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年12月16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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	195,119,598
合計	195,119,598

(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1年12月16日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和1年12月16日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	319,000,020	-	318,412,200	587,820
アメリカ・ドル	319,000,020	-	318,412,200	587,820
買建	190,928,400	-	189,898,800	1,029,600
ユーロ	190,928,400	-	189,898,800	1,029,600
合計	509,928,420	-	508,311,000	441,780

(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。

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。

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和1年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3707円 (23,707円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

令和1年12月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.625 08/15/29	7,000,000.000	6,878,046.840	
		US T N/B 1.75 11/15/29	3,000,000.000	2,981,250.000	
		US T N/B 2.25 02/15/27	7,000,000.000	7,233,515.590	
		US T N/B 2.25 08/15/27	6,000,000.000	6,207,187.500	
		US T N/B 2.25 11/15/27	6,000,000.000	6,207,656.220	
		US T N/B 2.375 05/15/27	6,000,000.000	6,257,343.720	

	US T N/B 2.375 05/15/29	7,000,000.000	7,337,968.750	
	US T N/B 2.375 11/15/49	3,000,000.000	3,078,750.000	
	US T N/B 2.625 02/15/29	7,000,000.000	7,480,156.240	
	US T N/B 2.75 02/15/28	5,900,000.000	6,332,820.280	
	US T N/B 2.875 05/15/28	6,000,000.000	6,508,125.000	
	US T N/B 2.875 08/15/28	6,900,000.000	7,495,125.000	
	US T N/B 3.125 11/15/28	7,000,000.000	7,759,062.500	
アメリカ・ドル	小計	77,800,000.000 (8,513,654,000)	81,757,007.640 (8,946,669,348)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,000,000.000	1,008,400.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,300,000.000	1,357,473.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,500,000.000	1,619,000.400	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,200,000.000	1,535,748.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,900,000.000	2,774,247.000	
イギリス・ポンド	小計	6,900,000.000 (1,008,297,000)	8,294,868.400 (1,212,129,119)	
カナダ・ドル	CANADA 1.0 06/01/27	1,500,000.000	1,436,835.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,000,000.000	2,062,720.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	2,000,000.000	2,116,500.000	
カナダ・ドル	小計	5,500,000.000 (456,720,000)	5,616,055.000 (466,357,207)	
ユーロ	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,500,000.000	1,574,745.000	
	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,700,000.000	1,792,935.600	
	DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,000,000.000	2,106,500.000	
	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,500,000.000	1,610,205.000	
	DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,500,000.000	2,681,080.000	
	DEUTSCHLAND 08/15/29	2,500,000.000	2,572,335.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	900,000.000	1,298,871.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,000,000.000	1,492,860.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,000,000.000	1,531,410.000	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/29	1,300,000.000	1,300,046.800	
	FRANCE OAT 0.25 11/25/26	1,300,000.000	1,345,073.600	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,000,000.000	3,154,152.000	
	FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,000,000.000	3,223,890.000	
	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,500,000.000	3,762,885.000	
	FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,500,000.000	1,635,411.000	
	FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,934,640.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	4,576,920.000	
	ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,500,000.000	1,543,155.000	
	ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,000,000.000	1,080,469.000	
	ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,000,000.000	2,160,696.000	

	ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,000,000.000	2,180,200.000	
	ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.000	1,146,698.000	
	ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,000,000.000	1,167,704.000	
	ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,000,000.000	1,306,761.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,000,000.000	2,748,200.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,000,000.000	2,832,000.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,500,000.000	2,139,600.000	
	ユーロ 小計	50,200,000.000 (6,111,348,000)	58,899,443.000 (7,170,418,191)	
国債証券 合計		16,090,019,000 (16,090,019,000)	17,795,573,865 (17,795,573,865)	
合計			17,795,573,865 (17,795,573,865)	

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 13銘柄	49.37	50.27
イギリス・ポンド	国債証券 5銘柄	6.69	6.81
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	2.57	2.62
ユーロ	国債証券 27銘柄	39.56	40.29

(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。



## 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

（単位：円）

令和1年12月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	27,526,584
コール・ローン	1,073,824
国債証券	1,069,102,024
未収入金	8,359,890
未収利息	7,158,578
前払費用	4,590
差入委託証拠金	1,961
流動資産合計	1,113,227,451
資産合計	
1,113,227,451	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,015,825
未払金	90,321
未払解約金	2,000,000
流動負債合計	9,106,146
負債合計	
9,106,146	
純資産の部	
元本等	
元本	775,797,780
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	328,323,525
元本等合計	1,104,121,305
純資産合計	
1,104,121,305	
負債純資産合計	
1,113,227,451	

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年12月16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	6,368,058,840円
同期中追加設定元本額	92,713,064円
同期中一部解約元本額	5,684,974,124円
元本の内訳	
ファンド名	
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	166,326,655円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	84,014,973円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	510,833,593円
グローバル・ナビ	14,622,559円
計	775,797,780円
2. 受益権の総数	775,797,780口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年12月16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ぬ。
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つた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	3,656,359
合計	3,656,359

(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1年12月16日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和1年12月16日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	1,104,444,983	-	1,111,460,808	7,015,825
アメリカ・ドル	533,563,928	-	533,698,512	134,584
イギリス・ポンド	71,730,206	-	74,014,912	2,284,706
オーストラリア・ドル	21,304,781	-	21,661,112	356,331
カナダ・ドル	21,100,270	-	21,269,574	169,304
シンガポール・ドル	4,640,142	-	4,686,346	46,204
スウェーデン・クローナ	4,383,872	-	4,466,610	82,738
デンマーク・クローネ	6,246,574	-	6,296,085	49,511
ノルウェー・クローネ	3,228,455	-	3,288,176	59,721
ポーランド・ズロチ	7,139,839	-	7,254,488	114,649
メキシコ・ペソ	9,571,854	-	9,829,248	257,394
ユーロ	414,129,895	-	417,513,984	3,384,089
南アフリカ・ランド	7,405,167	-	7,481,761	76,594
合計	1,104,444,983	-	1,111,460,808	7,015,825

(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。

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。

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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和1年12月16日現在	
1口当たり純資産額	1.4232円
(1万口当たり純資産額)	(14,232円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年12月16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 1.375 05/31/21	310,000.000	308,789.060	
		US T N/B 1.5 08/15/26	50,000.000	49,214.840	
		US T N/B 1.625 02/15/26	50,000.000	49,707.030	
		US T N/B 1.625 05/15/26	30,000.000	29,786.710	
		US T N/B 1.625 11/15/22	70,000.000	69,997.260	
		US T N/B 1.75 05/15/22	40,000.000	40,129.680	
		US T N/B 1.75 05/15/23	100,000.000	100,390.620	
		US T N/B 2.0 02/15/22	70,000.000	70,549.600	
		US T N/B 2.0 02/15/23	40,000.000	40,456.250	
		US T N/B 2.0 02/15/25	70,000.000	71,088.280	
		US T N/B 2.0 08/15/25	70,000.000	71,066.400	
		US T N/B 2.0 10/31/22	50,000.000	50,531.250	
		US T N/B 2.0 11/15/21	130,000.000	130,949.600	
		US T N/B 2.0 11/15/26	50,000.000	50,808.590	
		US T N/B 2.0 11/30/22	60,000.000	60,637.500	
		US T N/B 2.125 03/31/24	60,000.000	61,153.120	
		US T N/B 2.125 05/15/25	90,000.000	91,982.810	
		US T N/B 2.125 08/15/21	180,000.000	181,413.280	
		US T N/B 2.125 12/31/22	90,000.000	91,328.900	
		US T N/B 2.25 02/15/27	30,000.000	31,000.780	
		US T N/B 2.25 08/15/27	40,000.000	41,381.250	
		US T N/B 2.25 11/15/24	80,000.000	82,156.240	
		US T N/B 2.25 11/15/25	70,000.000	72,017.960	
		US T N/B 2.25 11/15/27	50,000.000	51,730.460	
		US T N/B 2.375 05/15/27	40,000.000	41,715.620	
		US T N/B 2.375 08/15/24	70,000.000	72,198.430	
		US T N/B 2.5 02/28/26	50,000.000	52,257.810	
		US T N/B 2.5 05/15/24	90,000.000	93,192.180	
		US T N/B 2.5 05/15/46	40,000.000	41,968.750	
		US T N/B 2.5 08/15/23	90,000.000	92,728.120	
		US T N/B 2.625 02/15/29	50,000.000	53,429.680	
		US T N/B 2.75 02/15/24	60,000.000	62,620.310	
		US T N/B 2.75 02/15/28	60,000.000	64,401.560	
		US T N/B 2.75 05/31/23	60,000.000	62,217.180	
		US T N/B 2.75 07/31/23	100,000.000	103,867.180	
		US T N/B 2.75 08/15/47	30,000.000	33,075.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	80,000.000	83,312.500			
US T N/B 2.75 11/15/42	20,000.000	21,868.750			
US T N/B 2.75 11/15/47	40,000.000	44,109.370			
US T N/B 2.875 05/15/28	60,000.000	65,081.250			
US T N/B 2.875 05/15/43	20,000.000	22,335.930			

US T N/B 2.875 08/15/28	50,000.000	54,312.500	
US T N/B 2.875 09/30/23	50,000.000	52,242.180	
US T N/B 2.875 10/15/21	170,000.000	173,765.230	
US T N/B 2.875 10/31/23	100,000.000	104,593.750	
US T N/B 2.875 11/15/46	40,000.000	45,059.370	
US T N/B 2.875 11/30/23	80,000.000	83,731.240	
US T N/B 2.875 11/30/25	50,000.000	53,269.530	
US T N/B 3.0 02/15/47	40,000.000	46,150.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	40,000.000	46,221.870	
US T N/B 3.0 02/15/49	30,000.000	34,802.340	
US T N/B 3.0 05/15/42	20,000.000	22,771.870	
US T N/B 3.0 05/15/45	30,000.000	34,378.120	
US T N/B 3.0 05/15/47	30,000.000	34,605.460	
US T N/B 3.0 08/15/48	40,000.000	46,315.620	
US T N/B 3.0 10/31/25	60,000.000	64,270.310	
US T N/B 3.0 11/15/44	30,000.000	34,303.120	
US T N/B 3.0 11/15/45	20,000.000	22,964.060	
US T N/B 3.125 05/15/21	260,000.000	265,352.340	
US T N/B 3.125 05/15/48	30,000.000	35,493.750	
US T N/B 3.125 08/15/44	20,000.000	23,339.060	
US T N/B 3.125 11/15/28	70,000.000	77,590.620	
US T N/B 3.125 11/15/41	10,000.000	11,608.590	
US T N/B 3.375 05/15/44	30,000.000	36,398.430	
US T N/B 3.375 11/15/48	40,000.000	49,606.250	
US T N/B 3.5 02/15/39	10,000.000	12,225.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	30,000.000	37,764.840	
US T N/B 3.75 08/15/41	10,000.000	12,692.960	
US T N/B 3.75 11/15/43	30,000.000	38,404.680	
US T N/B 4.25 11/15/40	20,000.000	27,026.560	
US T N/B 4.375 05/15/40	20,000.000	27,428.120	
US T N/B 4.375 05/15/41	10,000.000	13,766.400	
US T N/B 4.375 11/15/39	10,000.000	13,667.180	
US T N/B 4.5 02/15/36	10,000.000	13,477.340	
US T N/B 4.5 05/15/38	10,000.000	13,763.280	
US T N/B 4.625 02/15/40	20,000.000	28,221.870	
US T N/B 5.375 02/15/31	30,000.000	40,687.500	
US T N/B 6.125 11/15/27	10,000.000	13,219.530	
US T N/B 8.0 11/15/21	130,000.000	145,493.350	
アメリカ・ドル 小計	4,530,000.000 (495,717,900)	4,799,631.310 (525,223,651)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.75 07/22/57	20,000.000	23,400.000
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	10,000.000	10,814.180
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	10,000.000	10,624.420
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	10,000.000	14,753.000
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	10,000.000	11,012.650

	UK TREASURY 3.25 01/22/44	20,000.000	28,100.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	10,000.000	14,723.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	10,000.000	18,625.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	10,000.000	16,727.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	10,000.000	19,028.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	10,000.000	14,655.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	20,000.000	27,776.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	30,000.000	38,393.700	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	10,000.000	15,551.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	10,000.000	16,736.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	10,000.000	17,382.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	10,000.000	18,884.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	10,000.000	14,715.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	20,000.000	32,898.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	10,000.000	16,095.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	20,000.000	24,523.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	20,000.000	29,202.600	
	イギリス・ボンド 小計	300,000.000 (43,839,000)	434,618.550 (63,510,809)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	30,000.000	32,688.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	40,000.000	43,234.420	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	10,000.000	11,727.880	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	30,000.000	33,519.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	20,000.000	22,553.070	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	10,000.000	12,433.270	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	40,000.000	47,032.280	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	10,000.000	13,283.860	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	20,000.000	23,955.200	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	10,000.000	12,560.770	
	オーストラリア・ドル 小計	220,000.000 (16,559,400)	252,987.750 (19,042,388)	
カナダ・ドル	CANADA 1.0 06/01/27	10,000.000	9,578.900	
	CANADA 1.5 06/01/23	30,000.000	29,877.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	20,000.000	19,883.400	
	CANADA 2.25 06/01/25	20,000.000	20,683.400	
	CANADA 2.5 06/01/24	20,000.000	20,776.600	
	CANADA 2.75 12/01/48	20,000.000	24,882.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	10,000.000	13,781.100	
	CANADA 5.0 06/01/37	10,000.000	14,991.600	

	CANADA 5.75 06/01/29	20,000.000	27,203.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	10,000.000	14,935.800	
カナダ・ドル 小計		170,000.000 (14,116,800)	196,592.800 (16,325,066)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.75 04/01/42	10,000.000	11,285.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	10,000.000	11,053.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	10,000.000	10,626.600	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	10,000.000	11,215.000	
シンガポール・ドル 小計		40,000.000 (3,232,400)	44,179.600 (3,570,153)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	20,000.000	21,322.560	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	80,000.000	86,228.160	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	50,000.000	57,402.600	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	60,000.000	93,443.400	
スウェーデン・クローナ 小計		210,000.000 (2,448,600)	258,396.720 (3,012,906)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.75 11/15/25	200,000.000	226,865.600	
	DENMARK 4.5 11/15/39	80,000.000	152,430.080	
デンマーク・クローネ 小計		280,000.000 (4,561,200)	379,295.680 (6,178,727)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	90,000.000	90,873.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	10,000.000	10,224.710	
	NORWAY 2.0 04/26/28	140,000.000	146,076.000	
ノルウェー・クローネ 小計		240,000.000 (2,906,400)	247,173.710 (2,993,274)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.5 07/25/26	20,000.000	20,720.560	
	POLAND 2.5 07/25/27	50,000.000	51,903.250	
	POLAND 3.25 07/25/25	40,000.000	42,950.450	
	POLAND 5.75 04/25/29	50,000.000	66,732.500	
ポーランド・ズロチ 小計		160,000.000 (4,547,200)	182,306.760 (5,181,158)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	103,000.000	133,480.790	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	602,000.000	626,441.200	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	136,000.000	151,725.680	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	305,000.000	349,221.950	
メキシコ・ペソ 小計		1,146,000.000 (6,589,500)	1,260,869.620 (7,250,000)	
ユーロ	AUSTRIA 0.75 10/20/26	30,000.000	32,130.180	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	20,000.000	21,829.440	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	10,000.000	11,015.730	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	50,000.000	54,401.470	



AUSTRIA 3.15 06/20/44	10,000.000	16,392.130	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	20,000.000	22,350.600	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	30,000.000	32,151.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	20,000.000	33,094.000	
BELGIUM 0.8 06/22/25	20,000.000	21,262.380	
BELGIUM 1.0 06/22/26	20,000.000	21,656.720	
BELGIUM 1.6 06/22/47	10,000.000	12,203.810	
BELGIUM 1.7 06/22/50	10,000.000	12,413.440	
BELGIUM 3.75 06/22/45	10,000.000	17,249.010	
BELGIUM 4.0 03/28/22	20,000.000	22,123.800	
BELGIUM 4.25 03/28/41	10,000.000	17,369.900	
BELGIUM 4.25 09/28/21	20,000.000	21,756.040	
BELGIUM 5.0 03/28/35	20,000.000	33,959.780	
BELGIUM 5.5 03/28/28	20,000.000	29,439.120	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	20,000.000	21,093.360	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	30,000.000	31,597.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	20,000.000	21,058.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	10,000.000	10,616.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	10,000.000	10,734.700	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	10,000.000	10,724.320	
DEUTSCHLAND 08/15/26	30,000.000	30,969.960	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	40,000.000	42,959.040	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	30,000.000	32,565.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	10,000.000	12,963.740	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	90,000.000	95,304.870	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	100,000.000	104,995.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	10,000.000	15,718.500	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	20,000.000	32,246.660	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	10,000.000	16,954.400	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	10,000.000	18,270.100	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	10,000.000	17,179.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	10,000.000	19,677.600	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	20,000.000	32,917.200	
FINLAND 0.75 04/15/31	10,000.000	10,814.140	
FINLAND 2.75 07/04/28	10,000.000	12,490.400	
FINLAND 4.0 07/04/25	20,000.000	24,941.200	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	20,000.000	20,693.440	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	20,000.000	21,492.600	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	20,000.000	21,502.200	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	30,000.000	32,708.220	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	20,000.000	21,593.360	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	10,000.000	11,398.680	

FRANCE OAT 1.25 05/25/36	20,000.000	22,500.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	30,000.000	34,819.620	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	10,000.000	11,953.350	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	10,000.000	13,078.340	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	10,000.000	12,361.200	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	30,000.000	33,258.450	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	10,000.000	13,277.420	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	70,000.000	75,768.700	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	30,000.000	37,769.580	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	30,000.000	37,009.800	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	50,000.000	54,311.250	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	10,000.000	16,113.800	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	40,000.000	49,660.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	10,000.000	19,657.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	10,000.000	20,639.460	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	10,000.000	16,491.860	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	40,000.000	47,481.100	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	20,000.000	36,141.400	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	20,000.000	33,452.520	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	30,000.000	45,769.200	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	20,000.000	34,351.920	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	20,000.000	27,497.500	
IRISH 0.8 03/15/22	40,000.000	41,176.560	
IRISH 0.9 05/15/28	20,000.000	21,675.400	
IRISH 1.7 05/15/37	10,000.000	12,014.200	
IRISH 2.4 05/15/30	10,000.000	12,429.880	
IRISH 5.4 03/13/25	20,000.000	26,039.210	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	10,000.000	10,456.510	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	10,000.000	10,276.400	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	30,000.000	32,414.070	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	20,000.000	21,514.060	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	10,000.000	11,066.230	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	10,000.000	11,056.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	10,000.000	10,725.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	10,000.000	11,360.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	20,000.000	24,999.120	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	30,000.000	36,501.240	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	50,000.000	57,543.460	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	20,000.000	26,184.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	20,000.000	23,418.260	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	30,000.000	36,813.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	10,000.000	11,439.260	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	10,000.000	11,619.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	20,000.000	26,135.220	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	10,000.000	14,816.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	50,000.000	55,575.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	40,000.000	49,079.680	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	20,000.000	28,536.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	20,000.000	29,632.000	

	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	10,000.000	14,809.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	20,000.000	27,482.000	
	ITALY BTPS 5.5 11/01/22	90,000.000	103,959.410	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	20,000.000	29,910.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	10,000.000	14,160.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	10,000.000	14,264.000	
	NETHERLANDS 0.25 07/15/25	10,000.000	10,382.300	
	NETHERLANDS 0.5 07/15/26	10,000.000	10,544.500	
	NETHERLANDS 0.75 07/15/27	10,000.000	10,802.590	
	NETHERLANDS 0.75 07/15/28	10,000.000	10,861.180	
	NETHERLANDS 2.25 07/15/22	60,000.000	64,503.010	
	NETHERLANDS 2.5 01/15/33	10,000.000	13,316.150	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/47	10,000.000	16,643.790	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	10,000.000	17,824.830	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	10,000.000	16,620.000	
	SPAIN 1.4 04/30/28	10,000.000	10,925.860	
	SPAIN 1.4 07/30/28	20,000.000	21,818.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	10,000.000	10,986.050	
	SPAIN 1.95 07/30/30	10,000.000	11,518.680	
	SPAIN 2.35 07/30/33	10,000.000	12,146.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	10,000.000	13,436.680	
	SPAIN 2.75 10/31/24	30,000.000	34,168.350	
	SPAIN 2.9 10/31/46	10,000.000	13,805.650	
	SPAIN 3.45 07/30/66	10,000.000	16,066.830	
	SPAIN 3.8 04/30/24	20,000.000	23,438.540	
	SPAIN 4.2 01/31/37	10,000.000	15,361.850	
	SPAIN 4.65 07/30/25	20,000.000	25,207.820	
	SPAIN 4.7 07/30/41	10,000.000	17,073.750	
	SPAIN 4.9 07/30/40	10,000.000	17,242.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	30,000.000	42,525.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	10,000.000	18,645.170	
	SPAIN 5.4 01/31/23	20,000.000	23,557.080	
	SPAIN 5.75 07/30/32	10,000.000	16,309.730	
	SPAIN 5.85 01/31/22	30,000.000	33,991.020	
	SPAIN 5.9 07/30/26	20,000.000	27,624.660	
	SPAIN 6.0 01/31/29	30,000.000	45,253.290	
	ユーロ 小計	2,730,000.000 (332,350,200)	3,374,021.140 (410,753,334)	
南アフリカ・ラ ンド	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	330,000.000	234,005.930	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	400,000.000	275,204.720	

	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	340,000.000	294,576.900	
	南アフリカ・ランド 小計	1,070,000.000 (8,067,800)	803,787.550 (6,060,558)	
国債証券 合計		934,936,400 (934,936,400)	1,069,102,024 (1,069,102,024)	
合計			1,069,102,024 (1,069,102,024)	

(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 79銘柄	47.57	49.13
イギリス・ポンド	国債証券 22銘柄	5.75	5.94
オーストラリア・ドル	国債証券 10銘柄	1.72	1.78
カナダ・ドル	国債証券 10銘柄	1.48	1.53
シンガポール・ドル	国債証券 4銘柄	0.32	0.33
スウェーデン・クローナ	国債証券 4銘柄	0.27	0.28
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	0.56	0.58
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	0.27	0.28
ポーランド・ズロチ	国債証券 4銘柄	0.47	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券 4銘柄	0.66	0.68
ユーロ	国債証券 131銘柄	37.20	38.42
南アフリカ・ランド	国債証券 3銘柄	0.55	0.57

(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。

グローバル高金利通貨マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和1年12月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,015,382
コール・ローン	10,437,084
特殊債券	4,647,107,333
未収利息	152,914,045
前払費用	30,630,304
流動資産合計	4,842,104,148
資産合計	4,842,104,148
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	4,139,279,103
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	702,825,045
元本等合計	4,842,104,148
純資産合計	4,842,104,148
負債純資産合計	4,842,104,148

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	特殊債券 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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年12月16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	4,846,635,350円
同期中追加設定元本額	796,036円
同期中一部解約元本額	708,152,283円
元本の内訳	
ファンド名	
高金利通貨ファンド	4,130,179,977円
グローバル・ナビ	9,099,126円
計	4,139,279,103円
2. 受益権の総数	4,139,279,103口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年12月16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ぬ。
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ぬ。 (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つた場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
特殊債券	80,251,879
合計	80,251,879

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年3月9日から令和1年12月16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ぬ。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありませぬ。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和1年12月16日現在
1口当たり純資産額	1.1698円
(1万口当たり純資産額)	(11,698円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年12月16日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券	インド・ルピー	ASIAN DEV BANK 5.9 12/20/22	192,000,000.000	190,045,440.000	
		IADB 5.5 08/23/21	58,000,000.000	57,365,480.000	
		IFC 6.45 08/10/20	34,900,000.000	35,017,096.480	
	インド・ルピー	小計	284,900,000.000 (444,444,000)	282,428,016.480 (440,587,706)	
	インドネシア・ルピア	EBRD 6.45 12/13/22	9,000,000,000.000	9,078,300,000.000	
		EBRD 7.5 05/15/22	19,000,000,000.000	19,469,870,000.000	
		EBRD 8.3 10/02/20	18,000,000,000.000	18,341,100,000.000	
		IADB 5.8 09/28/20	10,550,000,000.000	10,456,309,142.500	
	インドネシア・ルピア	小計	56,550,000,000.000 (446,745,000)	57,345,579,142.500 (453,030,075)	
	オーストラリア・ドル	EIB 2.8 01/15/21	2,850,000.000	2,904,150.000	
		IFC 5.75 07/28/20	960,000.000	987,780.280	
	オーストラリア・ドル	小計	3,810,000.000 (286,778,700)	3,891,930.280 (292,945,592)	
	トルコ・リラ	EBRD 24.0 09/10/21	5,500,000.000	6,505,372.500	
		EBRD 24.0 10/05/22	6,500,000.000	8,336,250.000	
		EBRD 27.5 09/18/20	10,500,000.000	11,657,184.000	
		IADB 26.5 10/25/21	3,500,000.000	4,309,025.000	
	トルコ・リラ	小計	26,000,000.000 (489,840,000)	30,807,831.500 (580,419,545)	
	ブラジル・リアル	EIB 7.5 04/13/22	1,500,000.000	1,604,850.000	
		IBRD 8.0 01/31/22	2,500,000.000	2,686,125.000	
		IFC 8.25 01/30/23	15,500,000.000	17,009,390.000	
	ブラジル・リアル	小計	19,500,000.000 (519,285,000)	21,300,365.000 (567,228,720)	
	ポーランド・ズロチ	EIB 2.25 05/25/21	10,500,000.000	10,627,995.000	
		IBRD 1.5 07/31/20	6,762,000.000	6,760,647.600	
ポーランド・ズロチ	小計	17,262,000.000 (490,586,040)	17,388,642.600 (494,185,223)		
メキシコ・ペソ	EIB 4.75 01/19/21	68,000,000.000	67,005,160.000		
	EIB 5.5 01/23/23	18,100,000.000	17,734,742.000		
	EIB 7.625 01/12/22	21,500,000.000	21,779,500.000		
メキシコ・ペソ	小計	107,600,000.000 (618,700,000)	106,519,402.000 (612,486,562)		
ロシア・ルーブル	ASIAN DEV BANK 7.0 03/14/22	25,000,000.000	25,842,500.000		



		IFC 11.0 01/21/20	156,500,000.000	157,155,735.000	
		IFC 6.375 04/11/22	176,000,000.000	180,593,600.000	
	ロシア・ルーブル	小計	357,500,000.000 (622,050,000)	363,591,835.000 (632,649,791)	
	南アフリカ・ランド	EIB 8.375 07/29/22	42,500,000.000	44,338,550.000	
		EIB 9.0 03/31/21	30,880,000.000	31,732,288.000	
	南アフリカ・ランド	小計	73,380,000.000 (553,285,200)	76,070,838.000 (573,574,119)	
特殊債券	合計		4,471,713,940 (4,471,713,940)	4,647,107,333 (4,647,107,333)	
合計				4,647,107,333 (4,647,107,333)	

(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 (%)
インド・ルピー	特殊債券 3銘柄	9.10	9.48
インドネシア・ルピア	特殊債券 4銘柄	9.36	9.75
オーストラリア・ドル	特殊債券 2銘柄	6.05	6.30
トルコ・リラ	特殊債券 4銘柄	11.99	12.49
ブラジル・リアル	特殊債券 3銘柄	11.71	12.21
ポーランド・ズロチ	特殊債券 2銘柄	10.21	10.63
メキシコ・ペソ	特殊債券 3銘柄	12.65	13.18
ロシア・ルーブル	特殊債券 3銘柄	13.07	13.61
南アフリカ・ランド	特殊債券 2銘柄	11.85	12.34

(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J-REITマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和1年12月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,229,681
投資証券	2,348,650,320
未収配当金	14,269,143
流動資産合計	2,377,149,144
資産合計	2,377,149,144
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	1,103,895,941
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,273,253,203
元本等合計	2,377,149,144
純資産合計	2,377,149,144
負債純資産合計	2,377,149,144

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年12月16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	1,287,527,799円
同期中追加設定元本額	161,768,846円
同期中一部解約元本額	345,400,704円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	308,546,790円
グローバル・ナビ	4,659,241円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	790,689,910円
計	1,103,895,941円
2. 受益権の総数	1,103,895,941口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年12月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	158,186,249
合計	158,186,249

(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10月22日から令和1年12月16日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和1年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1534円 (21,534円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年12月16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	31	4,175,700	
	GLP投資法人	544	73,712,000	
	MCUBS MidCity投 資法人	280	31,724,000	
	Oneリート投資法人	34	11,577,000	
	いちごオフィスリート投資法人	169	18,218,200	
	いちごホテルリート投資法人	36	4,744,800	
	さくら総合リート投資法人	47	4,610,700	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	109	57,988,000	
	アドバンス・レジデンス投資法 人	207	69,448,500	
	イオンリート投資法人	236	34,196,400	
	インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人	1,404	28,964,520	
	インヴィンシブル投資法人	958	58,917,000	
	エスコンジャパンリート投資法 人	22	2,732,400	
	オリックス不動産投資法人	435	98,527,500	
	グローバル・ワン不動産投資法 人	152	20,596,000	
	ケネディクス・オフィス投資法 人	68	54,196,000	
	ケネディクス・レジデンシャ ル・ネクスト投資法人	136	26,941,600	
	ケネディクス商業リート投資法 人	84	22,486,800	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	91	30,394,000	
	サムティ・レジデンシャル投資 法人	44	4,980,800	
	サンケイリアルエステート投資 法人	32	3,952,000	
	ザイマックス・リート投資法人	32	4,406,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資 法人	704	58,361,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	196	34,692,000	
	ジャパンリアルエステイト投資 法人	219	157,023,000	
	スターアジア不動産投資法人	73	8,468,000	
スターツプロシード投資法人	34	6,711,600		

タカラレーベン不動産投資法人	62	7,607,400	
トーセイ・リート投資法人	48	6,225,600	
ヒューリックリート投資法人	186	35,860,800	
フロンティア不動産投資法人	78	36,036,000	
プレミア投資法人	197	30,397,100	
ヘルスケア&メディカル投資法人	47	6,095,900	
マリモ地方創生リート投資法人	19	2,437,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	491	101,440,600	
ラサールロジポート投資法人	203	31,485,300	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	34	3,906,600	
阪急阪神リート投資法人	99	16,404,300	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	54	24,921,000	
三菱地所物流リート投資法人	43	14,792,000	
産業ファンド投資法人	269	43,120,700	
森トラスト・ホテルリート投資法人	51	7,415,400	
森トラスト総合リート投資法人	156	29,406,000	
森ヒルズリート投資法人	251	44,276,400	
星野リゾート・リート投資法人	33	18,546,000	
積水ハウス・リート投資法人	639	57,957,300	
大江戸温泉リート投資法人	37	3,374,400	
大和ハウスリート投資法人	295	84,016,000	
大和証券オフィス投資法人	50	40,250,000	
投資法人みらい	237	13,674,900	
東急リアル・エステート投資法人	147	29,135,400	
日本アコモデーションファンド投資法人	73	48,472,000	
日本ビルファンド投資法人	212	167,268,000	
日本プライムリアルティ投資法人	138	65,274,000	
日本プロロジスリート投資法人	314	88,077,000	
日本ヘルスケア投資法人	11	2,253,900	
日本リート投資法人	71	32,660,000	
日本リテールファンド投資法人	413	96,642,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	143	38,238,200	
日本賃貸住宅投資法人	246	24,772,200	
福岡リート投資法人	113	20,453,000	
平和不動産リート投資法人	136	18,047,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	681	124,963,500	
投資証券 合計	12,654	2,348,650,320	
合計		2,348,650,320	

(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。

#### 新光米国REITマザーファンド

##### 貸借対照表

（単位：円）

		令和1年12月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金		2,897,884
コール・ローン		1,173,136
投資証券		688,390,397
未収配当金		1,443,384
流動資産合計		693,904,801
資産合計		693,904,801
<b>負債の部</b>		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		369,050,948
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		324,853,853
元本等合計		693,904,801
純資産合計		693,904,801
負債純資産合計		693,904,801

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年12月16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	435,741,944円
同期中追加設定元本額	848,316円
同期中一部解約元本額	67,539,312円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	363,609,719円
グローバル・ナビ	5,441,229円
計	369,050,948円
2. 受益権の総数	369,050,948口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年12月18日 至 令和1年12月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年12月16日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年12月16日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	38,843,030
合計	38,843,030

(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10月22日から令和1年12月16日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和1年12月16日現在
1口当たり純資産額	1.8802円
(1万口当たり純資産額)	(18,802円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年12月16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	446.000	11,359.620	
		AGREE REALTY CORP	220.000	15,050.200	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	368.000	7,713.280	
		ALEXANDER'S INC.	11.000	3,488.320	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	602.000	94,194.940	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	259.000	11,577.300	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	737.000	33,909.370	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	573.000	7,804.260	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	1,386.000	35,509.320	
		AMERICAN TOWER CORP	2,374.000	504,522.480	
		AMERICOLD REALTY TRUST	1,033.000	34,150.980	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	797.000	40,766.550	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,132.000	17,851.640	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	282.000	5,208.540	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	483.000	1,279.950	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	752.000	156,897.280	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	121.000	1,408.440	
		BOSTON PROPERTIES INC	834.000	112,681.740	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	161.000	1,521.450	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	940.000	13,883.800	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,600.000	33,392.000	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	398.000	7,287.380	
		BRT APARTMENTS CORP	52.000	890.240	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	503.000	52,940.750	
		CARETRUST REIT INC	512.000	10,393.600	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	263.000	3,027.130	
		CBL & ASSOCIATES	909.000	954.450	
CEDAR REALTY TRUST INC	460.000	1,214.400			

CHATHAM LODGING TRUST	246.000	4,494.420	
CITY OFFICE REIT INC	208.000	2,602.080	
CLIPPER REALTY INC	77.000	749.980	
COLONY CAPITAL INC	2,577.000	11,776.890	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	628.000	12,691.880	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	993.000	7,253.860	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	99.000	4,424.310	
CORECIVIC INC	639.000	10,172.880	
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	69.000	3,029.100	
COREPOINT LODGING INC	215.000	2,216.650	
CORESITE REALTY CORP	198.000	21,997.800	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	604.000	16,869.720	
COUSINS PROPERTIES INC	785.000	30,976.100	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2,240.000	297,203.200	
CUBESMART	1,036.000	31,307.920	
CYRUSONE INC	603.000	36,831.240	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,080.000	11,599.200	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,121.000	127,468.910	
DOUGLAS EMMETT INC	894.000	37,896.660	
DUKE REALTY TRUST	1,939.000	66,333.190	
EAST GROUP	199.000	26,369.490	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	422.000	9,566.740	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	797.000	10,894.990	
EPR PROPERTIES	415.000	28,199.250	
EQUINIX INC	453.000	249,983.520	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	935.000	65,309.750	
EQUITY RESIDENTIAL	1,974.000	159,913.740	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	408.000	10,142.880	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	353.000	106,080.030	
EXTRA SPACE STORAGE INC	667.000	68,227.430	
FARMLAND PARTNERS INC	147.000	948.150	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	403.000	51,491.310	
FIRST INDUSTRIAL RT	677.000	27,621.600	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	367.000	9,956.710	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	557.000	4,717.790	

FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	266.000	3,271.800	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,091.000	44,883.740	
GEO GROUP INC	638.000	9,353.080	
GETTY REALTY CORP	179.000	5,833.610	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	164.000	3,660.480	
GLADSTONE LAND CORP	99.000	1,273.140	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	169.000	2,164.890	
GLOBAL NET LEASE INC	453.000	8,996.580	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	686.000	22,137.220	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,099.000	31,816.050	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,654.000	85,591.500	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	187.000	2,647.920	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	550.000	25,371.500	
HOST HOTELS & RESORTS INC	3,904.000	70,076.800	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	819.000	29,090.880	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	483.000	6,621.930	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	348.000	7,060.920	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	62.000	4,584.900	
INVITATION HOMES INC	2,884.000	83,722.520	
IRON MOUNTAIN INC	1,537.000	48,553.830	
JBG SMITH PROPERTIES	659.000	25,674.640	
KILROY REALTY CORP	534.000	43,547.700	
KIMCO REALTY	2,177.000	44,214.870	
KITE REALTY GROUP TRUST	444.000	8,018.640	
LAMAR ADVERTISING CO	459.000	39,345.480	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,229.000	12,953.660	
LIBERTY PROPERTY TRUST	840.000	50,139.600	
LIFE STORAGE INC	250.000	26,047.500	
LTC PROPERTIES INC	211.000	9,305.100	
MACK CALI	465.000	9,569.700	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,655.000	52,754.850	
MID AMERICA	613.000	79,996.500	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	496.000	7,355.680	
NATIONAL HEALTH INVS INC	225.000	17,698.500	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	874.000	45,203.280	

NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	318.000	10,160.100	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	449.000	3,403.420	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	102.000	4,646.100	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	256.000	7,910.400	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	1,152.000	47,266.560	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	83.000	2,304.910	
OUTFRONT MEDIA INC	770.000	19,573.400	
PARAMOUNT GROUP INC	1,086.000	14,726.160	
PARK HOTELS & RESORTS INC	1,286.000	31,802.780	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	698.000	18,252.700	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	372.000	1,979.040	
PHYSICIANS REALTY TRUST	996.000	18,196.920	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	672.000	14,441.280	
POTLATCH CORP	355.000	15,098.150	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	238.000	3,101.140	
PROLOGIS INC	3,391.000	300,239.140	
PS BUSINESS PARKS	107.000	17,821.920	
PUBLIC STORAGE	799.000	164,138.570	
QTS REALTY TRUST INC	294.000	15,082.200	
RAYONIER INC	698.000	22,189.420	
REALTY INCOME CORP	1,718.000	124,555.000	
REGENCY CENTERS CORP	897.000	54,636.270	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	604.000	10,364.640	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,148.000	15,038.800	
RETAIL VALUE INC	80.000	2,880.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	588.000	26,706.960	
RLJ LODGING TRUST	924.000	15,966.720	
RPT REALTY	419.000	6,033.600	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	246.000	20,912.460	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,014.000	20,847.840	
SAFEHOLD INC	57.000	2,224.140	
SAUL CENTERS INC	64.000	3,212.160	
SBA COMMUNICATIONS CORP	605.000	142,465.400	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	1,270.000	9,296.400	

	SERVICE PROPERTIES TRUST	878.000	20,738.360	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,660.000	239,621.000	
	SITE CENTERS CORP	753.000	9,894.420	
	SL GREEN	443.000	39,294.100	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	483.000	23,894.010	
	STAG INDUSTRIAL INC	687.000	20,836.710	
	STORE CAPITAL CORP	1,136.000	42,372.800	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	555.000	6,632.250	
	SUN COMMUNITIES INC	478.000	73,200.920	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,204.000	17,012.520	
	TANGER FACTORY OUTLET	490.000	7,408.800	
	TAUBMAN CENTERS INC	315.000	9,465.750	
	TERRENO REALTY CORP	346.000	18,742.820	
	THE MACERICH COMPANY	762.000	19,850.100	
	UDR INC	1,565.000	72,396.900	
	UMH PROPERTIES INC	192.000	3,064.320	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	69.000	7,948.110	
	URBAN EDGE PROPERTIES	617.000	11,704.490	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	159.000	3,731.730	
	VENTAS INC	2,010.000	111,555.000	
	VEREIT INC	5,697.000	52,127.550	
	VICI PROPERTIES INC	2,491.000	60,606.030	
	VORNADO REALTY TRUST	932.000	60,831.640	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,002.000	3,597.180	
	WASHINGTON REIT	430.000	12,728.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	652.000	19,859.920	
	WELLTOWER INC	2,188.000	172,129.960	
	WEYERHAEUSER CO	4,020.000	119,152.800	
	WHITESTONE REIT	206.000	2,727.440	
	WINTHROP REALTY TRUST- ESCROW	300.000	9.000	
	WP CAREY INC	912.000	70,461.120	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	608.000	12,883.520	
	アメリカ・ドル 小計	131,632.000	6,290,691.740 (688,390,397)	
投資証券 合計		131,632	688,390,397 (688,390,397)	
合計			688,390,397 (688,390,397)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資証券 164銘柄	99.21	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。



- ( 1 ) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- ( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(令和1年12月17日から令和2年6月16日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【グローバル・ナビ】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 令和1年12月16日現在	第7期中間計算期間末 令和2年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	2,662	-
コール・ローン	11,828,901	10,772,796
投資信託受益証券	10,825,598	10,193,651
親投資信託受益証券	188,687,785	179,326,554
未収配当金	-	85,557
流動資産合計	211,344,946	200,378,558
資産合計	211,344,946	200,378,558
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	56,033	54,536
未払委託者報酬	1,535,741	1,495,256
その他未払費用	4,173	3,865
流動負債合計	1,595,947	1,553,657
負債合計	1,595,947	1,553,657
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	170,479,099	168,369,124
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	39,269,900	30,455,777
（分配準備積立金）	24,424,845	24,049,864
元本等合計	209,748,999	198,824,901
純資産合計	209,748,999	198,824,901
負債純資産合計	211,344,946	200,378,558

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 自 平成30年12月18日 至 令和1年6月17日	第7期中間計算期間 自 令和1年12月17日 至 令和2年6月16日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	164,422	301,531
有価証券売買等損益	6,727,871	6,655,195
為替差損益	430,953	188,612
<b>営業収益合計</b>	<b>6,461,340</b>	<b>6,542,276</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,666	2,360
受託者報酬	55,929	54,536
委託者報酬	1,532,413	1,495,256
その他費用	171,560	202,693
<b>営業費用合計</b>	<b>1,763,568</b>	<b>1,754,845</b>
営業利益又は営業損失( )	4,697,772	8,297,121
経常利益又は経常損失( )	4,697,772	8,297,121
中間純利益又は中間純損失( )	4,697,772	8,297,121
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	300,907	2,761
期首剰余金又は期首欠損金( )	26,125,219	39,269,900
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>78,446</b>	<b>89,362</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	78,446	89,362
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>1,627,192</b>	<b>603,603</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,627,192	603,603
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金( )	28,973,338	30,455,777

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第7期中間計算期間	
	自 令和1年12月17日	至 令和2年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所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。</p> <p>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。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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。</p> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年12月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を令和1年12月16日、当中間計算期間末日を令和2年6月16日としております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期中間計算期間末
	令和1年12月16日現在	令和2年6月16日現在
1. 期首元本額	185,467,996円	170,479,099円
期中追加設定元本額	1,025,105円	510,638円
期中一部解約元本額	16,014,002円	2,620,613円
2. 受益権の総数	170,479,099口	168,369,124口

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第6期中間計算期間 自 平成30年12月18日 至 令和1年6月17日	第7期中間計算期間 自 令和1年12月17日 至 令和2年6月16日
1. その他費用	-	その他費用の内訳は、監査費用（3,865円）、保管費用（198,828円）となっております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 令和1年12月16日現在	第7期中間計算期間末 令和2年6月16日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間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。	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

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第6期 令和1年12月16日現在	第7期中間計算期間末 令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2304円 (12,304円)	1,1809円 (11,809円)

(参考)

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」受益証券、「新光外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「新光日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「海外国債マザーファンド」受益証券、「新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)」受益証券、「グローバル高金利通貨マザーファンド」受益証券、「新光」-REIT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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親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6月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	56,639,386
株式	2,319,207,130
未収配当金	18,748,672
前払金	3,960,000
流動資産合計	2,398,555,188
資産合計	2,398,555,188
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,521,320
未払解約金	9,667,000
流動負債合計	11,188,320
負債合計	11,188,320
純資産の部	
元本等	
元本	1,096,017,359
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,291,349,509
元本等合計	2,387,366,868
純資産合計	2,387,366,868
負債純資産合計	2,398,555,188

## 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12月17日 至 令和2年6月16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6月16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	1,338,753,892円
同期中追加設定元本額	92,574,414円
同期中一部解約元本額	335,310,947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	223,982,143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)	77,618,688円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	378,398,163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)	21,605,138円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	33,786,899円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	14,251,434円
グローバル・ナビ	18,387,906円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,947,636円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	13,159,047円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	1,438,247円
計	1,096,017,359円
2. 受益権の総数	1,096,017,359口
3. 差入代用有価証券	
株式	148,453,950円



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年6月16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。

## （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6月16日現在			
	契約額等（円）	うち		評価損益（円）
		1年超	時価（円）	
市場取引 先物取引 買建	64,800,000	-	63,280,000	1,520,000
合計	64,800,000	-	63,280,000	1,520,000

## （注）時価の算定方法

## 株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。  
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。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額	2,1782円
(1万口当たり純資産額)	(21,782円)

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6月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,560,958
コール・ローン	6,032,685
株式	1,874,306,458
投資信託受益証券	3,184,024
投資証券	46,322,310
派生商品評価勘定	1,302,946
未収入金	3,797
未収配当金	2,419,938
差入委託証拠金	90,819,488
流動資産合計	2,037,952,604
資産合計	2,037,952,604
負債の部	
流動負債	
未払解約金	9,000
流動負債合計	9,000
負債合計	9,000
純資産の部	
元本等	
元本	831,832,828
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,206,110,776
元本等合計	2,037,943,604
純資産合計	2,037,943,604
負債純資産合計	2,037,952,604

## 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12月17日 至 令和2年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年6月16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	979,392,436円
同期中追加設定元本額	135,081,560円
同期中一部解約元本額	282,641,168円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	272,221,766円
新光外国株式インデックスVA	378,166,377円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	131,073,214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）	6,410,845円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	19,482,803円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	12,269,700円
グローバル・ナビ	12,208,123円
計	831,832,828円
2. 受益権の総数	831,832,828口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年6月16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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

## (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6月16日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	111,710,177	-		113,013,123	1,302,946
合計	111,710,177	-		113,013,123	1,302,946

## (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ではありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額	2.4499円
(1万口当たり純資産額)	(24,499円)

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6月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	112,473,034
国債証券	6,128,811,600
地方債証券	826,060,160
特殊債券	730,673,000
社債券	510,823,000
未収利息	20,967,278
前払費用	810,073
流動資産合計	8,330,618,145
資産合計	8,330,618,145
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	6,477,234,981
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,853,383,164
元本等合計	8,330,618,145
純資産合計	8,330,618,145
負債純資産合計	8,330,618,145

## 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12月17日 至 令和2年6月16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6月16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	6,938,461,315円
同期中追加設定元本額	547,658,505円
同期中一部解約元本額	1,008,884,839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	245,890,045円
新光7資産バランスファンド	453,383,806円
日本債券ファンド	5,100,838,218円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	509,074,002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）	36,370,535円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	71,327,669円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	37,418,651円
グローバル・ナビ	22,932,055円
計	6,477,234,981円
2. 受益権の総数	6,477,234,981口



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年6月16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。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額	1,2861円
（1万口当たり純資産額）	（12,861円）

海外国債マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

令和2年6月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	18,732,829
コール・ローン	166,692,684
国債証券	17,281,554,836
未収利息	80,525,354
前払費用	7,222,007
流動資産合計	17,554,727,710
資産合計	17,554,727,710
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	7,098,801,463
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	10,455,926,247
元本等合計	17,554,727,710
純資産合計	17,554,727,710
負債純資産合計	17,554,727,710

## 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12月17日 至 令和2年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年6月16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	7,644,675,360円
同期中追加設定元本額	8,467,525円
同期中一部解約元本額	554,341,422円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	5,219,415,686円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	945,449,254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）	22,006,615円
海外国債ファンド（変額年金）	669,537,716円
グローバル・ナビ	12,036,030円
計	7,098,801,463円
2. 受益権の総数	7,098,801,463口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年6月16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。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額	2,4729円
（1万口当たり純資産額）	（24,729円）

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

## 貸借対照表

(単位:円)

令和2年6月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	18,509,283
コール・ローン	1,743,945
国債証券	303,376,406
派生商品評価勘定	590,007
未収利息	1,815,457
前払費用	126,565
差入委託証拠金	1,923
流動資産合計	326,163,586
資産合計	326,163,586
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,695,440
未払金	31,538
流動負債合計	2,726,978
負債合計	2,726,978
純資産の部	
元本等	
元本	219,043,573
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	104,393,035
元本等合計	323,436,608
純資産合計	323,436,608
負債純資産合計	326,163,586

## 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12月17日 至 令和2年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年6月16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	775,797,780円
同期中追加設定元本額	9,119,195円
同期中一部解約元本額	565,873,402円
元本の内訳	
ファンド名	
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	95,278,484円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	77,695,134円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	32,739,759円
グローバル・ナビ	13,330,196円
計	219,043,573円
2. 受益権の総数	219,043,573口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年6月16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。

(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6月16日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	321,026,804	-	323,132,237	2,105,433
アメリカ・ドル	153,884,059	-	153,299,557	584,502
イギリス・ポンド	20,264,044	-	20,627,666	363,622
オーストラリア・ドル	6,039,789	-	6,300,320	260,531
カナダ・ドル	5,990,886	-	6,093,556	102,670
シンガポール・ドル	1,447,537	-	1,466,990	19,453
スウェーデン・クローナ	992,696	-	1,004,276	11,580
デンマーク・クローネ	1,665,950	-	1,690,752	24,802
ノルウェー・クローネ	986,209	-	1,003,920	17,711
ポーランド・ズロチ	2,048,857	-	2,097,786	48,929
メキシコ・ペソ	2,704,992	-	2,699,487	5,505
ユーロ	125,001,785	-	126,847,927	1,846,142
合計	321,026,804	-	323,132,237	2,105,433

(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。

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。

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ではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.4766円
(1万口当たり純資産額)	(14,766円)



## グローバル高金利通貨マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年6月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,028,534
コール・ローン	14,998,951
特殊債券	3,767,017,359
未収利息	146,963,195
前払費用	13,741,023
流動資産合計	3,951,749,062
資産合計	3,951,749,062
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	3,705,683,004
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	246,066,058
元本等合計	3,951,749,062
純資産合計	3,951,749,062
負債純資産合計	3,951,749,062

## 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12月17日 至 令和2年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	特殊債券 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。
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6月16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	4,139,279,103円
同期中追加設定元本額	569,140円
同期中一部解約元本額	434,165,239円
元本の内訳	
ファンド名	
高金利通貨ファンド	3,696,312,744円
グローバル・ナビ	9,370,260円
計	3,705,683,004円
2. 受益権の総数	3,705,683,004口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年6月16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。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.0664円
（1万口当たり純資産額）	（10,664円）

## 新光J-REITマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年6月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,073,007
投資証券	1,504,294,230
未収配当金	8,916,312
流動資産合計	1,519,283,549
資産合計	1,519,283,549
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,915,000
流動負債合計	1,915,000
負債合計	1,915,000
純資産の部	
元本等	
元本	848,245,426
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	669,123,123
元本等合計	1,517,368,549
純資産合計	1,517,368,549
負債純資産合計	1,519,283,549

## 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12月17日 至 令和2年6月16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6月16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	1,103,895,941円
同期中追加設定元本額	105,586,072円
同期中一部解約元本額	361,236,587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	5,632,773円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	488,581,112円
計	848,245,426円
2. 受益権の総数	848,245,426口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年6月16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。

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額	1,7888円
(1万口当たり純資産額)	(17,888円)

## 新光米国REITマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年6月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,710,692
コール・ローン	1,505,327
投資証券	651,481,357
未収配当金	1,430,587
流動資産合計	657,127,963
資産合計	657,127,963
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	385,299,172
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	271,828,791
元本等合計	657,127,963
純資産合計	657,127,963
負債純資産合計	657,127,963

## 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12月17日 至 令和2年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年6月16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	369,050,948円
同期中追加設定元本額	97,982,504円
同期中一部解約元本額	81,734,280円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	379,226,578円
グローバル・ナビ	6,072,594円
計	385,299,172円
2. 受益権の総数	385,299,172口



## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年6月16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。

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和2年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.7055円
(1万口当たり純資産額)	(17,055円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

令和2年6月30日現在

資産総額	198,054,102円
負債総額	118,805円
純資産総額( - )	197,935,297円
発行済数量	168,454,195口
1口当たり純資産額( / )	1.1750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6月30日現在

資産総額	2,338,103,022円
負債総額	2,071,579円
純資産総額( - )	2,336,031,443円
発行済数量	1,094,961,319口
1口当たり純資産額( / )	2.1334円

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和2年6月30日現在

資産総額	2,014,529,848円
負債総額	612円
純資産総額( - )	2,014,529,236円
発行済数量	818,194,426口
1口当たり純資産額( / )	2.4622円

新光日本債券インデックスマザーファンド

令和2年6月30日現在

資産総額	8,478,100,433円
負債総額	70,888,600円
純資産総額( - )	8,407,211,833円
発行済数量	6,548,580,226口
1口当たり純資産額( / )	1.2838円

海外国債マザーファンド

令和2年6月30日現在

資産総額	17,523,595,141円
負債総額	0円
純資産総額( - )	17,523,595,141円
発行済数量	7,057,157,158口
1口当たり純資産額( / )	2.4831円

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

令和2年6月30日現在

資産総額	324,701,750円
負債総額	1,720,614円
純資産総額( - )	322,981,136円
発行済数量	217,550,661口
1口当たり純資産額( / )	1.4846円

## グローバル高金利通貨マザーファンド

令和2年6月30日現在

資産総額	3,923,379,338円
負債総額	0円
純資産総額( - )	3,923,379,338円
発行済数量	3,705,740,180口
1口当たり純資産額( / )	1.0587円

## 新光J-REITマザーファンド

令和2年6月30日現在

資産総額	1,464,037,340円
負債総額	4,882,240円
純資産総額( - )	1,459,155,100円
発行済数量	833,144,987口
1口当たり純資産額( / )	1.7514円

## 新光米国REITマザーファンド

令和2年6月30日現在

資産総額	631,904,067円
負債総額	5,683円
純資産総額( - )	631,898,384円
発行済数量	384,943,974口
1口当たり純資産額( / )	1.6415円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

### (7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2020年6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6月30日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。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6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	1,323,999,246,050
追加型株式投資信託	858	13,221,868,526,595
単位型公社債投資信託	36	92,360,845,213
単位型株式投資信託	186	1,190,816,034,444
合計	1,106	15,829,044,652,302

### 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		
建物	1,461,316	1,278,455
1 建物	1,096,916	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		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
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		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
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				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			-	51,753	51,753
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			利益準備金	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		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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
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あります。

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あります。

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あります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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おります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

#### （4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第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 其他有価証券	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 其他有価証券	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)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第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、記載していません。

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

(注)非上場株式(貸借対照表計上額276,764千円)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			
株式	-	-	-
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			
株式	-	-	-
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	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
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

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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



## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

	第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

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第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	-	-
子 会 社	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
								子会社株式 の取得	10,294,840	未払 手数料	1,231,431
子 会 社	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) 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
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。
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。

(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

「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【その他】

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

## 独立監査人の監査報告書

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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

令和2年1月24日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・ナビの平成30年12月18日から令和1年12月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・ナビの令和1年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

令和2年7月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・ナビの令和1年12月17日から令和2年6月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・ナビの令和2年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和1年12月17日から令和2年6月16日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。