

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年7月20日提出
【計算期間】	第29特定期間(自 2020年10月21日至 2021年4月20日)
【ファンド名】	新光7資産バランスファンド
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式	年1回	グローバル (含む日本)	ファミリーファンド
一般 大型株 中小型株	年2回	日本	
債券	年4回	北米	ファンド・オブ・ファンズ
一般	年6回（隔月）	欧州	為替ヘッジ
公債 社債	年12回（毎月）	アジア	
その他債券 クレジット属性 （ ）	日々	オセアニア	あり（ ）
不動産投信	その他（ ）	中南米	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式一 般、債券一般、不動 産投信)) (資産配分 固定型))		アフリカ	なし
資産複合 （ ） 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東（中東） エマージング	

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

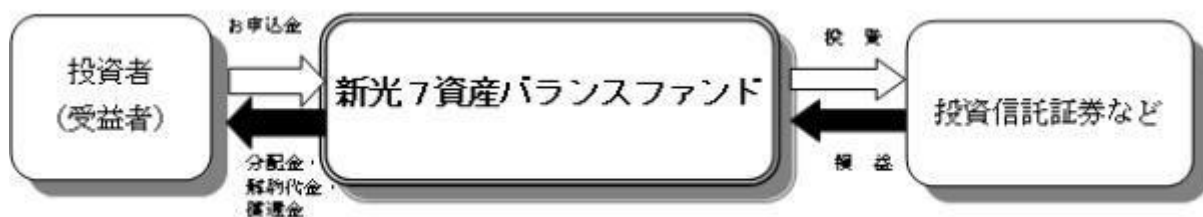
その他資産 （投資信託証券（資産複合 （株式一般、債券一般、不動産投信） （資産配分固定型）））	投資信託証券への投資を通じて、実質的に株式一般、債券一般、不動産投信の複数の資産に投資を行います。 資産配分固定型とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。
年12回（毎月）	目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（含む日本） エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（含む日本）・エマージング地域（複数の新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジなし ^{（注）}	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

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

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

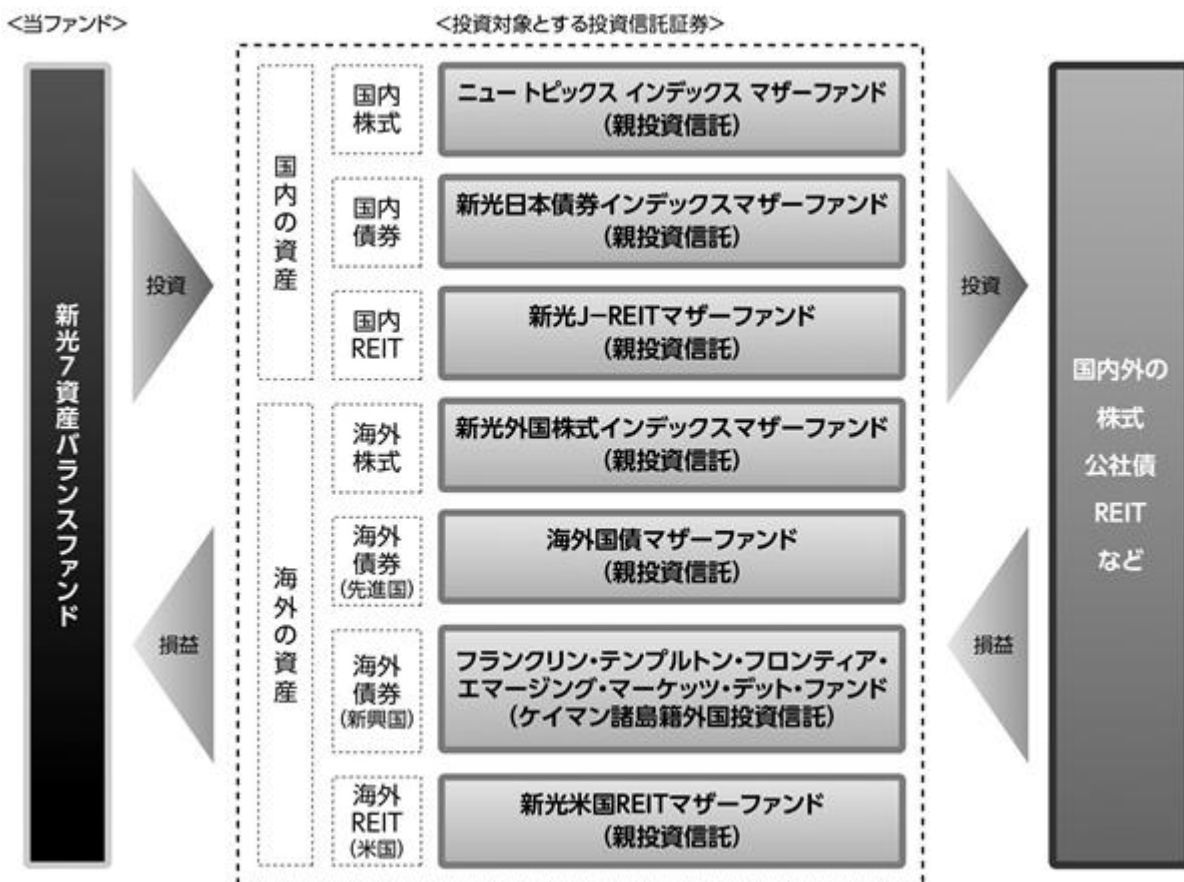
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



b. ファンドの特色

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

- 国内外の、株式、公社債および不動産投資信託証券(以下「REIT」といいます。)に実質的に投資することにより、リスク分散を図りながら、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指すファンド・オブ・ファンズです。
- 投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とします。
- 投資信託証券に含まれる外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。
- フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドへの投資にあたっては、フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッドから投資助言および情報提供を受けます。

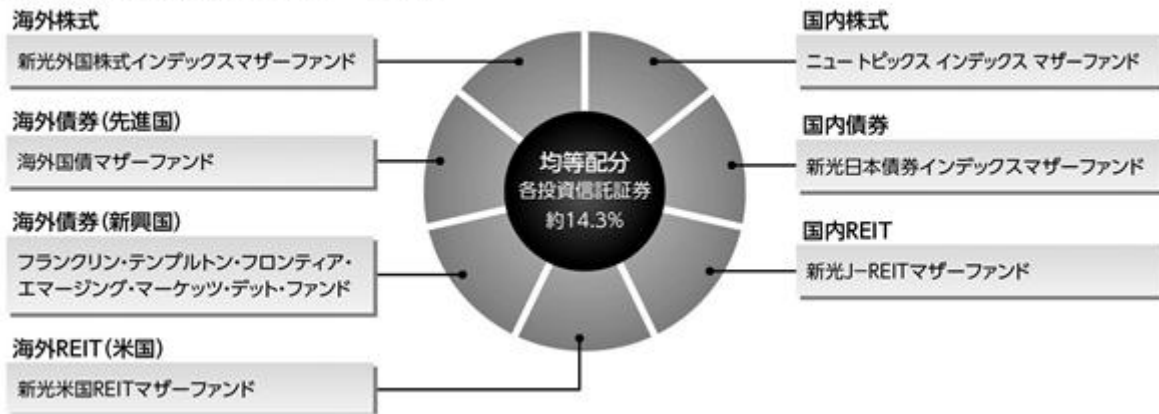


2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

- 基本投資配分比率は、各投資信託証券につき純資産総額に対し約14.3%となります。
- 各投資信託証券の組入比率については、原則として、6ヵ月ごとにチェックを行い、基本投資配分比率に対し±5%の範囲を超過している場合には調整を行います。

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



■ 分配方針

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



- ◆ 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。
- ◆ 分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ◆ 上記にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。
- ◆ 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



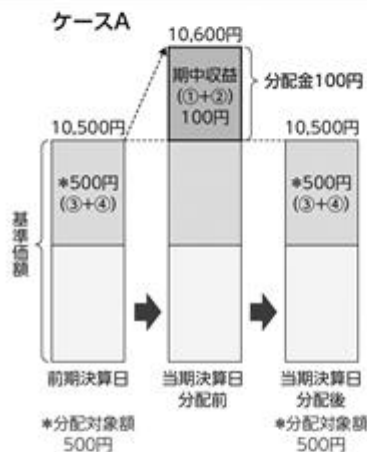
◆分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係(イメージ)

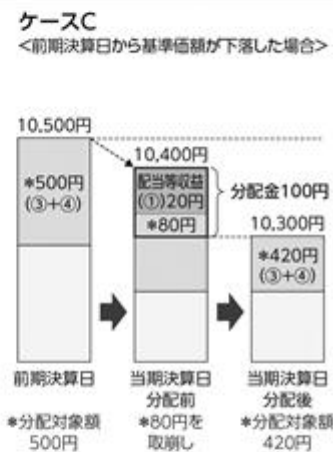
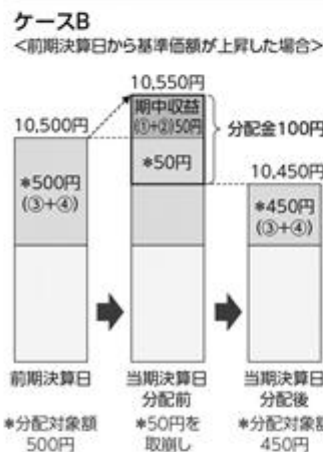
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

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

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

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

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金: 個別元本(投資者(受益者)のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

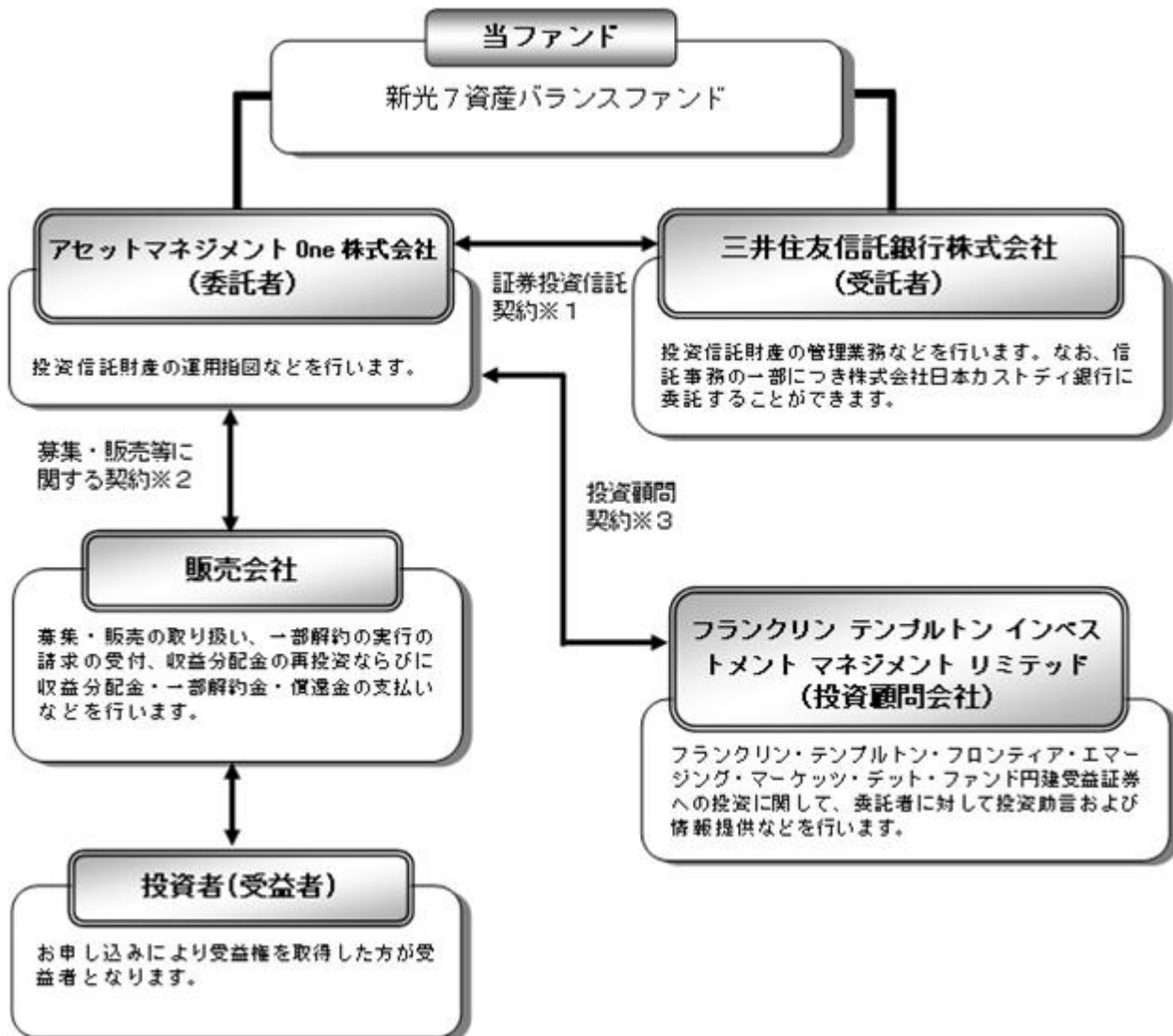
元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(2) 【ファンドの沿革】

2006年10月31日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2021年1月21日	信託期間を2026年10月20日までに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み



1 証券投資信託契約

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

2 募集・販売等に関する契約

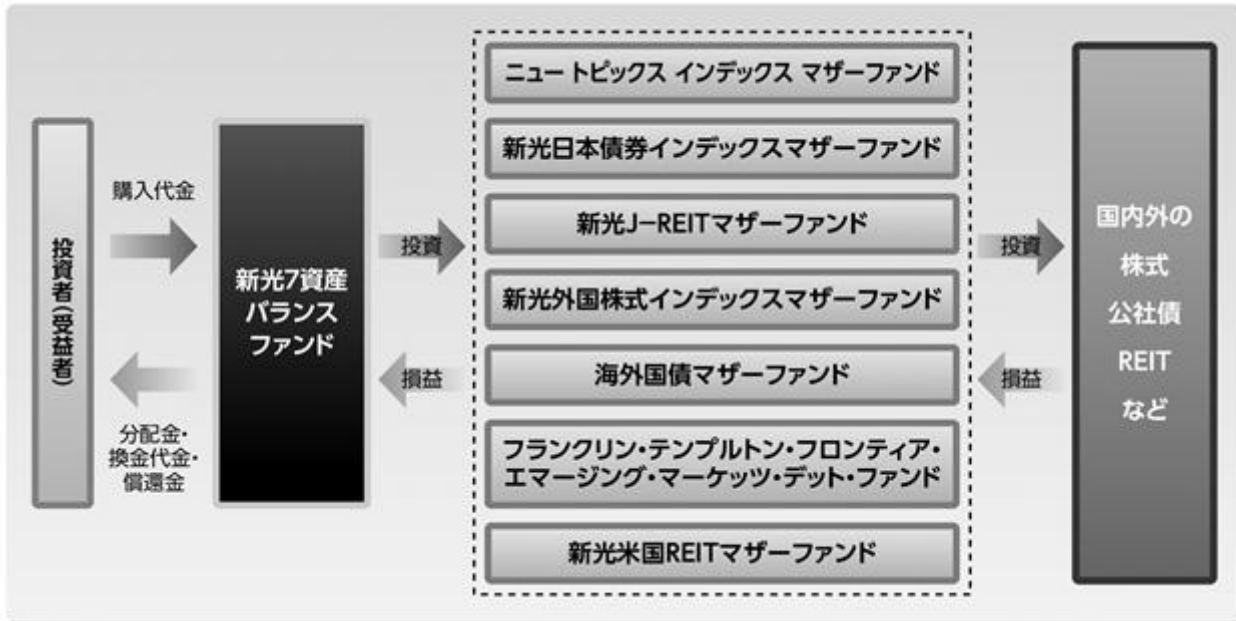
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2021年4月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2021年4月30日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

当ファンドは、投資信託証券を主要投資対象として、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

(2) 【投資対象】

a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

b. 運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

8. コマーシャル・ペーパー

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

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

11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ 東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・ 東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。 ・ 投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。 ・ 資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。 ・ 株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・ 株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式への投資割合には制限を設けません。 ・ 同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年1月14日
収益配分方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2002年1月15日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

東証株価指数について

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

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

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

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

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

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

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

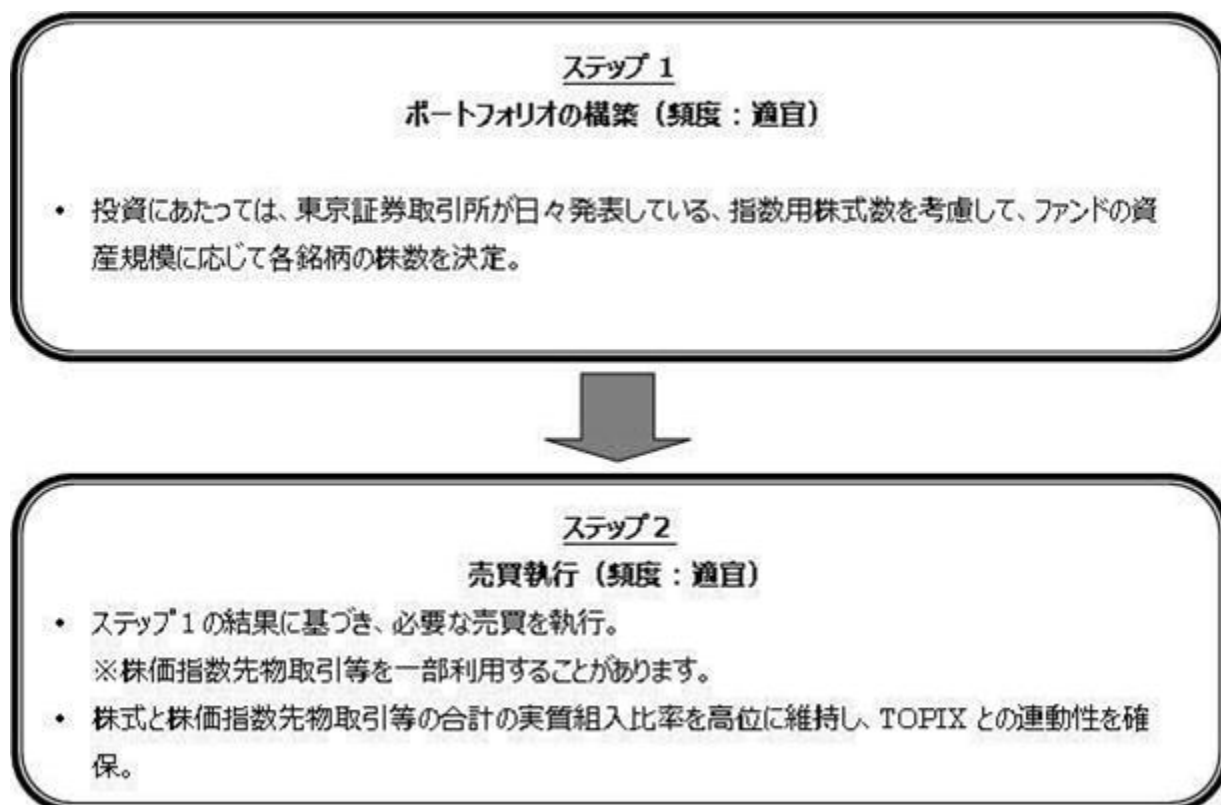
(株)東京証券取引所は、委託会社またはニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

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

運用プロセス

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



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2021年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光日本債券インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限りません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年8月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

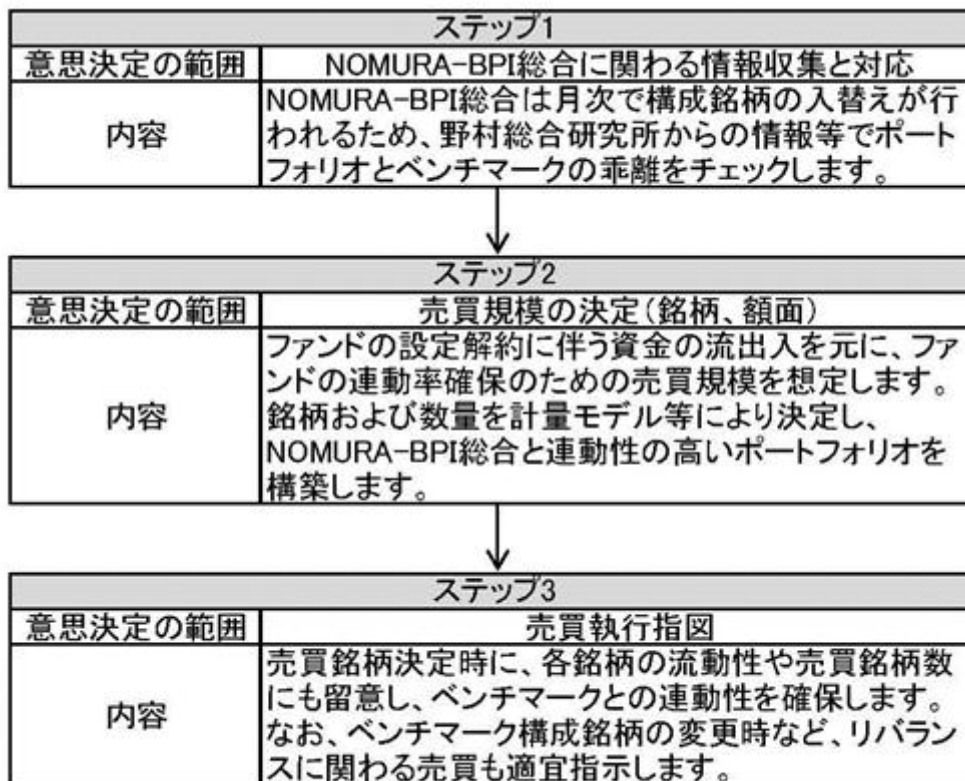
NOMURA - B P I 総合について

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

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

運用プロセス

新光日本債券インデックスマザーファンドは、以下のプロセスにより「NOMURA - 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2021年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光J-REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。 不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>2021年9月16日以降は以下の記載が追加される予定です。</p> <ul style="list-style-type: none"> 不動産投資信託証券の実質組入比率を調整するため、不動産投信指数先物取引を活用する場合があります。 </div>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができます。 外貨建資産への直接投資は行いません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>2021年9月16日以降、以下の通り変更（下線部分が追加）となる予定です。</p> <ul style="list-style-type: none"> 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。）、<u>不動産投信指数先物取引</u>以外には投資を行いません。 <u>不動産投信指数先物取引の利用はヘッジ目的に限定します。</u> </div>
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

東証REIT指数（配当込み）について

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

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

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

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

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

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

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

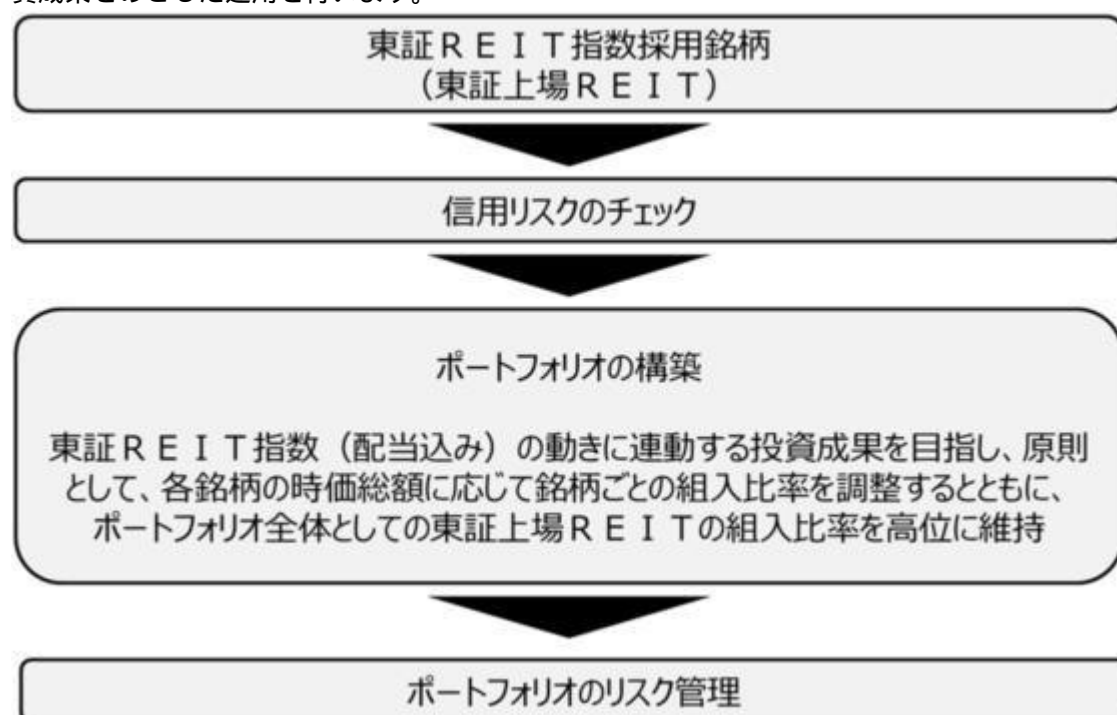
(株)東京証券取引所は、委託会社または新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

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

運用プロセス

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



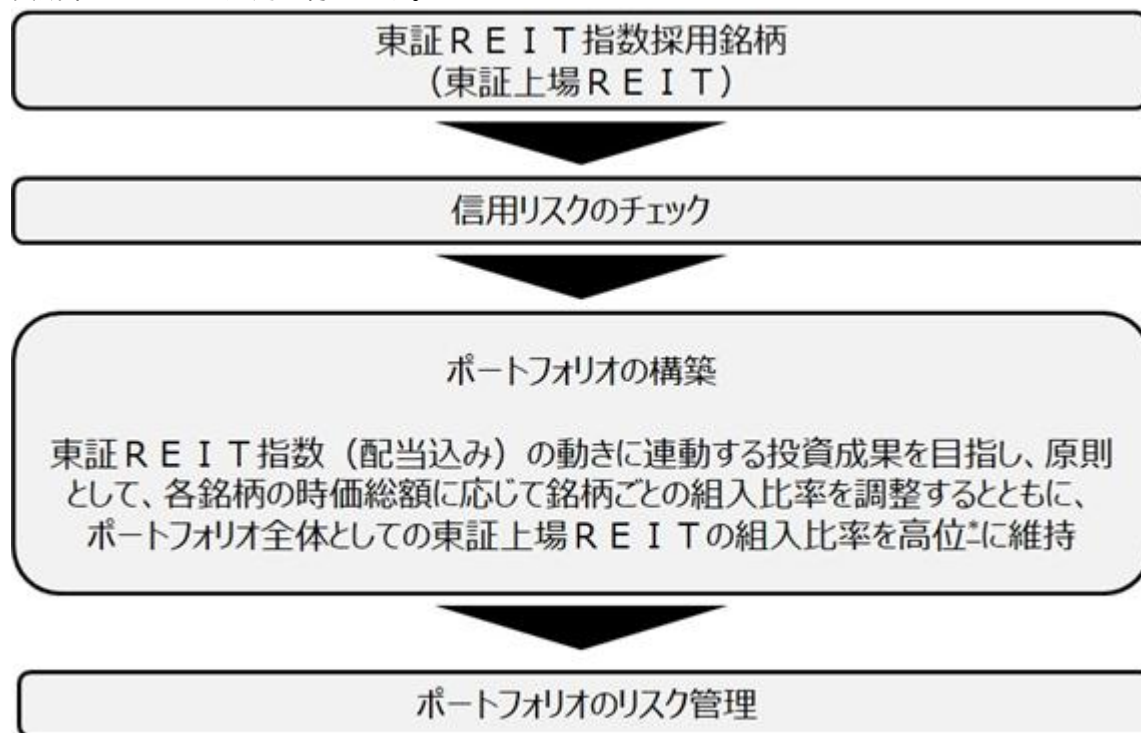
1. 原則として、東証REIT指数採用銘柄をすべてポートフォリオに組入れます。ただし、財務データ分析等に基づき信用リスクをチェックし、信用リスクが高いと判断される銘柄については、東証REIT指数（配当込み）に対する連動性を勘案しつつ、投資対象から除外する場合があります。
2. 東証REIT指数採用銘柄に対して投資を行い、ポートフォリオを構築します。ポートフォリオの構築にあたっては、原則として、各銘柄の時価総額に応じて銘柄ごとの組入比率を調整するとともに、ポートフォリオ全体としての東証上場REIT指数の組入比率（各銘柄の組入比率の合計）を、でき得る限り100%に近づけるよう高位に維持し、東証REIT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

運用プロセスは2021年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

2021年9月16日以降、「運用プロセス」は以下の下線の内容が追加となる予定です。

運用プロセス

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



1. 原則として、東証REIT指数採用銘柄をすべてポートフォリオに組み入れます。ただし、財務データ分析等に基づき信用リスクをチェックし、信用リスクが高いと判断される銘柄については、東証REIT指数（配当込み）に対する連動性を勘案しつつ、投資対象から除外する場合があります。
2. 東証REIT指数採用銘柄に対して投資を行い、ポートフォリオを構築します。ポートフォリオの構築にあたっては、原則として、各銘柄の時価総額に応じて銘柄ごとの組入比率を調整するとともに、ポートフォリオ全体としての東証上場REIT指数の組入比率（各銘柄の組入比率の合計）を、でき得る限り100%に近づけるよう高位^{*}に維持し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。

*不動産投信指数先物取引を一部利用することがあります。

3. 東証REIT指数（配当込み）の動きと新光J-REITマザーファンドの基準価額の値動きの乖離（トラッキングエラー）を日々管理し、修正が必要な場合は速やかにポートフォリオの見直しを実施します。

運用プロセスは今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年8月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

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

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

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

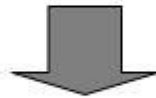
運用プロセス

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

ステップ 1

リスクモニタリング

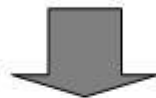
- 計量モデル等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析を実施し、リバランスの必要性を判断。



ステップ 2

ポートフォリオの構築

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



ステップ 3

売買執行

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

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2021年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。 ・日本を除く、FTSE世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。 ・債券ポートフォリオは、日本を除くG7構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6ヵ国）が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。 ・運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。 <ul style="list-style-type: none"> ・通貨アロケーション ・イールドカーブ戦略 ・セクターアロケーション ・デュレーション調整 ・外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得したものに限り、 ・外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月4日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2001年11月5日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

FTSE世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）について

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

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

運用プロセス

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



運用プロセスは2021年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

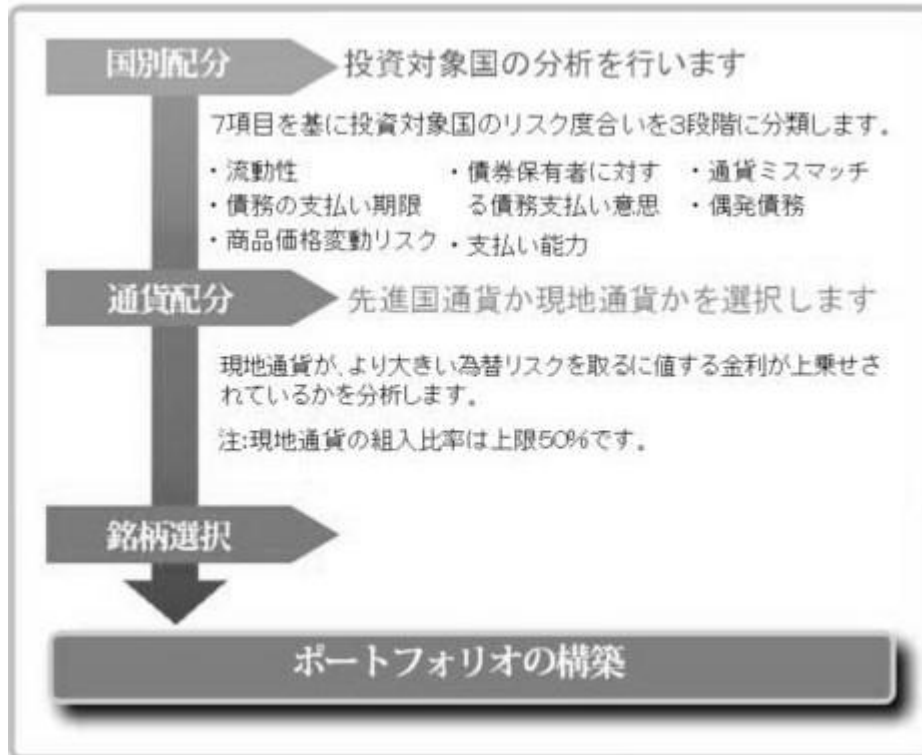
ファンド名	フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、政府保証債は除きます。 ・クレジットリンク債への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・発行体格付けにおいて、ムーディーズ・インベスターズ・サービスまたはS & Pグローバル・レーティングのソブリン信用格付けがC a a 1またはC C C +以下の証券または無格付けの証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。 ・ファンドにおける証券の平均信用格付けは、ムーディーズ・インベスターズ・サービスまたはS & Pグローバル・レーティングの格付けにおいてB 1またはB +以上とします。 ・ファンドにおける証券の平均デュレーションは、8年以下とします。
信託期間	150年
決算日	毎年5月31日
収益分配方針	<p>受託会社は毎月3日（休業日の場合は翌営業日）に受益者に分配金を支払います。当該月次分配にかかわらず、投資顧問会社および管理会社からの通知により受託会社は分配を行う場合があります。</p> <p>分配はネット・インカム収益とネット実現損益の合計の範囲内で行うことができますが、受益者の利益にかなうと判断される場合には純資産から分配を行うこともできます。</p>
信託報酬等	<p>運用報酬 : 純資産総額に対し0.40%</p> <p>その他報酬 : 純資産総額に対し0.15% (上限)</p> <p>その他報酬には、受託会社報酬、管理事務代行会社報酬、保管受託銀行報酬、監査報酬、法的費用が含まれます。</p>
信託設定日	2006年3月8日
関係法人	<p>受託会社兼管理事務代行会社 : B N Y メロン ファンド マネジメント (ケイマン) リミテッド</p> <p>副管理事務代行会社 : ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店</p> <p>保管受託銀行 : ザ バンク オブ ニューヨーク メロン</p> <p>管理会社 : フランクリン テンブルトン インターナショナル サービスーズ エス エー アール エル</p> <p>投資顧問会社 : フランクリン テンブルトン インベストメント マネジメント リミテッド</p>

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（F T I M L 社）は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン・テンプレトン（設立：1947年、運用総資産：約165.9兆円）の一員です。F T I M L 社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2021年3月末現在、1米ドル = 110.71円で換算

運用プロセス



出所：F T I M L 社資料を基にアセットマネジメントOne作成

運用プロセスは2021年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光米国REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。 ・REITの組入比率は原則として高位を保ちます。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・REITおよび短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 ・REITへの投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

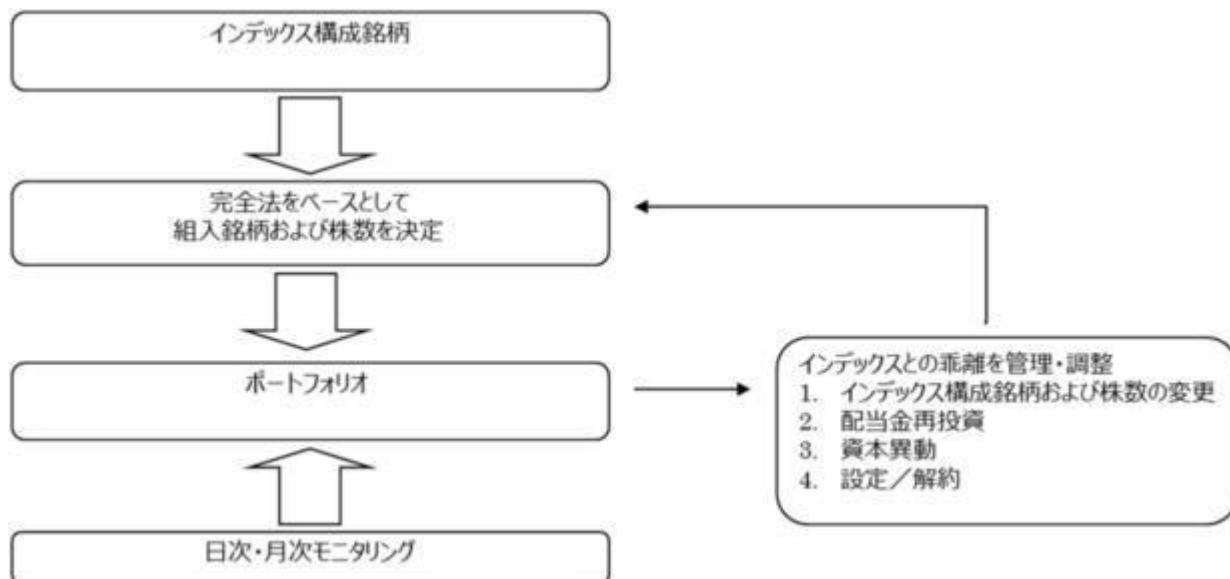
FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスについて

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

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

運用プロセス

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



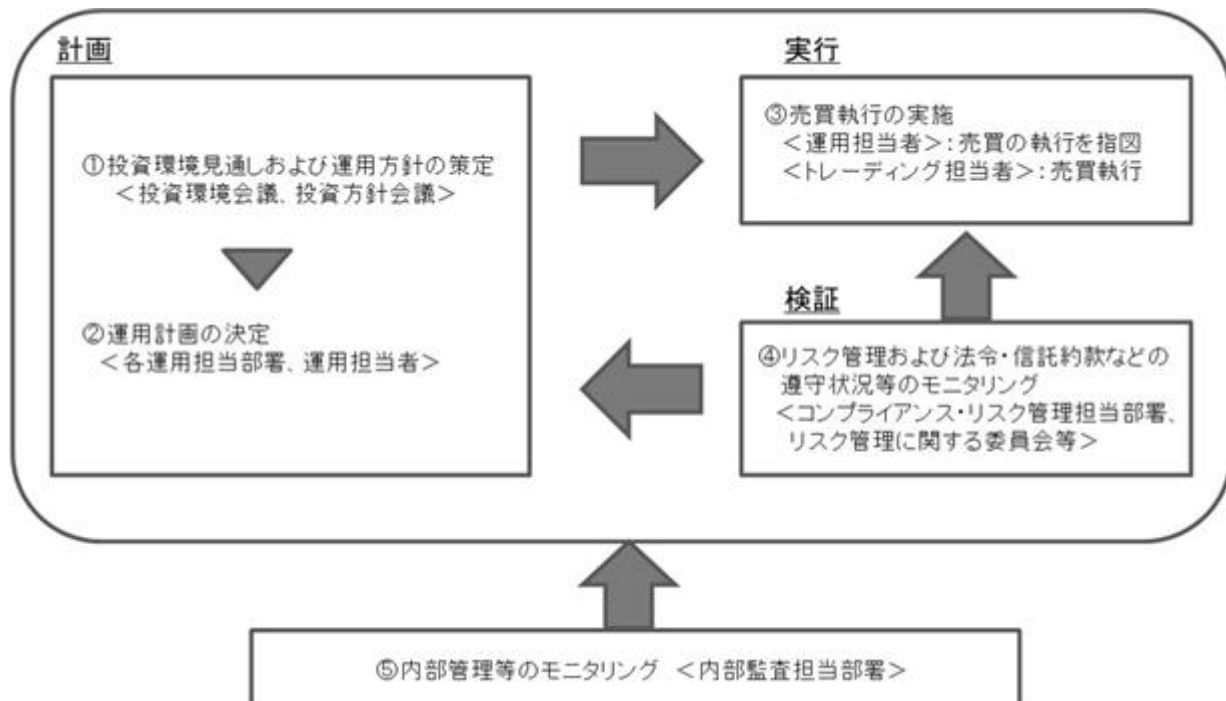
運用プロセスは2021年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は2021年7月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



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2021年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

- a. 収益分配は原則として、毎月20日(該当日が休業日の場合は翌営業日。)の決算時に以下の方針に基づき収益の分配を行います。
1. 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みません。)等の全額とします。
 2. 分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
 3. 上記2.にかかわらず、上記2.にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。
 4. 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。
- b. 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
1. 分配金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- c. 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- d. 「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払われます。
- 「分配金再投資コース」の受益者の分配金は、税金を差し引いた後、別に定める契約に基づき、全額再投資されます。

(5) 【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c. 公社債の借り入れ

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

- (ロ) 借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 借入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。
- d. 同一銘柄の投資信託証券への投資制限
- 委託者は、原則として、投資信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- e. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券(外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。)への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- f. 外国為替予約の指図
- 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産(外貨建有価証券、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。以下同じ。)について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- g. 資金の借入れ
- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

h. 受託者の自己または利害関係人等との取引

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

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

i. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

j. 信用リスク集中回避のための投資制限

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

k. ファンドの投資制限

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

a. 資産配分リスク

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

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

b. 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

c. REITの価格変動リスク

REITの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

d. 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

e. カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制などの要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。これらの影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

一般に新興国市場は、先進国市場に比べて規模が小さく、流動性も低く、金融インフラが未発達であり、様々な地政学的問題を抱えていることから、カントリーリスクはより高くなる可能性があります。

f. 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

g. 信用リスク

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

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

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

h. 流動性リスク

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

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

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

i. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- (ロ) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- (ハ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ニ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ホ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。
- (ヘ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入る有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。

(ト) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。

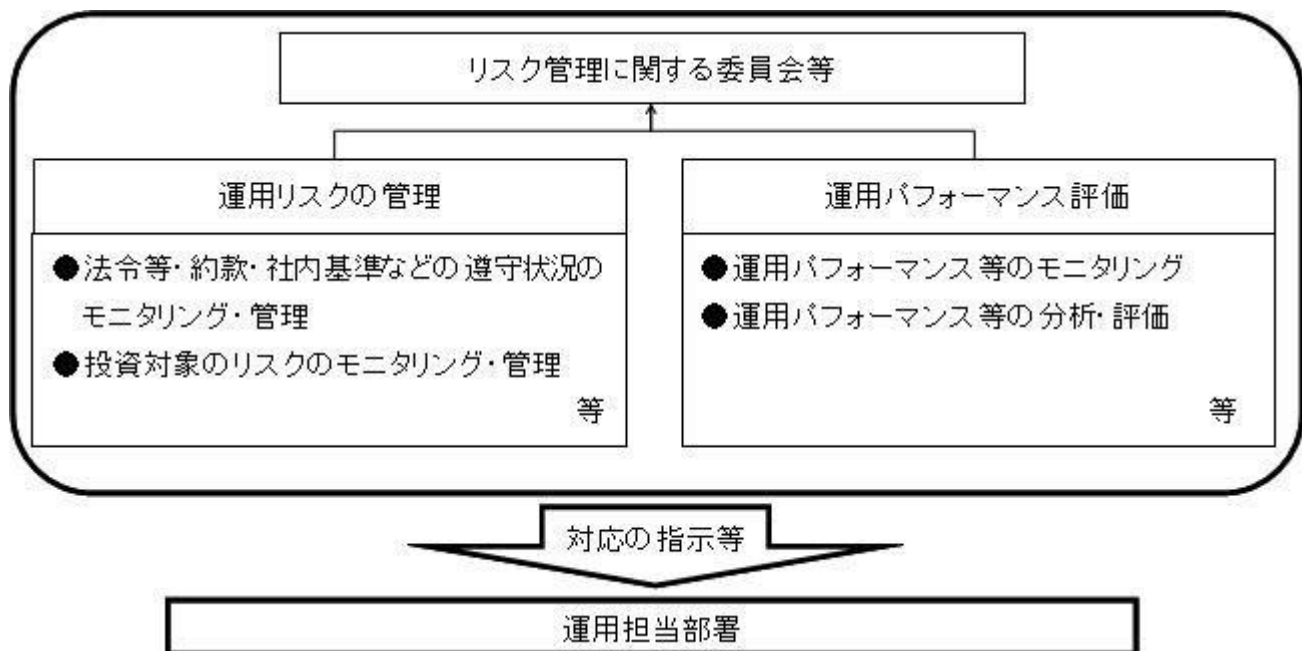
(チ) 投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券（ベビーファンド）が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券（ベビーファンド）の価額が変動する可能性があります。

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

(2) リスク管理体制

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

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



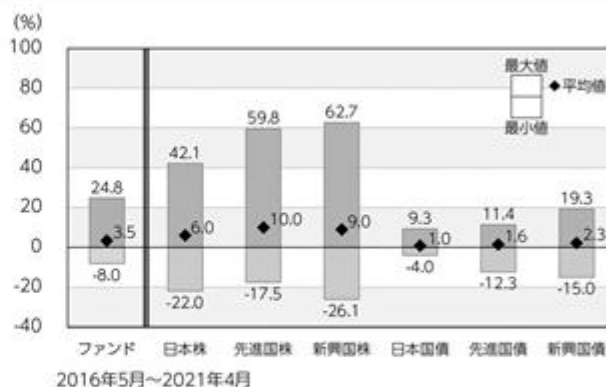
リスク管理体制は2021年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

*すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

b. 信託財産留保額

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

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

(3) 【信託報酬等】

<p>ファンド</p>	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.045%（税抜0.95%） 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。 運用管理費用（信託報酬）の配分は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。</p> <table border="1" data-bbox="379 436 1364 969"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円未満の部分</td> <td>年率0.42%</td> <td>年率0.45%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>300億円以上 500億円未満の部分</td> <td>年率0.37%</td> <td>年率0.50%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>500億円以上の部分</td> <td>年率0.32%</td> <td>年率0.55%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table> <p>委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド）に対する投資顧問報酬（投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうちファンドにおける保有分に対し年率0.05%）が含まれます。</p>	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）				各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社	300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%	300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%	500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%	主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）																									
各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社																						
300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%																						
300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%																						
500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%																						
主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価																						
<p>投資対象とする外国投資信託</p>	<p>フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865% 当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</p>																								
<p>実質的な負担</p>	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.12365%（税抜1.02865%）程度 上記は概算の数値です。実際の運用管理費用（信託報酬）は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。</p>																								

(4) 【その他の手数料等】

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

投資信託財産にかかる監査報酬は毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額とともに投資信託財産中から支払われます。

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

a. 個人の受益者に対する課税

(イ) 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(ロ) 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

(ハ) 損益通算について

解約 (換金) 時および償還時の差損 (譲渡損) については、確定申告を行うことにより上場株式等 (上場株式、上場投資信託 (ETF)、上場不動産投資信託 (REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等 (公募公社債投資信託を含みます。) など。以下同じ。) の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額 (配当所得については申告分離課税を選択したものに限り。) 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、2021年4月末現在のもので、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】

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	596,610,000	12.78
内 ケイマン諸島	596,610,000	12.78
親投資信託受益証券	3,975,186,576	85.15
内 日本	3,975,186,576	85.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	96,515,978	2.07
純資産総額	4,668,312,554	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

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	2,395,462,880	96.95
内 日本	2,395,462,880	96.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	75,330,160	3.05
純資産総額	2,470,793,040	100.00

その他資産の投資状況

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	57,045,000	2.31
内 日本	57,045,000	2.31

(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

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	7,208,653,600	78.40
内 日本	7,208,653,600	78.40
地方債証券	822,635,500	8.95
内 日本	822,635,500	8.95
特殊債券	624,942,000	6.80
内 日本	624,942,000	6.80
社債券	509,457,000	5.54
内 日本	509,457,000	5.54
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	28,766,037	0.31
純資産総額	9,194,454,137	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

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	127,972,589,020	98.87
内 日本	127,972,589,020	98.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,461,518,018	1.13
純資産総額	129,434,107,038	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,966,277,665	92.77
内 アメリカ	1,356,290,909	63.99
内 イギリス	87,818,857	4.14
内 カナダ	71,391,089	3.37
内 フランス	67,802,870	3.20
内 スイス	64,579,670	3.05
内 ドイツ	60,623,328	2.86
内 オーストラリア	42,644,378	2.01
内 オランダ	38,727,371	1.83
内 アイルランド	38,313,096	1.81
内 スウェーデン	22,285,053	1.05
内 香港	17,060,267	0.80
内 スペイン	15,848,029	0.75
内 デンマーク	15,694,765	0.74
内 イタリア	11,848,351	0.56
内 フィンランド	7,952,222	0.38
内 ジャージー	7,507,338	0.35
内 シンガポール	6,552,260	0.31
内 ベルギー	5,669,186	0.27
内 バミューダ	5,621,555	0.27
内 ノルウェー	4,189,063	0.20
内 イスラエル	3,932,168	0.19
内 ケイマン諸島	3,649,701	0.17
内 ニュージーランド	2,237,782	0.11
内 ルクセンブルグ	2,092,269	0.10
内 オランダ領キュラソー	1,384,907	0.07
内 オーストリア	1,241,621	0.06
内 ポルトガル	1,068,957	0.05
内 パナマ	788,420	0.04
内 リベリア	656,619	0.03
内 マン島	524,792	0.02
内 パプアニューギニア	280,772	0.01
新株予約権証券	20,769	0.00
内 スイス	20,769	0.00
投資信託受益証券	3,642,878	0.17
内 オーストラリア	2,797,967	0.13
内 シンガポール	844,911	0.04
投資証券	41,320,449	1.95
内 アメリカ	37,849,688	1.79

内 イギリス	1,286,589	0.06
内 フランス	1,133,137	0.05
内 香港	829,917	0.04
内 カナダ	221,118	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	108,215,534	5.11
純資産総額	2,119,477,295	100.00

その他資産の投資状況

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	105,321,490	4.97
内 アメリカ	68,681,454	3.24
内 ドイツ	26,107,622	1.23
内 イギリス	10,532,414	0.50

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(注3) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

海外国債マザーファンド

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	16,478,950,082	98.95
内 アメリカ	4,882,655,733	29.32
内 フランス	3,573,016,573	21.45
内 イタリア	3,093,295,463	18.57
内 カナダ	1,841,400,716	11.06
内 ドイツ	1,764,690,286	10.60
内 イギリス	1,323,891,311	7.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	175,509,777	1.05
純資産総額	16,654,459,859	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

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	701,208,820	99.03
内 アメリカ	701,208,820	99.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,897,633	0.97
純資産総額	708,106,453	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】

2021年4月30日現在

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

1	新光外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	210,261,219	3.3826 711,250,625	3.4393 723,151,410	- -	15.49
2	新光米国REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	326,561,318	2.0709 676,308,489	2.1347 697,110,445	- -	14.93
3	新光J-REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	307,674,156	2.2121 680,636,767	2.2443 690,513,108	- -	14.79
4	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	239,469,774	2.6865 643,359,494	2.6482 634,163,855	- -	13.58
5	海外国債マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	242,526,194	2.5530 619,193,625	2.5743 624,335,181	- -	13.37
6	新光日本債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	472,115,145	1.2843 606,384,692	1.2834 605,912,577	- -	12.98
7	フランクリン・テンプレト ン・フロンティア・エマー ジング・マーケット・デッ ト・ファンド ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	284,100	2,094.0000 594,905,400	2,100.0000 596,610,000	- -	12.78

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	12.78
親投資信託受益証券	85.15
合計	97.93

(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

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	9,400	7,863.00 73,912,200	8,127.00 76,393,800	- -	3.09
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	7,200	8,565.22 61,669,634	9,885.00 71,172,000	- -	2.88
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,800	10,738.10 62,280,980	10,900.00 63,220,000	- -	2.56
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	900	57,700.00 51,930,000	52,520.00 47,268,000	- -	1.91

5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	62,800	501.83 31,515,371	578.00 36,298,400	- -	1.47
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	6,400	4,587.12 29,357,624	4,939.00 31,609,600	- -	1.28
7	信越化学工業 日本	株式 化学	1,700	19,061.94 32,405,300	18,450.00 31,365,000	- -	1.27
8	任天堂 日本	株式 その他製品	500	65,810.00 32,905,000	62,690.00 31,345,000	- -	1.27
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	10,700	2,767.14 29,608,433	2,755.00 29,478,500	- -	1.19
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	7,700	3,690.36 28,415,792	3,635.00 27,989,500	- -	1.13
11	日本電産 日本	株式 電気機器	2,200	14,050.00 30,910,000	12,655.00 27,841,000	- -	1.13
12	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,200	23,795.00 28,554,000	21,930.00 26,316,000	- -	1.07
13	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	6,400	3,544.67 22,685,890	3,802.00 24,332,800	- -	0.98
14	日立製作所 日本	株式 電気機器	4,500	4,341.19 19,535,381	5,381.00 24,214,500	- -	0.98
15	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	500	42,250.00 21,125,000	48,320.00 24,160,000	- -	0.98
16	KDDI 日本	株式 情報・通信業	7,300	3,234.00 23,608,200	3,306.00 24,133,800	- -	0.98
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	7,300	2,917.34 21,296,598	3,232.00 23,593,600	- -	0.95
18	村田製作所 日本	株式 電気機器	2,700	10,255.00 27,688,500	8,703.00 23,498,100	- -	0.95
19	HOYA 日本	株式 精密機器	1,800	13,920.00 25,056,000	12,435.00 22,383,000	- -	0.91
20	第一三共 日本	株式 医薬品	8,000	3,636.59 29,092,799	2,787.00 22,296,000	- -	0.90
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	6,400	3,136.06 20,070,788	3,408.00 21,811,200	- -	0.88
22	ファナック 日本	株式 電気機器	800	27,675.00 22,140,000	25,175.00 20,140,000	- -	0.82
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	12,500	1,437.85 17,973,140	1,535.00 19,187,500	- -	0.78
24	S M C 日本	株式 機械	300	69,180.00 20,754,000	63,450.00 19,035,000	- -	0.77
25	三井物産 日本	株式 卸売業	7,400	2,000.00 14,800,000	2,303.50 17,045,900	- -	0.69

26	セブン&アイ・ホールディングス	日本	株式	3,600	3,955.35	4,699.00	-	0.68
			小売業		14,239,265	16,916,400	-	
27	三菱商事	日本	株式	5,600	2,691.00	3,020.00	-	0.68
			卸売業		15,069,600	16,912,000	-	
28	東京海上ホールディングス	日本	株式	3,000	5,643.00	5,230.00	-	0.64
			保険業		16,929,000	15,690,000	-	
29	三菱電機	日本	株式	9,300	1,681.32	1,682.00	-	0.63
			電気機器		15,636,304	15,642,600	-	
30	花王	日本	株式	2,200	7,873.00	7,007.00	-	0.62
			化学		17,320,600	15,415,400	-	

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.95
合計	96.95

(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

2021年4月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.35
情報・通信業		9.17
化学		7.30
輸送用機器		6.91
機械		5.54
サービス業		5.32
医薬品		5.11
銀行業		4.92
卸売業		4.57
小売業		4.42
陸運業		3.29
食料品		3.23
精密機器		2.50
その他製品		2.34
建設業		2.28
不動産業		1.91
保険業		1.81
電気・ガス業		1.27
その他金融業		1.05
鉄鋼		0.82
ガラス・土石製品	0.81	
証券、商品先物取引業	0.79	
非鉄金属	0.75	
金属製品	0.63	
ゴム製品	0.62	
繊維製品	0.47	
空運業	0.44	
石油・石炭製品	0.42	

海運業	0.26
パルプ・紙	0.25
鉱業	0.17
倉庫・運輸関連業	0.16
水産・農林業	0.09
合計	96.95

（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

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	414回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	140,000,000	100.29 140,411,600	100.27 140,387,800	0.1 2022/7/1	1.53
2	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	118.36 118,367,000	117.12 117,127,000	2.1 2029/12/28	1.27
3	18回 東京都公募公債 20年 日本	地方債証券	100,000,000	117.67 117,673,000	116.58 116,585,000	2.22 2029/3/19	1.27
4	36回 東日本旅客鉄道社 債 日本	社債券	100,000,000	108.25 108,250,000	107.48 107,487,000	2.11 2024/12/20	1.17
5	12回 兵庫県公募公債 15年 日本	地方債証券	100,000,000	106.14 106,149,000	105.77 105,773,000	0.781 2030/12/6	1.15
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	102.14 102,149,000	101.97 101,970,000	0.484 2025/6/30	1.11
7	49回 政保地方公共団体 金融機構債券 日本	特殊債券	100,000,000	102.30 102,302,000	101.86 101,867,000	0.882 2023/6/16	1.11
8	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	102.08 102,088,000	101.83 101,839,000	0.645 2024/3/15	1.11
9	4回 第一三共社債 日本	社債券	100,000,000	101.75 101,757,000	101.73 101,736,000	0.846 2023/9/15	1.11
10	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	101.58 101,589,000	101.33 101,330,000	0.715 2023/3/20	1.10
11	24年度7回 広島県公募 公債 日本	地方債証券	100,000,000	101.51 101,519,000	101.25 101,258,000	0.67 2023/3/27	1.10
12	24年度2回 広島市公募 公債 日本	地方債証券	100,000,000	101.41 101,416,000	101.13 101,136,000	0.7 2022/12/22	1.10
13	169回 共同発行市場公 募地方債 日本	地方債証券	100,000,000	100.86 100,867,000	100.89 100,894,000	0.205 2027/4/23	1.10

14	218回 神奈川県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	100.63 100,631,000	100.85 100,857,000	0.195 2025/12/19	1.10
15	327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	100.93 100,938,000	100.80 100,809,000	0.17 2027/10/29	1.10
16	11回 プリヂストーン社債 日本	社債券	100,000,000	99.94 99,949,000	100.30 100,309,000	0.295 2027/4/21	1.09
17	50回 西日本高速道路債券 日本	社債券	100,000,000	100.05 100,053,000	100.00 100,000,000	0.04 2024/6/20	1.09
18	44回 ホンダファイナンス社債 日本	社債券	100,000,000	99.82 99,820,000	99.92 99,925,000	0.08 2022/9/20	1.09
19	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	102.38 92,145,600	102.17 91,957,500	0.4 2025/6/20	1.00
20	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	102.42 92,179,800	102.13 91,921,500	0.5 2024/9/20	1.00
21	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	101.33 91,197,900	100.99 90,899,100	0.1 2028/3/20	0.99
22	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	101.12 91,014,300	100.97 90,879,300	0.1 2026/6/20	0.99
23	333回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	102.44 81,952,800	102.13 81,706,400	0.6 2024/3/20	0.89
24	338回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	102.27 81,820,000	102.06 81,649,600	0.4 2025/3/20	0.89
25	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.22 80,982,400	101.01 80,813,600	0.1 2026/12/20	0.88
26	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.17 80,942,400	100.99 80,799,200	0.1 2026/9/20	0.88
27	349回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.33 81,070,000	100.99 80,797,600	0.1 2027/12/20	0.88
28	351回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.33 81,067,600	100.96 80,771,200	0.1 2028/6/20	0.88
29	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.07 80,861,600	100.95 80,763,200	0.1 2026/3/20	0.88
30	144回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	80,000,000	101.00 80,805,200	100.93 80,745,600	0.1 2025/6/20	0.88

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	78.40
地方債証券	8.95
特殊債券	6.80
社債券	5.54
合計	99.69

(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

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	12,934	623,964.10 8,070,351,738	718,000.00 9,286,612,000	- -	7.17
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	11,492	625,659.82 7,190,082,662	678,000.00 7,791,576,000	- -	6.02
3	GLP投資法人 日本	投資証券	35,910	166,990.05 5,996,612,959	183,200.00 6,578,712,000	- -	5.08
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	37,162	156,600.66 5,819,593,974	172,800.00 6,421,593,600	- -	4.96
5	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	18,168	332,988.48 6,049,734,815	351,000.00 6,376,968,000	- -	4.93
6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	57,241	102,837.20 5,886,504,442	107,700.00 6,164,855,700	- -	4.76
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	16,397	279,060.52 4,575,755,451	293,100.00 4,805,960,700	- -	3.71
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	22,898	174,608.22 3,998,179,103	192,800.00 4,414,734,400	- -	3.41
9	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	24,577	138,213.79 3,396,880,396	163,400.00 4,015,881,800	- -	3.10
10	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	10,916	303,471.44 3,312,694,313	348,500.00 3,804,226,000	- -	2.94
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	16,244	185,365.16 3,011,071,807	198,100.00 3,217,936,400	- -	2.49
12	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	7,155	364,745.99 2,609,757,611	444,500.00 3,180,397,500	- -	2.46
13	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	33,801	75,242.36 2,543,267,103	91,000.00 3,075,891,000	- -	2.38

14	アクティビア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証 券	5,758	417,922.99 2,406,400,581	504,000.00 2,902,032,000	- -	2.24
15	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証 券	3,555	663,925.24 2,360,254,263	806,000.00 2,865,330,000	- -	2.21
16	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証 券	3,961	565,428.43 2,239,662,014	649,000.00 2,570,689,000	- -	1.99
17	ラサールロジポート投資法 人 日本	投資証 券	13,901	164,907.17 2,292,374,607	177,500.00 2,467,427,500	- -	1.91
18	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証 券	7,509	310,156.97 2,328,968,690	313,000.00 2,350,317,000	- -	1.82
19	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証 券	37,022	55,789.90 2,065,453,712	62,600.00 2,317,577,200	- -	1.79
20	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	4,011	517,670.58 2,076,376,717	566,000.00 2,270,226,000	- -	1.75
21	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証 券	13,499	142,570.08 1,924,553,540	158,700.00 2,142,291,300	- -	1.66
22	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証 券	2,448	661,245.68 1,618,729,428	791,000.00 1,936,368,000	- -	1.50
23	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証 券	48,052	35,014.52 1,682,517,893	39,250.00 1,886,041,000	- -	1.46
24	フロンティア不動産投資法 人 日本	投資証 券	3,814	433,668.08 1,654,010,059	478,000.00 1,823,092,000	- -	1.41
25	コンフォリア・レジデン シャル投資法人 日本	投資証 券	5,167	294,981.39 1,524,168,848	350,000.00 1,808,450,000	- -	1.40
26	ケネディクス・レジデン シャル・ネクスト投資法人 日本	投資証 券	7,832	179,196.13 1,403,464,168	225,800.00 1,768,465,600	- -	1.37
27	イオンリート投資法人 日本	投資証 券	11,656	138,168.58 1,610,492,997	150,500.00 1,754,228,000	- -	1.36
28	大和証券リビング投資法人 日本	投資証 券	15,006	98,734.99 1,481,617,277	112,200.00 1,683,673,200	- -	1.30
29	N T T都市開発リート投資 法人 日本	投資証 券	10,380	128,380.22 1,332,586,702	162,200.00 1,683,636,000	- -	1.30
30	ヒューリックリート投資法 人 日本	投資証 券	9,527	159,362.39 1,518,245,530	174,600.00 1,663,414,200	- -	1.29

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.87

合計	98.87
----	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	5,955	12,670.73 75,454,242	14,539.97 86,585,559	- -	4.09
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	2,515	23,789.22 59,829,895	27,505.91 69,177,374	- -	3.26
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	149	342,447.59 51,024,692	378,129.79 56,341,339	- -	2.66
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	842	30,366.41 25,568,522	35,893.52 30,222,347	- -	1.43
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	104	192,043.58 19,972,533	264,687.91 27,527,543	- -	1.30
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	105	191,871.47 20,146,505	260,643.34 27,367,551	- -	1.29
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	265	45,887.84 12,160,280	73,745.60 19,542,586	- -	0.92
8	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	1,069	12,733.91 13,612,557	16,904.84 18,071,281	- -	0.85
9	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	924	15,912.49 14,703,144	17,886.30 16,526,946	- -	0.78

10	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	592	23,167.23 13,715,001	25,801.15 15,274,286	- -	0.72
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	481	24,127.99 11,605,565	30,238.96 14,544,943	- -	0.69
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 ア・サー ビス	332	38,125.50 12,657,666	43,740.84 14,521,959	- -	0.69
13	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	217	59,391.90 12,888,043	66,773.00 14,489,741	- -	0.68
14	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	377	29,407.83 11,086,752	35,439.28 13,360,610	- -	0.63
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	1,010	12,640.43 12,766,839	13,083.91 13,214,756	- -	0.62
16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	311	37,532.91 11,672,738	42,368.32 13,176,548	- -	0.62
17	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	633	15,532.32 9,831,964	20,187.99 12,779,002	- -	0.60
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	869	15,031.24 13,062,156	14,434.31 12,543,419	- -	0.59
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	2,725	3,023.89 8,240,118	4,478.11 12,202,856	- -	0.58
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	388	20,121.54 7,807,161	29,176.89 11,320,637	- -	0.53
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	149	46,816.85 6,975,711	71,644.16 10,674,981	- -	0.50
22	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	1,592	5,139.31 8,181,793	6,143.65 9,780,693	- -	0.46
23	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	1,470	4,022.78 5,913,493	6,420.33 9,437,891	- -	0.45
24	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	167	51,321.27 8,570,653	56,217.68 9,388,353	- -	0.44

25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,436	4,967.20 7,132,910	6,348.44 9,116,360	- -	0.43
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	1,453	6,518.37 9,471,193	6,243.86 9,072,339	- -	0.43
27	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	243	37,252.48 9,052,354	35,940.02 8,733,425	- -	0.41
28	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	154	51,251.56 7,892,741	55,445.36 8,538,586	- -	0.40
29	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	2,491	3,082.71 7,679,053	3,413.86 8,503,940	- -	0.40
30	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	1,429	5,726.44 8,183,097	5,910.54 8,446,164	- -	0.40

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	92.77
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.17
投資証券	1.95
合計	94.89

(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

2021年4月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	6.75
銀行		5.95
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.50
情報技術サービス		4.48
コンピュータ・周辺機器		4.39
半導体・半導体製造装置		4.27
医薬品		4.26
インターネット販売・通信販売		3.20
保険		3.09
資本市場		3.04
石油・ガス・消耗燃料		2.95
ヘルスケア機器・用品		2.94
化学		2.10
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.88
ホテル・レストラン・レジャー		1.83
電力		1.74
機械		1.70

専門小売り	1.65
バイオテクノロジー	1.61
自動車	1.60
飲料	1.57
金属・鉱業	1.55
食品	1.50
娯楽	1.44
航空宇宙・防衛	1.42
各種電気通信サービス	1.41
繊維・アパレル・贅沢品	1.41
食品・生活必需品小売り	1.23
コングロマリット	1.16
メディア	1.09
家庭用品	1.08
陸運・鉄道	1.04
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.96
各種金融サービス	0.94
電気設備	0.87
総合公益事業	0.82
専門サービス	0.74
航空貨物・物流サービス	0.66
通信機器	0.64
タバコ	0.64
パーソナル用品	0.62
建設関連製品	0.57
電子装置・機器・部品	0.54
複合小売り	0.49
消費者金融	0.45
不動産管理・開発	0.43
商業サービス・用品	0.41
家庭用耐久財	0.38
商社・流通業	0.30
容器・包装	0.29
無線通信サービス	0.27
自動車部品	0.27
建設資材	0.26
建設・土木	0.22
ヘルスケア・テクノロジー	0.15
運送インフラ	0.15
エネルギー設備・サービス	0.14
ガス	0.13
紙製品・林産品	0.12
水道	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
販売	0.08
レジャー用品	0.07
海運業	0.07
旅客航空輸送業	0.06
合計	92.77

(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。

海外国債マザーファンド

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ITALY BTPS 1.5 06/01/25 イタリア	国債証券	831,537,000	106.64 886,797,121	105.96 881,179,758	1.5 2025/6/1	5.29
2	FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス	国債証券	725,945,000	110.30 800,754,952	106.82 775,458,804	0.75 2028/11/25	4.66
3	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証券	664,473,000	99.80 663,167,661	99.80 663,201,151	0.25 2024/3/15	3.98
4	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	544,650,000	118.61 646,048,508	112.48 612,624,868	3.125 2028/11/15	3.68
5	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	544,650,000	116.31 633,496,031	110.61 602,476,507	2.875 2028/8/15	3.62
6	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	544,650,000	115.96 631,623,796	110.54 602,072,275	2.875 2028/5/15	3.62
7	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	544,650,000	114.96 626,134,742	108.88 593,030,235	2.625 2029/2/15	3.56
8	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	395,970,000	151.92 601,594,647	145.28 575,269,967	5.5 2029/4/25	3.45
9	CANADA 2.25 06/01/29 カナダ	国債証券	532,200,000	113.46 603,869,600	106.78 568,323,607	2.25 2029/6/1	3.41
10	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証券	544,650,000	107.05 583,073,352	101.11 550,713,484	1.625 2029/8/15	3.31
11	CANADA 1.0 09/01/22 カナダ	国債証券	461,240,000	101.16 466,595,706	101.03 466,008,760	1 2022/9/1	2.80
12	FRANCE OAT 0.0 11/25/29 フランス	国債証券	435,567,000	103.85 452,377,272	100.28 436,827,530	- 2029/11/25	2.62
13	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	395,970,000	109.83 434,900,978	106.76 422,759,746	0.75 2028/5/25	2.54
14	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	395,970,000	108.38 429,180,399	104.77 414,858,956	0.5 2029/5/25	2.49
15	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	381,255,000	111.67 425,781,771	106.43 405,783,394	2.25 2027/11/15	2.44
16	ITALY BTPS 0.95 08/01/30 イタリア	国債証券	395,970,000	102.90 407,453,130	101.32 401,196,804	0.95 2030/8/1	2.41
17	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 ドイツ	国債証券	250,781,000	166.02 416,354,139	158.19 396,723,002	6.25 2030/1/4	2.38
18	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	403,041,000	97.92 394,696,792	97.94 394,775,507	0.375 2026/1/31	2.37
19	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	326,790,000	114.75 374,991,525	109.64 358,294,598	2.75 2028/2/15	2.15
20	CANADA 0.5 09/01/25 カナダ	国債証券	354,800,000	99.26 352,192,220	98.52 349,548,960	0.5 2025/9/1	2.10
21	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 ドイツ	国債証券	250,781,000	143.59 360,116,500	137.99 346,070,256	4.75 2028/7/4	2.08
22	ITALY BTPS 4.75 09/01/28 イタリア	国債証券	263,980,000	132.73 350,384,613	129.96 343,070,968	4.75 2028/9/1	2.06

23	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証券	263,980,000	126.15 333,029,248	123.48 325,970,951	3.5 2030/3/1	1.96
24	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	263,980,000	128.35 338,828,889	122.77 324,097,749	2.5 2030/5/25	1.95
25	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 ドイツ	国債証券	316,776,000	103.30 327,245,446	101.88 322,753,563	- 2031/2/15	1.94
26	CANADA 1.25 06/01/30 カナダ	国債証券	328,190,000	104.80 343,943,120	97.81 321,020,361	1.25 2030/6/1	1.93
27	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	263,980,000	120.87 319,086,352	118.61 313,106,678	3 2029/8/1	1.88
28	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証券	263,980,000	118.26 312,193,571	116.37 307,218,023	2.8 2028/12/1	1.84
29	UK TREASURY 0.5 07/22/22 イギリス	国債証券	288,705,000	100.70 290,750,854	100.58 290,407,782	0.5 2022/7/22	1.74
30	UK TREASURY 6.0 12/07/28 イギリス	国債証券	182,340,000	146.80 267,675,120	139.30 254,012,383	6 2028/12/7	1.53

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.95
合計	98.95

(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

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券	2,132	26,090.02 55,623,942	27,277.16 58,154,907	- -	8.21
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	3,558	11,222.83 39,930,833	12,665.29 45,063,105	- -	6.36
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	2,008	17,869.05 35,881,065	20,474.48 41,112,761	- -	5.81
4	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	429	88,123.02 37,804,777	76,913.29 32,995,803	- -	4.66
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	728	25,191.75 18,339,600	30,443.75 22,163,054	- -	3.13
6	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,348	16,817.89 22,670,526	16,234.92 21,884,681	- -	3.09
7	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	1,579	7,153.39 11,295,214	13,434.33 21,212,817	- -	3.00
8	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証券	534	33,495.90 17,886,814	32,469.85 17,338,902	- -	2.45

9	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	2,018	5,741.56 11,586,486	8,287.39 16,723,961	- -	2.36
10	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証券	3,606	3,195.57 11,523,240	4,317.98 15,570,654	- -	2.20
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	1,774	5,535.11 9,819,300	8,010.71 14,211,003	- -	2.01
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	679	15,864.02 10,771,675	20,861.18 14,164,744	- -	2.00
13	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	1,805	6,403.76 11,558,803	7,549.93 13,627,638	- -	1.92
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	655	17,372.47 11,378,969	19,572.54 12,820,015	- -	1.81
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	1,801	4,505.37 8,114,175	6,078.29 10,947,007	- -	1.55
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	2,708	3,015.69 8,166,492	3,782.04 10,241,790	- -	1.45
17	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	619	12,398.36 7,674,591	15,993.10 9,899,730	- -	1.40
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	315	21,726.06 6,843,710	31,172.49 9,819,336	- -	1.39
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,603	2,894.58 7,534,593	3,689.45 9,603,662	- -	1.36
20	MID AMERICA アメリカ	投資証券	550	12,830.65 7,056,862	16,936.43 9,315,040	- -	1.32
21	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	511	15,781.70 8,064,450	18,113.96 9,256,238	- -	1.31
22	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	751	8,292.53 6,227,692	11,919.11 8,951,259	- -	1.26
23	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,580	2,525.60 6,516,049	3,459.61 8,925,811	- -	1.26
24	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	1,778	4,184.48 7,440,023	4,993.35 8,878,178	- -	1.25
25	UDR INC アメリカ	投資証券	1,413	3,508.68 4,957,769	5,011.86 7,081,771	- -	1.00
26	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	3,373	1,166.40 3,934,290	2,007.57 6,771,567	- -	0.96
27	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	840	7,142.30 5,999,535	7,993.28 6,714,358	- -	0.95
28	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	2,767	1,959.46 5,421,841	2,397.54 6,634,018	- -	0.94
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	839	6,861.08 5,756,452	7,528.15 6,316,119	- -	0.89
30	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	1,380	2,980.63 4,113,270	4,388.78 6,056,529	- -	0.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
----	---------

投資証券	99.03
合計	99.03

(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。

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

新光J - R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国R E I T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

2021年4月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0306月	買建	3	57,980,990	57,045,000	2.31

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

新光J - R E I T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

2021年4月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Jun21	買建	3	64,370,549	68,681,454	3.24
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun21	買建	5	25,936,035	26,107,622	1.23
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun21	買建	1	10,220,157	10,532,414	0.50

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(2021年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第10特定期間末 (2011年10月20日)	9,331	9,365	0.5447	0.5467
第11特定期間末 (2012年 4月20日)	8,395	8,423	0.5983	0.6003
第12特定期間末 (2012年10月22日)	7,563	7,588	0.5969	0.5989
第13特定期間末 (2013年 4月22日)	9,376	9,400	0.7854	0.7874
第14特定期間末 (2013年10月21日)	8,609	8,631	0.7728	0.7748
第15特定期間末 (2014年 4月21日)	8,104	8,125	0.7970	0.7990
第16特定期間末 (2014年10月20日)	7,644	7,663	0.8254	0.8274
第17特定期間末 (2015年 4月20日)	7,692	7,709	0.9283	0.9303
第18特定期間末 (2015年10月20日)	6,937	6,952	0.8993	0.9013
第19特定期間末 (2016年 4月20日)	6,329	6,344	0.8666	0.8686
第20特定期間末 (2016年10月20日)	5,699	5,713	0.8330	0.8350
第21特定期間末 (2017年 4月20日)	5,622	5,635	0.8684	0.8704

第22特定期間末 (2017年10月20日)	5,597	5,609	0.9138	0.9158
第23特定期間末 (2018年 4月20日)	5,336	5,348	0.8885	0.8905
第24特定期間末 (2018年10月22日)	5,115	5,126	0.8935	0.8955
第25特定期間末 (2019年 4月22日)	5,013	5,024	0.9197	0.9217
第26特定期間末 (2019年10月21日)	4,980	4,991	0.9464	0.9484
第27特定期間末 (2020年4月20日)	4,234	4,244	0.8402	0.8422
第28特定期間末 (2020年10月20日)	4,344	4,353	0.8946	0.8966
第29特定期間末 (2021年4月20日)	4,642	4,651	1.0067	1.0087
2020年4月末日	4,239	-	0.8416	-
5月末日	4,388	-	0.8741	-
6月末日	4,386	-	0.8780	-
7月末日	4,343	-	0.8787	-
8月末日	4,447	-	0.9078	-
9月末日	4,362	-	0.8954	-
10月末日	4,213	-	0.8722	-
11月末日	4,371	-	0.9171	-
12月末日	4,413	-	0.9332	-
2021年1月末日	4,439	-	0.9436	-
2月末日	4,495	-	0.9636	-
3月末日	4,632	-	1.0019	-
4月末日	4,668	-	1.0151	-

【分配の推移】

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

第27特定期間	0.0120
第28特定期間	0.0120
第29特定期間	0.0120

【収益率の推移】

	収益率(%)
第10特定期間	9.8
第11特定期間	12.0
第12特定期間	1.8
第13特定期間	33.6
第14特定期間	0.1
第15特定期間	4.7
第16特定期間	5.1
第17特定期間	13.9
第18特定期間	1.8
第19特定期間	2.3
第20特定期間	2.5
第21特定期間	5.7
第22特定期間	6.6
第23特定期間	1.5
第24特定期間	1.9
第25特定期間	4.3
第26特定期間	4.2
第27特定期間	10.0
第28特定期間	7.9
第29特定期間	13.9

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第10特定期間	55,270,668	2,043,398,766
第11特定期間	24,129,070	3,124,126,893
第12特定期間	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	22,407,208	820,891,392
第15特定期間	25,208,228	996,341,985
第16特定期間	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	13,815,643	989,033,927
第18特定期間	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	5,348,676	374,412,075
第22特定期間	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	45,095,213	164,575,560
第24特定期間	4,817,074	285,434,876
第25特定期間	13,966,043	287,993,351
第26特定期間	34,127,005	222,623,381
第27特定期間	9,232,953	232,290,245

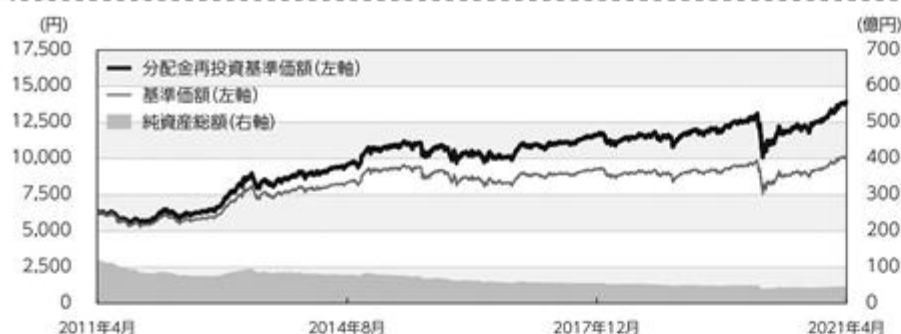
第28特定期間	14,557,001	198,285,857
第29特定期間	8,969,863	253,533,579

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

参考情報

データの基準日:2021年4月30日

基準価額・純資産の推移 (2011年4月28日～2021年4月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。

(設定日:2006年10月31日)

分配の推移(税引前)

2020年12月	20円
2021年 1月	20円
2021年 2月	20円
2021年 3月	20円
2021年 4月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	4,520円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	新光外国株式インデックスマザーファンド	15.49
2	新光米国REITマザーファンド	14.93
3	新光J-REITマザーファンド	14.79
4	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	13.58
5	海外国債マザーファンド	13.37
6	新光日本債券インデックスマザーファンド	12.98
7	フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	12.78

■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	3.09
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.88
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.56
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.91
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.47

■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	414回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2022/7/1	1.53
2	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	特殊債券	日本	2.1	2029/12/28	1.27
3	18回 東京都公債 20年	地方債証券	日本	2.22	2029/3/19	1.27
4	36回 東日本旅客鉄道社債	社債券	日本	2.11	2024/12/20	1.17
5	12回 兵庫県公債 15年	地方債証券	日本	0.781	2030/12/6	1.15

■新光J-REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	7.17
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	6.02
3	GLP投資法人	日本	5.08
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.96
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.93

○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。

■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	4.09
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.26
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.66
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	1.43
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	1.30

■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	ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	イタリア	1.5	2025/6/1	5.29
2	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	フランス	0.75	2028/11/25	4.66
3	US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	アメリカ	0.25	2024/3/15	3.98
4	US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	3.68
5	US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/8/15	3.62

■フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド(現地2021年4月14日現在)

※フランクリン テンプレトン インベストメント マネジメント リミテッドからの情報を基に作成しております。

※比率(%)は、フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

①組入公社債の上位5通貨

順位	通貨	比率(%)
1	米ドル	50.5
2	メキシコペソ	6.0
3	ユーロ	5.5
4	コロンビアペソ	4.2
5	ウルグアイペソ	3.9

②組入公社債の上位5カ国

順位	国/地域	比率(%)
1	メキシコ	7.6
2	その他	7.2
3	南アフリカ	5.6
4	コロンビア	4.2
5	トリニダード・トバゴ	3.9

■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	8.21
2	PROLOGIS INC	アメリカ	6.36
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	アメリカ	5.81
4	EQUINIX INC	アメリカ	4.66
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.13

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。

※2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

2【換金(解約)手続等】

一部解約(解約請求によるご解約)

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

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

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

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

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

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

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

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

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

(チ)上記(ト)により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合、またはすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付が取り消された場合には、受益者は当該受付中止または取消以前に行った一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止または取り消しを解除した後の最初の基準価額の計算日(この日が一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。)に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記(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
外国投資信託証券	計算日に入手し得る直近の純資産価格(基準価額)
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2026年10月20日までです。

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

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了(投資信託契約の解約)

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

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

- (ハ) 上記(ロ)の投資信託契約の解約にかかる公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、投資信託契約の解約をしません。
- (ホ) 委託者は、上記(ニ)の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ヘ) 上記(ハ)から(ホ)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(ホ)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (ト) 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。
- (チ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

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

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

b. 投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

c．異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d．運用報告書

委託者は、毎年4月、10月の決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知っている受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

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

e．公告

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

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

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

f．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g．信託事務処理の再信託

（イ）受託者は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について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。

h．信託業務の委託等

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

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

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

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

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

i. 関係法人との契約の更改

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

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

4【受益者の権利等】

a. 収益分配金請求権

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

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

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

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

b. 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c. 一部解約請求権

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

d. 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2020年10月21日から2021年4月20日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【新光7資産バランスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2020年10月20日現在	当期 2021年4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	102,149,519	128,082,865
投資信託受益証券	596,325,900	594,905,400
親投資信託受益証券	3,666,587,240	3,937,133,692
流動資産合計	4,365,062,659	4,660,121,957
資産合計	4,365,062,659	4,660,121,957
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,711,948	9,222,820
未払解約金	7,815,050	4,549,500
未払受託者報酬	285,047	324,444
未払委託者報酬	3,099,999	3,528,405
その他未払費用	12,718	14,423
流動負債合計	20,924,762	17,639,592
負債合計	20,924,762	17,639,592
純資産の部		
元本等		
元本	4,855,974,013	4,611,410,297
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	511,836,116	31,072,068
（分配準備積立金）	508,577,909	517,420,993
元本等合計	4,344,137,897	4,642,482,365
純資産合計	4,344,137,897	4,642,482,365
負債純資産合計	4,365,062,659	4,660,121,957

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年4月21日 至 2020年10月20日	当期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
営業収益		
受取配当金	66,883,500	51,138,000
有価証券売買等損益	288,130,746	556,125,952
営業収益合計	355,014,246	607,263,952
営業費用		
支払利息	29,906	8,837
受託者報酬	1,929,455	1,958,843
委託者報酬	20,983,402	21,302,927
その他費用	86,839	87,080
営業費用合計	23,029,602	23,357,687
営業利益又は営業損失()	331,984,644	583,906,265
経常利益又は経常損失()	331,984,644	583,906,265
当期純利益又は当期純損失()	331,984,644	583,906,265
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()	1,805,791	2,223,731
期首剰余金又は期首欠損金()	805,297,627	511,836,116
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,258,882	17,954,164
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,258,882	17,954,164
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,677,741	404,139
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,677,741	404,139
分配金	59,298,483	56,324,375
期末剰余金又は期末欠損金()	511,836,116	31,072,068

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2020年10月21日	至 2021年4月20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、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> <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. 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>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2020年10月20日現在	2021年4月20日現在
1. 期首元本額	5,039,702,869円	4,855,974,013円
期中追加設定元本額	14,557,001円	8,969,863円
期中一部解約元本額	198,285,857円	253,533,579円
2. 受益権の総数	4,855,974,013口	4,611,410,297口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は511,836,116円であります。	-

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年4月21日 至 2020年10月20日	自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年4月21日 至2020年5月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,947,540円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(10,355,465円)及び分配準備積立金(489,088,452円)より分配対象収益は514,391,457円(1万口当たり1,022.09円)であり、うち10,065,462円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2020年10月21日 至2020年11月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,266,964円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,274,668円)及び分配準備積立金(502,950,924円)より分配対象収益は527,492,556円(1万口当たり1,098.25円)であり、うち9,606,038円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>

<p>(自2020年5月21日 至2020年6月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,227,610円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,112,209円)及び分配準備積立金(489,859,785円)より分配対象収益は518,199,604円(1万口当たり1,036.58円)であり、うち9,998,199円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2020年11月21日 至2020年12月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,182,699円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,191,226円)及び分配準備積立金(499,723,540円)より分配対象収益は524,097,465円(1万口当たり1,106.07円)であり、うち9,476,715円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2020年6月23日 至2020年7月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,723,195円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,140,086円)及び分配準備積立金(492,884,916円)より分配対象収益は520,748,197円(1万口当たり1,050.31円)であり、うち9,916,013円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2020年12月22日 至2021年1月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,033,926円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,266,511円)及び分配準備積立金(500,876,408円)より分配対象収益は527,176,845円(1万口当たり1,117.95円)であり、うち9,431,056円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2020年7月21日 至2020年8月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,085,042円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,146,674円)及び分配準備積立金(496,655,204円)より分配対象収益は523,886,920円(1万口当たり1,062.95円)であり、うち9,857,177円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年1月21日 至2021年2月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,318,438円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,532,583円)及び分配準備積立金(500,749,054円)より分配対象収益は527,600,075円(1万口当たり1,130.80円)であり、うち9,331,440円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>

	<p>(自2020年8月21日 至2020年9月23日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,185,136円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,115,154円)及び分配準備積立金(497,310,044円)より分配対象収益は524,610,334円(1万口当たり1,076.15円)であり、うち9,749,684円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2020年9月24日 至2020年10月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,736,689円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,316,716円)及び分配準備積立金(501,553,168円)より分配対象収益は529,606,573円(1万口当たり1,090.62円)であり、うち9,711,948円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年2月23日 至2021年3月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,706,731円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,537,649円)及び分配準備積立金(502,559,260円)より分配対象収益は530,803,640円(1万口当たり1,146.90円)であり、うち9,256,306円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年3月23日 至2021年4月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,685,033円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,703,939円)及び分配準備積立金(507,958,780円)より分配対象収益は538,347,752円(1万口当たり1,167.42円)であり、うち9,222,820円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
--	--	---

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自 2020年4月21日 至 2020年10月20日	当期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左
-------------------	---	----

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 2020年10月20日現在	当期 2021年4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 2020年10月20日現在	当期 2021年4月20日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	9,943,500	5,682,000
親投資信託受益証券	36,249,355	87,159,619
合計	26,305,855	81,477,619

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前期 2020年10月20日現在	当期 2021年4月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8946円 (8,946円)	1.0067円 (10,067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

2021年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	284,100	594,905,400	
投資信託受益証券 合計		284,100	594,905,400	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	242,526,194	619,193,625	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	239,469,774	643,359,494	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	210,261,219	711,250,625	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	472,115,145	606,384,692	
	新光J-REITマザーファンド	307,674,156	680,636,767	
	新光米国REITマザーファンド	326,561,318	676,308,489	
親投資信託受益証券 合計		1,798,607,806	3,937,133,692	
合計			4,532,039,092	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2021年4月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	52,398,945
株式	2,421,267,070
派生商品評価勘定	469,340
未収配当金	22,373,203
差入委託証拠金	2,610,000
流動資産合計	2,499,118,558
資産合計	2,499,118,558
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	485,330
前受金	870,000
流動負債合計	1,355,330
負債合計	1,355,330
純資産の部	
元本等	
元本	929,716,185
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,568,047,043
元本等合計	2,497,763,228
純資産合計	2,497,763,228
負債純資産合計	2,499,118,558

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年4月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,096,045,401円
同期中追加設定元本額	7,064,609円
同期中一部解約元本額	173,393,825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	191,973,711円
新光7資産バランスファンド	239,469,774円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	69,305,421円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	344,248,310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)	14,978,836円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	27,520,998円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	9,783,211円
グローバル・ナビ	15,520,238円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,179,996円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	11,450,631円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	1,285,059円
計	929,716,185円
2. 受益権の総数	929,716,185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 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<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、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2021年4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価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。</p>
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	<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。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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年4月20日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	66,579,657
合計	66,579,657

（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（2021年1月15日から2021年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年4月20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	57,825,000	-	57,810,000	15,000
合計	57,825,000	-	57,810,000	15,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年4月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6866円 (26,866円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年4月20日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	1,200	508.00	609,600	
マルハニチロ	200	2,486.00	497,200	
雪国まいたけ	100	1,989.00	198,900	
サカタのタネ	200	3,975.00	795,000	
ホクト	100	2,024.00	202,400	
ショーボンドホールディングス	200	4,830.00	966,000	
ミライト・ホールディングス	400	1,816.00	726,400	
タマホーム	100	2,418.00	241,800	
日本アクア	100	608.00	60,800	
Robot Home	200	179.00	35,800	
スペースバリューホールディングス	200	785.00	157,000	
住石ホールディングス	200	114.00	22,800	
三井松島ホールディングス	100	923.00	92,300	
INPEX	4,600	756.00	3,477,600	
石油資源開発	200	2,089.00	417,800	
K&Oエナジーグループ	100	1,433.00	143,300	
安藤・間	800	851.00	680,800	
東急建設	400	584.00	233,600	
コムシスホールディングス	400	3,390.00	1,356,000	
ピーアールホールディングス	200	590.00	118,000	
高松コンストラクショングループ	100	2,126.00	212,600	

ヤマウラ	100	914.00	91,400	
オリエンタル白石	400	293.00	117,200	
大成建設	900	4,175.00	3,757,500	
大林組	2,900	1,019.00	2,955,100	
清水建設	2,700	899.00	2,427,300	
飛島建設	100	1,128.00	112,800	
長谷工コーポレーション	1,000	1,565.00	1,565,000	
松井建設	100	725.00	72,500	
鹿島建設	2,100	1,535.00	3,223,500	
不動テトラ	100	1,938.00	193,800	
鉄建建設	100	1,868.00	186,800	
西松建設	200	2,857.00	571,400	
三井住友建設	700	487.00	340,900	
大豊建設	100	3,950.00	395,000	
前田建設工業	700	956.00	669,200	
佐田建設	100	436.00	43,600	
ナカノフドー建設	100	396.00	39,600	
奥村組	200	2,839.00	567,800	
東鉄工業	100	2,587.00	258,700	
戸田建設	1,200	811.00	973,200	
熊谷組	100	3,005.00	300,500	
矢作建設工業	100	833.00	83,300	
ピーエス三菱	100	650.00	65,000	
日本ハウスホールディングス	200	329.00	65,800	
大東建託	300	12,010.00	3,603,000	
新日本建設	100	847.00	84,700	
N I P P O	200	3,045.00	609,000	
前田道路	200	2,144.00	428,800	
東亜建設工業	100	2,430.00	243,000	
日本国土開発	300	608.00	182,400	
若築建設	100	1,308.00	130,800	
東洋建設	300	568.00	170,400	
五洋建設	1,200	894.00	1,072,800	
世紀東急工業	100	889.00	88,900	
住友林業	700	2,490.00	1,743,000	
日本基礎技術	100	520.00	52,000	
巴コーポレーション	100	384.00	38,400	
大和ハウス工業	2,700	3,260.00	8,802,000	
ライト工業	200	1,812.00	362,400	
積水ハウス	3,200	2,308.50	7,387,200	
日特建設	100	801.00	80,100	
北陸電気工事	100	1,160.00	116,000	
ユアテック	200	804.00	160,800	
日本リーテック	100	1,822.00	182,200	
中電工	100	2,394.00	239,400	
関電工	500	1,015.00	507,500	
きんでん	600	1,871.00	1,122,600	
東京エネシス	100	922.00	92,200	
住友電設	100	2,474.00	247,400	
日本電設工業	200	1,978.00	395,600	

協和エクシオ	400	2,902.00	1,160,800	
新日本空調	100	2,270.00	227,000	
日本工営	100	2,998.00	299,800	
九電工	200	4,050.00	810,000	
三機工業	200	1,411.00	282,200	
日揮ホールディングス	1,000	1,271.00	1,271,000	
ヤマト	100	660.00	66,000	
太平電業	100	2,703.00	270,300	
高砂熱学工業	300	1,690.00	507,000	
NEC ネットエスアイ	300	1,868.00	560,400	
明星工業	200	780.00	156,000	
大気社	100	3,060.00	306,000	
ダイダン	100	2,819.00	281,900	
日比谷総合設備	100	1,924.00	192,400	
ニッポン	300	1,587.00	476,100	
日清製粉グループ本社	1,100	1,753.00	1,928,300	
昭和産業	100	3,005.00	300,500	
鳥越製粉	100	822.00	82,200	
中部飼料	100	1,425.00	142,500	
フィード・ワン	100	869.00	86,900	
DM三井製糖ホールディングス	100	1,865.00	186,500	
塩水港精糖	100	237.00	23,700	
LIFULL	300	399.00	119,700	
ミクシィ	200	2,778.00	555,600	
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,805.00	180,500	
日本M&Aセンター	1,500	2,981.00	4,471,500	
UTグループ	100	3,640.00	364,000	
タケエイ	100	1,302.00	130,200	
夢真ビーネックスグループ	200	1,531.00	306,200	
コシダカホールディングス	200	531.00	106,200	
パソナグループ	100	2,082.00	208,200	
リンクアンドモチベーション	200	625.00	125,000	
GCA	100	815.00	81,500	
エス・エム・エス	300	3,295.00	988,500	
パーソルホールディングス	900	2,070.00	1,863,000	
クックパッド	300	314.00	94,200	
森永製菓	200	3,740.00	748,000	
江崎グリコ	300	4,235.00	1,270,500	
井村屋グループ	100	2,480.00	248,000	
不二家	100	2,211.00	221,100	
山崎製パン	700	1,708.00	1,195,600	
亀田製菓	100	4,710.00	471,000	
寿スピリッツ	100	6,340.00	634,000	
カルビー	400	2,628.00	1,051,200	
森永乳業	200	5,830.00	1,166,000	
六甲バター	100	1,658.00	165,800	
ヤクルト本社	600	5,270.00	3,162,000	
明治ホールディングス	600	6,800.00	4,080,000	
雪印メグミルク	200	2,231.00	446,200	
プリマハム	100	3,380.00	338,000	

日本ハム	400	4,780.00	1,912,000
丸大食品	100	1,699.00	169,900
S Foods	100	3,415.00	341,500
伊藤ハム米久ホールディングス	600	711.00	426,600
システナ	300	2,231.00	669,300
デジタルアーツ	100	9,400.00	940,000
日鉄ソリューションズ	100	3,600.00	360,000
総合警備保障	400	4,895.00	1,958,000
いちご	1,000	318.00	318,000
日本駐車場開発	900	157.00	141,300
カカクコム	700	3,020.00	2,114,000
セントケア・ホールディング	100	1,252.00	125,200
ルネサンス	100	1,132.00	113,200
ディップ	100	3,150.00	315,000
SBSホールディングス	100	2,679.00	267,900
デジタルホールディングス	100	1,943.00	194,300
新日本科学	100	735.00	73,500
ベネフィット・ワン	300	2,983.00	894,900
エムスリー	1,600	8,186.00	13,097,600
ツカダ・グローバルホールディング	100	333.00	33,300
アウトソーシング	500	1,725.00	862,500
ウェルネット	100	585.00	58,500
ディー・エヌ・エー	400	2,201.00	880,400
博報堂DYホールディングス	1,200	1,836.00	2,203,200
ぐるなび	200	590.00	118,000
タカミヤ	100	555.00	55,500
ジャパンベストレスキューシステム	100	763.00	76,300
ファンコミュニケーションズ	200	409.00	81,800
エスプール	200	927.00	185,400
ティア	100	486.00	48,600
アドウェイズ	100	903.00	90,300
バリューコマース	100	3,730.00	373,000
インフォマート	900	1,026.00	923,400
サッポロホールディングス	300	2,177.00	653,100
アサヒグループホールディングス	2,000	4,549.00	9,098,000
キリンホールディングス	3,900	2,053.50	8,008,650
宝ホールディングス	700	1,457.00	1,019,900
オエノンホールディングス	300	396.00	118,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	700	1,712.00	1,198,400
サントリー食品インターナショナル	600	3,760.00	2,256,000
ガイドグループホールディングス	100	5,240.00	524,000
伊藤園	300	6,030.00	1,809,000
キーコーヒー	100	2,081.00	208,100
日清オイリオグループ	100	3,095.00	309,500
不二製油グループ本社	200	2,904.00	580,800
J-オイルミルズ	100	1,877.00	187,700
ローソン	200	5,270.00	1,054,000
サンエー	100	4,410.00	441,000
カワチ薬品	100	2,655.00	265,500

エービーシー・マート	100	5,850.00	585,000	
アスクル	100	4,125.00	412,500	
ゲオホールディングス	100	1,167.00	116,700	
アダストリア	100	1,866.00	186,600	
ジーフット	100	409.00	40,900	
くら寿司	100	7,580.00	758,000	
エレマテック	100	1,051.00	105,100	
バルグループホールディングス	100	1,544.00	154,400	
エディオン	400	1,227.00	490,800	
あらた	100	4,600.00	460,000	
サーラコーポレーション	200	614.00	122,800	
J Pホールディングス	300	306.00	91,800	
フジオフードグループ本社	100	1,459.00	145,900	
ひらまつ	200	153.00	30,600	
フィールズ	100	523.00	52,300	
双日	5,000	306.00	1,530,000	
アルフレッサホールディングス	900	2,013.00	1,811,700	
ハニーズホールディングス	100	1,077.00	107,700	
キッコーマン	700	6,320.00	4,424,000	
味の素	2,200	2,170.50	4,775,100	
キュービー	500	2,565.00	1,282,500	
ハウス食品グループ本社	300	3,470.00	1,041,000	
カゴメ	400	3,295.00	1,318,000	
アリアケジャパン	100	6,410.00	641,000	
ニチレイ	400	2,743.00	1,097,200	
横浜冷凍	200	909.00	181,800	
東洋水産	500	4,510.00	2,255,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	924.00	92,400	
日清食品ホールディングス	400	7,800.00	3,120,000	
フジッコ	100	1,944.00	194,400	
ロック・フィールド	100	1,644.00	164,400	
日本たばこ産業	5,000	2,077.00	10,385,000	
ケンコーマヨネーズ	100	1,763.00	176,300	
わらべや日洋ホールディングス	100	2,023.00	202,300	
なとり	100	1,930.00	193,000	
ファーマフーズ	100	3,445.00	344,500	
北の達人コーポレーション	300	520.00	156,000	
ユーグレナ	400	912.00	364,800	
A Dワークスグループ	200	159.00	31,800	
片倉工業	100	1,500.00	150,000	
グンゼ	100	3,935.00	393,500	
ヒューリック	1,900	1,295.00	2,460,500	
アルペン	100	2,525.00	252,500	
ラクーンホールディングス	100	2,857.00	285,700	
クオールホールディングス	100	1,440.00	144,000	
アルコニックス	100	1,575.00	157,500	
神戸物産	600	3,060.00	1,836,000	
ピックカメラ	500	1,180.00	590,000	
D C Mホールディングス	600	1,162.00	697,200	
ペッパーフードサービス	100	278.00	27,800	

MonotaRO	1,300	2,847.00	3,701,100	
あいホールディングス	100	2,146.00	214,600	
アークランドサービスホールディングス	100	2,222.00	222,200	
J・フロントリテイリング	1,100	935.00	1,028,500	
ドトール・日レスホールディングス	100	1,570.00	157,000	
マツモトキヨシホールディングス	400	4,480.00	1,792,000	
ZOZO	500	3,500.00	1,750,000	
ココカラファイン	100	7,820.00	782,000	
三越伊勢丹ホールディングス	1,600	705.00	1,128,000	
東洋紡	400	1,402.00	560,800	
ユニチカ	300	401.00	120,300	
日清紡ホールディングス	600	842.00	505,200	
倉敷紡績	100	1,892.00	189,200	
ダイワボウホールディングス	400	1,744.00	697,600	
シキボウ	100	990.00	99,000	
日東紡績	100	3,955.00	395,500	
トヨタ紡織	300	1,860.00	558,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	200	2,305.00	461,000	
ウエルシアホールディングス	500	3,585.00	1,792,500	
クリエイトSDホールディングス	100	3,460.00	346,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	709.00	141,800	
八洲電機	100	969.00	96,900	
メディアスホールディングス	100	927.00	92,700	
レスターホールディングス	100	2,020.00	202,000	
丸善CHIホールディングス	100	390.00	39,000	
TOKAIホールディングス	400	923.00	369,200	
三洋貿易	100	1,108.00	110,800	
シュッピン	100	1,142.00	114,200	
オイシックス・ラ・大地	100	3,005.00	300,500	
ウイン・パートナーズ	100	1,004.00	100,400	
ネクステージ	200	1,797.00	359,400	
ジョイフル本田	300	1,376.00	412,800	
ホットランド	100	1,294.00	129,400	
すかいらーくホールディングス	1,000	1,635.00	1,635,000	
綿半ホールディングス	100	1,304.00	130,400	
日本毛織	300	998.00	299,400	
ダイトウボウ	100	111.00	11,100	
ダイドーリミテッド	100	181.00	18,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	1,174.00	352,200	
野村不動産ホールディングス	600	2,619.00	1,571,400	
三重交通グループホールディングス	200	479.00	95,800	
サムティ	100	1,962.00	196,200	
ディア・ライフ	100	468.00	46,800	
日本商業開発	100	1,690.00	169,000	
プレサンスコーポレーション	200	1,790.00	358,000	
THEグローバル社	100	263.00	26,300	
フージャースホールディングス	100	670.00	67,000	

オープンハウス	300	4,870.00	1,461,000
東急不動産ホールディングス	2,500	587.00	1,467,500
飯田グループホールディングス	800	2,749.00	2,199,200
ムゲンエステート	100	497.00	49,700
帝国繊維	100	2,186.00	218,600
日本コークス工業	800	107.00	85,600
あさひ	100	1,552.00	155,200
日本調剤	100	1,761.00	176,100
コスモス薬品	100	16,090.00	1,609,000
シップヘルスケアホールディングス	300	2,906.00	871,800
セブン&アイ・ホールディングス	3,600	4,556.00	16,401,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	500	727.00	363,500
ツルハホールディングス	200	13,130.00	2,626,000
サンマルクホールディングス	100	1,674.00	167,400
トリドールホールディングス	200	1,677.00	335,400
帝人	900	1,830.00	1,647,000
東レ	6,600	689.60	4,551,360
クラレ	1,400	1,216.00	1,702,400
旭化成	6,000	1,220.00	7,320,000
T O K Y O B A S E	100	700.00	70,000
稲葉製作所	100	1,508.00	150,800
トーカロ	200	1,482.00	296,400
S U M C O	1,200	2,844.00	3,412,800
日本フェルト	100	440.00	44,000
エコナックホールディングス	200	94.00	18,800
アツギ	100	556.00	55,600
J Mホールディングス	100	2,165.00	216,500
コメダホールディングス	200	2,006.00	401,200
アレンザホールディングス	100	1,286.00	128,600
パロックジャパンリミテッド	100	760.00	76,000
クスリのアオキホールディングス	100	8,310.00	831,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	500	5,030.00	2,515,000
セーレン	200	1,983.00	396,600
小松マテーレ	100	993.00	99,300
ワコールホールディングス	200	2,461.00	492,200
ホギメディカル	100	3,305.00	330,500
T S Iホールディングス	300	342.00	102,600
ワールド	100	1,387.00	138,700
T I S	900	2,661.00	2,394,900
グリー	600	585.00	351,000
コーエーテクモホールディングス	200	5,110.00	1,022,000
ファインデックス	100	1,233.00	123,300
K L a b	200	839.00	167,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	100	1,274.00	127,400
ネクソン	2,300	3,570.00	8,211,000
アイスタイル	300	479.00	143,700
エイチーム	100	1,760.00	176,000

エニグモ	100	1,383.00	138,300
テクノスジャパン	100	699.00	69,900
コロプラ	300	874.00	262,200
オルトプラス	100	494.00	49,400
ブロードリーフ	500	548.00	274,000
システム情報	100	1,041.00	104,100
じげん	200	418.00	83,600
ディー・エル・イー	100	315.00	31,500
フィックスターズ	100	998.00	99,800
オプティム	100	2,950.00	295,000
特種東海製紙	100	4,575.00	457,500
ティーガイア	100	1,932.00	193,200
日本アジアグループ	100	938.00	93,800
テクマトリックス	100	2,141.00	214,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	2,230.00	446,000
GMOペイメントゲートウェイ	200	14,240.00	2,848,000
インターネットイニシアティブ	200	2,583.00	516,600
さくらインターネット	100	801.00	80,100
朝日ネット	100	777.00	77,700
e B A S E	100	1,008.00	100,800
アバント	100	1,829.00	182,900
フリービット	100	982.00	98,200
コムチュア	100	2,643.00	264,300
アステリア	100	899.00	89,900
アイル	100	1,801.00	180,100
王子ホールディングス	4,100	726.00	2,976,600
日本製紙	400	1,340.00	536,000
三菱製紙	100	360.00	36,000
北越コーポレーション	600	567.00	340,200
大王製紙	400	1,885.00	754,000
メディカル・データ・ビジョン	100	2,281.00	228,100
g u m i	100	1,202.00	120,200
オープンドア	100	1,817.00	181,700
カナミックネットワーク	100	727.00	72,700
レンゴー	900	931.00	837,900
トーモク	100	1,812.00	181,200
ザ・バック	100	2,886.00	288,600
チェンジ	100	3,830.00	383,000
シンクロ・フード	100	403.00	40,300
A O I T Y O H O L D I N G S	100	637.00	63,700
マクロミル	200	917.00	183,400
昭和電工	700	3,345.00	2,341,500
住友化学	7,100	576.00	4,089,600
日産化学	500	5,940.00	2,970,000
クレハ	100	7,870.00	787,000
テイカ	100	1,464.00	146,400
石原産業	200	934.00	186,800
日本曹達	100	3,380.00	338,000
東ソー	1,400	2,102.00	2,942,800

トクヤマ	300	2,818.00	845,400
セントラル硝子	200	2,348.00	469,600
東亜合成	600	1,296.00	777,600
大阪ソーダ	100	2,678.00	267,800
関東電化工業	200	902.00	180,400
デンカ	300	4,445.00	1,333,500
イビデン	400	5,260.00	2,104,000
信越化学工業	1,700	19,035.00	32,359,500
堺化学工業	100	2,041.00	204,100
第一稀元素化学工業	100	1,389.00	138,900
エア・ウォーター	900	1,834.00	1,650,600
日本酸素ホールディングス	700	2,066.00	1,446,200
日本パーカライジング	500	1,116.00	558,000
高压ガス工業	100	723.00	72,300
四国化成工業	100	1,306.00	130,600
日本触媒	200	6,020.00	1,204,000
大日精化工業	100	2,378.00	237,800
カネカ	200	4,470.00	894,000
協和キリン	900	3,265.00	2,938,500
三菱瓦斯化学	900	2,647.00	2,382,300
三井化学	800	3,590.00	2,872,000
J S R	900	3,455.00	3,109,500
東京応化工業	200	7,250.00	1,450,000
大阪有機化学工業	100	4,265.00	426,500
三菱ケミカルホールディングス	6,100	840.00	5,124,000
K Hネオケム	100	2,720.00	272,000
ダイセル	1,200	866.00	1,039,200
住友ベークライト	100	4,540.00	454,000
積水化学工業	1,900	2,104.00	3,997,600
日本ゼオン	800	1,675.00	1,340,000
アイカ工業	300	3,945.00	1,183,500
宇部興産	500	2,307.00	1,153,500
積水樹脂	100	2,115.00	211,500
タキロンシーアイ	200	713.00	142,600
旭有機材	100	1,455.00	145,500
リケンテクノス	200	521.00	104,200
積水化成成品工業	100	601.00	60,100
ダイキョーニシカワ	200	767.00	153,400
日本化薬	600	1,064.00	638,400
カーリットホールディングス	100	720.00	72,000
E P Sホールディングス	100	1,190.00	119,000
プレステージ・インターナショナル	300	755.00	226,500
プロトコーポレーション	100	1,195.00	119,500
野村総合研究所	1,700	3,350.00	5,695,000
サイバネットシステム	100	903.00	90,300
クイック	100	1,203.00	120,300
電通グループ	1,000	3,320.00	3,320,000
インテージホールディングス	100	1,356.00	135,600
ソースネクスト	400	333.00	133,200
シーティーエス	100	871.00	87,100

インフォコム	100	2,975.00	297,500
メディカルシステムネットワーク	100	902.00	90,200
日本精化	100	1,500.00	150,000
扶桑化学工業	100	4,100.00	410,000
トリケミカル研究所	100	3,780.00	378,000
ラクスル	100	5,310.00	531,000
F I G	100	299.00	29,900
A D E K A	400	2,177.00	870,800
日油	300	5,960.00	1,788,000
新日本理化	200	284.00	56,800
ハリマ化成グループ	100	935.00	93,500
アルテリア・ネットワークス	100	1,575.00	157,500
S a n s a n	100	9,020.00	902,000
花王	2,200	7,115.00	15,653,000
三洋化成工業	100	5,440.00	544,000
武田薬品工業	7,700	3,674.00	28,289,800
アステラス製薬	8,000	1,653.50	13,228,000
大日本住友製薬	700	1,846.00	1,292,200
塩野義製薬	1,200	5,646.00	6,775,200
わかもと製薬	100	364.00	36,400
日本新薬	300	7,770.00	2,331,000
中外製薬	2,900	4,255.00	12,339,500
科研製薬	200	4,405.00	881,000
エーザイ	1,000	7,345.00	7,345,000
理研ビタミン	100	1,396.00	139,600
ロート製薬	400	2,850.00	1,140,000
小野薬品工業	2,100	2,880.00	6,048,000
久光製薬	300	6,590.00	1,977,000
有機合成薬品工業	100	295.00	29,500
持田製薬	100	4,015.00	401,500
参天製薬	1,600	1,462.00	2,339,200
ツムラ	300	3,790.00	1,137,000
日医工	300	940.00	282,000
テルモ	2,800	4,083.00	11,432,400
H . U . グループホールディングス	200	3,750.00	750,000
キッセイ薬品工業	200	2,296.00	459,200
生化学工業	200	1,018.00	203,600
栄研化学	200	2,218.00	443,600
鳥居薬品	100	2,866.00	286,600
J C R ファーマ	300	2,982.00	894,600
東和薬品	100	2,278.00	227,800
富士製薬工業	100	1,244.00	124,400
ゼリア新薬工業	200	2,015.00	403,000
第一三共	8,000	2,921.50	23,372,000
キョーリン製薬ホールディングス	200	1,895.00	379,000
大幸薬品	100	1,211.00	121,100
ダイト	100	3,600.00	360,000
大塚ホールディングス	1,900	4,277.00	8,126,300
大正製薬ホールディングス	200	6,610.00	1,322,000
ペプチドリーム	500	4,805.00	2,402,500

大日本塗料	100	888.00	88,800
日本ペイントホールディングス	3,700	1,609.00	5,953,300
関西ペイント	1,000	2,924.00	2,924,000
神東塗料	100	206.00	20,600
中国塗料	200	1,004.00	200,800
日本特殊塗料	100	1,025.00	102,500
藤倉化成	100	549.00	54,900
太陽ホールディングス	100	5,900.00	590,000
D I C	400	2,882.00	1,152,800
サカタインクス	200	1,038.00	207,600
東洋インキS Cホールディングス	200	2,068.00	413,600
T & K T O K A	100	820.00	82,000
アルプス技研	100	2,070.00	207,000
サニックス	100	341.00	34,100
日本空調サービス	100	738.00	73,800
オリエンタルランド	900	15,430.00	13,887,000
フォーカスシステムズ	100	952.00	95,200
ダスキン	200	2,648.00	529,600
パーク24	500	1,910.00	955,000
明光ネットワークジャパン	100	599.00	59,900
クレスコ	100	1,680.00	168,000
フジ・メディア・ホールディングス	900	1,310.00	1,179,000
ラウンドワン	300	1,054.00	316,200
リゾートトラスト	400	1,721.00	688,400
オービック	300	20,070.00	6,021,000
ジャストシステム	100	6,520.00	652,000
T D C ソフト	100	1,022.00	102,200
Zホールディングス	12,500	561.90	7,023,750
ビー・エム・エル	100	3,795.00	379,500
トレンドマイクロ	500	5,330.00	2,665,000
りらいあコミュニケーションズ	100	1,419.00	141,900
リソー教育	400	314.00	125,600
日本オラクル	200	10,340.00	2,068,000
フューチャー	100	2,023.00	202,300
C A C H o l d i n g s	100	1,456.00	145,600
ユー・エス・エス	1,000	2,074.00	2,074,000
オービックビジネスコンサルタント	100	5,650.00	565,000
伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,660.00	1,464,000
アイティフォー	100	817.00	81,700
東京個別指導学院	100	611.00	61,100
サイバーエージェント	2,200	1,999.00	4,397,800
楽天グループ	4,100	1,333.00	5,465,300
モーニングスター	100	482.00	48,200
テー・オー・ダブリュー	200	332.00	66,400
大塚商会	500	5,210.00	2,605,000
サイボウズ	100	2,540.00	254,000
山田コンサルティンググループ	100	1,181.00	118,100
電通国際情報サービス	100	4,090.00	409,000
A C C E S S	100	849.00	84,900
デジタルガレージ	200	4,865.00	973,000

イーエムシステムズ	200	869.00	173,800
C I J	100	896.00	89,600
日本エンタープライズ	100	238.00	23,800
スカラ	100	812.00	81,200
インテリジェント ウェイブ	100	695.00	69,500
フルキャストホールディングス	100	1,911.00	191,100
エン・ジャパン	200	3,320.00	664,000
あすか製薬ホールディングス	100	1,373.00	137,300
サワイグループホールディングス	200	5,160.00	1,032,000
富士フイルムホールディングス	1,600	6,915.00	11,064,000
コニカミノルタ	1,900	605.00	1,149,500
資生堂	1,800	7,754.00	13,957,200
ライオン	1,200	2,105.00	2,526,000
高砂香料工業	100	2,688.00	268,800
マンダム	200	2,099.00	419,800
ミルボン	100	5,890.00	589,000
ファンケル	300	3,580.00	1,074,000
コーセー	200	15,960.00	3,192,000
ポーラ・オルビスホールディングス	400	2,509.00	1,003,600
ノエビアホールディングス	100	4,885.00	488,500
エステー	100	1,879.00	187,900
コニシ	200	1,721.00	344,200
長谷川香料	200	2,233.00	446,600
星光PMC	100	792.00	79,200
小林製薬	300	9,860.00	2,958,000
荒川化学工業	100	1,290.00	129,000
メック	100	2,368.00	236,800
タカラバイオ	200	2,855.00	571,000
JCU	100	4,250.00	425,000
新田ゼラチン	100	651.00	65,100
デクセリアルズ	300	1,995.00	598,500
アース製薬	100	6,420.00	642,000
北興化学工業	100	1,087.00	108,700
クミアイ化学工業	400	963.00	385,200
日本農薬	200	595.00	119,000
ニチレキ	100	1,537.00	153,700
ユシロ化学工業	100	1,150.00	115,000
富士石油	200	230.00	46,000
出光興産	1,000	2,665.00	2,665,000
ENEOSホールディングス	13,900	477.00	6,630,300
コスモエネルギーホールディングス	300	2,431.00	729,300
横浜ゴム	500	2,079.00	1,039,500
TOYO TIRE	500	2,063.00	1,031,500
ブリヂストン	2,500	4,406.00	11,015,000
住友ゴム工業	800	1,348.00	1,078,400
藤倉コンポジット	100	502.00	50,200
オカモト	100	4,090.00	409,000
アキレス	100	1,444.00	144,400
ニッタ	100	2,663.00	266,300
住友理工	200	727.00	145,400

三ツ星ベルト	100	1,775.00	177,500
バンドー化学	200	753.00	150,600
A G C	900	4,955.00	4,459,500
日本板硝子	500	698.00	349,000
有沢製作所	100	993.00	99,300
日本電気硝子	300	2,701.00	810,300
住友大阪セメント	200	3,655.00	731,000
太平洋セメント	500	2,848.00	1,424,000
日本ヒューム	100	734.00	73,400
日本コンクリート工業	200	406.00	81,200
アジアパイルホールディングス	100	520.00	52,000
東海カーボン	900	1,758.00	1,582,200
日本カーボン	100	4,690.00	469,000
東洋炭素	100	2,141.00	214,100
ノリタケカンパニーリミテド	100	3,495.00	349,500
T O T O	700	6,200.00	4,340,000
日本碍子	1,000	1,979.00	1,979,000
日本特殊陶業	700	1,886.00	1,320,200
ダントーホールディングス	100	310.00	31,000
ヨータイ	100	1,063.00	106,300
東京窯業	100	322.00	32,200
フジインコーポレーテッド	100	4,530.00	453,000
ニチアス	200	2,824.00	564,800
日本製鉄	4,400	1,916.00	8,430,400
神戸製鋼所	1,700	760.00	1,292,000
中山製鋼所	100	437.00	43,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,700	1,410.00	3,807,000
東京製鐵	400	944.00	377,600
共英製鋼	100	1,568.00	156,800
大和工業	200	3,270.00	654,000
淀川製鋼所	100	2,452.00	245,200
丸一鋼管	300	2,728.00	818,400
大同特殊鋼	200	4,850.00	970,000
日本冶金工業	100	2,004.00	200,400
山陽特殊製鋼	100	1,688.00	168,800
愛知製鋼	100	3,590.00	359,000
日立金属	900	1,911.00	1,719,900
大平洋金属	100	2,138.00	213,800
新日本電工	600	365.00	219,000
日本製鋼所	300	2,613.00	783,900
三菱製鋼	100	860.00	86,000
日亜鋼業	100	319.00	31,900
大紀アルミニウム工業所	100	988.00	98,800
日本軽金属ホールディングス	200	2,151.00	430,200
三井金属鉱業	200	3,675.00	735,000
東邦亜鉛	100	2,315.00	231,500
三菱マテリアル	600	2,476.00	1,485,600
住友金属鉱山	1,200	4,770.00	5,724,000
D O W Aホールディングス	200	4,575.00	915,000

古河機械金属	200	1,279.00	255,800
エス・サイエンス	400	38.00	15,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	966.00	96,600
東邦チタニウム	200	971.00	194,200
U A C J	100	2,566.00	256,600
古河電気工業	300	2,946.00	883,800
住友電気工業	3,200	1,672.50	5,352,000
フジクラ	1,100	528.00	580,800
昭和電線ホールディングス	100	1,678.00	167,800
タツタ電線	200	619.00	123,800
平河ヒューテック	100	1,311.00	131,100
リョービ	100	1,670.00	167,000
アーレスティ	100	493.00	49,300
アサヒホールディングス	300	2,228.00	668,400
東洋製罐グループホールディングス	600	1,288.00	772,800
コロナ	100	942.00	94,200
横河ブリッジホールディングス	200	2,079.00	415,800
三和ホールディングス	900	1,399.00	1,259,100
文化シャッター	300	977.00	293,100
三協立山	100	839.00	83,900
アルインコ	100	996.00	99,600
L I X I L	1,300	3,110.00	4,043,000
日本フィルコン	100	514.00	51,400
ノーリツ	200	1,779.00	355,800
長府製作所	100	2,113.00	211,300
リンナイ	200	11,530.00	2,306,000
ユニプレス	200	1,082.00	216,400
日東精工	100	575.00	57,500
岡部	200	770.00	154,000
ジーテクト	100	1,495.00	149,500
東プレ	200	1,511.00	302,200
高周波熱錬	200	565.00	113,000
東京製綱	100	1,100.00	110,000
サンコール	100	463.00	46,300
モリテックスチール	100	425.00	42,500
パイオラックス	100	1,521.00	152,100
エイチワン	100	807.00	80,700
日本発条	900	814.00	732,600
三浦工業	400	5,810.00	2,324,000
タクマ	300	2,340.00	702,000
テクノプロ・ホールディングス	200	8,630.00	1,726,000
K e e P e r 技研	100	2,405.00	240,500
G u n o s y	100	925.00	92,500
ジャパンマテリアル	300	1,358.00	407,400
ベクトル	100	1,009.00	100,900
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,278.00	127,800
I B J	100	911.00	91,100
M & A キャピタルパートナーズ	100	5,290.00	529,000
ウィルグループ	100	1,065.00	106,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	278.00	27,800

リクルートホールディングス	6,300	5,008.00	31,550,400	
エラン	100	1,366.00	136,600	
ツガミ	200	1,805.00	361,000	
オークマ	100	6,190.00	619,000	
芝浦機械	100	2,770.00	277,000	
アマダ	1,300	1,177.00	1,530,100	
アイダエンジニアリング	200	980.00	196,000	
F U J I	400	2,925.00	1,170,000	
牧野フライス製作所	100	4,330.00	433,000	
オーエスジー	500	1,911.00	955,500	
旭ダイヤモンド工業	200	533.00	106,600	
D M G 森精機	600	1,785.00	1,071,000	
ソディック	200	1,030.00	206,000	
ディスコ	100	37,400.00	3,740,000	
日進工具	100	1,561.00	156,100	
パンチ工業	100	588.00	58,800	
日本郵政	6,700	927.20	6,212,240	
ベルシステム24ホールディングス	100	1,736.00	173,600	
鎌倉新書	100	1,298.00	129,800	
アトラエ	100	1,674.00	167,400	
ソラスト	200	1,454.00	290,800	
インソース	100	2,625.00	262,500	
豊田自動織機	800	9,430.00	7,544,000	
豊和工業	100	934.00	93,400	
東洋機械金属	100	505.00	50,500	
島精機製作所	100	2,295.00	229,500	
オプトラン	100	2,942.00	294,200	
イワキ	100	1,054.00	105,400	
フリー	100	989.00	98,900	
ヤマシンフィルタ	200	835.00	167,000	
日阪製作所	100	904.00	90,400	
やまびこ	200	1,222.00	244,400	
ペガサスミシン製造	100	514.00	51,400	
ナブテスコ	500	5,130.00	2,565,000	
三井海洋開発	100	2,152.00	215,200	
レオン自動機	100	1,188.00	118,800	
S M C	300	65,900.00	19,770,000	
オイレス工業	100	1,648.00	164,800	
サトーホールディングス	100	2,745.00	274,500	
技研製作所	100	4,820.00	482,000	
日精樹脂工業	100	982.00	98,200	
小松製作所	4,200	3,245.00	13,629,000	
住友重機械工業	500	3,165.00	1,582,500	
日立建機	400	3,345.00	1,338,000	
日工	100	730.00	73,000	
井関農機	100	1,643.00	164,300	
T O W A	100	2,268.00	226,800	
シンニッタン	100	255.00	25,500	
クボタ	4,900	2,551.50	12,502,350	
東洋エンジニアリング	100	696.00	69,600	

月島機械	200	1,271.00	254,200
帝国電機製作所	100	1,383.00	138,300
新東工業	200	751.00	150,200
澁谷工業	100	3,450.00	345,000
アイチコーポレーション	200	858.00	171,600
小森コーポレーション	200	768.00	153,600
鶴見製作所	100	1,722.00	172,200
荏原製作所	400	4,785.00	1,914,000
西島製作所	100	859.00	85,900
北越工業	100	1,083.00	108,300
ダイキン工業	1,200	22,010.00	26,412,000
栗田工業	500	5,030.00	2,515,000
橋本チエイン	100	2,980.00	298,000
日機装	300	1,120.00	336,000
木村化工機	100	732.00	73,200
レイズネクスト	200	1,201.00	240,200
アネスト岩田	200	1,029.00	205,800
ダイフク	500	10,880.00	5,440,000
加藤製作所	100	1,073.00	107,300
タダノ	400	1,177.00	470,800
フジテック	300	2,364.00	709,200
C K D	200	2,454.00	490,800
キトー	100	1,795.00	179,500
平和	300	1,852.00	555,600
理想科学工業	100	1,365.00	136,500
S A N K Y O	200	2,906.00	581,200
日本金銭機械	100	601.00	60,100
マースグループホールディングス	100	1,611.00	161,100
フクシマガリレイ	100	4,125.00	412,500
竹内製作所	200	3,020.00	604,000
アマノ	200	2,726.00	545,200
J U K I	100	893.00	89,300
サンデンホールディングス	100	362.00	36,200
蛇の目ミシン工業	100	815.00	81,500
ブラザー工業	1,100	2,402.00	2,642,200
マックス	100	1,634.00	163,400
モリタホールディングス	100	1,644.00	164,400
グローリー	200	2,384.00	476,800
新晃工業	100	2,270.00	227,000
大和冷機工業	100	1,117.00	111,700
セガサミーホールディングス	800	1,609.00	1,287,200
T P R	100	1,593.00	159,300
ツバキ・ナカシマ	200	1,595.00	319,000
ホシザキ	300	9,850.00	2,955,000
大豊工業	100	1,035.00	103,500
日本精工	1,900	1,074.00	2,040,600
N T N	2,100	334.00	701,400
ジェイテクト	900	1,067.00	960,300
不二越	100	4,550.00	455,000
ミネベアミツミ	1,600	2,791.00	4,465,600

日本トムソン	300	669.00	200,700
THK	600	3,810.00	2,286,000
ユーシン精機	100	907.00	90,700
前澤給装工業	100	1,141.00	114,100
イーグル工業	100	1,272.00	127,200
前澤工業	100	691.00	69,100
日本ピラー工業	100	1,785.00	178,500
キッツ	300	717.00	215,100
日立製作所	4,500	5,056.00	22,752,000
東芝	1,400	4,350.00	6,090,000
三菱電機	9,300	1,661.00	15,447,300
富士電機	600	4,855.00	2,913,000
安川電機	1,000	5,240.00	5,240,000
シンフォニアテクノロジー	100	1,447.00	144,700
明電舎	200	2,393.00	478,600
デンヨー	100	2,000.00	200,000
ベイカレント・コンサルティング	100	31,250.00	3,125,000
グレイステクノロジー	100	2,893.00	289,300
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	300	2,250.00	675,000
日総工業	100	769.00	76,900
RPAホールディングス	100	886.00	88,600
三櫻工業	100	1,232.00	123,200
マキタ	1,200	5,220.00	6,264,000
東芝テック	100	4,310.00	431,000
マブチモーター	300	4,635.00	1,390,500
日本電産	2,200	13,630.00	29,986,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	937.00	93,700
ダブル・スコープ	200	691.00	138,200
ダイヘン	100	4,830.00	483,000
ヤーマン	200	1,591.00	318,200
JVCケンウッド	800	229.00	183,200
ミマキエンジニアリング	100	667.00	66,700
日新電機	200	1,238.00	247,600
大崎電気工業	200	602.00	120,400
オムロン	800	8,710.00	6,968,000
日東工業	100	2,015.00	201,500
IDEC	100	1,768.00	176,800
ジーエス・ユアサコーポレーション	300	2,995.00	898,500
日本電気	1,200	6,350.00	7,620,000
富士通	800	16,270.00	13,016,000
沖電気工業	400	1,148.00	459,200
サンケン電気	100	5,380.00	538,000
アイホン	100	1,761.00	176,100
ルネサスエレクトロニクス	4,000	1,295.00	5,180,000
セイコーエプソン	1,200	1,911.00	2,293,200
ワコム	700	743.00	520,100
アルバック	200	5,100.00	1,020,000
EIZO	100	4,205.00	420,500
ジャパンディスプレイ	3,200	47.00	150,400

日本信号	200	953.00	190,600
京三製作所	200	416.00	83,200
能美防災	100	2,137.00	213,700
ホーチキ	100	1,343.00	134,300
エレコム	200	2,407.00	481,400
パナソニック	9,900	1,366.00	13,523,400
シャープ	1,200	1,865.00	2,238,000
アンリツ	600	2,432.00	1,459,200
富士通ゼネラル	300	2,949.00	884,700
ソニーグループ	5,800	11,865.00	68,817,000
T D K	400	15,440.00	6,176,000
タムラ製作所	300	545.00	163,500
アルプスアルパイン	800	1,315.00	1,052,000
日本電波工業	100	772.00	77,200
ローランド ディー・ジー	100	1,742.00	174,200
フォスター電機	100	1,275.00	127,500
ヨコオ	100	2,701.00	270,100
ティアック	100	138.00	13,800
ホシデン	300	1,110.00	333,000
ヒロセ電機	100	17,290.00	1,729,000
日本航空電子工業	200	1,727.00	345,400
T O A	100	904.00	90,400
マクセルホールディングス	200	1,458.00	291,600
古野電気	100	1,163.00	116,300
スミダコーポレーション	100	1,113.00	111,300
本多通信工業	100	503.00	50,300
船井電機	100	920.00	92,000
横河電機	900	2,028.00	1,825,200
アズビル	600	4,425.00	2,655,000
日本光電工業	400	3,240.00	1,296,000
共和電業	100	391.00	39,100
堀場製作所	200	7,450.00	1,490,000
アドバンテスト	700	10,300.00	7,210,000
エスベック	100	1,909.00	190,900
キーエンス	900	50,590.00	45,531,000
シスメックス	700	11,295.00	7,906,500
日本マイクロニクス	200	1,872.00	374,400
メガチップス	100	3,690.00	369,000
O B A R A G R O U P	100	3,730.00	373,000
I M A G I C A G R O U P	100	532.00	53,200
デンソー	2,000	7,130.00	14,260,000
コーセル	100	1,080.00	108,000
イリソ電子工業	100	5,070.00	507,000
オプテックスグループ	200	1,682.00	336,400
レーザーテック	400	18,780.00	7,512,000
スタンレー電気	600	3,270.00	1,962,000
ウシオ電機	500	1,476.00	738,000
岡谷電機産業	100	378.00	37,800
ヘリオス テクノ ホールディング	100	370.00	37,000
日本セラミック	100	2,664.00	266,400

古河電池	100	1,676.00	167,600
山一電機	100	1,643.00	164,300
図研	100	2,868.00	286,800
日本電子	200	5,770.00	1,154,000
カシオ計算機	700	1,907.00	1,334,900
ファナック	800	26,740.00	21,392,000
日本シイエムケイ	200	459.00	91,800
ローム	400	11,400.00	4,560,000
浜松ホトニクス	700	6,490.00	4,543,000
三井ハイテック	100	4,630.00	463,000
新光電気工業	300	3,420.00	1,026,000
京セラ	1,400	7,055.00	9,877,000
太陽誘電	400	5,100.00	2,040,000
村田製作所	2,700	8,945.00	24,151,500
双葉電子工業	200	906.00	181,200
日東電工	600	9,510.00	5,706,000
東海理化電機製作所	200	1,823.00	364,600
ニチコン	300	1,135.00	340,500
日本ケミコン	100	1,717.00	171,700
K O A	100	1,611.00	161,100
三井E & S ホールディングス	400	529.00	211,600
日立造船	700	814.00	569,800
三菱重工業	1,500	3,271.00	4,906,500
川崎重工業	700	2,552.00	1,786,400
I H I	600	2,132.00	1,279,200
名村造船所	300	199.00	59,700
サノヤスホールディングス	100	153.00	15,300
カーブスホールディングス	200	960.00	192,000
三菱ロジスネクスト	100	1,233.00	123,300
F P G	300	666.00	199,800
じもとホールディングス	100	728.00	72,800
全国保証	200	5,010.00	1,002,000
めぶきフィナンシャルグループ	4,800	242.00	1,161,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	1,240.00	124,000
九州フィナンシャルグループ	1,900	432.00	820,800
かんぽ生命保険	1,100	2,146.00	2,360,600
ゆうちょ銀行	2,600	984.00	2,558,400
富山第一銀行	200	291.00	58,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,600	416.00	2,329,600
西日本フィナンシャルホールディングス	600	715.00	429,000
アルヒ	100	1,740.00	174,000
日産自動車	10,900	557.20	6,073,480
いすゞ自動車	2,700	1,136.00	3,067,200
トヨタ自動車	9,400	8,418.00	79,129,200
日野自動車	1,200	897.00	1,076,400
三菱自動車工業	3,400	297.00	1,009,800
エフテック	100	694.00	69,400
武蔵精密工業	200	2,042.00	408,400

日産車体	100	765.00	76,500
新明和工業	300	981.00	294,300
極東開発工業	200	1,752.00	350,400
トビー工業	100	1,363.00	136,300
曙ブレーキ工業	500	188.00	94,000
タチエス	100	1,231.00	123,100
NOK	400	1,447.00	578,800
フタバ産業	200	560.00	112,000
KYB	100	2,950.00	295,000
市光工業	100	715.00	71,500
大同メタル工業	200	588.00	117,600
プレス工業	500	334.00	167,000
ミクニ	100	310.00	31,000
太平洋工業	200	1,267.00	253,400
河西工業	100	441.00	44,100
アイシン	700	3,965.00	2,775,500
マツダ	2,900	860.00	2,494,000
今仙電機製作所	100	732.00	73,200
本田技研工業	7,300	3,274.00	23,900,200
スズキ	1,800	4,566.00	8,218,800
SUBARU	2,700	2,089.50	5,641,650
ヤマハ発動機	1,300	2,777.00	3,610,100
小糸製作所	600	7,110.00	4,266,000
TBK	100	421.00	42,100
エクセディ	100	1,708.00	170,800
ミツバ	200	667.00	133,400
豊田合成	300	2,825.00	847,500
愛三工業	100	690.00	69,000
日本プラスト	100	552.00	55,200
ヨロズ	100	1,265.00	126,500
エフ・シー・シー	200	1,806.00	361,200
シマノ	300	26,860.00	8,058,000
テイ・エス テック	400	1,600.00	640,000
三十三フィナンシャルグループ	100	1,337.00	133,700
第四北越フィナンシャルグループ	100	2,402.00	240,200
ひろぎんホールディングス	1,300	616.00	800,800
ジャムコ	100	908.00	90,800
小野建	100	1,338.00	133,800
ノジマ	200	2,866.00	573,200
佐島電機	100	790.00	79,000
カッパ・クリエイト	100	1,474.00	147,400
伯東	100	1,288.00	128,800
コンドーテック	100	1,015.00	101,500
中山福	100	499.00	49,900
ライトオン	100	691.00	69,100
ナガイレーベン	100	2,637.00	263,700
三菱食品	100	2,999.00	299,900
良品計画	1,200	2,324.00	2,788,800
三城ホールディングス	100	270.00	27,000
松田産業	100	2,317.00	231,700

第一興商		100	4,325.00	432,500	
メディバルホールディングス		900	2,138.00	1,924,200	
アドヴァン		100	997.00	99,700	
アズワン		100	14,150.00	1,415,000	
シモジマ		100	1,216.00	121,600	
ドウシシャ		100	1,899.00	189,900	
コナカ		100	329.00	32,900	
G-7ホールディングス		100	2,921.00	292,100	
イオン北海道		100	1,201.00	120,100	
コジマ		200	921.00	184,200	
コーナン商事		100	3,155.00	315,500	
ネットワンシステムズ		400	3,490.00	1,396,000	
ワタミ		100	935.00	93,500	
システムソフト		200	160.00	32,000	
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	1,800		2,420.00	4,356,000	
丸文		100	522.00	52,200	
西松屋チェーン		200	1,729.00	345,800	
ゼンショーホールディングス		500	2,828.00	1,414,000	
ハビネット		100	1,553.00	155,300	
幸楽苑ホールディングス		100	1,624.00	162,400	
日本ライフライン		300	1,500.00	450,000	
サイゼリヤ		100	2,393.00	239,300	
タカショー		100	774.00	77,400	
V Tホールディングス		300	441.00	132,300	
アルゴグラフィックス		100	3,195.00	319,500	
I D O M		300	672.00	201,600	
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	1,991.00	199,100	
進和		100	2,153.00	215,300	
ハイデイ日高		100	1,702.00	170,200	
シークス		100	1,509.00	150,900	
京都きもの友禅		100	257.00	25,700	
コロワイド		300	1,825.00	547,500	
ピーシーデポコーポレーション		100	475.00	47,500	
壱番屋		100	4,870.00	487,000	
スギホールディングス		200	8,510.00	1,702,000	
島津製作所	1,200		4,045.00	4,854,000	
J M S		100	984.00	98,400	
長野計器		100	1,265.00	126,500	
スター精密		100	1,707.00	170,700	
東京計器		100	1,010.00	101,000	
オーバル		100	284.00	28,400	
東京精密		200	5,440.00	1,088,000	
マニー		400	2,666.00	1,066,400	
ニコン	1,400		1,016.00	1,422,400	
トプコン		500	1,480.00	740,000	
オリンパス	5,100		2,261.00	11,531,100	
理研計器		100	3,055.00	305,500	
S C R E E Nホールディングス		200	10,480.00	2,096,000	

キヤノン電子	100	1,800.00	180,000
タムロン	100	2,213.00	221,300
HOYA	1,800	13,370.00	24,066,000
ノーリツ鋼機	100	2,869.00	286,900
エー・アンド・デイ	100	1,430.00	143,000
朝日インテック	1,000	3,035.00	3,035,000
キヤノン	4,600	2,555.00	11,753,000
リコー	2,400	1,161.00	2,786,400
シチズン時計	1,200	375.00	450,000
大研医器	100	570.00	57,000
メニコン	100	7,050.00	705,000
スノーピーク	100	4,150.00	415,000
パラマウントベッドホールディングス	200	2,214.00	442,800
トランザクション	100	1,275.00	127,500
ニホンフラッシュ	100	1,314.00	131,400
前田工織	100	3,275.00	327,500
永大産業	100	295.00	29,500
アートネイチャー	100	665.00	66,500
バンダイナムコホールディングス	800	8,140.00	6,512,000
共立印刷	200	134.00	26,800
SHOEI	100	4,395.00	439,500
フランスベッドホールディングス	100	953.00	95,300
マーベラス	100	880.00	88,000
パイロットコーポレーション	200	3,470.00	694,000
萩原工業	100	1,473.00	147,300
エイベックス	200	1,477.00	295,400
トッパン・フォームズ	200	1,125.00	225,000
フジシールインターナショナル	200	2,508.00	501,600
タカラトミー	400	959.00	383,600
廣済堂	100	995.00	99,500
レック	100	1,245.00	124,500
三光合成	100	458.00	45,800
プロネクス	100	1,214.00	121,400
ホクシン	100	127.00	12,700
大建工業	100	2,045.00	204,500
きもと	100	239.00	23,900
凸版印刷	1,400	1,897.00	2,655,800
大日本印刷	1,100	2,202.00	2,422,200
NISSHA	200	1,335.00	267,000
藤森工業	100	4,355.00	435,500
ヴィア・ホールディングス	100	200.00	20,000
前澤化成工業	100	1,129.00	112,900
アシックス	800	1,720.00	1,376,000
JSP	100	1,877.00	187,700
ニチハ	100	3,250.00	325,000
ローランド	100	4,660.00	466,000
エフピコ	200	4,485.00	897,000
ヤマハ	600	6,130.00	3,678,000
クリナップ	100	581.00	58,100
ビジョン	600	3,945.00	2,367,000

天馬	100	2,273.00	227,300
キングジム	100	971.00	97,100
象印マホービン	300	1,865.00	559,500
リンテック	200	2,504.00	500,800
信越ポリマー	100	1,015.00	101,500
東リ	200	250.00	50,000
イトーキ	200	399.00	79,800
任天堂	500	63,070.00	31,535,000
三菱鉛筆	200	1,585.00	317,000
タカラスタンダード	200	1,628.00	325,600
コクヨ	400	1,732.00	692,800
ナカバヤシ	100	607.00	60,700
ニフコ	300	3,905.00	1,171,500
オカムラ	300	1,296.00	388,800
バルカー	100	2,161.00	216,100
伊藤忠商事	6,400	3,434.00	21,977,600
丸紅	9,000	900.60	8,105,400
スクロール	100	1,072.00	107,200
ヨンドシーホールディングス	100	1,905.00	190,500
長瀬産業	500	1,730.00	865,000
蝶理	100	1,607.00	160,700
豊田通商	900	4,730.00	4,257,000
オンワードホールディングス	500	295.00	147,500
三共生興	100	525.00	52,500
兼松	400	1,475.00	590,000
美津濃	100	2,151.00	215,100
三井物産	7,400	2,276.50	16,846,100
東京エレクトロン	500	48,900.00	24,450,000
カメイ	100	1,191.00	119,100
スターゼン	100	2,309.00	230,900
セイコーホールディングス	100	1,916.00	191,600
山善	400	1,033.00	413,200
住友商事	5,800	1,518.50	8,807,300
日本ユニシス	300	3,480.00	1,044,000
三菱商事	5,600	3,012.00	16,867,200
キャノンマーケティングジャパン	200	2,534.00	506,800
佐藤商事	100	996.00	99,600
菱洋エレクトロ	100	2,720.00	272,000
東京産業	100	615.00	61,500
ユアサ商事	100	3,065.00	306,500
トルク	100	258.00	25,800
阪和興業	200	3,345.00	669,000
正栄食品工業	100	4,330.00	433,000
カナデン	100	1,178.00	117,800
菱電商事	100	1,661.00	166,100
ニプロ	700	1,363.00	954,100
岩谷産業	200	6,740.00	1,348,000
イワキ	100	765.00	76,500
三愛石油	200	1,250.00	250,000
稲畑産業	200	1,694.00	338,800

明和産業	100	478.00	47,800	
キムラタン	500	24.00	12,000	
ヤマエ久野	100	1,099.00	109,900	
ゴールドウイン	200	6,840.00	1,368,000	
ユニ・チャーム	2,000	4,400.00	8,800,000	
デサント	200	1,876.00	375,200	
ワキタ	200	1,081.00	216,200	
ヤマトインターナショナル	100	330.00	33,000	
東邦ホールディングス	300	1,881.00	564,300	
サンゲツ	200	1,580.00	316,000	
ミツウロコグループホールディングス	100	1,432.00	143,200	
伊藤忠エネクス	200	1,101.00	220,200	
サンリオ	300	1,824.00	547,200	
サンワテクノス	100	1,133.00	113,300	
リョーサン	100	2,199.00	219,900	
新光商事	100	769.00	76,900	
東陽テクニカ	100	1,098.00	109,800	
モスフードサービス	100	3,075.00	307,500	
加賀電子	100	2,473.00	247,300	
三益半導体工業	100	2,961.00	296,100	
ソーダニッカ	100	549.00	54,900	
立花エレテック	100	1,620.00	162,000	
木曽路	100	2,302.00	230,200	
S R Sホールディングス	100	830.00	83,000	
千趣会	200	390.00	78,000	
タカキュー	100	141.00	14,100	
リテールパートナーズ	100	1,354.00	135,400	
ケーヨー	200	716.00	143,200	
上新電機	100	2,918.00	291,800	
日本瓦斯	500	1,875.00	937,500	
ロイヤルホールディングス	200	1,917.00	383,400	
いなげや	100	1,685.00	168,500	
チヨダ	100	882.00	88,200	
ライフコーポレーション	100	3,660.00	366,000	
リンガーハット	100	2,221.00	222,100	
MrMaxHD	100	706.00	70,600	
テンアライド	100	322.00	32,200	
AOKIホールディングス	200	591.00	118,200	
オークワ	100	1,191.00	119,100	
コメリ	100	3,065.00	306,500	
青山商事	200	754.00	150,800	
しまむら	100	10,880.00	1,088,000	
高島屋	700	1,126.00	788,200	
松屋	200	873.00	174,600	
エイチ・ツー・オーリテイリング	400	797.00	318,800	
丸井グループ	800	2,024.00	1,619,200	
クレディセゾン	500	1,241.00	620,500	
アクシアルリテイリング	100	4,625.00	462,500	
イオン	3,500	3,091.00	10,818,500	
イズミ	200	4,495.00	899,000	

平和堂	200	2,339.00	467,800
フジ	100	2,168.00	216,800
ヤオコー	100	7,140.00	714,000
ゼビオホールディングス	100	911.00	91,100
ケーズホールディングス	800	1,523.00	1,218,400
PALTAC	100	5,840.00	584,000
三谷産業	100	458.00	45,800
日産東京販売ホールディングス	100	249.00	24,900
新生銀行	700	1,609.00	1,126,300
あおぞら銀行	500	2,362.00	1,181,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	62,600	585.00	36,621,000
りそなホールディングス	10,500	452.40	4,750,200
三井住友トラスト・ホールディングス	1,700	3,706.00	6,300,200
三井住友フィナンシャルグループ	6,300	3,827.00	24,110,100
千葉銀行	3,100	684.00	2,120,400
群馬銀行	1,900	365.00	693,500
武蔵野銀行	100	1,695.00	169,500
千葉興業銀行	200	270.00	54,000
筑波銀行	400	173.00	69,200
七十七銀行	300	1,409.00	422,700
青森銀行	100	2,351.00	235,100
秋田銀行	100	1,407.00	140,700
山形銀行	100	1,064.00	106,400
岩手銀行	100	2,171.00	217,100
東邦銀行	800	223.00	178,400
みちのく銀行	100	1,072.00	107,200
ふくおかフィナンシャルグループ	800	1,870.00	1,496,000
静岡銀行	2,200	836.00	1,839,200
十六銀行	100	2,055.00	205,500
スルガ銀行	800	396.00	316,800
八十二銀行	2,100	371.00	779,100
山梨中央銀行	100	841.00	84,100
大垣共立銀行	200	2,026.00	405,200
福井銀行	100	1,832.00	183,200
北國銀行	100	2,574.00	257,400
滋賀銀行	200	2,258.00	451,600
南都銀行	100	1,831.00	183,100
百五銀行	800	315.00	252,000
京都銀行	300	6,090.00	1,827,000
紀陽銀行	300	1,491.00	447,300
ほくほくフィナンシャルグループ	600	955.00	573,000
山陰合同銀行	600	521.00	312,600
中国銀行	800	882.00	705,600
伊予銀行	1,200	617.00	740,400
百十四銀行	100	1,566.00	156,600
四国銀行	100	734.00	73,400
阿波銀行	100	2,233.00	223,300
大分銀行	100	1,984.00	198,400
宮崎銀行	100	2,279.00	227,900
佐賀銀行	100	1,415.00	141,500

沖縄銀行	100	2,784.00	278,400
琉球銀行	200	733.00	146,600
セブン銀行	3,100	236.00	731,600
みずほフィナンシャルグループ	12,400	1,533.50	19,015,400
山口フィナンシャルグループ	1,100	673.00	740,300
芙蓉総合リース	100	7,220.00	722,000
みずほリース	100	3,225.00	322,500
東京センチュリー	200	6,990.00	1,398,000
SBIホールディングス	1,100	3,075.00	3,382,500
日本証券金融	400	794.00	317,600
アイフル	1,500	305.00	457,500
日本アジア投資	100	254.00	25,400
名古屋銀行	100	2,825.00	282,500
北洋銀行	1,400	285.00	399,000
愛媛銀行	100	933.00	93,300
京葉銀行	400	426.00	170,400
栃木銀行	400	179.00	71,600
東和銀行	200	624.00	124,800
福島銀行	100	229.00	22,900
リコーリース	100	3,465.00	346,500
イオンフィナンシャルサービス	600	1,228.00	736,800
アコム	1,800	489.00	880,200
ジャックス	100	2,167.00	216,700
オリエントコーポレーション	2,500	147.00	367,500
オリックス	5,600	1,781.00	9,973,600
三菱HCキャピタル	3,100	625.00	1,937,500
ジャフコグループ	100	7,290.00	729,000
トモニホールディングス	700	306.00	214,200
大和証券グループ本社	6,800	577.30	3,925,640
野村ホールディングス	14,000	576.50	8,071,000
岡三証券グループ	800	449.00	359,200
丸三証券	300	651.00	195,300
東洋証券	300	184.00	55,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,000	402.00	402,000
水戸証券	200	309.00	61,800
いちよし証券	200	614.00	122,800
松井証券	400	907.00	362,800
SOMPOホールディングス	1,600	4,076.00	6,521,600
日本取引所グループ	2,500	2,666.00	6,665,000
マネックスグループ	800	922.00	737,600
極東証券	100	832.00	83,200
岩井コスモホールディングス	100	1,770.00	177,000
藍澤證券	200	1,007.00	201,400
フィデアホールディングス	900	129.00	116,100
池田泉州ホールディングス	1,100	170.00	187,000
アニコムホールディングス	300	986.00	295,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,200	3,158.00	6,947,600
マネーパートナーズグループ	100	253.00	25,300

スパークス・グループ	400	298.00	119,200	
第一生命ホールディングス	4,800	1,981.50	9,511,200	
東京海上ホールディングス	3,000	5,335.00	16,005,000	
イー・ギャランティ	100	1,987.00	198,700	
T & Dホールディングス	2,700	1,330.00	3,591,000	
三井不動産	4,200	2,389.00	10,033,800	
三菱地所	6,000	1,834.50	11,007,000	
平和不動産	200	3,535.00	707,000	
東京建物	900	1,614.00	1,452,600	
ダイビル	200	1,290.00	258,000	
京阪神ビルディング	200	1,482.00	296,400	
住友不動産	2,100	3,616.00	7,593,600	
テーオーシー	200	736.00	147,200	
レオパレス21	800	142.00	113,600	
スターツコーポレーション	100	2,742.00	274,200	
フジ住宅	100	739.00	73,900	
空港施設	100	599.00	59,900	
ゴールドクレスト	100	1,632.00	163,200	
リログループ	500	2,244.00	1,122,000	
日神グループホールディングス	100	476.00	47,600	
日本エスコン	200	761.00	152,200	
タカラレーベン	400	355.00	142,000	
A V A N T I A	100	897.00	89,700	
イオンモール	500	1,733.00	866,500	
ランド	5,000	13.00	65,000	
カチタス	200	3,220.00	644,000	
東祥	100	1,743.00	174,300	
トーセイ	100	1,101.00	110,100	
サンフロンティア不動産	100	951.00	95,100	
エフ・ジェー・ネクスト	100	1,076.00	107,600	
グランディハウス	100	454.00	45,400	
東武鉄道	1,000	2,787.00	2,787,000	
相鉄ホールディングス	300	2,312.00	693,600	
東急	2,300	1,354.00	3,114,200	
京浜急行電鉄	1,200	1,414.00	1,696,800	
小田急電鉄	1,500	2,850.00	4,275,000	
京王電鉄	500	6,900.00	3,450,000	
京成電鉄	700	3,315.00	2,320,500	
富士急行	100	5,440.00	544,000	
東日本旅客鉄道	1,600	7,314.00	11,702,400	
西日本旅客鉄道	800	5,592.00	4,473,600	
東海旅客鉄道	800	15,410.00	12,328,000	
西武ホールディングス	1,100	1,079.00	1,186,900	
鴻池運輸	100	1,141.00	114,100	
西日本鉄道	300	2,826.00	847,800	
ハマキョウレックス	100	3,150.00	315,000	
近鉄グループホールディングス	900	3,865.00	3,478,500	
阪急阪神ホールディングス	1,200	3,290.00	3,948,000	
南海電気鉄道	400	2,375.00	950,000	
京阪ホールディングス	400	3,890.00	1,556,000	

名古屋鉄道	700	2,460.00	1,722,000	
山陽電気鉄道	100	1,857.00	185,700	
アルプス物流	100	906.00	90,600	
日本通運	300	7,930.00	2,379,000	
ヤマトホールディングス	1,200	2,996.00	3,595,200	
山九	200	4,720.00	944,000	
日新	100	1,385.00	138,500	
丸運	100	273.00	27,300	
丸全昭和運輸	100	3,160.00	316,000	
センコーグループホールディングス	500	1,024.00	512,000	
ニッコンホールディングス	300	2,303.00	690,900	
福山通運	100	4,310.00	431,000	
セイノーホールディングス	700	1,533.00	1,073,100	
日立物流	200	3,370.00	674,000	
丸和運輸機関	200	1,928.00	385,600	
C & F ロジホールディングス	100	1,736.00	173,600	
日本郵船	700	3,945.00	2,761,500	
商船三井	500	3,970.00	1,985,000	
川崎汽船	300	2,747.00	824,100	
明治海運	100	455.00	45,500	
飯野海運	400	515.00	206,000	
九州旅客鉄道	700	2,312.00	1,618,400	
S Gホールディングス	1,700	2,565.00	4,360,500	
日本航空	2,100	2,136.00	4,485,600	
A N Aホールディングス	2,400	2,315.50	5,557,200	
国際紙パルプ商事	200	242.00	48,400	
ブックオフグループホールディングス	100	988.00	98,800	
三菱倉庫	300	3,275.00	982,500	
三井倉庫ホールディングス	100	2,229.00	222,900	
住友倉庫	300	1,441.00	432,300	
東陽倉庫	100	336.00	33,600	
日本トランスシティ	200	542.00	108,400	
中央倉庫	100	1,122.00	112,200	
安田倉庫	100	941.00	94,100	
宇徳	100	492.00	49,200	
上組	500	2,165.00	1,082,500	
近鉄エクスプレス	200	2,486.00	497,200	
エーアイティー	100	1,041.00	104,100	
T B Sホールディングス	600	2,176.00	1,305,600	
日本テレビホールディングス	800	1,454.00	1,163,200	
朝日放送グループホールディングス	100	697.00	69,700	
テレビ朝日ホールディングス	300	2,054.00	616,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	600	491.00	294,600	
テレビ東京ホールディングス	100	2,292.00	229,200	
ビジョン	100	975.00	97,500	
コネクシオ	100	1,400.00	140,000	
日本通信	800	239.00	191,200	
日本電信電話	10,600	2,803.00	29,711,800	
K D D I	7,300	3,367.00	24,579,100	
ソフトバンク	8,300	1,436.50	11,922,950	

光通信	100	22,700.00	2,270,000	
エムティーアイ	100	833.00	83,300	
GMOインターネット	300	3,295.00	988,500	
KADOKAWA	200	4,540.00	908,000	
学研ホールディングス	100	1,424.00	142,400	
ゼンリン	200	1,311.00	262,200	
インプレスホールディングス	100	248.00	24,800	
東京電力ホールディングス	7,900	321.00	2,535,900	
中部電力	2,800	1,309.00	3,665,200	
関西電力	3,500	1,069.00	3,741,500	
中国電力	1,300	1,257.00	1,634,100	
北陸電力	800	712.00	569,600	
東北電力	2,200	1,004.00	2,208,800	
四国電力	800	811.00	648,800	
九州電力	2,000	990.00	1,980,000	
北海道電力	900	457.00	411,300	
沖縄電力	200	1,434.00	286,800	
電源開発	700	1,764.00	1,234,800	
エフオン	100	1,064.00	106,400	
イーレックス	100	1,843.00	184,300	
レノバ	200	3,120.00	624,000	
東京瓦斯	1,800	2,265.50	4,077,900	
大阪瓦斯	1,700	2,005.00	3,408,500	
東邦瓦斯	500	6,230.00	3,115,000	
広島ガス	200	381.00	76,200	
西部ガスホールディングス	100	2,636.00	263,600	
静岡ガス	300	918.00	275,400	
メタウォーター	100	2,290.00	229,000	
松竹	100	12,390.00	1,239,000	
東宝	500	4,410.00	2,205,000	
エイチ・アイ・エス	100	2,102.00	210,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	2,400	1,683.00	4,039,200	
共立メンテナンス	100	3,375.00	337,500	
イチネンホールディングス	100	1,310.00	131,000	
建設技術研究所	100	2,671.00	267,100	
スペース	100	952.00	95,200	
アインホールディングス	100	6,540.00	654,000	
東京都競馬	100	6,000.00	600,000	
カナモト	200	2,804.00	560,800	
DTS	200	2,542.00	508,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	6,460.00	2,584,000	
シーイーシー	100	1,439.00	143,900	
カブコン	800	3,545.00	2,836,000	
西尾レントオール	100	3,195.00	319,500	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	500	25.00	12,500	
日本空港ビルデング	300	4,740.00	1,422,000	
トランス・コスモス	100	3,150.00	315,000	
乃村工藝社	400	813.00	325,200	

ジャステック	100	1,258.00	125,800	
S C S K	200	6,660.00	1,332,000	
日本管財	100	2,193.00	219,300	
トーカイ	100	2,430.00	243,000	
セコム	900	9,006.00	8,105,400	
アイネス	100	1,417.00	141,700	
丹青社	200	848.00	169,600	
メイテック	100	5,910.00	591,000	
T K C	200	3,505.00	701,000	
富士ソフト	100	5,370.00	537,000	
応用地質	100	1,336.00	133,600	
船井総研ホールディングス	200	2,045.00	409,000	
N S D	300	1,820.00	546,000	
オオバ	100	843.00	84,300	
コナミホールディングス	300	6,520.00	1,956,000	
ベネッセホールディングス	300	2,509.00	752,700	
イオンディライト	100	3,400.00	340,000	
ダイセキ	100	4,110.00	411,000	
日鉄物産	100	3,995.00	399,500	
トラスコ中山	200	2,870.00	574,000	
ヤマダホールディングス	3,100	579.00	1,794,900	
オートバックスセブン	300	1,510.00	453,000	
モリト	100	615.00	61,500	
アークランドサカモト	100	1,634.00	163,400	
ニトリホールディングス	400	20,115.00	8,046,000	
グルメ杵屋	100	929.00	92,900	
愛眼	100	230.00	23,000	
吉野家ホールディングス	300	2,105.00	631,500	
加藤産業	100	3,335.00	333,500	
イノテック	100	1,356.00	135,600	
イエローハット	200	1,874.00	374,800	
J B C Cホールディングス	100	1,421.00	142,100	
J Kホールディングス	100	826.00	82,600	
サガミホールディングス	100	1,060.00	106,000	
日伝	100	2,140.00	214,000	
関西スーパーマーケット	100	1,151.00	115,100	
ミロク情報サービス	100	1,952.00	195,200	
北沢産業	100	266.00	26,600	
因幡電機産業	200	2,648.00	529,600	
王将フードサービス	100	5,660.00	566,000	
ブレナス	100	1,927.00	192,700	
ミニストップ	100	1,452.00	145,200	
アークス	200	2,395.00	479,000	
パローホールディングス	200	2,408.00	481,600	
ミスミグループ本社	1,100	3,100.00	3,410,000	
アルテック	100	324.00	32,400	
ファーストリテイリング	100	87,400.00	8,740,000	
ソフトバンクグループ	7,200	9,821.00	70,711,200	
スズケン	400	4,010.00	1,604,000	
サンドラッグ	300	3,825.00	1,147,500	

サクスパー ホールディングス	100	599.00	59,900	
ジェコス	100	986.00	98,600	
グローセル	100	438.00	43,800	
ペルーナ	200	1,301.00	260,200	
合計	972,500		2,421,267,070	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

新光日本債券インデックスマザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年4月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	29,667,021
国債証券	7,163,450,100
地方債証券	822,948,350
特殊債証券	625,155,000
社債証券	509,537,000
未収利息	12,494,056
前払費用	245,766
流動資産合計	9,163,497,293
資産合計	
9,163,497,293	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	9,031,000
流動負債合計	9,031,000
負債合計	
9,031,000	
純資産の部	
元本等	
元本	7,127,677,414
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,026,788,879
元本等合計	9,154,466,293
純資産合計	
9,154,466,293	
負債純資産合計	
9,163,497,293	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年4月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,862,940,764円
同期中追加設定元本額	707,541,950円
同期中一部解約元本額	442,805,300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	736,218,491円
新光7資産バランスファンド	472,115,145円
日本債券ファンド	5,162,855,493円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	588,325,791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）	32,154,802円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	76,772,783円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	34,462,503円
グローバル・ナビ	24,772,406円
計	7,127,677,414円
2. 受益権の総数	7,127,677,414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 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年4月20日現在
----	--------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年4月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		25,647,500
地方債証券		1,745,600
特殊債券		2,278,000
社債券		292,000
合計		29,963,100

(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(2020年11月11日から2021年4月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

		2021年4月20日現在
1口当たり純資産額		1.2844円
(1万口当たり純資産額)		(12,844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

2021年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考

国債証券	414回 利付国庫債券(2年)	140,000,000	140,385,000	
	418回 利付国庫債券(2年)	50,000,000	50,180,000	
	422回 利付国庫債券(2年)	20,000,000	20,089,400	
	133回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,159,500	
	134回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,229,800	
	135回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,132,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,249,500	
	137回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,284,500	
	138回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,256,800	
	139回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,350,500	
	140回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,304,800	
	141回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,322,400	
	142回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,346,000	
	143回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,452,000	
	144回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	80,752,800	
	145回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,390,400	
	146回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,393,600	
	1回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,541,300	
	2回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,112,100	
	3回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,169,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	28,476,400	
	5回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	27,552,600	
	6回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	27,182,200	
	7回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	26,190,600	
	8回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	24,543,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	27,630,000	
	10回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	32,372,100	
	11回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	20,955,400	
	12回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	28,415,100	
	13回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	28,381,800	

324回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,536,000	
325回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,524,800	
326回 利付国庫債券(10年)	10,000,000	10,137,700	
327回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,617,600	
328回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,972,300	
329回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,412,600	
330回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,906,400	
332回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,188,000	
333回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,730,400	
334回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,411,200	
335回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,944,900	
336回 利付国庫債券(10年)	30,000,000	30,696,000	
337回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,633,200	
338回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,667,200	
339回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,977,300	
340回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,384,800	
341回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,345,400	
342回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,789,600	
343回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	90,886,500	
344回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,804,800	
345回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,819,200	
346回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,727,300	
347回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,736,400	
348回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,744,100	
349回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,856,000	

350回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	90,936,000	
351回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,804,000	
352回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,676,200	
353回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,736,800	
354回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,522,600	
355回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,489,600	
356回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,529,200	
357回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,415,200	
358回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,373,200	
359回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,350,700	
360回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,294,700	
361回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,201,600	
10回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,197,600	
11回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,837,500	
12回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,354,300	
15回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,933,400	
17回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,909,300	
19回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,848,300	
20回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,167,500	
21回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,909,200	
22回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,234,600	
23回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,267,900	
26回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,229,500	
27回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,452,600	
28回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,038,400	

29回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,818,400	
30回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,894,000	
31回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,355,800	
32回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,233,900	
33回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	38,752,800	
34回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,033,200	
35回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,059,700	
36回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,187,200	
37回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	38,724,000	
38回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,486,800	
39回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,949,200	
40回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,549,800	
41回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,167,800	
42回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,192,600	
43回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,217,800	
44回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,242,400	
45回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,387,000	
46回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	36,603,000	
47回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,877,000	
48回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	35,992,500	
49回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	36,007,500	
50回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,211,600	
51回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,853,000	
52回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,665,500	
53回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,224,800	

54回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,736,700	
55回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,143,600	
56回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,128,800	
57回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,670,400	
58回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,646,700	
59回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,587,200	
60回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,564,800	
61回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,523,200	
62回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,475,200	
63回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,922,200	
64回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,868,400	
65回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,837,200	
66回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,805,800	
67回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,741,400	
68回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,801,800	
69回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	30,486,600	
59回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,304,600	
64回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,492,000	
70回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,607,600	
72回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,530,400	
78回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,690,800	
81回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,938,800	
84回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,986,900	
88回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,240,000	
90回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,243,300	

92回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	33,722,100	
95回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,934,400	
99回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,445,500	
105回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,583,200	
108回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,474,000	
110回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,670,800	
111回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,796,100	
112回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,429,000	
113回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,272,500	
114回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,799,300	
116回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,928,800	
117回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,679,800	
118回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,789,600	
120回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,848,800	
121回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,467,600	
122回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,280,200	
123回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,909,200	
124回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,717,200	
125回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,090,800	
126回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,894,000	
127回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,795,600	
128回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,658,000	
129回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,728,200	
130回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,517,200	
131回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,655,400	

132回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,364,600	
133回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,575,600	
134回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,631,800	
135回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,708,100	
136回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,600,300	
137回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,734,100	
138回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,027,800	
139回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,248,000	
140回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	58,797,500	
141回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,135,200	
142回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,797,000	
143回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,070,300	
144回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,146,200	
145回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,350,000	
146回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	59,302,000	
147回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,033,600	
148回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,604,000	
149回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,669,600	
150回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,211,200	
151回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,200,400	
152回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,230,400	
153回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,839,600	
154回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,319,200	
155回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	55,227,000	
156回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,686,800	

	157回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,448,400	
	158回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,208,800	
	159回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,795,200	
	160回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,774,200	
	161回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,290,900	
	162回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,261,200	
	163回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,050,000	
	164回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,958,000	
	165回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,905,200	
	166回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,645,500	
	167回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,794,400	
	168回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,024,900	
	169回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,466,900	
	170回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,409,600	
	171回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,376,600	
	172回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,868,600	
	173回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,787,200	
	174回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,811,900	
	175回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,353,100	
	国債証券 合計	6,680,000,000	7,163,450,100	
地方債証券	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	116,696,000	
	200回 神奈川県公募公債	35,000,000	35,685,650	
	218回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,862,000	
	412回 大阪府公募公債 10年	50,000,000	50,027,000	
	12回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	105,889,000	
	24年度3回 広島県公募公債	66,000,000	66,762,300	
	24年度7回 広島県公募公債	100,000,000	101,266,000	
	24年度1回 福岡県公募公債 30年	10,000,000	13,198,000	

	169回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,898,000	
	485回 名古屋市公募公債10年	30,000,000	30,518,400	
	24年度2回 広島市公募公債	100,000,000	101,146,000	
地方債証券 合計		791,000,000	822,948,350	
特殊債券	104回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,340,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,281,000	
	249回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,966,000	
	327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,846,000	
	49回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,880,000	
	58回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,842,000	
特殊債券 合計		600,000,000	625,155,000	
社債券	50回 西日本高速道路債券	100,000,000	99,984,000	
	4回 第一三共社債	100,000,000	101,752,000	
	11回 プリヂストン社債	100,000,000	100,316,000	
	44回 ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,922,000	
	36回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,563,000	
社債券 合計		500,000,000	509,537,000	
合計			9,121,090,450	

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)

2021年4月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	251,668,818
投資証券	127,166,091,110
未収入金	414,640,367
未収配当金	1,024,489,598
流動資産合計	128,856,889,893
資産合計	128,856,889,893
負債の部	
流動負債	
未払金	94,691,115
未払解約金	344,949,000
流動負債合計	439,640,115
負債合計	439,640,115
純資産の部	
元本等	
元本	58,049,127,563
剰余金	
剰余金又は欠損金()	70,368,122,215
元本等合計	128,417,249,778
純資産合計	128,417,249,778
負債純資産合計	128,856,889,893

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年4月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	828,220,828円
同期中追加設定元本額	60,772,818,414円
同期中一部解約元本額	3,551,911,679円
元本の内訳	
ファンド名	
J-REITパッケージ	2,960,135,679円
新光J-REITオープン	53,164,824,380円
One DC 国内リートインデックスファンド	872,679,836円
新光7資産バランスファンド	307,674,156円
グローバル・ナビ	4,780,919円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	739,032,593円
計	58,049,127,563円
2. 受益権の総数	58,049,127,563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 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年4月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券		12,656,835,305
合計		12,656,835,305

(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)

	2021年4月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,212円 (22,122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

2021年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	3,705	662,454,000	
	GLP投資法人	36,188	6,589,834,800	
	NTT都市開発リート投資法人	10,460	1,733,222,000	

Oneリート投資法人	1,805	555,940,000	
SOSILA物流リート投資法人	3,045	439,089,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,608	934,858,400	
いちごホテルリート投資法人	2,025	170,100,000	
アクティブア・プロパティーズ投資法人	5,803	2,808,652,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	11,000	3,861,000,000	
イオンリート投資法人	11,746	1,738,408,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	74,401	1,533,404,610	
インヴィンシブル投資法人	48,423	1,936,920,000	
エスコンジャパンリート投資法人	1,893	246,468,600	
オリックス不動産投資法人	23,075	4,522,700,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,042	1,018,921,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,583	2,898,647,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,893	1,738,827,900	
ケネディクス商業リート投資法人	4,606	1,264,347,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,207	1,770,380,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,229	257,895,300	
サンケイリアルエステート投資法人	2,834	336,962,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,774	202,058,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,308	2,320,557,600	
ジャパンエクセレント投資法人	10,746	1,596,855,600	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,581	7,701,365,000	
スターアジア不動産投資法人	11,899	661,584,400	
スターツプロシード投資法人	1,803	412,165,800	
タカラレーベン不動産投資法人	3,480	401,592,000	
トーセイ・リート投資法人	2,562	358,167,600	
ヒューリックリート投資法人	9,601	1,634,090,200	
フロンティア不動産投資法人	3,843	1,798,524,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,470	334,932,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,085	140,073,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	24,767	3,895,849,100	
ラサルロジポート投資法人	12,905	2,249,341,500	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,492	618,099,200	
阪急阪神リート投資法人	5,231	791,450,300	

三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,042	2,239,268,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,913	1,290,459,000	
産業ファンド投資法人	16,370	3,223,253,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,508	330,052,800	
森トラスト総合リート投資法人	8,277	1,268,036,400	
森ヒルズリート投資法人	13,604	2,120,863,600	
星野リゾート・リート投資法人	1,762	1,132,966,000	
積水ハウス・リート投資法人	34,062	3,147,328,800	
大江戸温泉リート投資法人	1,869	153,071,100	
大和ハウスリート投資法人	16,523	4,862,718,900	
大和証券オフィス投資法人	2,467	1,963,732,000	
大和証券リビング投資法人	15,122	1,672,493,200	
投資法人みらい	12,507	629,102,100	
東急リアル・エステート投資法人	7,764	1,402,178,400	
日本アコモデーションファンド投資法人	3,991	2,602,132,000	
日本ビルファンド投資法人	13,034	8,915,256,000	
日本プライムリアルティ投資法人	7,210	3,096,695,000	
日本プロロジスリート投資法人	18,309	6,325,759,500	
日本リート投資法人	3,762	1,619,541,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,567	2,429,007,000	
日本都市ファンド投資法人	57,683	6,039,410,100	
福岡リート投資法人	5,989	1,050,470,600	
平和不動産リート投資法人	7,106	1,116,352,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	37,450	6,400,205,000	
投資証券 合計	725,009	127,166,091,110	
合計		127,166,091,110	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2021年4月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	38,648,517
コール・ローン	22,756,951
株式	1,935,250,396
新株予約権証券	21,565
投資信託受益証券	3,596,912
投資証券	40,169,714
派生商品評価勘定	5,342,035
未収入金	368,740
未収配当金	2,049,585
差入委託証拠金	67,405,788
流動資産合計	2,115,610,203
資産合計	2,115,610,203
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	206
未払解約金	17,000,000
流動負債合計	17,000,206
負債合計	17,000,206
純資産の部	
元本等	
元本	620,393,119
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,478,216,878
元本等合計	2,098,609,997
純資産合計	2,098,609,997
負債純資産合計	2,115,610,203

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所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>新株予約権証券 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>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>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所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 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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年4月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	727,308,528円
同期中追加設定元本額	1,182,810円
同期中一部解約元本額	108,098,219円

元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	210,261,219円
新光外国株式インデックスVA	260,751,001円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	111,335,378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)	4,215,130円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	15,900,935円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	8,538,655円
グローバル・ナビ	9,390,801円
計	620,393,119円
2. 受益権の総数	620,393,119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 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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	2021年4月20日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	281,027,576	
新株予約権証券	9,735	
投資信託受益証券	156,945	
投資証券	5,084,477	
合計	286,278,733	

(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(2020年11月11日から2021年4月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年4月20日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	3,890,940	-	3,891,139	199	
イギリス・ポンド	3,026,940	-	3,027,146	206	
カナダ・ドル	864,000	-	863,993	7	
合計	3,890,940	-	3,891,139	199	

(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。

株式関連

種類	2021年4月20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	105,489,199	-	110,831,227	5,342,028
合計	105,489,199	-	110,831,227	5,342,028

(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)

2021年4月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3827円 (33,827円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年4月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	149	3,372.010	502,429.490	
	ABBOTT LABORATORIES	620	124.530	77,208.600	
	AES CORP	262	28.340	7,425.080	
	ABIOMED INC	16	329.420	5,270.720	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	312	133.120	41,533.440	
	ADVANCED MICRO DEVICES	420	81.110	34,066.200	
	ADOBE INC	167	516.170	86,200.390	
	CHUBB LTD	159	161.710	25,711.890	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	80	284.400	22,752.000	
	ALLEGHANY CORP	5	676.000	3,380.000	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	34	70.320	2,390.880	
	ALLSTATE CORP	106	122.840	13,021.040	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	247	230.970	57,049.590	
	AMGEN INC	203	255.970	51,961.910	
	HESS CORP	85	69.400	5,899.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	240	148.540	35,649.600	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	169	88.650	14,981.850	

AFLAC INC	234	53.560	12,533.040	
AMERICAN INTL GROUP	295	46.730	13,785.350	
AMERCO	2	600.880	1,201.760	
ANALOG DEVICES	132	156.910	20,712.120	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	79	165.470	13,072.130	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	263	62.320	16,390.160	
VALERO ENERGY CORP	137	70.850	9,706.450	
ANSYS INC	28	364.470	10,205.160	
APPLE INC	5,955	134.840	802,972.200	
APPLIED MATERIALS INC	320	130.890	41,884.800	
ALBEMARLE CORP	43	157.500	6,772.500	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	199	59.290	11,798.710	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	34	84.240	2,864.160	
AMEREN CORP	92	83.790	7,708.680	
ARROW ELECTRONICS INC	21	117.860	2,475.060	
AUTOLIV INC	26	97.350	2,531.100	
AUTODESK INC	75	290.200	21,765.000	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	149	192.750	28,719.750	
AUTOZONE INC	8	1,504.300	12,034.400	
AVERY DENNISON CORP	32	198.600	6,355.200	
BALL CORP	111	90.900	10,089.900	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	481	270.280	130,004.680	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	273	46.810	12,779.130	
BAXTER INTERNATIONAL INC	179	86.520	15,487.080	
BECTON DICKINSON & CO	101	258.960	26,154.960	
AMETEK INC	80	132.120	10,569.600	
VERIZON COMM INC	1,453	58.390	84,840.670	
WR BERKLEY CORP	47	80.760	3,795.720	
BEST BUY CO INC	80	118.840	9,507.200	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	8	629.590	5,036.720	
YUM! BRANDS INC	106	117.710	12,477.260	
FIRSTENERGY CORP	176	35.800	6,300.800	
BOEING CO	187	244.150	45,656.050	
ROBERT HALF INTL INC	40	81.480	3,259.200	
BORGWARNER INC	76	49.320	3,748.320	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	493	40.880	20,153.840	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	46	98.640	4,537.440	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	44	177.910	7,828.040	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	8	1,277.290	10,218.320	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	793	65.600	52,020.800	
ONEOK INC	171	51.780	8,854.380	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24	119.380	2,865.120	
UNITED RENTALS INC	26	324.590	8,439.340	
SEMPRA ENERGY	100	138.240	13,824.000	
FEDEX CORP	87	283.250	24,642.750	
VERISIGN INC	34	207.260	7,046.840	
AMPHENOL CORP	208	67.510	14,042.080	
BROWN-FORMAN CORP	104	74.840	7,783.360	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	494	6.280	3,102.320	
CSX CORP	265	98.710	26,158.150	
CABOT OIL & GAS CORP	185	16.540	3,059.900	
CAMPBELL SOUP CO	55	49.660	2,731.300	
SEAGATE TECHNOLOGY	78	82.330	6,421.740	
CONSTELLATION BRANDS INC	58	237.600	13,780.800	
CARDINAL HEALTH INC	96	61.230	5,878.080	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	266	26.890	7,152.740	
CATERPILLAR INC	190	232.390	44,154.100	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	42	119.180	5,005.560	
CITRIX SYSTEMS INC	42	138.850	5,831.700	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	303	12.640	3,829.920	
CERNER CORP	115	74.680	8,588.200	
JPMORGAN CHASE & CO	1,069	152.650	163,182.850	
CHURCH & DWIGHT CO INC	95	87.340	8,297.300	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	52	107.220	5,575.440	
CINTAS CORP	30	343.740	10,312.200	
CISCO SYSTEMS INC	1,485	52.850	78,482.250	
CLOROX COMPANY	47	189.960	8,928.120	
COCA-COLA CO/THE	1,429	54.000	77,166.000	
COPART INC	82	121.760	9,984.320	
COGNEX CORP	70	85.690	5,998.300	
COLGATE-PALMOLIVE CO	283	80.370	22,744.710	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	99	147.900	14,642.100	
MOLINA HEALTHCARE INC	21	254.670	5,348.070	
NRG ENERGY, INC.	79	38.370	3,031.230	
COMCAST CORP-CL A	1,592	54.140	86,190.880	
CONAGRA BRANDS INC	193	37.850	7,305.050	
CONSOLIDATED EDISON INC	126	78.350	9,872.100	
CMS ENERGY CORP	110	64.120	7,053.200	
COOPER COS INC	20	399.330	7,986.600	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	66	54.010	3,564.660	
CORNING INC	261	46.060	12,021.660	

SEALED AIR CORP	49	48.210	2,362.290	
HEICO CORP-CL A	30	122.030	3,660.900	
CUMMINS INC	52	262.810	13,666.120	
DR HORTON INC	120	95.720	11,486.400	
DANAHER CORP	223	241.990	53,963.770	
MOODY'S CORP	60	320.720	19,243.200	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	196	80.400	15,758.400	
TARGET CORP	175	208.650	36,513.750	
DEERE & CO	104	380.720	39,594.880	
MORGAN STANLEY	490	80.030	39,214.700	
REPUBLIC SERVICES INC	75	104.670	7,850.250	
COSTAR GROUP INC	14	899.000	12,586.000	
THE WALT DISNEY CO	633	187.430	118,643.190	
DOLLAR TREE INC	88	116.950	10,291.600	
DOVER CORP	54	140.430	7,583.220	
OMNICOM GROUP	67	79.310	5,313.770	
DTE ENERGY CO	65	139.700	9,080.500	
DUKE ENERGY CORP	256	100.200	25,651.200	
DARDEN RESTAURANTS INC	45	145.960	6,568.200	
EBAY INC	251	63.790	16,011.290	
BANK OF AMERICA CORP	2,725	39.170	106,738.250	
CITIGROUP INC	723	72.130	52,149.990	
EASTMAN CHEMICAL CO	55	113.560	6,245.800	
EATON CORP PLC	142	140.780	19,990.760	
CADENCE DESIGN SYS INC	93	141.940	13,200.420	
DISH NETWORK CORP	103	37.000	3,811.000	
ECOLAB INC	89	220.310	19,607.590	
PERKINELMER INC	41	134.590	5,518.190	
ELECTRONIC ARTS INC	106	139.630	14,800.780	
SALESFORCE.COM INC	318	230.500	73,299.000	
ERIE INDEMNITY CO	6	224.860	1,349.160	
EMERSON ELECTRIC CO	213	91.790	19,551.270	
ATMOS ENERGY CORP	44	101.840	4,480.960	
ENTERGY CORP	73	106.580	7,780.340	
EOG RESOURCES INC	204	71.290	14,543.160	
EQUIFAX INC	45	189.590	8,531.550	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	79	309.180	24,425.220	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	55	110.220	6,062.100	
EXXON MOBIL CORP	1,470	56.480	83,025.600	
FMC CORP	47	112.820	5,302.540	
NEXTERA ENERGY INC	685	79.790	54,656.150	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12	317.340	3,808.080	
FAIR ISAAC CORP	11	529.990	5,829.890	
ASSURANT INC	17	153.240	2,605.080	
FASTENAL CO	201	50.800	10,210.800	
FIFTH THIRD BANCORP	238	37.870	9,013.060	
M&T BANK CORP	48	154.980	7,439.040	

FISERV INC	199	125.130	24,900.870	
FORD MOTOR CO	1,358	12.110	16,445.380	
FRANKLIN RESOURCES INC	101	29.970	3,026.970	
FREEMPORT-MCMORAN INC	500	37.330	18,665.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	72	136.260	9,810.720	
DENTSPLY SIRONA INC	89	65.530	5,832.170	
GENERAL DYNAMICS CORP	85	184.790	15,707.150	
GENERAL MILLS INC	205	61.300	12,566.500	
GENUINE PARTS CO	49	119.400	5,850.600	
GILEAD SCIENCES INC	436	65.950	28,754.200	
GARTNER INC	31	191.940	5,950.140	
MCKESSON CORP	58	193.690	11,234.020	
NVIDIA CORP	217	614.470	133,339.990	
GENERAL ELECTRIC CO	3,054	13.460	41,106.840	
VW GRAINGER INC	17	408.980	6,952.660	
HALLIBURTON CO	348	20.670	7,193.160	
MONSTER BEVERAGE CORP	144	97.860	14,091.840	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	114	343.090	39,112.260	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	74	209.730	15,520.020	
HASBRO INC	54	98.010	5,292.540	
HENRY SCHEIN INC	59	70.640	4,167.760	
HEICO CORP	13	133.760	1,738.880	
HERSHEY FOODS CORP	55	160.980	8,853.900	
HP INC	486	33.700	16,378.200	
F5 NETWORKS INC	19	208.490	3,961.310	
CROWN HOLDINGS INC NPR	52	108.770	5,656.040	
JUNIPER NETWORKS INC	114	25.920	2,954.880	
HOLOGIC INC	97	76.680	7,437.960	
HOME DEPOT INC	377	326.850	123,222.450	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58	79.590	4,616.220	
HORMEL FOODS CORP	102	46.520	4,745.040	
CENTERPOINT ENERGY INC	182	23.780	4,327.960	
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	335.800	3,693.800	
HUMANA INC	46	439.920	20,236.320	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	25	166.930	4,173.250	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	322	15.870	5,110.140	
BIOGEN INC	53	269.050	14,259.650	
IDEX CORP	26	219.850	5,716.100	
ILLINOIS TOOL WORKS	112	223.830	25,068.960	
INTUIT INC	91	402.290	36,608.390	
IDEXX LABORATORIES INC	29	528.580	15,328.820	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	63	39.940	2,516.220	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	84	172.280	14,471.520	
INTEL CORP	1,436	63.630	91,372.680	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	77	142.920	11,004.840	
INTERNATIONAL PAPER CO	129	57.180	7,376.220	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	144	30.440	4,383.360	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	48	133.720	6,418.560	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	29	161.150	4,673.350	
INCYTE CORP	58	82.670	4,794.860	
JOHNSON & JOHNSON	924	162.690	150,325.560	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	123	66.730	8,207.790	
KLA CORPORATION	54	324.390	17,517.060	
DEVON ENERGY CORP	240	22.030	5,287.200	
KELLOGG CO	98	63.700	6,242.600	
KEYCORP	333	20.420	6,799.860	
KIMBERLY-CLARK CORP	120	138.930	16,671.600	
BLACKROCK INC/NEW YORK	54	811.090	43,798.860	
KROGER CO	262	37.430	9,806.660	
LAM RESEARCH CORP	50	621.730	31,086.500	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	13	429.200	5,579.600	
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	141.120	4,939.200	
AKAMAI TECHNOLOGIES	59	105.740	6,238.660	
PLUG POWER INC	170	25.240	4,290.800	
LENNAR CORP	95	104.000	9,880.000	
ELI LILLY & CO	300	189.640	56,892.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	67	64.780	4,340.260	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	251	178.060	44,693.060	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	114	133.500	15,219.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	89	391.730	34,863.970	
LOEWS CORP	89	54.260	4,829.140	
LOWE'S COS INC	257	204.010	52,430.570	
DOMINION ENERGY INC	295	78.740	23,228.300	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	181	39.750	7,194.750	
MCCORMICK & CO INC	82	88.850	7,285.700	
MCDONALD'S CORPORATION	262	231.810	60,734.220	
S&P GLOBAL INC	84	376.440	31,620.960	
EVEREST RE GROUP LTD	14	264.000	3,696.000	
MARKEL CORPORATION	5	1,211.550	6,057.750	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	225	88.560	19,926.000	
MARSH & MCLENNAN COS	179	127.150	22,759.850	
MASCO CORP	94	64.550	6,067.700	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	21	350.620	7,363.020	
METLIFE INC	279	63.100	17,604.900	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	103	93.890	9,670.670	
MEDTRONIC PLC	470	126.130	59,281.100	
ACTIVISION BLIZZARD INC	267	96.000	25,632.000	
CVS HEALTH CORP	458	75.750	34,693.500	
MERCK & CO. INC.	888	77.660	68,962.080	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	131	41.070	5,380.170	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	33	260.510	8,596.830	
MICROSOFT CORP	2,515	258.740	650,731.100	
MICRON TECH INC	388	88.410	34,303.080	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	89	154.030	13,708.670	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	230	46.650	10,729.500	
3M CO	203	198.590	40,313.770	
MOHAWK INDUSTRIES INC	25	199.910	4,997.750	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	58	187.660	10,884.280	
KANSAS CITY SOUTHERN	31	256.400	7,948.400	
ILLUMINA INC	51	404.180	20,613.180	
XCEL ENERGY INC	176	70.490	12,406.240	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	29	94.850	2,750.650	
NETAPP INC	75	77.310	5,798.250	
NEWELL BRANDS INC	133	26.480	3,521.840	
NEWMONT CORP	277	64.850	17,963.450	
NVR INC	1	4,984.420	4,984.420	
NIKE INC-CL B	440	132.570	58,330.800	
NORDSON CORP	22	205.930	4,530.460	
NORFOLK SOUTHERN CORP	88	270.460	23,800.480	
EVERSOURCE ENERGY	114	89.340	10,184.760	
NISOURCE INC	157	25.740	4,041.180	
NORTHERN TRUST CORP	72	106.230	7,648.560	
NORTHROP GRUMMAN CORP	55	344.640	18,955.200	
WELLS FARGO & CO	1,371	43.880	60,159.480	
NUCOR CORP	102	79.440	8,102.880	
CHENIERE ENERGY INC	73	74.650	5,449.450	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	158	135.410	21,394.780	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	309	24.540	7,582.860	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	35	247.910	8,676.850	
OGE ENERGY CORP	71	33.560	2,382.760	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	25	533.770	13,344.250	
ORACLE CORP	683	78.750	53,786.250	

PACCAR INC	121	93.350	11,295.350	
PTC INC	40	139.800	5,592.000	
EXELON CORP	334	45.500	15,197.000	
PARKER HANNIFIN CORP	45	317.520	14,288.400	
PAYCHEX INC	121	96.430	11,668.030	
ALIGN TECHNOLOGY INC	26	603.720	15,696.720	
PPL CORPORATION	287	28.880	8,288.560	
PEPSICO INC	483	144.750	69,914.250	
PENTAIR PLC	48	64.000	3,072.000	
PFIZER INC	1,946	38.930	75,757.780	
ESSENTIAL UTILITIES INC	83	47.360	3,930.880	
CONOCOPHILLIPS	489	50.890	24,885.210	
PG&E CORP	524	11.200	5,868.800	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	71	148.580	10,549.180	
ALTRIA GROUP INC	648	49.080	31,803.840	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	148	177.720	26,302.560	
BROWN & BROWN INC	73	49.480	3,612.040	
GARMIN LTD	49	140.550	6,886.950	
PPG INDUSTRIES INC	81	168.780	13,671.180	
IPG PHOTONICS CORP	12	222.120	2,665.440	
COSTCO WHOLESALE CORP	155	369.550	57,280.250	
T ROWE PRICE GROUP INC	79	177.040	13,986.160	
QUEST DIAGNOSTICS	46	131.090	6,030.140	
PROCTER & GAMBLE CO	869	136.610	118,714.090	
PROGRESSIVE CORP	207	99.290	20,553.030	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	173	63.480	10,982.040	
PULTE GROUP INC	98	53.710	5,263.580	
GLOBAL PAYMENTS INC	104	215.900	22,453.600	
QUALCOMM INC	395	135.250	53,423.750	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	41	129.410	5,305.810	
EXACT SCIENCES CORP	54	127.530	6,886.620	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	19	171.090	3,250.710	
REGENERON PHARMACEUTICALS	36	499.690	17,988.840	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	19	131.470	2,497.930	
RESMED INC	49	205.660	10,077.340	
US BANCORP	470	57.720	27,128.400	
SEAGEN INC	42	144.010	6,048.420	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	145	39.700	5,756.500	
ROSS STORES INC	126	127.490	16,063.740	
ROLLINS INC	100	34.810	3,481.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	36	425.460	15,316.560	
ROCKWELL AUTOMATION INC	40	267.100	10,684.000	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	71	83.780	5,948.380	
RPM INTERNATIONAL INC	50	93.080	4,654.000	
ACCENTURE PLC-CL A	223	286.540	63,898.420	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	495	58.690	29,051.550	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	48	238.010	11,424.480	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	94	154.380	14,511.720	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	217	152.220	33,031.740	
BOOKING HOLDINGS INC	14	2,456.200	34,386.800	
SCHLUMBERGER LTD	457	26.530	12,124.210	
SCHWAB (CHARLES) CORP	537	65.880	35,377.560	
POOL CORP	13	382.950	4,978.350	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	70	172.530	12,077.100	
BUNGE LTD	45	83.180	3,743.100	
SEI INVESTMENTS CO	33	62.510	2,062.830	
ANTHEM INC	87	379.660	33,030.420	
AMERISOURCEBERGEN CORP	56	119.500	6,692.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	91	63.260	5,756.660	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	90	265.600	23,904.000	
CENTENE CORP	200	65.380	13,076.000	
SVB FINANCIAL GROUP	18	519.260	9,346.680	
SMITH (A.O.) CORP	48	67.870	3,257.760	
SNAP-ON INC	15	236.010	3,540.150	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	133	98.540	13,105.820	
ADVANCE AUTO PARTS	22	192.540	4,235.880	
EDISON INTERNATIONAL	125	61.120	7,640.000	
SOUTHERN CO	380	64.920	24,669.600	
TRUIST FINANCIAL CORP	478	57.400	27,437.200	
SOUTHWEST AIRLINES	52	62.030	3,225.560	
AT&T INC	2,491	29.990	74,705.090	
CHEVRON CORP	670	103.260	69,184.200	
STANLEY BLACK & DECKER INC	55	205.890	11,323.950	
STATE STREET CORP	121	80.890	9,787.690	
STARBUCKS CORP	411	117.600	48,333.600	
STEEL DYNAMICS INC	67	51.190	3,429.730	
STRYKER CORP	118	256.750	30,296.500	
NETFLIX INC	154	554.440	85,383.760	
NORTONLIFELOCK INC	184	21.800	4,011.200	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	58	49.820	2,889.560	
SYNOPSIS INC	55	250.640	13,785.200	
SYSCO CORP	167	81.080	13,540.360	

INTUITIVE SURGICAL INC	41	811.190	33,258.790	
TELEFLEX INC	17	431.790	7,340.430	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	357	10.280	3,669.960	
TERADYNE INC	58	126.320	7,326.560	
TEXAS INSTRUMENTS INC	322	187.060	60,233.320	
TEXTRON INC	82	59.060	4,842.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	139	487.640	67,781.960	
GLOBE LIFE INC	31	104.270	3,232.370	
DAVITA INC	29	110.780	3,212.620	
TRACTOR SUPPLY CO	39	183.080	7,140.120	
TRIMBLE INC	84	80.970	6,801.480	
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	445.960	6,689.400	
TYSON FOODS INC	111	78.550	8,719.050	
UGI CORP	76	43.860	3,333.360	
UNION PACIFIC CORP	236	223.470	52,738.920	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	533	78.590	41,888.470	
UNITEDHEALTH GROUP INC	332	389.840	129,426.880	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	29	146.040	4,235.160	
VF CORP	114	83.980	9,573.720	
VIACOMCBS INC	210	38.400	8,064.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	93	219.180	20,383.740	
VULCAN MATERIALS CO	46	176.740	8,130.040	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	259	53.790	13,931.610	
WALMART INC	498	139.710	69,575.580	
WASTE MANAGEMENT INC	150	134.430	20,164.500	
WATERS CORP	23	298.810	6,872.630	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	24	316.790	7,602.960	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	42	132.150	5,550.300	
VAIL RESORTS INC	17	313.610	5,331.370	
WESTERN DIGITAL CORP	103	68.310	7,035.930	
WABTEC CORP	63	81.200	5,115.600	
WHIRLPOOL CORP	21	235.270	4,940.670	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	57	185.870	10,594.590	
WYNN RESORTS LTD	34	126.280	4,293.520	
NASDAQ INC	43	158.630	6,821.090	
CME GROUP INC	125	205.590	25,698.750	
WILLIAMS COS INC	414	23.690	9,807.660	
LKQ CORP	92	44.810	4,122.520	
ALLIANT ENERGY CORP	84	56.190	4,719.960	
WEC ENERGY GROUP INC	106	96.850	10,266.100	
CARMAX INC	63	130.100	8,196.300	
XILINX INC	84	126.900	10,659.600	

TJX COMPANIES INC	418	69.000	28,842.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	20	509.630	10,192.600	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	343	5.000	1,715.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	100	64.590	6,459.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	44	137.400	6,045.600	
CBRE GROUP INC	116	82.340	9,551.440	
LIBERTY GLOBAL PLC	59	26.370	1,555.830	
REGIONS FINANCIAL CORP	317	20.900	6,625.300	
DOMINO'S PIZZA INC	13	397.960	5,173.480	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	14	369.600	5,174.400	
T-MOBILE US INC	194	131.990	25,606.060	
LAS VEGAS SANDS CORP	125	60.620	7,577.500	
MOSAIC CO/THE	136	32.730	4,451.280	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	13	533.620	6,937.060	
CELANESE CORP	42	158.270	6,647.340	
DEXCOM INC	33	393.040	12,970.320	
DISCOVERY INC-A	43	36.370	1,563.910	
EXPEDIA GROUP INC	52	175.620	9,132.240	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	69	46.910	3,236.790	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	45	246.710	11,101.950	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	157	26.340	4,135.380	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	196	119.740	23,469.040	
LIVE NATION	61	81.580	4,976.380	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	9	1,550.010	13,950.090	
TRANSDIGM GROUP INC	18	606.000	10,908.000	
MASTERCARD INC	311	382.160	118,851.760	
WESTERN UNION CO	133	26.150	3,477.950	
OWENS CORNING	36	97.270	3,501.720	
LEIDOS HOLDINGS INC	43	101.490	4,364.070	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	80	19.120	1,529.600	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	45	155.940	7,017.300	
DELTA AIR LINES INC	71	46.150	3,276.650	
INSULET CORP	25	281.510	7,037.750	
DISCOVER FINANCIAL	109	100.610	10,966.490	
TE CONNECTIVITY LTD	120	130.350	15,642.000	
MASIMO CORP	22	242.980	5,345.560	
LULULEMON ATHLETICA INC	43	322.270	13,857.610	
VMWARE INC	29	170.030	4,930.870	
MERCADOLIBRE INC	16	1,570.990	25,135.840	

ULTA BEAUTY INC	20	328.260	6,565.200	
INVESCO LTD	154	26.480	4,077.920	
MSCI INC	28	468.270	13,111.560	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	545	91.670	49,960.150	
VISA INC	592	225.790	133,667.680	
KEURIG DR PEPPER INC	190	36.130	6,864.700	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	60	158.720	9,523.200	
DISCOVERY INC-C	129	31.200	4,024.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	219	53.430	11,701.170	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	57	102.510	5,843.070	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	663	16.620	11,019.060	
XYLEM INC	58	108.210	6,276.180	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	91	107.200	9,755.200	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	14	210.000	2,940.000	
SPLUNK INC	62	132.900	8,239.800	
EPAM SYSTEMS INC	19	446.940	8,491.860	
ZILLOW GROUP INC	26	134.590	3,499.340	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	60	51.490	3,089.400	
HCA HEALTHCARE INC	94	194.890	18,319.660	
VERISK ANALYTICS INC	52	184.530	9,595.560	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	167.160	2,674.560	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	31	290.900	9,017.900	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	61	175.640	10,714.040	
NXP SEMICONDUCTOR NV	100	194.760	19,476.000	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	46	84.830	3,902.180	
LEAR CORP	21	180.360	3,787.560	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	37	103.700	3,836.900	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	74	72.700	5,379.800	
DOLLAR GENERAL CORP	86	216.730	18,638.780	
FORTINET INC	51	206.140	10,513.140	
HORIZON PHARMA PLC	78	90.260	7,040.280	
TESLA INC	265	714.630	189,376.950	
GENERAC HOLDINGS INC	22	318.680	7,010.960	
ENPHASE ENERGY INC	44	141.140	6,210.160	
GENERAL MOTORS CO	453	57.880	26,219.640	
XPO LOGISTICS INC	30	135.410	4,062.300	
ALLY FINANCIAL INC	119	48.090	5,722.710	
VOYA FINANCIAL INC	35	68.630	2,402.050	

APTIV PLC	98	140.320	13,751.360	
PHILLIPS 66	145	77.940	11,301.300	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	32	104.000	3,328.000	
FACEBOOK INC	842	302.240	254,486.080	
IQVIA HOLDINGS INC	65	216.220	14,054.300	
SERVICENOW INC	67	549.370	36,807.790	
PALO ALTO NETWORKS INC	32	366.960	11,742.720	
WORKDAY INC	61	254.510	15,525.110	
ABBVIE INC	618	108.610	67,120.980	
ZOETIS INC	165	168.100	27,736.500	
NEWS CORP/NEW-CL A	154	26.740	4,117.960	
CDW CORP	55	182.200	10,021.000	
HOWMET AEROSPACE INC	117	32.570	3,810.690	
TWILIO INC	48	367.460	17,638.080	
COUPA SOFTWARE INC	26	263.470	6,850.220	
SNAP INC	319	60.440	19,280.360	
TRADE DESK INC A	15	695.480	10,432.200	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	90	45.920	4,132.800	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	39	45.080	1,758.120	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	55	45.040	2,477.200	
OKTA INC	39	266.010	10,374.390	
BLACK KNIGHT INC	50	73.110	3,655.500	
BAKER HUGHES CO	258	20.030	5,167.740	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	62	79.730	4,943.260	
ALTICE USA INC-A	99	34.760	3,441.240	
BROADCOM INC	142	462.000	65,604.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	29	319.070	9,253.030	
MONGODB INC	20	300.920	6,018.400	
BURLINGTON STORES INC	24	320.880	7,701.120	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	157	30.000	4,710.000	
VEEVA SYSTEMS INC	47	270.380	12,707.860	
TWITTER INC	273	67.940	18,547.620	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	49	58.180	2,850.820	
EVERGY INC	74	63.240	4,679.760	
ALLEGION PLC	31	132.340	4,102.540	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	45	92.140	4,146.300	
STERIS PLC	28	208.630	5,841.640	
DOCUSIGN INC	65	223.300	14,514.500	
WIX.COM LTD	22	289.060	6,359.320	
DROPBOX INC	115	26.120	3,003.800	
KKR & CO INC	194	53.310	10,342.140	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	68	324.330	22,054.440	
MODERNA INC	103	161.910	16,676.730	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	99	125.930	12,467.070	
ARAMARK	70	39.500	2,765.000	

CIGNA CORP	126	252.490	31,813.740	
DELL TECHNOLOGIES INC	91	103.420	9,411.220	
DOW INC	255	64.550	16,460.250	
AMCOR PLC	547	11.860	6,487.420	
PINTEREST INC	189	73.910	13,968.990	
PELTON INTERACTIVE INC	89	107.750	9,589.750	
FOX CORP-A	100	37.680	3,768.000	
FOX CORP-B	64	36.590	2,341.760	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	65	213.370	13,869.050	
CHEWY INC	26	78.980	2,053.480	
AVANTOR INC	206	31.880	6,567.280	
DYNATRACE INC	62	52.290	3,241.980	
CLOUDFLARE INC	72	73.300	5,277.600	
TRADEWEB MARKETS INC	39	79.690	3,107.910	
CARRIER GLOBAL CORP	283	43.870	12,415.210	
OTIS WORLDWIDE CORP	154	71.030	10,938.620	
UBER TECHNOLOGIES INC	337	57.850	19,495.450	
CORTEVA INC	256	47.520	12,165.120	
MATCH GROUP INC	86	146.000	12,556.000	
SLACK TECHNOLOGIES INC	159	42.300	6,725.700	
BLACKSTONE GROUP INC	235	79.300	18,635.500	
CARLYLE GROUP INC	43	39.835	1,712.900	
10X GENOMICS INC	22	186.970	4,113.340	
DATADOG INC	62	87.890	5,449.180	
INGERSOLL RAND INC	137	50.910	6,974.670	
PAYCOM SOFTWARE INC	18	393.180	7,077.240	
PPD INC	35	46.200	1,617.000	
AON PLC	110	235.830	25,941.300	
IAC/INTERACTIVECORP	31	243.335	7,543.380	
AIRBNB INC	17	174.580	2,967.860	
ZENDESK INC	38	147.960	5,622.480	
ROYALTY PHARMA PLC	57	41.770	2,380.890	
VIATRIS INC	469	13.250	6,214.250	
DRAFTKINGS INC	64	56.680	3,627.520	
SNOWFLAKE INC	11	229.070	2,519.770	
ARISTA NETWORKS INC	20	314.810	6,296.200	
IHS MARKIT LTD	130	103.500	13,455.000	
FNF GROUP	89	44.720	3,980.080	
CATALENT INC	59	108.630	6,409.170	
SYNCHRONY FINANCIAL	176	40.730	7,168.480	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	144	44.610	6,423.840	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	147.490	1,179.920	
WAYFAIR INC	26	315.330	8,198.580	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	69	143.630	9,910.470	
HUBSPOT INC	15	509.940	7,649.100	
QORVO INC	44	188.440	8,291.360	

	LIBERTY BROADBAND CORP W/I	4	150.790	603.160	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	57	155.620	8,870.340	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	77	31.690	2,440.130	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	17	244.860	4,162.620	
	GODADDY INC	63	85.660	5,396.580	
	ETSY INC	43	213.190	9,167.170	
	TRANSUNION	69	96.860	6,683.340	
	SQUARE INC	133	245.330	32,628.890	
	DUPONT DE NEMOURS INC	182	76.970	14,008.540	
	CARVANA CO	21	276.500	5,806.500	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	87	55.170	4,799.790	
	TELADOC HEALTH INC	42	184.090	7,731.780	
	WESTROCK CO	83	54.170	4,496.110	
	KRAFT HEINZ CO	226	40.950	9,254.700	
	NOVOCURE LTD	28	190.900	5,345.200	
	FORTIVE CORP	106	72.350	7,669.100	
	WASTE CONNECTIONS INC	91	116.400	10,592.400	
	ALPHABET INC-CL A	105	2,289.760	240,424.800	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	464	15.960	7,405.440	
	PAYPAL HOLDINGS INC	388	267.910	103,949.080	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	156	33.620	5,244.720	
	SUNRUN INC	55	48.540	2,669.700	
	ZILLOW GROUP INC-C	52	133.000	6,916.000	
	ALPHABET INC-CL C	104	2,302.400	239,449.600	
	ZSCALER INC	26	190.940	4,964.440	
	CABLE ONE INC	2	1,813.570	3,627.140	
	LINDE PLC	185	288.450	53,363.250	
	ATHENE HOLDING LTD	44	55.530	2,443.320	
	ROKU INC	40	361.150	14,446.000	
	AVALARA INC	27	143.860	3,884.220	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	48	644.420	30,932.160	
	VISTRA CORP	161	17.860	2,875.460	
アメリカ・ドル	小計	109,838		12,831,078.930 (1,388,322,738)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	144	18.675	2,689.200	
	ASHTREAD GROUP	158	46.000	7,268.000	
	SEVERN TRENT PLC	102	24.600	2,509.200	
	BHP GROUP PLC	735	22.175	16,298.620	
	BARCLAYS PLC	5,924	1.876	11,113.420	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	389	7.780	3,026.420	
	BT GROUP PLC	3,397	1.546	5,251.760	

BUNZL PLC	141	25.200	3,553.200	
AVIVA PLC	1,384	4.086	5,655.020	
CRODA INTERNATIONAL	44	67.040	2,949.760	
DIAGEO PLC	817	32.210	26,315.570	
SCHRODERS PLC	39	36.420	1,420.380	
DCC PLC	34	64.540	2,194.360	
NATIONAL GRID PLC	1,233	9.075	11,189.470	
KINGFISHER PLC	697	3.607	2,514.070	
BAE SYSTEMS PLC	1,215	5.230	6,354.450	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	801	29.140	23,341.140	
HALMA PLC	115	25.440	2,925.600	
NEXT PLC	52	81.120	4,218.240	
IMPERIAL BRANDS PLC	358	15.810	5,659.980	
JOHNSON MATTHEY PLC	52	31.980	1,662.960	
ANGLO AMERICAN PLC	432	31.865	13,765.680	
COMPASS GROUP PLC	628	15.755	9,894.140	
HSBC HOLDINGS PLC	7,124	4.281	30,497.840	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,125	2.771	5,888.370	
UNILEVER PLC	918	41.320	37,931.760	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	706	1.837	1,296.920	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	304	9.734	2,959.130	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	442	6.822	3,015.320	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	145	24.600	3,567.000	
PEARSON PLC	275	8.138	2,237.950	
PERSIMMON PLC	130	31.850	4,140.500	
PRUDENTIAL PLC	920	15.540	14,296.800	
RIO TINTO PLC	398	60.890	24,234.220	
VODAFONE GROUP PLC	9,653	1.352	13,050.850	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	247	67.050	16,561.350	
RELX PLC	684	19.250	13,167.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	662	5.192	3,437.100	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	2,848	1.051	2,993.240	
NATWEST GROUP PLC	1,586	1.988	3,152.960	
ST JAMES'S PLACE PLC	173	13.300	2,300.900	
SSE PLC	376	14.940	5,617.440	
BP PLC	7,051	3.008	21,209.400	
SAGE GROUP PLC(THE)	445	6.440	2,865.800	
SMITHS GROUP PLC	175	16.400	2,870.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	121.850	3,533.650	
STANDARD CHARTERED PLC	873	4.952	4,323.090	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	24,294	0.437	10,616.470	

TAYLOR WIMPLEY PLC	1,208	1.904	2,300.030	
TESCO PLC	2,825	2.345	6,624.620	
3I GROUP PLC	329	12.440	4,092.760	
SMITH & NEPHEW PLC	281	14.125	3,969.120	
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,764	13.380	23,602.320	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	110	77.300	8,503.000	
WPP PLC	398	9.752	3,881.290	
ASTRAZENECA PLC	458	74.180	33,974.440	
WHITBREAD PLC	63	35.190	2,216.970	
INTERTEK GROUP PLC	49	60.300	2,954.700	
BURBERRY GROUP PLC	139	20.670	2,873.130	
INTERCONTINENTAL HOTELS	73	51.560	3,763.880	
SAINSBURY (J) PLC	716	2.547	1,823.650	
ADMIRAL GROUP PLC	59	31.940	1,884.460	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	37	46.030	1,703.110	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,459	13.968	20,379.310	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,272	13.370	17,006.640	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	43	23.810	1,023.830	
AVEVA GROUP PLC	29	38.020	1,102.580	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	765	2.842	2,174.130	
EXPERIAN PLC	320	26.940	8,620.800	
MONDI PLC	190	19.690	3,741.100	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	117	16.835	1,969.690	
FRESNILLO PLC NPR	28	9.196	257.480	
OCADO GROUP PLC	188	22.260	4,184.880	
INFORMA PLC	485	5.912	2,867.320	
GLENCORE PLC	3,472	3.038	10,547.930	
ENTAIN PLC	204	16.445	3,354.780	
EVRAZ PLC	114	6.206	707.480	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	372	3.040	1,130.880	
COCA-COLA HBC AG	72	25.050	1,803.600	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	130	7.490	973.700	
FERGUSON PLC	79	93.280	7,369.120	
M&G PLC	858	2.190	1,879.020	
JD SPORTS FASHION PLC	119	9.132	1,086.700	
AUTO TRADER GROUP PLC	284	5.794	1,645.490	
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,586	1.706	2,705.710	
イギリス・ボンド 小計	102,169		608,235.350 (92,062,503)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	407	26.590	10,822.130

	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	529	22.960	12,145.840	
	ELBIT SYSTEMS LTD	8	466.800	3,734.400	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	204	14.550	2,968.200	
	ICL GROUP LTD	193	21.000	4,053.000	
	NICE LTD	26	772.000	20,072.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48	91.510	4,392.480	
	AZRIELI GROUP	17	222.900	3,789.300	
イスラエル・シケル 小計		1,432		61,977.350 (2,057,177)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	65	67.080	4,360.200	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	981	28.930	28,380.330	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,249	25.360	31,674.640	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	632	21.200	13,398.400	
	TELSTRA CORP LTD	1,589	3.370	5,354.930	
	AMP LTD	697	1.180	822.460	
	ASX LTD	70	72.130	5,049.100	
	BHP GROUP LTD	1,021	47.560	48,558.760	
	AMPOL LTD	130	26.030	3,383.900	
	COMPUTERSHARE LT	212	15.080	3,196.960	
	CSL LIMITED	158	268.300	42,391.400	
	REA GROUP LTD	17	159.450	2,710.650	
	TRANSURBAN GROUP	1,044	13.970	14,584.680	
	COCA-COLA AMATIL LTD	137	13.300	1,822.100	
	COCHLEAR LTD	22	221.260	4,867.720	
	ORIGIN ENERGY LTD	776	4.190	3,251.440	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	616	88.840	54,725.440	
	RIO TINTO LIMITED	139	120.850	16,798.150	
	APA GROUP	357	10.070	3,594.990	
	ARISTOCRAT LEISU	199	36.910	7,345.090	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	925	4.820	4,458.500	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	147	43.190	6,348.930	
	ORICA LTD	100	14.020	1,402.000	
	CIMIC GROUP LTD	36	17.410	626.760	
	LEND LEASE CORP LTD	207	13.090	2,709.630	
	BLUESCOPE STEEL LTD	224	21.400	4,793.600	
	SYDNEY AIRPORT	525	6.140	3,223.500	
MACQUARIE GROUP LTD	117	157.280	18,401.760		
SUNCORP GROUP LTD	547	10.430	5,705.210		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,135	26.680	30,281.800		
NEWCREST MINING LTD	266	27.970	7,440.020		
OIL SEARCH LTD	865	3.950	3,416.750		

	QANTAS AIRWAYS LIMITED	136	5.080	690.880	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	428	9.650	4,130.200	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	333	11.460	3,816.180	
	SANTOS LTD	714	7.060	5,040.840	
	SONIC HEALTHCARE	137	35.700	4,890.900	
	TABCORP HOLDINGS LTD	899	4.850	4,360.150	
	WESFARMERS LTD	395	55.830	22,052.850	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	318	23.620	7,511.160	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	457	42.010	19,198.570	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	35	47.940	1,677.900	
	SEEK LTD	158	31.010	4,899.580	
	AUSNET SERVICES	648	1.855	1,202.040	
	AGL ENERGY LTD	269	9.250	2,488.250	
	BRAMBLES LTD	489	10.480	5,124.720	
	CROWN RESORTS LTD	93	12.000	1,116.000	
	EVOLUTION MINING LTD	688	4.740	3,261.120	
	AURIZON HOLDINGS LTD	934	3.920	3,661.280	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	355	10.250	3,638.750	
	XERO LTD	41	145.780	5,976.980	
	AFTERPAY LTD	85	126.200	10,727.000	
	MEDIBANK PVT LTD	807	2.880	2,324.160	
	SOUTH32 LTD(AUD)	1,797	2.890	5,193.330	
	COLES GROUP LTD	454	15.470	7,023.380	
	WISETECH GLOBAL LTD	39	32.060	1,250.340	
	オーストラリア・ドル 小計	25,914		516,336.360 (43,392,908)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	91	82.300	7,489.300	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	297	41.970	12,465.090	
	BARRICK GOLD CORP	609	27.710	16,875.390	
	ATCO LTD	31	42.480	1,316.880	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	79	25.400	2,006.600	
	BANK OF MONTREAL	226	114.070	25,779.820	
	BANK OF NOVA SCOTIA	429	77.170	33,105.930	
	NATIONAL BANK OF CANADA	110	87.500	9,625.000	
	BCE INC	58	58.160	3,373.280	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	447	57.370	25,644.390	
	BAUSCH HEALTH COS INC	119	36.530	4,347.070	
	SAPUTO INC	99	39.570	3,917.430	
	BLACKBERRY LTD	197	10.840	2,135.480	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	248	20.120	4,989.760	
	CGI INC	78	107.990	8,423.220	

CCL INDUSTRIES INC	53	69.830	3,700.990	
CAE INC	111	36.710	4,074.810	
CAMECO CORP	126	20.310	2,559.060	
ROGERS COMM-CL B	135	61.680	8,326.800	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	159	124.590	19,809.810	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	393	38.300	15,051.900	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	18	195.380	3,516.840	
CANADIAN UTILITIES LTD	69	34.310	2,367.390	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	251	148.160	37,188.160	
YAMANA GOLD INC	384	5.940	2,280.960	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	53	41.370	2,192.610	
OPEN TEXT CORP	111	61.750	6,854.250	
EMPIRE CO LTD	48	39.790	1,909.920	
KINROSS GOLD CORP	533	9.340	4,978.220	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	52	78.440	4,078.880	
FORTIS INC	147	55.260	8,123.220	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	198	28.230	5,589.540	
TELUS CORP	88	25.770	2,267.760	
GREAT WEST LIFECO INC	70	34.930	2,445.100	
IMPERIAL OIL LTD	76	31.840	2,419.840	
ENBRIDGE INC	702	46.820	32,867.640	
IGM FINANCIAL INC	35	40.430	1,415.050	
MANULIFE FINANCIAL CORP	684	27.070	18,515.880	
LOBLAW CO LTD	60	69.940	4,196.400	
MAGNA INTERNATIONAL INC	105	117.850	12,374.250	
SUN LIFE FINANCIAL INC	216	65.700	14,191.200	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	570.420	5,133.780	
METRO INC	85	58.870	5,003.950	
EMERA INC	100	56.780	5,678.000	
ONEX CORP	39	80.280	3,130.920	
PAN AMERICAN SILVER CORP	73	41.710	3,044.830	
POWER CORP OF CANADA	202	34.550	6,979.100	
QUEBECOR INC-B	38	35.810	1,360.780	
ROYAL BANK OF CANADA	500	117.950	58,975.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	47	457.900	21,521.300	
SHAW COMM INC-B	132	34.820	4,596.240	
SUNCOR ENERGY INC	515	26.170	13,477.550	
LUNDIN MINING CORP	208	15.670	3,259.360	
TECK RESOURCES LTD-CL B	193	28.110	5,425.230	
THOMSON REUTERS CORP	65	115.250	7,491.250	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	19	97.370	1,850.030	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	641	82.310	52,760.710	

	TC ENERGY CORP	331	59.630	19,737.530	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	27	105.600	2,851.200	
	WESTON (GEORGE) LTD	36	113.740	4,094.640	
	INTACT FINANCIAL CORP	49	161.970	7,936.530	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	172	53.270	9,162.440	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	1,830.000	12,810.000	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	63	171.210	10,786.230	
	B2GOLD CORP	413	6.210	2,564.730	
	KEYERA CORP	42	26.250	1,102.500	
	PARKLAND CORP	80	38.600	3,088.000	
	ALTAGAS LTD	79	21.330	1,685.070	
	PEMBINA PIPELINE CORP	213	37.220	7,927.860	
	DOLLARAMA INC	101	57.750	5,832.750	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	418	9.850	4,117.300	
	NORTHLAND POWER INC	57	43.590	2,484.630	
	TMX GROUP LTD	17	136.720	2,324.240	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	85	47.330	4,023.050	
	INTER PIPELINE LTD	188	17.910	3,367.080	
	NUTRIEN LTD	211	67.600	14,263.600	
	SSR MINING INC	36	20.150	725.400	
	WSP GLOBAL INC	38	127.700	4,852.600	
	IA FINANCIAL CORP INC	34	69.060	2,348.040	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	58	40.400	2,343.200	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	48	55.500	2,664.000	
	AIR CANADA	21	24.150	507.150	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	101	83.020	8,385.020	
	SHOPIFY INC	38	1,432.280	54,426.640	
	FIRSTSERVICE CORP	9	204.000	1,836.000	
	CANOPY GROWTH CORP	81	34.400	2,786.400	
	HYDRO ONE LTD	137	30.410	4,166.170	
	カナダ・ドル 小計	14,051		789,679.150 (68,228,279)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	600	4.020	2,412.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	700	29.020	20,314.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	200	8.040	1,608.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	300	10.590	3,177.000	
	CAPITALAND LTD	1,000	3.760	3,760.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	2,300	0.910	2,093.000	
	KEPPEL CORP LTD	300	5.520	1,656.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,300	11.960	15,548.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,000	2.600	7,800.000	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	600	5.230	3,138.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	500	26.230	13,115.000	
	UOL GROUP LIMITED	300	7.920	2,376.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	500	5.470	2,735.000	
シンガポール・ドル 小計		11,600		79,732.000 (6,491,779)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	875	9.760	8,540.000	
	LOGITECH INTL-REG	55	104.550	5,750.250	
	NESTLE SA-REGISTERED	1,010	106.480	107,544.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	182	95.740	17,424.680	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	243	310.300	75,402.900	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	13	285.800	3,715.400	
	SIKA INHABER	51	269.700	13,754.700	
	SGS SA-REG	2	2,731.000	5,462.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	778	80.940	62,971.320	
	BALOISE HOLDING AG -R	17	162.900	2,769.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	1	2,184.000	2,184.000	
	CLARIANT AG-REG	69	20.240	1,396.560	
	SWISSCOM AG-REG	10	482.900	4,829.000	
	ABB LTD	652	30.440	19,846.880	
	ADECCO GROUP AG-REG	44	65.180	2,867.920	
	GEBERIT AG	13	613.600	7,976.800	
	LONZA GROUP AG-REG	25	556.400	13,910.000	
	GIVAUDAN-REG	3	3,895.000	11,685.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	54	382.500	20,655.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	14	326.400	4,569.600	
	LAFARGEHOLCIM LTD	178	57.820	10,291.960	
	TEMENOS GROUP	21	146.600	3,078.600	
	SONOVA HOLDING AG	22	267.900	5,893.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	21	283.200	5,947.200	
	STRAUMANN HOLDING AG	4	1,235.000	4,940.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	12	283.400	3,400.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	54.900	549.000	
	SCHINDLER NAMEN	10	277.400	2,774.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	10	477.000	4,770.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	7	95.600	669.200	
	VIFOR PHARMA AG	16	134.000	2,144.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	3	852.000	2,556.000	
SWISS PRIME SITE AG	22	90.500	1,991.000		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	7	1,306.500	9,145.500		
JULIUS BAER GROUP LTD	89	59.800	5,322.200		
SWISS RE LTD	98	90.800	8,898.400		
ALCON INC	176	67.560	11,890.560		
UBS GROUP AG	1,263	14.605	18,446.110		
スイス・フラン 小計		6,080		495,964.440	

(58,637,876)

スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	231	545.000	125,895.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	148	471.100	69,722.800	
	ERICSSON LM-B SHS	1,030	116.660	120,159.800	
	LUNDBERGS B	37	494.300	18,289.100	
	SKF AB-B SHS	126	250.700	31,588.200	
	SANDVIK AB	422	238.600	100,689.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	607	106.900	64,888.300	
	SKANSKA AB-B SHS	112	228.000	25,536.000	
	SWEDBANK AB	320	156.680	50,137.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	204	157.400	32,109.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	533	96.600	51,487.800	
	VOLVO AB-B SHS	510	211.450	107,839.500	
	SWEDISH MATCH AB	61	725.600	44,261.600	
	TELE2 AB-B SHS	145	119.150	17,276.750	
	INDUSTRIVARDEN A	14	344.600	4,824.400	
	INDUSTRIVARDEN C	40	329.400	13,176.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	58	247.100	14,331.800	
	SECURITAS AB-B SHS	101	149.150	15,064.150	
	INVESTOR AB-B SHS	166	727.900	120,831.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	279	207.250	57,822.750	
	ASSA ABLOY AB-B	359	252.900	90,791.100	
	TELIA CO AB	969	36.350	35,223.150	
	LUNDIN ENERGY AB	81	269.300	21,813.300	
	BOLIDEN AB	92	339.200	31,206.400	
	ALFA LAVAL AB	107	277.000	29,639.000	
	KINNEVIK AB-B	83	472.850	39,246.550	
	FASTIGHETS AB BALDER	24	489.300	11,743.200	
	ICA GRUPPEN AB	38	413.600	15,716.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	141	124.150	17,505.150	
	NIBE INDUSTRIER AB	111	311.000	34,521.000	
	HEXAGON AB	101	858.200	86,678.200	
	EPIROC AB-A	261	204.500	53,374.500	
EPIROC AB-B	117	187.650	21,955.050		
ESSITY AB-B	211	283.100	59,734.100		
EQT AB	78	297.800	23,228.400		
EVOLUTION GAMING GROUP AB	56	1,426.000	79,856.000		
NORDEA BANK ABP	1,116	87.210	97,326.360		
INVESTMENT AB LATOUR	23	250.800	5,768.400		
スウェーデン・クローナ 小計	9,112		1,841,258.410 (23,733,821)		
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	40	1,058.500	42,340.000	
	A P MOLLER A/S	2	15,220.000	30,440.000	

	AP MOLLER MAERSK A	1	14,200.000	14,200.000	
	DANSKE BANK A/S	238	120.550	28,690.900	
	GENMAB A/S	23	2,204.000	50,692.000	
	NOVOZYMES-B SHS	67	405.600	27,175.200	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	1	2,701.000	2,701.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	608	449.650	273,387.200	
	GN STORE NORD A/S	38	535.000	20,330.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	69	1,222.400	84,345.600	
	COLOPLAST-B	42	988.600	41,521.200	
	DSV PANALPINA A S	76	1,302.500	98,990.000	
	DEMANT A/S	33	305.000	10,065.000	
	H LUNDBECK A/S	15	196.900	2,953.500	
	TRYG A/S	44	148.250	6,523.000	
	PANDORA A/S	35	706.000	24,710.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	35	554.400	19,404.000	
	AMBU A/S B	75	344.400	25,830.000	
	ORSTED A/S	66	952.400	62,858.400	
	デンマーク・クローネ 小計	1,508		867,157.000 (15,192,591)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	512	7.730	3,957.760	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	101	14.350	1,449.350	
	A2 MILK CO LTD	367	8.920	3,273.640	
	FISHER & PAYKEL	206	33.850	6,973.100	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	789	4.375	3,451.870	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	87	6.820	593.340	
	MERIDIAN ENERGY LTD	456	5.890	2,685.840	
	ニュージーランド・ドル 小計	2,518		22,384.900 (1,741,769)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	140	204.000	28,560.000	
	DNB ASA	359	185.200	66,486.800	
	NORSK HYDRO ASA	358	55.920	20,019.360	
	TELENOR ASA	268	155.000	41,540.000	
	SCHIBSTED ASA	9	415.800	3,742.200	
	ORKLA ASA	236	82.600	19,493.600	
	EQUINOR ASA	383	165.720	63,470.760	
	YARA INTERNATIONAL ASA	60	440.200	26,412.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	84	196.750	16,527.000	
	ADEVINTA ASA	72	150.450	10,832.400	
	SCHIBSTED ASA	47	365.000	17,155.000	
	ノルウェー・クローネ 小計	2,016		314,239.120 (4,097,678)	
ユーロ	CRH PLC	279	40.380	11,266.020	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	57	176.700	10,071.900	

KERRY GROUP PLC-A	55	110.550	6,080.250	
KINGSPAN GROUP PLC	53	76.780	4,069.340	
UMICORE	70	47.750	3,342.500	
AIR LIQUIDE	166	141.080	23,419.280	
AIRBUS SE	204	102.700	20,950.800	
AXA SA	685	23.750	16,268.750	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	170	24.890	4,231.300	
ADIDAS AG	69	277.200	19,126.800	
ASSICURAZIONI GENERALI	386	17.225	6,648.850	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.000	0.000	
DASSAULT AVIATION SA	1	964.500	964.500	
DANONE	218	60.340	13,154.120	
SAFRAN SA	112	122.400	13,708.800	
INTESA SANPAOLO	5,782	2.310	13,356.420	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	116	87.700	10,173.200	
ACCOR SA	56	33.970	1,902.320	
BOUYGUES	81	35.150	2,847.150	
BNP PARIBAS	387	53.330	20,638.710	
THALES SA	36	86.400	3,110.400	
CAPGEMINI SA	54	153.350	8,280.900	
UNICREDIT SPA	719	8.625	6,201.370	
NATIXIS	473	4.068	1,924.160	
KONINKLIJKE DSM NV	58	149.800	8,688.400	
COMMERZBANK AG	351	5.098	1,789.390	
EIFFAGE	26	89.080	2,316.080	
FRESENIUS SE & CO KGAA	153	38.790	5,934.870	
UNITED INTERNET	42	33.900	1,423.800	
FUCHS PETROLUB SE PREF	21	44.320	930.720	
PUBLICIS GROUPE	72	54.120	3,896.640	
FAURECIA	14	46.730	654.220	
IBERDROLA SA	2,121	11.605	24,614.200	
ENI SPA	828	10.324	8,548.270	
JERONIMO MARTINS	86	14.455	1,243.130	
KESKO OYJ-B	72	25.720	1,851.840	
KBC GROUPE	86	63.280	5,442.080	
HANNOVER RUECK SE	24	155.350	3,728.400	
WARTSILA OYJ	111	9.248	1,026.520	
L'OREAL	89	338.850	30,157.650	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	97	624.900	60,615.300	
GEA GROUP AG	52	35.460	1,843.920	
BOLLORE	224	4.210	943.040	
MEDIOBANCA SPA	225	9.390	2,112.750	
MICHELIN(CGDE) -B	60	123.300	7,398.000	
CONTINENTAL AG	39	114.320	4,458.480	
DEUTSCHE POST AG-REG	350	48.135	16,847.250	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	79	29.830	2,356.570	

OMV AG	59	42.670	2,517.530	
VERBUND AG	22	65.000	1,430.000	
PERNOD-RICARD	71	171.800	12,197.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	46	95.980	4,415.080	
RENAULT SA	68	36.130	2,456.840	
REPSOL SA	549	10.252	5,628.340	
REMY COINTREAU	12	169.600	2,035.200	
MERCK KGAA	45	147.450	6,635.250	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	173	53.080	9,182.840	
RWE AG	236	33.830	7,983.880	
SEB SA	9	143.000	1,287.000	
SOCIETE GENERALE-A	266	22.545	5,996.970	
VINCI S.A.	180	92.080	16,574.400	
SODEXO	26	84.840	2,205.840	
SOFINA	6	310.800	1,864.800	
SOLVAY SA	32	104.850	3,355.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	190	137.520	26,128.800	
VIVENDI SA	300	28.600	8,580.000	
SAP SE	366	116.040	42,470.640	
TELEFONICA S.A	1,932	3.763	7,270.110	
TOTAL SE	873	38.040	33,208.920	
VALEO	78	27.480	2,143.440	
E.ON SE	751	10.036	7,537.030	
VOEST-ALPINE AG	26	37.100	964.600	
HENKEL AG & CO KGAA	31	83.650	2,593.150	
SIEMENS AG-REG	267	143.800	38,394.600	
UPM-KYMMENE OYJ	181	32.380	5,860.780	
ING GROEP NV-CVA	1,327	10.510	13,946.770	
PUMA AG	42	91.120	3,827.040	
BAYER AG	339	54.960	18,631.440	
STORA ENSO OYJ-R SHS	239	16.755	4,004.440	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	66	96.180	6,347.880	
DAIMLER AG	300	75.960	22,788.000	
BASF SE	320	71.760	22,963.200	
BEIERSDORF AG	34	92.100	3,131.400	
HOCHTIEF AG	11	78.540	863.940	
HEIDELBERGCEMENT AG	59	78.960	4,658.640	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	84	64.220	5,394.480	
ASM INTERNATIONAL NV	15	255.700	3,835.500	
ORANGE	704	10.450	7,356.800	
SAMPO OYJ-A SHS	166	40.620	6,742.920	
RANDSTAD NV	32	63.160	2,021.120	
ALLIANZ SE	146	219.100	31,988.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	967	5.032	4,865.940	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	373	23.055	8,599.510	
HERMES INTL	11	1,020.000	11,220.000	
ENDESA S.A.	143	22.200	3,174.600	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	94	10.784	1,013.690	
ERSTE GROUP BANK AG	95	29.370	2,790.150	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	49	257.900	12,637.100	
ARCELOR MITTAL (NL)	263	24.770	6,514.510	
DASSAULT SYSTEMES SA	46	192.000	8,832.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	96	28.400	2,726.400	
HEINEKEN NV	88	92.940	8,178.720	
AKZO NOBEL	72	102.000	7,344.000	
ASML HOLDING NV	149	522.200	77,807.800	
AEGON NV	607	3.894	2,363.650	
VOLKSWAGEN AG	12	290.800	3,489.600	
VOLKSWAGEN AG PFD	64	240.150	15,369.600	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,493	4.513	11,250.900	
KERING	26	640.200	16,645.200	
CNP ASSURANCES	20	16.790	335.800	
FORTUM OYJ	149	22.690	3,380.810	
AGEAS	50	51.440	2,572.000	
UCB SA	48	83.080	3,987.840	
NEMETSCHEK SE	31	59.700	1,850.700	
CARREFOUR SA	232	15.370	3,565.840	
NATURGY ENERGY GROUP SA	107	21.020	2,249.140	
ATOS SE	29	61.120	1,772.480	
NOKIA OYJ	1,932	3.518	6,796.770	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	325	50.510	16,415.750	
WOLTERS KLUWER-CVA	89	76.780	6,833.420	
SANOFI	396	86.210	34,139.160	
STMICROELECTRONICS NV	245	31.885	7,811.820	
ELISA OYJ	49	48.730	2,387.770	
BANCO SANTANDER SA	5,891	2.965	17,466.810	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	134	15.305	2,050.870	
QIAGEN N.V.	83	43.320	3,595.560	
DEUTSCHE BANK AG-REG	749	10.396	7,786.600	
BMW VORZUG	19	68.700	1,305.300	
ENEL SPA	2,858	8.662	24,755.990	
COLRUYT NV	6	49.850	299.100	
VOPAK (KON.)	38	41.510	1,577.380	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,156	16.194	18,720.260	
SARTORIUS AG	13	468.000	6,084.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	27	65.780	1,776.060	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	454	34.660	15,735.640	
RATIONAL AG	1	676.600	676.600	

CARL ZEISS MEDITEC AG	12	146.550	1,758.600	
BECHTLE AG	7	170.100	1,190.700	
KONINKLIJKE KPN NV	1,386	2.738	3,794.860	
EUROFINS SCIENTIFIC	49	88.490	4,336.010	
TELEPERFORMANCE	22	330.500	7,271.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	71	147.650	10,483.150	
EURAZEO	23	69.050	1,588.150	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	43	92.320	3,969.760	
HEINEKEN HOLDING NV-A	50	79.600	3,980.000	
INDITEX	379	28.790	10,911.410	
ESSILORLUXOTTICA	103	139.520	14,370.560	
SNAM SPA	735	4.706	3,458.910	
CREDIT AGRICOLE SA	428	12.598	5,391.940	
ORPEA	19	108.350	2,058.650	
ENAGAS	61	18.710	1,141.310	
WENDEL	13	111.600	1,450.800	
TENARIS SA	163	9.232	1,504.810	
TELECOM ITALIA SPA	1,206	0.442	533.050	
TELECOM ITALIA-RNC	3,436	0.471	1,618.350	
ATLANTIA SPA	206	16.570	3,413.420	
ILIAD SA	2	158.300	316.600	
PROXIMUS	39	18.740	730.860	
SES FDR	156	6.958	1,085.440	
TERNA SPA	397	6.198	2,460.600	
BIOMERIEUX	17	109.900	1,868.300	
GRIFOLS SA	92	23.180	2,132.560	
FERROVIAL SA	197	22.660	4,464.020	
LANXESS AG	26	61.740	1,605.240	
NESTE OYJ	157	50.560	7,937.920	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	91	18.250	1,660.750	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	33	45.890	1,514.370	
GALAPAGOS NV	22	65.590	1,442.980	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	202	10.060	2,032.120	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	18	199.950	3,599.100	
KONE OYJ	124	71.820	8,905.680	
ELIA GROUP	4	91.750	367.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	11	383.000	4,213.000	
ENGIE	608	12.388	7,531.900	
ALSTOM	87	44.890	3,905.430	
ELECTRICITE DE FRANCE	195	12.070	2,353.650	
IPSEN SA	21	78.820	1,655.220	
DEUTSCHE WOHNEN	115	45.140	5,191.100	
ARKEMA SA	28	104.600	2,928.800	
LEGRAND SA	101	83.220	8,405.220	

AMPLIFON SPA	27	35.220	950.940	
ADP	10	103.150	1,031.500	
ORION OYJ	46	35.790	1,646.340	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	236	9.646	2,276.450	
SYMRISE AG	41	108.800	4,460.800	
SCOR SE	71	28.930	2,054.030	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	85	41.480	3,525.800	
PRYSMIAN SPA	62	26.630	1,651.060	
DIASORIN SPA	11	154.400	1,698.400	
CAIXABANK	1,237	2.594	3,208.770	
BUREAU VERITAS SA	95	24.930	2,368.350	
GETLINK	123	13.235	1,627.900	
SUEZ SA	102	19.860	2,025.720	
AMADEUS IT GROUP SA	154	59.100	9,101.400	
BRENTAG SE	54	75.740	4,089.960	
EVONIK INDUSTRIES AG	66	30.410	2,007.060	
EDENRED	76	47.040	3,575.040	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	239	2.334	557.820	
LEG IMMOBILIEN SE	24	118.600	2,846.400	
KION GROUP AG	28	82.860	2,320.080	
VONOVIA SE	186	56.900	10,583.400	
KNORR-BREMSE AG	22	102.750	2,260.500	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	85	47.170	4,009.450	
FERRARI NV	47	175.150	8,232.050	
CNH INDUSTRIAL NV	376	12.735	4,788.360	
AROUNDTOWN SA	443	6.394	2,832.540	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	25	41.500	1,037.500	
MONCLER SPA	60	51.340	3,080.400	
NEXI SPA	160	15.255	2,440.800	
TEAMVIEWER AG	62	38.850	2,408.700	
PROSUS NV	171	94.290	16,123.590	
JDE PEET'S BV	9	31.520	283.680	
SIEMENS ENERGY AG	157	28.760	4,515.320	
WORLDLINE SA	93	75.520	7,023.360	
NN GROUP NV	109	42.470	4,629.230	
FINECOBANK SPA	248	14.410	3,573.680	
ARGENX SE	15	230.200	3,453.000	
ZALANDO SE	52	90.680	4,715.360	
STELLANTIS NV	733	14.792	10,842.530	
AENA SME SA	25	141.050	3,526.250	
CELLNEX TELECOM SAU	117	45.820	5,360.940	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	42	92.600	3,889.200	
ABN AMRO BANK NV	203	10.928	2,218.380	
EXOR NV	29	72.460	2,101.340	
SCOUT24 AG	32	68.460	2,190.720	
COVESTRO AG	66	55.780	3,681.480	

	HELLOFRESH SE	52	74.320	3,864.640	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	261	57.060	14,892.660	
	POSTE ITALIANE SPA	238	10.760	2,560.880	
	AMUNDI SA	30	74.250	2,227.500	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	59	9.426	556.130	
	ADYEN NV	6	1,996.200	11,977.200	
	UNIPER SE	61	30.370	1,852.570	
	DELIVERY HERO SE	44	130.950	5,761.800	
ユーロ 小計		81,859		1,619,785.670 (211,025,677)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	100	103.100	10,310.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	864	21.350	18,446.400	
	BANK OF EAST ASIA	267	16.640	4,442.880	
	CLP HOLDINGS LTD	735	76.550	56,264.250	
	PCCW LTD	884	4.580	4,048.720	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	47.700	23,850.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	466	479.600	223,493.600	
	MTR CORP	903	44.150	39,867.450	
	HANG SENG BANK LTD	300	152.400	45,720.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,086	35.150	38,172.900	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	567	46.800	26,535.600	
	HONG KONG & CHINA GAS	3,348	12.500	41,850.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	69.850	37,509.450	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,184	27.550	32,619.200	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	890	42.600	37,914.000	
	SINO LAND CO	576	11.100	6,393.600	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	119.400	59,700.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	273	138.800	37,892.400	
	SJM HOLDINGS LTD	1,000	10.240	10,240.000	
	WYNN MACAU LTD	699	15.080	10,540.920	
	AIA GROUP LTD	4,351	98.000	426,398.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	2,080	11.100	23,088.000	
	SANDS CHINA LTD	974	36.950	35,989.300	
	SWIRE PROPERTIES LTD	432	23.400	10,108.800	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,000	46.200	46,200.000	
	ESR CAYMAN LTD	600	25.100	15,060.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	1,000	7.680	7,680.000	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	500	24.500	12,250.000	
	WH GROUP LTD	3,000	6.680	20,040.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,034	64.500	66,693.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	534	47.750	25,498.500	
香港・ドル	小計	31,184		1,454,816.970 (20,265,600)	
合計		399,281		1,935,250,396 (1,935,250,396)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年4月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	スイス・フラン	CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23	456.000	182.400	
	スイス・フラン	小計	456.000	182.400 (21,565)	
新株予約権証券 合計			456	21,565 (21,565)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	393.000	4,012.530	
		GOODMAN GROUP	613.000	11,591.830	
		GPT GROUP	525.000	2,446.500	
		MIRVAC GROUP	1,078.000	2,748.900	
		SCENTRE GROUP	1,683.000	4,678.740	
		STOCKLAND	1,002.000	4,629.240	
		VICINITY CENTRES	1,672.000	2,733.720	
	オーストラリア・ドル	小計	6,966.000	32,841.460 (2,759,996)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,100.000	3,410.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,125.000	4,675.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	200.000	424.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	500.000	990.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	500.000	780.000	
	シンガポール・ドル	小計	4,425.000	10,279.000 (836,916)	
投資信託受益証券 合計			11,391	3,596,912 (3,596,912)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	191.000	3,311.940	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	45.000	7,946.100	
		AMERICAN TOWER CORP	155.000	38,523.700	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	549.000	4,831.200	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	46.000	8,756.560	
	BOSTON PROPERTIES INC	46.000	4,882.900	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	33.000	3,864.960	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	150.000	27,108.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	97.000	14,332.720	
	DUKE REALTY TRUST	122.000	5,469.260	
	EQUINIX INC	31.000	22,235.990	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	67.000	4,544.610	
	EQUITY RESIDENTIAL	130.000	9,493.900	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	23.000	6,683.110	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	44.000	6,332.920	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	189.000	6,303.150	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	223.000	3,880.200	
	INVITATION HOMES INC	196.000	6,591.480	
	IRON MOUNTAIN INC	83.000	3,193.840	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	198.000	4,403.520	
	MID AMERICA	36.000	5,465.520	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	68.000	2,535.720	
	PROLOGIS INC	258.000	28,960.500	
	PUBLIC STORAGE	54.000	14,600.520	
	REALTY INCOME CORP	127.000	8,552.180	
	REGENCY CENTERS CORP	69.000	4,123.440	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	38.000	10,947.420	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	117.000	13,637.520	
	SUN COMMUNITIES INC	41.000	6,519.820	
	UDR INC	90.000	4,061.700	
	VENTAS INC	142.000	7,781.600	
	VEREIT INC	90.000	3,667.500	
	VICI PROPERTIES INC	207.000	6,183.090	
	VORNADO REALTY TRUST	57.000	2,591.790	
	WELLTOWER INC	141.000	10,558.080	
	WEYERHAEUSER CO	284.000	11,041.920	
	WP CAREY INC	73.000	5,337.760	
アメリカ・ドル	小計	4,510.000	339,256.140 (36,707,517)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	255.000	1,329.570	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	322.000	2,333.850	
	SEGRO PLC	481.000	4,755.160	
イギリス・ポンド	小計	1,058.000	8,418.580 (1,274,236)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	10.000	558.300	

		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	93.000	1,880.460	
	カナダ・ドル 小計		103.000	2,438.760 (210,709)	
	ユーロ	COVIVIO	21.000	1,641.360	
		GECINA SA	18.000	2,214.000	
		KLEPIERRE	82.000	1,797.440	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	44.000	3,113.000	
	ユーロ 小計		165.000	8,765.800 (1,142,008)	
	香港・ドル	LINK REIT	807.000	59,960.100	
	香港・ドル 小計		807.000	59,960.100 (835,244)	
投資証券 合計			6,643	40,169,714 (40,169,714)	
合計				43,788,191 (43,788,191)	

(注) 新株予約権証券、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)

- 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	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証 券 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 591銘柄	66.15	-	-	-	72.01
	投資証券 37銘柄	-	-	-	1.75	
イギリス・ポンド	株式 85銘柄	4.39	-	-	-	4.72
	投資証券 3銘柄	-	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式 56銘柄	2.07	-	-	-	2.33
	投資信託受益証 券 7銘柄	-	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.25	-	-	-	3.46
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 13銘柄	0.31	-	-	-	0.37
	投資信託受益証 券 5銘柄	-	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 38銘柄	2.79	-	-	-	2.96
	新株予約権証 券 1銘柄	-	0.00	-	-	
スウェーデン・クロー ナ	株式 38銘柄	1.13	-	-	-	1.20
デンマーク・クローネ	株式 19銘柄	0.72	-	-	-	0.77
ニュージーランド・ド ル	株式 7銘柄	0.08	-	-	-	0.09

ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.20	-	-	-	0.21
ユーロ	株式	235銘柄	10.06	-	-	-	10.72
	投資証券	4銘柄	-	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	31銘柄	0.97	-	-	-	1.07
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.04	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

海外国債マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年4月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	238,478
コール・ローン	42,516,775
国債証券	16,381,247,048
派生商品評価勘定	65,164
未収入金	758,127,147
未収利息	109,611,342
前払費用	11,019,217
流動資産合計	17,302,825,171
資産合計	
負債の部	
流動負債	
未払金	744,989,884
未払解約金	10,700,000
流動負債合計	755,689,884
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	6,481,302,084
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,065,833,203
元本等合計	16,547,135,287
純資産合計	16,547,135,287
負債純資産合計	17,302,825,171

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</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. 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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年4月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,839,282,823円
同期中追加設定元本額	56,230,688円
同期中一部解約元本額	414,211,427円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	4,743,563,449円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	806,694,787円
新光7資産バランスファンド	242,526,194円
海外国債ファンド（1年決算型）	20,958,194円
海外国債ファンド（変額年金）	655,186,363円
グローバル・ナビ	12,373,097円
計	6,481,302,084円
2. 受益権の総数	6,481,302,084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 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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>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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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	2021年4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価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。</p>
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	<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。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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年4月20日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	476,555,024
合計	476,555,024

（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（2020年11月5日から2021年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年4月20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	16,805,716	-	16,740,552	65,164
アメリカ・ドル	7,968,295	-	7,917,861	50,434
ユーロ	8,837,421	-	8,822,691	14,730
合計	16,805,716	-	16,740,552	65,164

(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)

	2021年4月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5531円 (25,531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

2021年4月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 03/15/24	6,100,000.000	6,088,324.170	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,625,855.440	
		US T N/B 0.625 08/15/30	1,000,000.000	918,906.250	
		US T N/B 1.625 08/15/29	5,000,000.000	5,073,046.850	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,500,000.000	3,734,882.790	
		US T N/B 2.625 02/15/29	5,000,000.000	5,462,304.640	
		US T N/B 2.75 02/15/28	3,000,000.000	3,298,945.290	
		US T N/B 2.875 05/15/28	5,000,000.000	5,544,335.900	
		US T N/B 2.875 08/15/28	5,000,000.000	5,548,828.090	

	US T N/B 3.125 11/15/28	5,000,000.000	5,639,453.100	
アメリカ・ドル	小計	42,300,000.000 (4,576,860,000)	44,934,882.520 (4,861,954,289)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/31/24	700,000.000	699,765.220	
	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,100,000.000	2,113,608.000	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,050,000.000	982,479.120	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	500,000.000	507,337.300	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	500,000.000	524,073.000	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	500,000.000	500,227.400	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,000,000.000	1,076,996.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	700,000.000	871,872.400	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,200,000.000	1,681,316.400	
イギリス・ポンド	小計	8,250,000.000 (1,248,720,000)	8,957,674.840 (1,355,833,664)	
カナダ・ドル	CANADA 0.5 09/01/25	4,000,000.000	3,939,800.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,700,000.000	1,543,464.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	5,200,000.000	5,254,605.200	
	CANADA 1.25 06/01/30	3,700,000.000	3,630,280.900	
	CANADA 2.25 06/01/29	6,000,000.000	6,423,138.000	
カナダ・ドル	小計	20,600,000.000 (1,779,840,000)	20,791,288.100 (1,796,367,292)	
ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,400,000.000	2,456,112.000	
	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	600,000.000	547,882.200	
	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,700,000.000	1,788,270.120	
	DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,500,000.000	1,560,594.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,900,000.000	2,630,151.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,000,000.000	1,419,880.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,900,000.000	3,018,739.000	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,300,000.000	3,323,750.100	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/25	700,000.000	730,028.600	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,000,000.000	3,156,477.000	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,500,000.000	1,487,667.000	
	FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,000,000.000	3,213,714.000	
	FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,000,000.000	971,712.000	
	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	5,500,000.000	5,897,991.000	
	FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,000,000.000	2,467,568.000	
	FRANCE OAT 2.75 10/25/27	300,000.000	360,792.600	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	700,000.000	1,230,633.600	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	4,379,412.000	

	ITALY BTPS 0.95 08/01/30	3,000,000.000	3,064,200.000	
	ITALY BTPS 1.5 06/01/25	6,300,000.000	6,690,915.000	
	ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,000,000.000	1,106,535.000	
	ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,300,000.000	1,493,570.000	
	ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,000,000.000	2,341,688.000	
	ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,000,000.000	2,388,082.000	
	ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,000,000.000	2,487,492.000	
	ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.000	2,614,760.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,000,000.000	1,395,300.000	
	ユーロ 小計	55,600,000.000 (7,243,568,000)	64,223,916.220 (8,367,091,803)	
国債証券 合計		14,848,988,000 (14,848,988,000)	16,381,247,048 (16,381,247,048)	
合計			16,381,247,048 (16,381,247,048)	

(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 10銘柄	29.38	29.68
イギリス・ポンド	国債証券 9銘柄	8.19	8.28
カナダ・ドル	国債証券 5銘柄	10.86	10.97
ユーロ	国債証券 27銘柄	50.57	51.08

(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。

新光米国REITマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年4月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,927,115
コール・ローン	1,049,353
投資証券	680,243,325
未収配当金	776,636
流動資産合計	686,996,429
資産合計	686,996,429
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	331,716,865
剰余金	
剰余金又は欠損金()	355,279,564
元本等合計	686,996,429
純資産合計	686,996,429
負債純資産合計	686,996,429

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
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	2021年4月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	368,112,178円
同期中追加設定元本額	562,283円
同期中一部解約元本額	36,957,596円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	326,561,318円
グローバル・ナビ	5,155,547円
計	331,716,865円
2. 受益権の総数	331,716,865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 2020年10月21日 至 2021年4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年4月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券		114,606,580
合計		114,606,580

(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)

	2021年4月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0710円 (20,710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

2021年4月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	407.000	8,278.380	
		AGREE REALTY CORP	299.000	20,589.140	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	346.000	6,113.820	
		ALEXANDER'S INC.	11.000	3,114.650	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	655.000	115,659.900	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	241.000	8,107.240	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	660.000	29,238.000	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	524.000	5,019.920	
AMERICAN HOMES 4 RENT	1,316.000	46,454.800	
AMERICAN TOWER CORP	2,132.000	529,887.280	
AMERICOLD REALTY TRUST	1,214.000	46,981.800	
APARTMENT INCOME REIT CORP	714.000	32,130.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	714.000	4,548.180	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,011.000	15,175.110	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	297.000	4,015.440	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	679.000	129,254.440	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	128.000	1,217.280	
BOSTON PROPERTIES INC	751.000	79,718.650	
BRANDYWINE REALTY TRUST	813.000	10,780.380	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,429.000	30,323.380	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	202.000	3,636.000	
BRT APARTMENTS CORP	60.000	1,062.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	455.000	53,289.600	
CARETRUST REIT INC	458.000	10,904.980	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	254.000	2,816.860	
CENTERSPACE	62.000	4,315.820	
CHATHAM LODGING TRUST	222.000	2,954.820	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	58.000	713.400	
CITY OFFICE REIT INC	227.000	2,512.890	
COLONY CAPITAL INC	2,304.000	15,759.360	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	549.000	10,260.810	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	927.000	9,983.790	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	107.000	5,307.200	
COREPOINT LODGING INC	205.000	1,945.450	
CORESITE REALTY CORP	194.000	24,381.920	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	542.000	15,062.180	

COUSINS PROPERTIES INC	714.000	25,732.560	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2,008.000	362,885.760	
CUBESMART	932.000	38,258.600	
CYRUSONE INC	580.000	42,711.200	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	958.000	9,388.400	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,348.000	199,180.480	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	1,138.000	5,257.560	
DOUGLAS EMMETT INC	803.000	26,201.890	
DUKE REALTY TRUST	1,778.000	79,707.740	
EAST GROUP	188.000	28,831.680	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	391.000	8,394.770	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	695.000	7,909.100	
EPR PROPERTIES	357.000	17,036.040	
EQUINIX INC	429.000	307,717.410	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	839.000	56,909.370	
EQUITY RESIDENTIAL	1,774.000	129,555.220	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	499.000	12,415.120	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	315.000	91,529.550	
EXTRA SPACE STORAGE INC	619.000	89,092.670	
FARMLAND PARTNERS INC	139.000	1,843.140	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	368.000	39,394.400	
FIRST INDUSTRIAL RT	618.000	30,238.740	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	353.000	10,106.390	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	542.000	2,997.260	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,048.000	46,960.880	
GEO GROUP INC	565.000	3,277.000	
GETTY REALTY CORP	167.000	5,078.470	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	161.000	3,318.210	
GLADSTONE LAND CORP	111.000	2,334.330	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	227.000	3,227.940	
GLOBAL NET LEASE INC	432.000	8,108.640	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	671.000	21,237.150	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,049.000	30,158.750	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,603.000	86,810.050	

HERSHA HOSPITALITY TRUST	178.000	1,899.260	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	496.000	21,576.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	3,373.000	58,690.200	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	725.000	20,126.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	489.000	8,009.820	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	311.000	7,711.240	
INVITATION HOMES INC	2,708.000	91,070.040	
IRON MOUNTAIN INC	1,380.000	53,102.400	
JBG SMITH PROPERTIES	588.000	19,027.680	
KILROY REALTY CORP	560.000	38,068.800	
KIMCO REALTY	1,993.000	39,600.910	
KITE REALTY GROUP TRUST	398.000	7,872.440	
LAMAR ADVERTISING CO	415.000	39,773.600	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,312.000	15,416.000	
LIFE STORAGE INC	356.000	33,211.240	
LTC PROPERTIES INC	187.000	8,125.150	
MACK CALI	416.000	6,718.400	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,767.000	61,538.080	
MID AMERICA	550.000	83,501.000	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	455.000	8,267.350	
NATIONAL HEALTH INVS INC	209.000	15,313.430	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	835.000	38,410.000	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	300.000	12,993.000	
NETSTREIT CORP	106.000	2,201.620	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	435.000	2,871.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	105.000	5,162.850	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	229.000	6,533.370	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	1,106.000	41,242.740	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	84.000	2,042.880	
OUTFRONT MEDIA INC	693.000	15,897.420	
PARAMOUNT GROUP INC	901.000	9,604.660	
PARK HOTELS & RESORTS INC	1,134.000	23,984.100	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	624.000	15,225.600	
PHYSICIANS REALTY TRUST	1,001.000	18,598.580	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	595.000	10,864.700	

PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	127.000	2,237.740	
POTLATCH CORP	314.000	19,348.680	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	248.000	2,586.640	
PROLOGIS INC	3,558.000	399,385.500	
PS BUSINESS PARKS	96.000	15,432.000	
PUBLIC STORAGE	728.000	196,836.640	
QTS REALTY TRUST INC	307.000	20,188.320	
RAYONIER INC	636.000	23,436.600	
REALTY INCOME CORP	1,805.000	121,548.700	
REGENCY CENTERS CORP	813.000	48,584.880	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	555.000	9,626.470	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,029.000	11,833.500	
RETAIL VALUE INC	96.000	1,786.560	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	633.000	34,973.250	
RLJ LODGING TRUST	787.000	12,300.810	
RPT REALTY	387.000	4,678.830	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	242.000	18,921.980	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	985.000	17,493.600	
SAFEHOLD INC	86.000	5,881.540	
SAUL CENTERS INC	63.000	2,571.660	
SBA COMMUNICATIONS CORP	534.000	153,840.060	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	176.000	3,162.720	
SERVICE PROPERTIES TRUST	786.000	9,746.400	
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,579.000	184,048.240	
SITE CENTERS CORP	735.000	10,326.750	
SL GREEN	339.000	24,258.840	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	551.000	24,536.030	
STAG INDUSTRIAL INC	774.000	27,515.700	
STORE CAPITAL CORP	1,165.000	40,891.500	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	496.000	4,855.840	
SUN COMMUNITIES INC	511.000	81,259.220	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,031.000	12,866.880	
TANGER FACTORY OUTLET	434.000	7,351.960	
TERRENO REALTY CORP	324.000	20,188.440	
THE MACERICH COMPANY	719.000	9,109.730	
UDR INC	1,413.000	63,768.690	
UMH PROPERTIES INC	178.000	3,581.360	

	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	62.000	4,250.720	
	URBAN EDGE PROPERTIES	557.000	9,998.150	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	158.000	2,850.320	
	VENTAS INC	1,801.000	98,694.800	
	VEREIT INC	1,055.000	42,991.250	
	VICI PROPERTIES INC	2,580.000	77,064.600	
	VORNADO REALTY TRUST	847.000	38,513.090	
	WASHINGTON REIT	406.000	9,317.700	
	WEINGARTEN REALTY INVST	585.000	17,889.300	
	WELLTOWER INC	2,018.000	151,107.840	
	WEYERHAEUSER CO	3,606.000	140,201.280	
	WHITESTONE REIT	208.000	2,015.520	
	WP CAREY INC	840.000	61,420.800	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	543.000	10,056.360	
	アメリカ・ドル 小計	115,106.000	6,286,906.890 (680,243,325)	
投資証券 合計		115,106	680,243,325 (680,243,325)	
合計			680,243,325 (680,243,325)	

(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 156銘柄	99.02	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。

フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド

「フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

財政状態計算書

2020年5月31日現在

	2020年 (日本円)	2019年 (日本円)
資産		
流動資産		
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	23,312,508,302	28,798,229,550
ブローカーに対する債権	302,000,000	-
現金および現金同等物	631,504,565	1,612,634,555
その他の債権	79,302	585,504
資産合計	24,246,092,169	30,411,449,609
負債		
流動負債		
未払解約金	303,520,000	-
ブローカーに対する債務	341,308,763	320,660,640
未払費用	27,096,268	37,865,210
負債合計	671,925,031	358,525,850
受益証券保有者に帰属する純資産	23,574,167,138	30,052,923,759

投資ポートフォリオ(無監査)

2020年5月31日終了会計年度

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
債券		
アンゴラ		
Angolan Government International Bond 8.00% due 26/11/2029 REGS	485,754,341	-
Angolan Government International Bond 9.50% due 26/11/2029 REGS	-	1,065,202,163
アンゴラ合計	485,754,341	1,065,202,163
アルゼンチン		
Argentina Treasury Bill 0% due 28/06/2019 TBLM	-	307,882,633
Argentina Treasury Bill 0% due 30/04/2020	-	32,785,893
Bonos De La Nacion Argentina En Moneda Dua 4.50% due 13/02/2020	-	264,109,932
Provincia Del Chubut Argentina 7.75% due 26/07/2026 REGS	69,966,794	548,624,657
Provincia De Tierra Del Fuego Argentina 8.95% due 17/04/2027 REGS	259,937,602	487,837,514
Republic of Argentina 5.875% due 11/01/2028	-	287,071,653
アルゼンチン合計	329,904,396	1,928,312,282
アルメニア		
Republic of Armenia International Bond 7.15% due 26/03/2025 REGS	622,962,259	827,802,600
アルメニア合計	622,962,259	827,802,600
アゼルバイジャン		
International Bank of Azerbaijan Ojsc 5.625% due 11/06/2019 REGS	542,151,550	519,343,303
Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026 REGS	402,534,028	400,528,873
アゼルバイジャン合計	944,685,578	919,872,176
ベラルーシ		
Development Bank of the Republic of Belarus JSC 12.00% due 15/05/2022 REGS	288,837,645	322,243,961
Republic of Belarus International Bond 6.20% due 28/02/2030 REGS	325,231,856	331,102,508
ベラルーシ合計	614,069,501	653,346,469
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina due 20/12/2021 REGS	242,154,573	350,021,453
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	242,154,573	350,021,453
ブラジル		
Brazil Republic of 2.625% due 05/01/2023	-	149,837,903
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 8.20% due 06/04/2028 REGS	374,919,491	409,907,720
ブラジル合計	374,919,491	559,745,623
カメルーン		
Republic of Cameroon International Bond 9.50% due 19/11/2025 REGS	494,795,841	541,505,227
カメルーン合計	494,795,841	541,505,227

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
債券(続き)		
中国		
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.875% due 14/03/2025 REGS	632,529,013	613,168,580
中国合計	632,529,013	613,168,580
コロンビア		
Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS	446,615,163	494,730,326
Ecopetrol SA 4.125% due 16/01/2025	317,674,883	315,553,418
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	361,617,331	368,005,979
Republic of Colombia 4.375% due 12/07/2021	284,013,947	294,754,675
コロンビア合計	1,409,921,324	1,473,044,398
ドミニカ共和国		
Dominican Republic 8.90% due 15/02/2023 REGS	249,397,178	318,587,731
Dominican Republic International Bond 9.75% due 05/06/2026 REGS	295,130,796	302,750,138
Mestenio Ltd 8.50% due 02/01/2020 REGS	-	35,695,093
ドミニカ共和国合計	544,527,974	657,032,962
エジプト		
Egypt Government Bond 16.40% due 05/09/2020	64,671,809	60,063,858
Egypt Government Bond 18.15% due 13/06/2020	196,721,094	188,383,591
Egypt Government International Bond 7.625% due 29/05/2032 REGS	185,510,495	-
Egypt Treasury Bills 0% due 15/09/2020 TBLM	478,981,784	392,493,699
エジプト合計	925,885,182	640,941,148
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035 REGS	436,469,319	255,474,237
エルサルバドル合計	436,469,319	255,474,237
エチオピア		
Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	580,035,583	627,971,988
エチオピア合計	580,035,583	627,971,988
ガボン		
Republic of Gabon 6.95% due 16/06/2025 REGS	-	92,049,636
ガボン合計	-	92,049,636
ジョージア		
Georgian Oil & Gas Corp 6.75% due 26/04/2021 REGS	290,167,017	306,311,752
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022 REGS	134,925,770	144,339,258
ジョージア合計	425,092,787	450,651,010
ガーナ		
Ghana Government International Bond 8.125% due 18/01/2026 REGS	216,847,700	229,924,005
Ghana Govt 18.25% due 25/07/2022	500,039,599	527,088,575
Ghana Govt 24.75% due 19/07/2021	69,122,267	76,690,000
Saderea DAC 12.50% due 30/11/2026 REGS	81,567,131	89,813,011
ガーナ合計	867,576,697	923,515,591

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
債券(続き)		
インドネシア		
Government of Indonesia 3.375% due 15/04/2023 REGS	448,853,600	437,259,848
インドネシア合計	448,853,600	437,259,848
イラク		
Oilflow SPV 1 DAC (Krg) 12.00% due 13/01/2022 REGS	-	197,444,218
Republic of Iraq 5.80% due 15/01/2028 REGS	-	245,435,984
イラク合計	-	442,880,202
ジャマイカ		
Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045	258,602,840	253,645,523
ジャマイカ合計	258,602,840	253,645,523
ヨルダン		
Jordan Kingdom 6.125% due 29/01/2026 REGS	441,160,766	445,982,637
ヨルダン合計	441,160,766	445,982,637
カザフスタン		
Astana Finance JSC 0% due 22/12/2024 REGS	3,265,620	3,281,544
Development Bank of Kazakhstan JSC 9.50% due 14/12/2020 REGS	138,100,748	156,682,645
Kazakhstan Government International Bond 4.875% due 14/10/2044 REGS	571,183,053	492,598,640
Kazakhstan Temir Zholy Finance Bv 6.95% due 10/07/2042 REGS	254,054,643	239,464,727
Kazakhstan Temir Zholy National Co JSC 4.85% due 17/11/2027 REGS	-	237,796,807
カザフスタン合計	966,604,064	1,129,824,363
ケニア		
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	321,307,925	340,917,904
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 12/05/2025	274,710,911	305,284,470
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 10/01/2033	81,006,407	89,591,450
ケニア合計	677,025,243	735,793,824
メキシコ		
Mexican Bonos 8.50% due 31/05/2029	993,848,490	-
Mexico City Airport Trust 4.25% due 31/10/2026 REGS	98,909,026	107,140,416
Mexico City Airport Trust 5.50% due 31/07/2047 REGS	175,559,483	199,025,486
Mexican Fixed Rate Bonds 5.00% due 11/12/2019	-	1,002,636,308
Mexican Udibonos 4.50% due 04/12/2025 Index Linked To Mxudi	90,420,623	93,667,646
メキシコ合計	1,358,737,622	1,402,469,856

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
債券(続き)		
モザンビーク		
Mozambique International Bond 10.50% due 18/01/2023 REGS	-	377,219,062
モザンビーク合計	-	377,219,062
パラグアイ		
Rutas 2 and 7 Finance Ltd 0% due 30/09/2036 REGS	280,891,783	-
パラグアイ合計	280,891,783	-
ペルー		
Iirsa Norte Finance Ltd 8.75% due 30/05/2024 REGS	207,322,503	271,275,755
Lima Metro Line 2 Finance Ltd 5.875% due 05/07/2034 REGS	336,902,878	584,018,145
Peruvian Government International Bond 6.35% due 12/08/2028 REGS	441,325,969	416,522,832
ペルー合計	985,551,350	1,271,816,732
ロシア		
Rzd Capital PLC (Russian Railways) 5.70% due 05/04/2022 REGS	428,466,890	423,782,582
ロシア合計	428,466,890	423,782,582
南アフリカ		
Government of South Africa 4.30% due 12/10/2028	567,209,588	596,453,306
Government of South Africa 7.00% due 28/02/2031	1,135,602,453	1,263,677,457
南アフリカ合計	1,702,812,041	1,860,130,763
国際機関		
Banque Ouest Africaine De Development 5.00% due 27/07/2027 REGS	330,709,228	336,141,815
European Bank for Reconstruction & Development 6.85% due 21/06/2021	318,256,025	328,527,087
European Bank for Reconstruction & Development 8.30% due 02/10/2020	166,323,419	171,977,887
European Bank for Reconstruction & Development 27.50% due 11/09/2020	569,640,669	-
European Bank for Reconstruction & Development 28.50% due 10/07/2019	-	722,317,180
International Bank for Reconstruction and Development 9.00% due 26/02/2021 REGS	288,045,406	315,227,056
Inter-American Development Bank 8.01% due 11/12/2021 REGS	127,398,191	-
国際機関合計	1,800,372,938	1,874,191,025
スリナム		
Government of Suriname 9.25% due 26/10/2026 REGS	105,724,168	287,684,786
Suriname Government International Bond 9.875% due 30/12/2023 REGS	82,887,763	-
スリナム合計	188,611,931	287,684,786

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
債券(続き)		
トリニダード・トバゴ		
Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 REGS	-	757,689,459
Trinidad Petroleum Holdings Ltd 9.75% due 15/06/2026 REGS	615,733,670	-
トリニダード・トバゴ合計	615,733,670	757,689,459
チュニジア		
Banque Cent de Tunisie International Bond 5.75% due 30/01/2025 REGS	689,988,228	699,545,726
チュニジア合計	689,988,228	699,545,726
トルコ		
Government of Turkey 4.875% due 16/04/2043	558,493,072	562,335,419
Türkiye İhracat Kredi Bankası AS 6.125% due 03/05/2024 REGS	325,402,681	303,554,731
トルコ合計	883,895,753	865,890,150
ウガンダ		
Republic of Uganda Government Bonds 13.75% due 13/06/2019	-	215,169,308
ウガンダ合計	-	215,169,308
ウクライナ		
KYIV Finance PLC (CITY OF KIEV) 7.50% due 15/12/2022 REGS	539,609,503	606,868,138
Ukraine Government 7.375% due 25/09/2032 REGS	-	514,370,192
ウクライナ合計	539,609,503	1,121,238,330
ウルグアイ		
Uruguay Republic of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked	901,681,330	899,655,404
ウルグアイ合計	901,681,330	899,655,404
債券合計	23,099,883,411	28,081,527,123
原油ワラント		
ナイジェリア		
Nigeria Central Bank of WRD Exp 15/11/2020 REGS	165,561,307	600,373,862
ナイジェリア合計	165,561,307	600,373,862
ベネズエラ		
Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020	47,063,584	116,328,565
ベネズエラ合計	47,063,584	116,328,565
原油ワラント合計	212,624,891	716,702,427
投資ポートフォリオ	23,312,508,302	28,798,229,550

(FRN)変動利付債です。

(Index Linked)インフレ連動債です。

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

はアセットマネジメントOneにて追記

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年4月30日現在

資産総額	4,672,670,431円
負債総額	4,357,877円
純資産総額(-)	4,668,312,554円
発行済数量	4,598,871,564口
1口当たり純資産額(/)	1.0151円

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	2,483,316,522円
負債総額	12,523,482円
純資産総額(-)	2,470,793,040円
発行済数量	933,009,236口
1口当たり純資産額(/)	2.6482円

新光日本債券インデックスマザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	9,205,131,337円
負債総額	10,677,200円
純資産総額(-)	9,194,454,137円
発行済数量	7,164,348,119口
1口当たり純資産額(/)	1.2834円

新光J-REITマザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	129,812,230,038円
負債総額	378,123,000円
純資産総額(-)	129,434,107,038円
発行済数量	57,671,722,834口
1口当たり純資産額(/)	2.2443円

新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	2,119,525,811円
負債総額	48,516円
純資産総額(-)	2,119,477,295円
発行済数量	616,252,568口
1口当たり純資産額(/)	3.4393円

海外国債マザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	16,658,759,859円
負債総額	4,300,000円
純資産総額(-)	16,654,459,859円
発行済数量	6,469,546,172口
1口当たり純資産額(/)	2.5743円

新光米国REITマザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	708,106,453円
負債総額	0円
純資産総額(-)	708,106,453円
発行済数量	331,716,865口
1口当たり純資産額(/)	2.1347円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2021年4月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2021年4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。

2021年4月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,470,877,769,130
追加型株式投資信託	843	15,735,956,827,061
単位型公社債投資信託	30	64,520,748,527
単位型株式投資信託	207	1,285,603,401,803
合計	1,106	18,556,958,746,521

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36期事業年度(自2020年4月1日至2021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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(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	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

(単位:千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		-	
為替差益	-		7,314	
金銭の信託運用益	-		1,229,697	
受取負担金	297,886		-	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		-	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		-	
システム解約料	31,680		-	
早期割増退職金	-		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		-	
特別利益計		1,169,758		-
特別損失				
固定資産除却損	1 16,085		1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		385,835		1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

(3) 【株主資本等変動計算書】

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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	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	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

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。

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606)を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

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35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021年3月31日現在）
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

（株主資本等変動計算書関係）

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

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					

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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
2021年6月16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
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17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	-

第36期(2021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	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(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、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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	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 其他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第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 其他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

第36期(2021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	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

(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35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36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。

第36期(2021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	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

(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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	996	-	3

(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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	4,319
退職給付の支払額	187,749	245,143
過去勤務費用の発生額	-	1,567
その他	1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

(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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	130,155	84,264
未認識過去勤務費用	173,798	102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	11,303	7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

(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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021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% ~ 3.76%

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103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

(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35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
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	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円
(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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

(2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85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	5,149,555千円	5,016,672千円

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

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) 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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) 受託会社

a. 名称

三井住友信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2020年3月末日現在、342,037百万円

c. 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
いちよし証券株式会社()	14,577	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
永和証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡安証券株式会社	650	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
あかつき証券株式会社	3,067	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
大山日ノ丸証券株式会社	215	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
西村証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三にいがた証券株式会社	852	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
三豊証券株式会社	300	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2020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。

(3) 投資顧問会社

a. 名称

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド

b. 資本金の額

2020年12月末日現在、300万ポンド

2.b. 事業の内容

英国籍の法人であり、内外の有価証券等にかかる投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」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

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2020年11月4日	臨時報告書
2021年1月20日	有価証券報告書
2021年1月20日	有価証券届出書
2021年2月3日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2021年5月26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 丘本 正彦 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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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2021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。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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) X B R 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

2021年6月4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 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光7資産バランスファンドの2020年10月21日から2021年4月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの2021年4月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。