

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年9月15日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出） 内国投資信託受益証券に係るファ ンドの名称】	グローバル・ナビ
【届出の対象とした募集（売出） 内国投資信託受益証券の金額】	3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

グローバル・ナビ

愛称として「世界の潮流」という名称を用いることがあります。

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

(イ) 追加型株式投資信託(契約型)の受益権です。

(ロ) 当初元本は1口当たり1円です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

3兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

(イ) 発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を公表します。

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時~午後5時です。)

インターネットホームページ

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

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

(5) 【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

(6) 【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

(7) 【申込期間】

2021年9月16日から2022年3月15日までです。（注）

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（注）繰上償還（信託終了）が決定した場合には、購入の申込期間は2021年10月28日までとなります。繰上償還（信託終了）については(12)その他をご参照ください。

(8) 【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所（販売会社）については、下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

(9) 【払込期日】

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

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

(1 0) 【払込取扱場所】

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

(1 1) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

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

< 繰上償還(信託終了)の予定について >

当ファンドは、信託契約を解約し、繰上償還(信託終了)するための手続きを行います。

1. 繰上償還(信託終了)を行う理由

当ファンドは2014年1月6日に設定し、主としてわが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券に実質的に投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行ってまいりました。しかしながら、2021年5月末時点の受益権口数が約1.6億口と信託約款に定める繰上償還(信託終了)の目安となる口数(30億口)を下回っているため、信託約款の規定に基づき繰上償還(信託終了)する予定です。

2. 繰上償還(信託終了)の日程

受益者の確定日	2021年9月17日
書面による議決権の行使期限	2021年10月18日まで
書面決議の日(繰上償還(信託終了)の可否が決定される日)	2021年10月19日
繰上償還(信託終了)予定日	2021年11月15日

3. 書面による決議(書面決議)について

- ・書面による議決権の行使については、2021年9月17日現在の受益者の皆さまを対象としております。2021年9月18日以降に取得された受益権口数(2021年9月16日以降に取得申込みをされた受益権口数)は書面決議の手続きの対象とはなりませんので、ご了承ください。
- ・書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の賛成をもって可決されます。また、書面決議において否決された場合には、当ファンドの繰上償還(信託終了)は行いません。

書面決議の結果は、2021年10月19日(書面決議の日)以降、委託会社のホームページ(<http://www.amone.co.jp/>)でご覧いただくか、委託会社または販売会社へお問い合わせいただければご確認いただけます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

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

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

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

b. ファンドの特色

1 国内外の株式、債券、REIT*¹に分散投資を行います。

- 当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

※詳しくは後述「ファンドの仕組み」をご覧ください。

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

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

*1「REIT」とは、不動産投資信託証券を指します。

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

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

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

当ファンドの資産配分について

Step1 株式と債券の配分比率決定・見直し

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

<配分比率決定・見直しのイメージ>



Step2 各資産の配分比率決定

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

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

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

先進国株式**●新光外国株式インデックスマザーファンド**

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

国内債券**●新光日本債券インデックスマザーファンド**

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

先進国債券**●海外国債マザーファンド**

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

●新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

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

新興国債券**●グローバル高金利通貨マザーファンド**

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

国内REIT**●新光J-REITマザーファンド**

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

先進国REIT**●新光米国REITマザーファンド**

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

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

また、記載内容は2021年9月15日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(参考)当ファンドの投資対象候補であるETFの概要(2021年9月15日現在)**新興国株式**

下記の投資対象候補およびその概要は2021年9月15日現在のものであり、今後予告なく変更する場合があります。

●名称:iシェアーズ・コア MSCI エマージング・マーケット ETF

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

■ 分配方針

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

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

※運用状況により分配金額は変動します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

(2) 【ファンドの沿革】

2014年1月6日

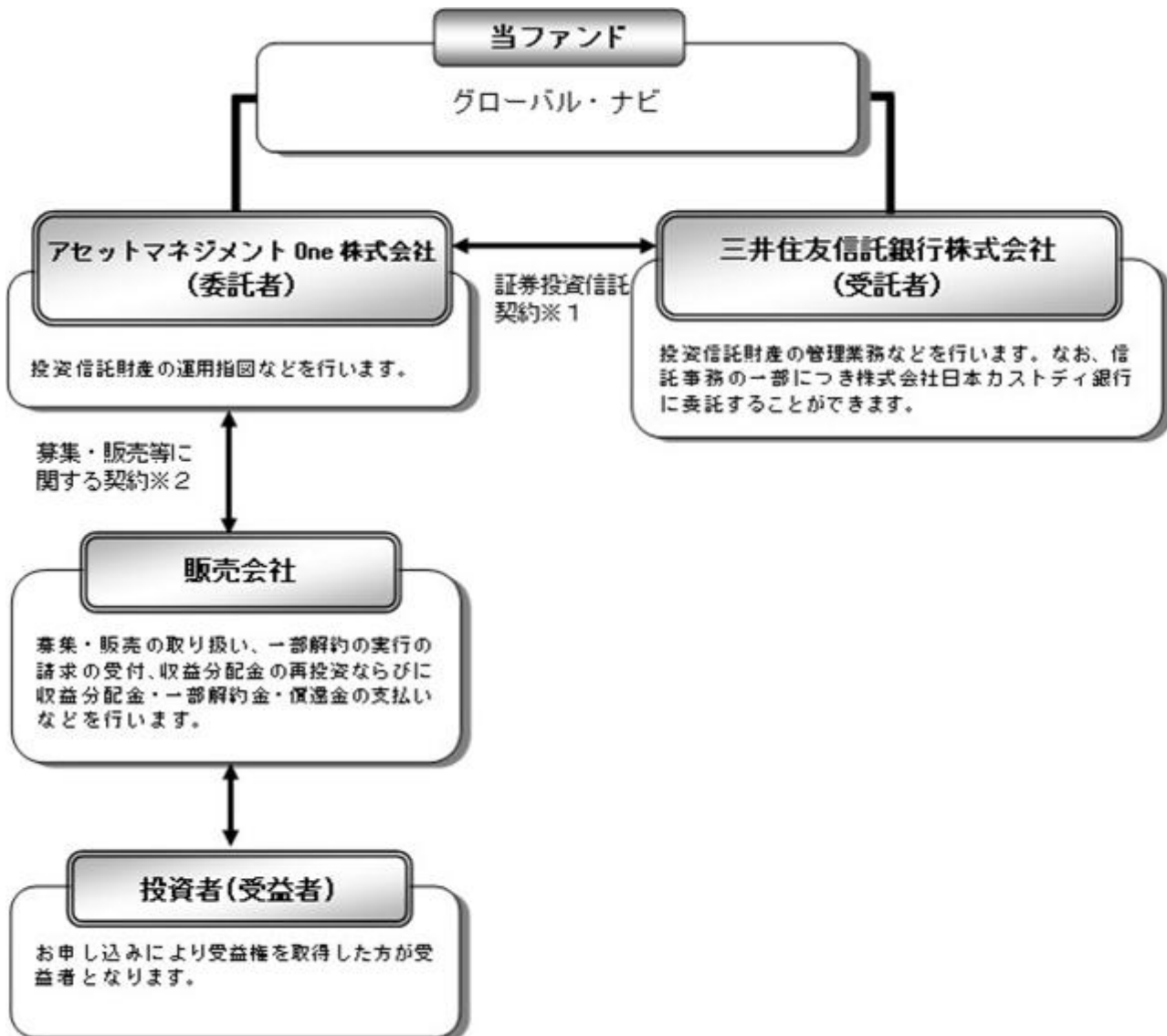
投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

2016年10月1日

ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み



1 証券投資信託契約

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

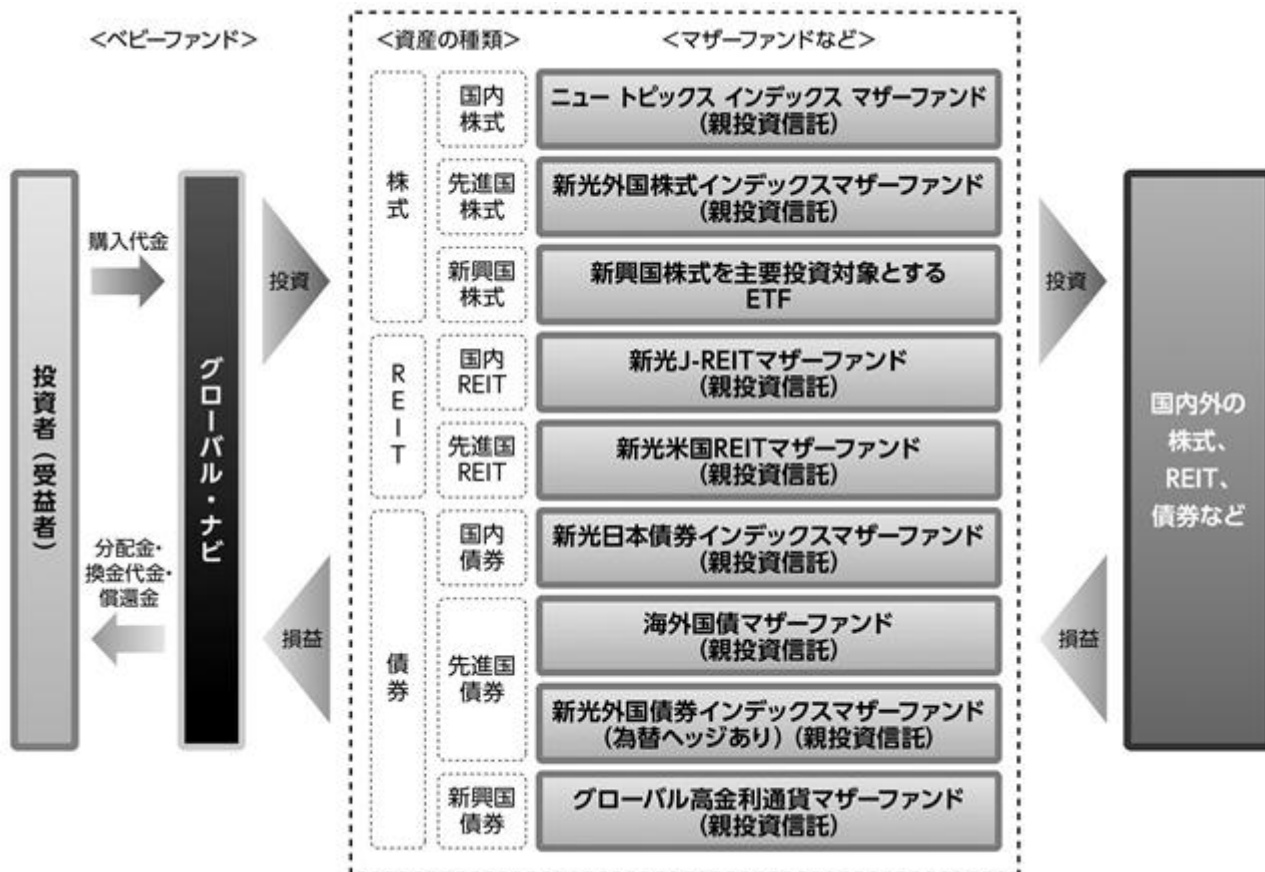
2 募集・販売等に関する契約

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

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

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

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



b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2021年6月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2021年6月30日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

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

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

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

(ロ) 投資態度

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

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

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

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

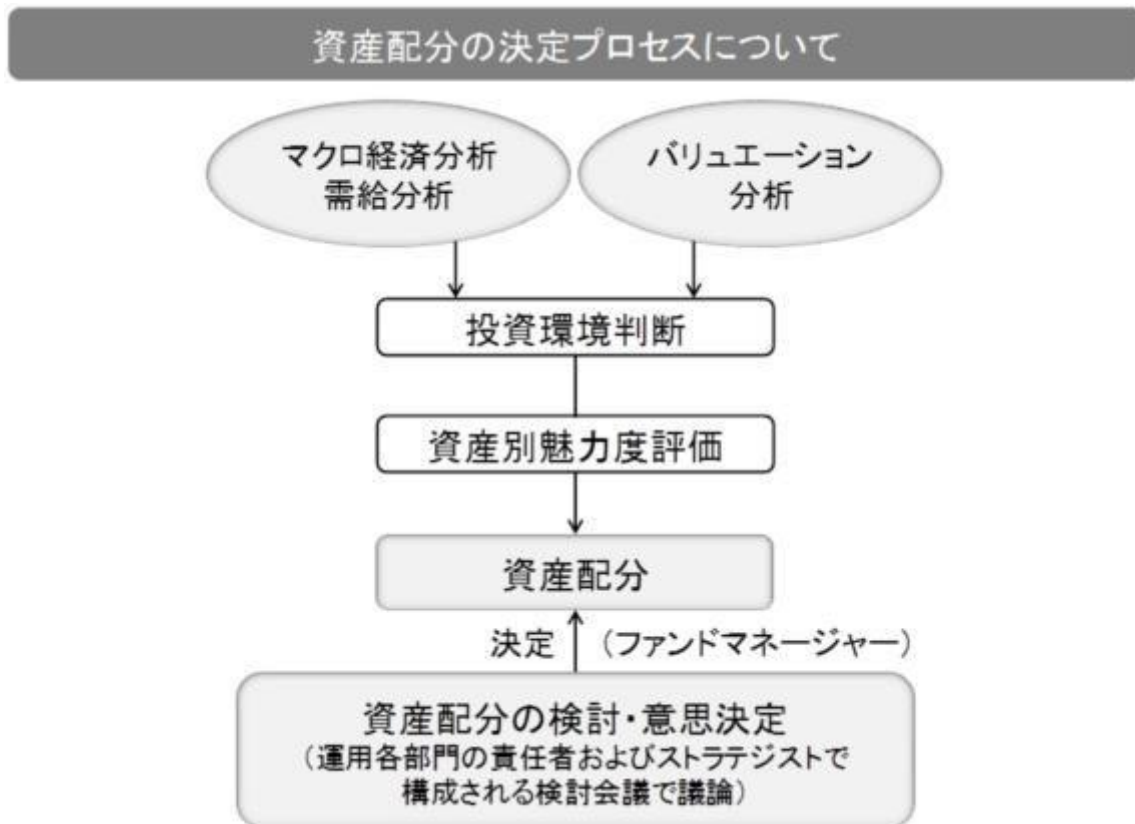
各マザーファンド受益証券と上場投資信託証券を合算した投資比率は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げることがあります。

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

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

運用プロセス

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



運用プロセスは2021年6月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

各マザーファンドの運用方針

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数に連動する投資成果をめざした運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

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

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

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資は行いません。

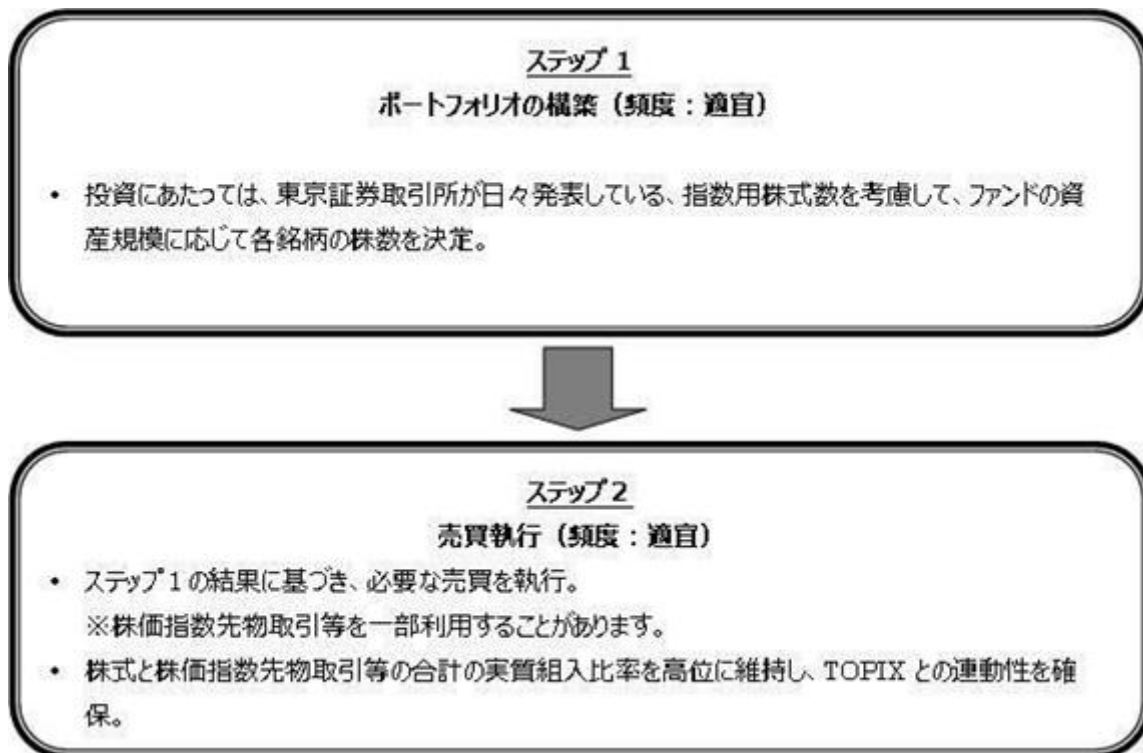
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしがたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

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

運用プロセス

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6月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光外国株式インデックスマザーファンド

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

3. 収益分配方針

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

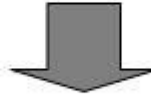
運用プロセス

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

ステップ 1

リスクモニタリング

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



ステップ 2

ポートフォリオの構築

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



ステップ 3

売買執行

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

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2021年6月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光日本債券インデックスマザーファンド

1. 基本方針

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

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

3. 収益分配方針

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

運用プロセス

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



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2021年6月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

海外国債マザーファンド

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

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

運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。

(イ) 超過収益獲得の観点から

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

(ロ) リスク管理の観点から

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

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

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。

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

3. 収益分配方針

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

運用プロセス

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



運用プロセスは2021年6月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

1．基本方針

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

2．運用方法

（1）投資対象

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

（3）投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

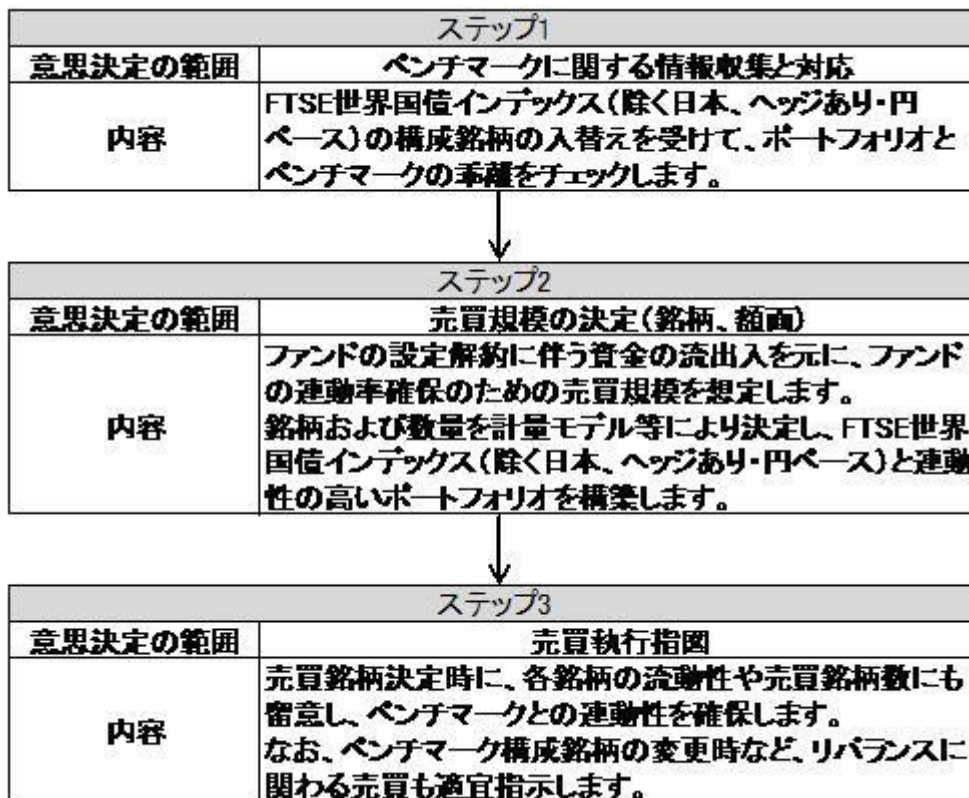
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

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

運用プロセス

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



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2021年6月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

グローバル高金利通貨マザーファンド

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

世界各国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

組入公社債の平均残存期間は、1～3年程度とします。

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

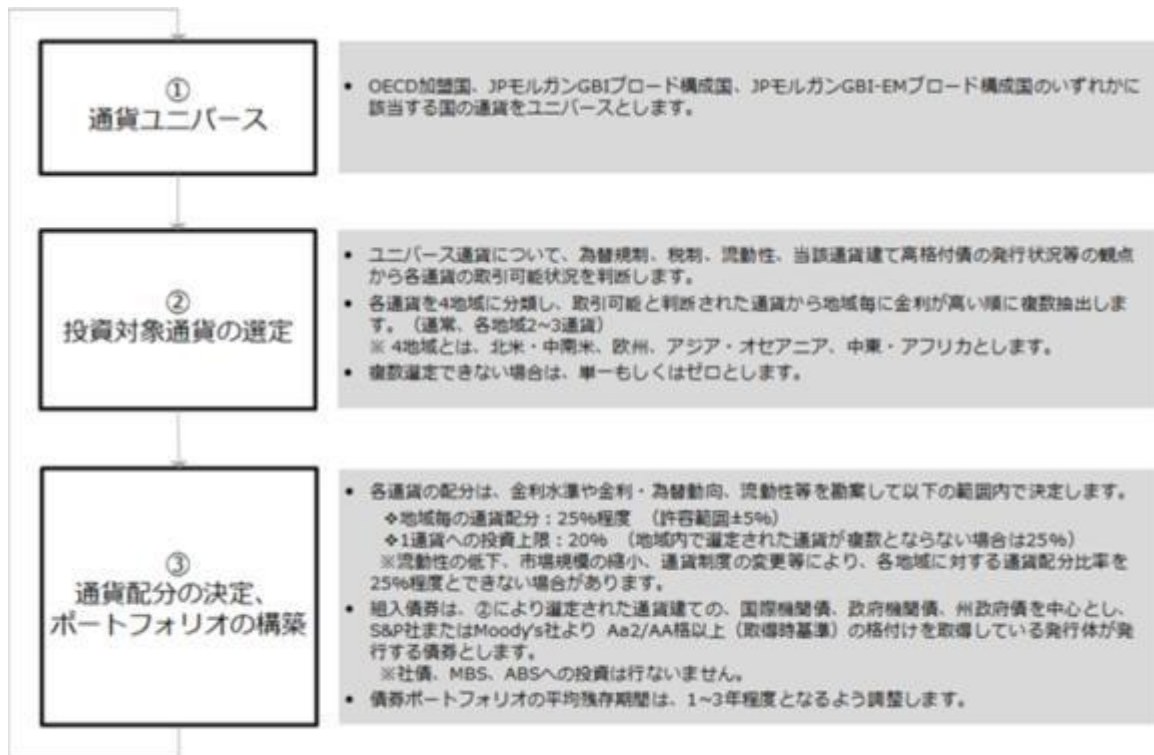
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

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

運用プロセス

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



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

運用プロセスは2021年6月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光J - R E I Tマザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。

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。

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

(3) 投資制限

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

不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

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。

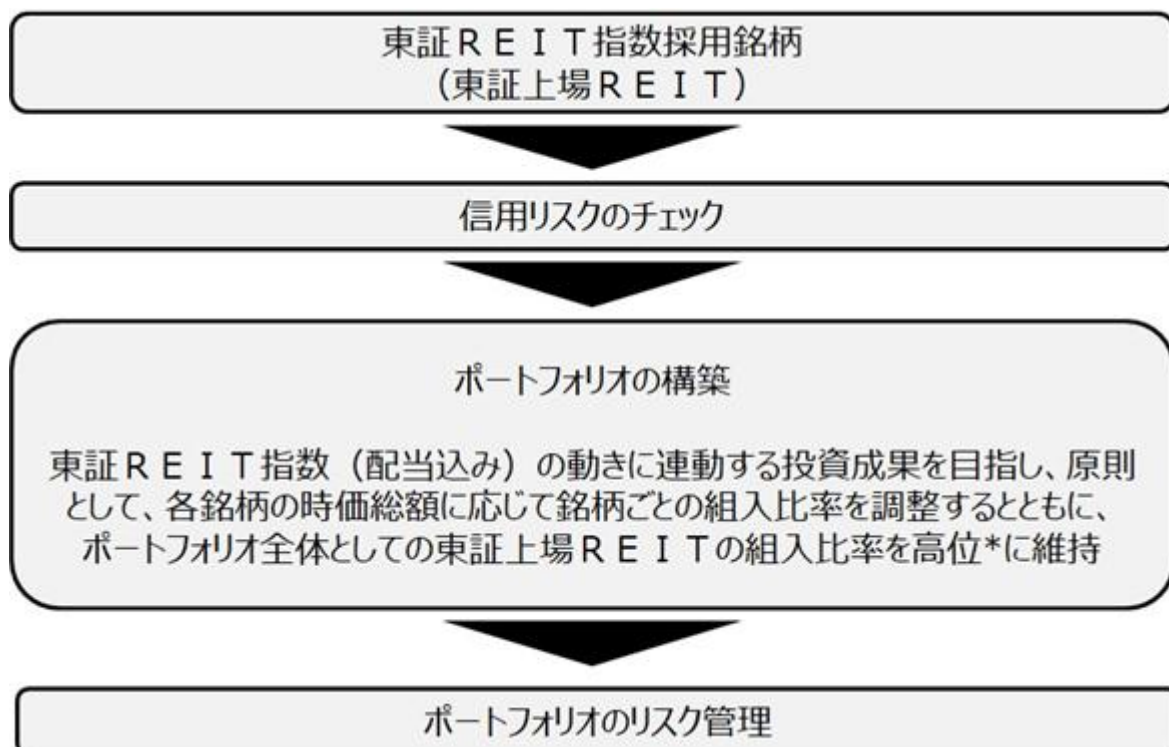
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

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

運用プロセス

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



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

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

運用プロセスは2021年9月16日時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光米国REITマザーファンド

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

REITの組入比率については、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

(3) 投資制限

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

REITへの投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

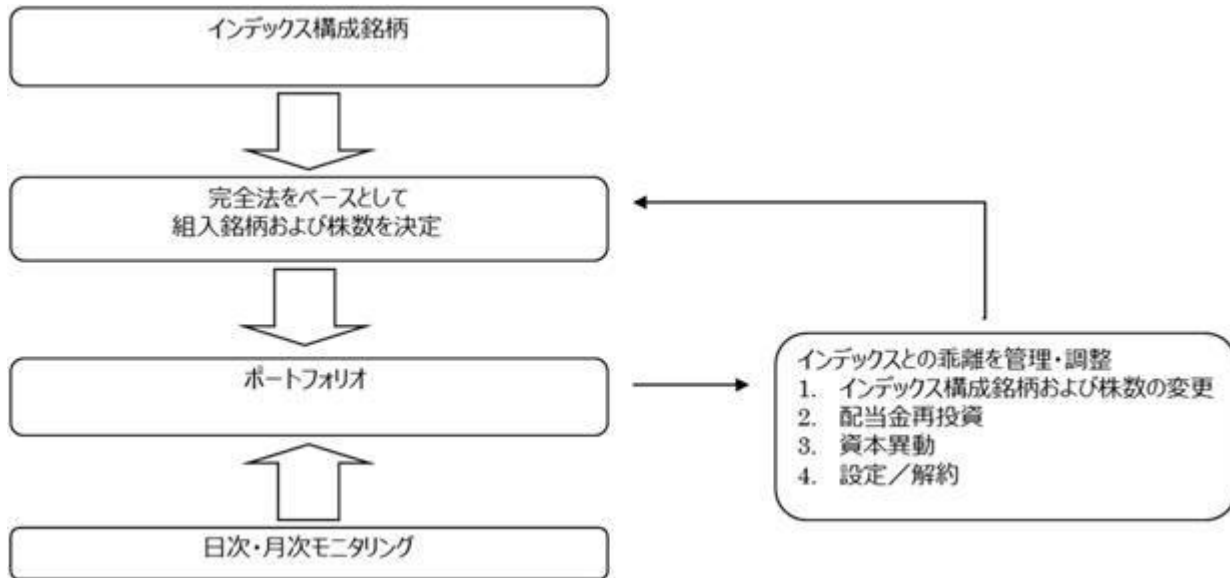
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

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

運用プロセス

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



運用プロセスは2021年6月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

(2) 【投資対象】

a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

b．有価証券および金融商品の指図範囲等

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

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

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

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

27. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

c. 先物

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

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

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

d. スワップ

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

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

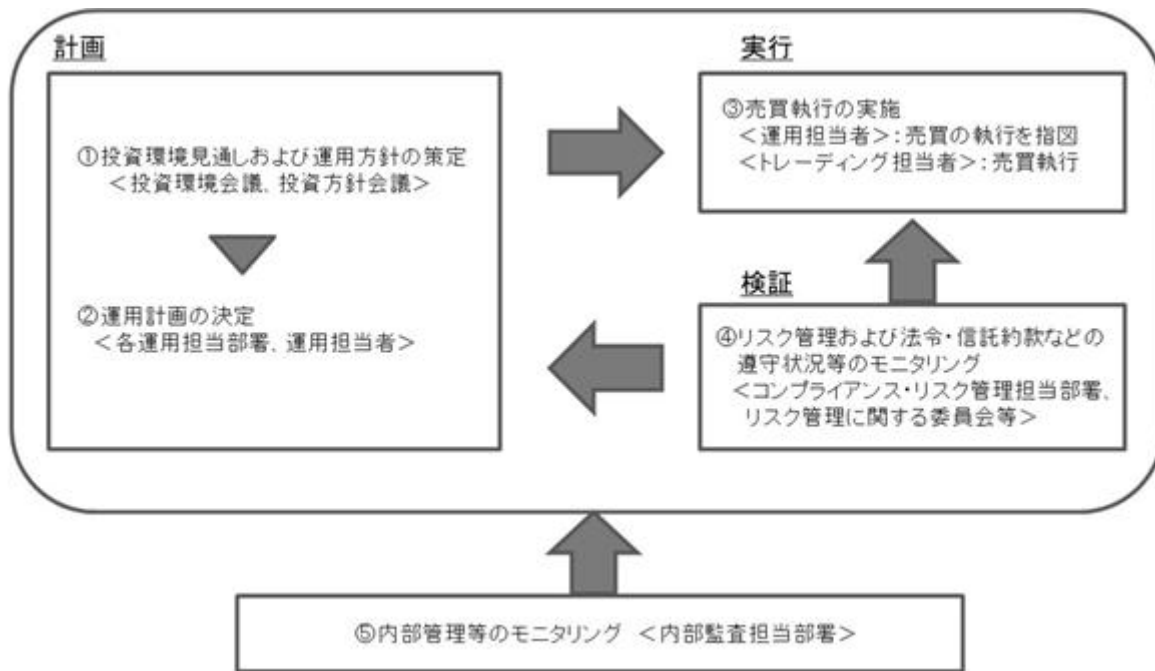
e. 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

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

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

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

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

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

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

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

(5) 【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a. 株式等への投資割合

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

b. 新株引受権証券等への投資割合

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

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

c. 投資信託証券への投資割合

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

d. 同一銘柄への投資割合

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

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

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

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

e. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

f．投資する株式等の範囲

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

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

g．信用取引の指図範囲

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

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

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

h．有価証券の貸し付けの指図および範囲

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

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

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

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

i . 公社債の空売りの指図範囲

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

j . 公社債の借り入れ

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借り入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借り入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 借り入れの指図は、当該借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

k . 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

l . 外国為替予約の指図および範囲

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

m. 資金の借入れ

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間、もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

n. 利害関係人等との取引等

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

o. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

p . 信用リスク集中回避のための投資制限

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

法令に定める投資制限

a . 同一の法人の発行する株式

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

（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

3【投資リスク】

（1）ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

a . 資産配分リスク

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

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

b . 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

c . R E I Tの価格変動リスク

R E I Tの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

d．為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

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

e．カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

f．金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

g．信用リスク

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

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

h．流動性リスク

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

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

i . 他のベビーファンドの影響

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

j . 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

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

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

(ニ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。

(ホ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。

(ヘ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。

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

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

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

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

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

東証株価指数について

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

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

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

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

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

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

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

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

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

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

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

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

NOMURA - BPI総合について

NOMURA - BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募利付債券市場全体の動向を表す投資収益指標で、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA - BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックスについて

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

東証REIT指数（配当込み）について

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

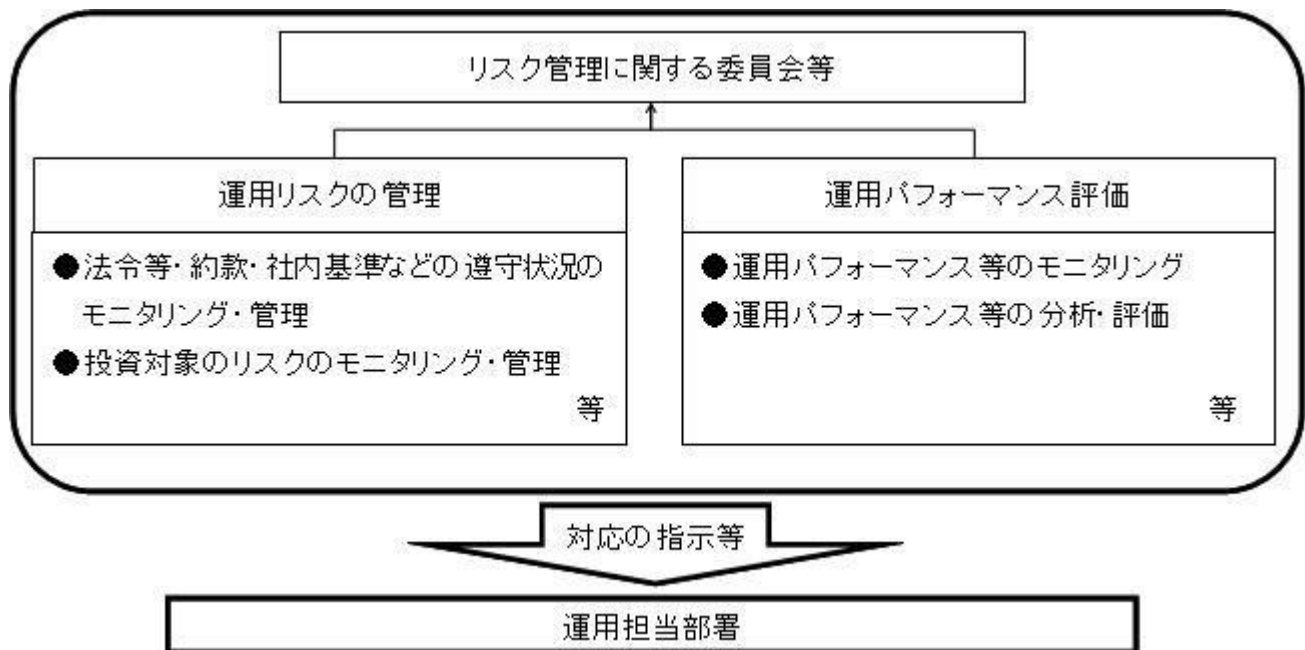
FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスとは、ニューヨーク証券取引所、アメリカン証券取引所、NASDAQ登録のすべてのEquity（エクイティ）型REITで構成される総合収益指数であり、FTSE International Limited（以下「FTSE」といいます。）が算出、公表しています。

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

（２）リスク管理体制

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

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



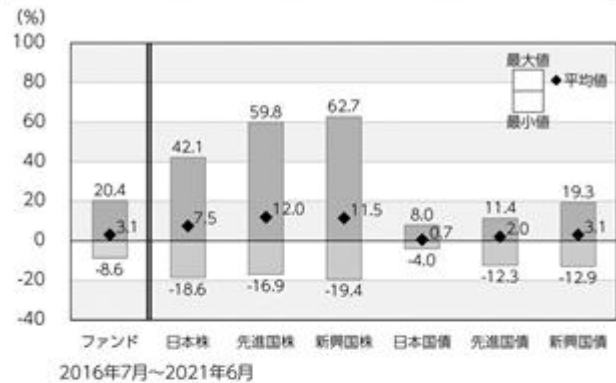
リスク管理体制は2021年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンド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(統東京証券取引所)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、統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ごとに異なりますので、詳しくは各販売会社でご確認ください。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

b. 信託財産留保額

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

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

なお、これは運用資金の一部として投資信託財産に組み入れられます。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.562%（税抜1.42%）

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

- a. 個人の受益者に対する課税

（イ）収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（ロ）解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

(八) 損益通算について

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

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

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

b. 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2021年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

c．個別元本について

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

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

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

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

d．収益分配金の課税について

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	11,189,590	5.19
内 アメリカ	11,189,590	5.19
親投資信託受益証券	194,151,574	90.08
内 日本	194,151,574	90.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,196,209	4.73
純資産総額	215,537,373	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6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	2,421,325,860	96.90
内 日本	2,421,325,860	96.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	77,411,447	3.10
純資産総額	2,498,737,307	100.00

その他資産の投資状況

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	58,290,000	2.33
内 日本	58,290,000	2.33

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

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

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

新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,951,876,463	90.98
内 アメリカ	1,350,023,424	62.93
内 イギリス	85,161,931	3.97
内 カナダ	72,230,612	3.37
内 スイス	67,292,345	3.14
内 フランス	66,578,891	3.10
内 ドイツ	59,034,710	2.75
内 オーストラリア	40,945,594	1.91
内 オランダ	38,160,597	1.78
内 アイルランド	36,497,557	1.70
内 スウェーデン	22,480,252	1.05
内 デンマーク	16,180,490	0.75
内 スペイン	15,607,451	0.73
内 香港	15,240,097	0.71
内 イタリア	11,833,268	0.55

内	ジャージー	8,118,635	0.38
内	フィンランド	8,055,786	0.38
内	シンガポール	5,813,653	0.27
内	ベルギー	5,430,997	0.25
内	バミューダ	5,346,110	0.25
内	ケイマン諸島	3,929,334	0.18
内	ノルウェー	3,892,661	0.18
内	イスラエル	3,804,464	0.18
内	ルクセンブルグ	2,094,264	0.10
内	ニュージーランド	2,073,253	0.10
内	オランダ領キュラソー	1,611,057	0.08
内	オーストリア	1,154,156	0.05
内	ポルトガル	1,046,996	0.05
内	パナマ	758,300	0.04
内	リベリア	651,647	0.03
内	マン島	556,154	0.03
内	パプアニューギニア	271,777	0.01
新株予約権証券		33,940	0.00
	内 スイス	33,940	0.00
投資信託受益証券		3,510,637	0.16
	内 オーストラリア	2,898,972	0.14
	内 シンガポール	611,665	0.03
投資証券		41,889,489	1.95
	内 アメリカ	38,662,297	1.80
	内 イギリス	1,174,592	0.05
	内 フランス	1,161,647	0.05
	内 香港	656,487	0.03
	内 カナダ	234,466	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		148,078,245	6.90
純資産総額		2,145,388,774	100.00

その他資産の投資状況

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	143,192,977	6.67
内 アメリカ	94,700,712	4.41
内 ドイツ	37,740,433	1.76
内 イギリス	10,751,832	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。

新光日本債券インデックスマザーファンド

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	7,349,807,000	78.42
内 日本	7,349,807,000	78.42
地方債証券	822,615,120	8.78
内 日本	822,615,120	8.78

特殊債券		624,758,000	6.67
	内 日本	624,758,000	6.67
社債券		509,258,000	5.43
	内 日本	509,258,000	5.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		66,231,955	0.71
純資産総額		9,372,670,075	100.00

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

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

海外国債マザーファンド

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
国債証券	16,348,155,969	99.04	
	内 アメリカ	5,100,899,872	30.90
	内 フランス	3,461,872,849	20.97
	内 イタリア	3,119,281,377	18.90
	内 ドイツ	1,891,201,338	11.46
	内 カナダ	1,513,820,602	9.17
	内 イギリス	1,261,079,931	7.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	158,973,032	0.96	
純資産総額	16,507,129,001	100.00	

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

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

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
国債証券	287,965,580	96.16	
	内 アメリカ	130,632,889	43.62
	内 イタリア	31,123,389	10.39
	内 フランス	28,153,892	9.40
	内 ドイツ	20,328,137	6.79
	内 イギリス	18,302,106	6.11
	内 スペイン	15,217,744	5.08
	内 ベルギー	6,962,942	2.33
	内 オーストラリア	6,445,517	2.15
	内 オランダ	6,399,714	2.14
	内 オーストリア	6,264,497	2.09
	内 カナダ	5,908,594	1.97
	内 アイルランド	3,003,753	1.00
	内 メキシコ	2,227,919	0.74
	内 ポーランド	1,915,649	0.64
	内 フィンランド	1,412,849	0.47
	内 デンマーク	1,308,055	0.44
	内 シンガポール	914,942	0.31
	内 ノルウェー	792,901	0.26
	内 スウェーデン	650,091	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,485,778	3.84	
純資産総額	299,451,358	100.00	

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

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

グローバル高金利通貨マザーファンド

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
特殊債券	3,390,950,316	96.41
内 国際機関	3,390,950,316	96.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	126,212,531	3.59
純資産総額	3,517,162,847	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6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	126,753,294,790	99.18
内 日本	126,753,294,790	99.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,046,351,250	0.82
純資産総額	127,799,646,040	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6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	744,120,540	99.08
内 アメリカ	744,120,540	99.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,912,829	0.92
純資産総額	751,033,369	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6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニュー トピックス イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	15,848,888	2.4631 39,038,923	2.7164 43,051,919	- -	19.97
2	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	9,249,187	2.8696 26,541,469	3.5694 33,014,048	- -	15.32
3	海外国債マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	12,264,876	2.5351 31,092,752	2.5968 31,849,429	- -	14.78
4	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	24,655,556	1.2876 31,747,974	1.2847 31,674,992	- -	14.70

5	新光外国債券インデックス マザーファンド(為替ヘッ ジあり) 日本	親投資 信託受 益証券	14,795,723	1.4920 22,075,452	1.4429 21,348,748	- -	9.90
6	新光米国REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,008,159	1.7034 8,530,901	2.2651 11,343,980	- -	5.26
7	ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	1,500	6,633.69 9,950,541	7,459.72 11,189,590	- -	5.19
8	新光J-REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,749,778	1.8328 8,705,397	2.3497 11,160,553	- -	5.18
9	グローバル高金利通貨マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	9,244,501	1.0895 10,072,769	1.1583 10,707,905	- -	4.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	5.19
親投資信託受益証券	90.08
合計	95.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	9,100	7,863.00 71,553,300	9,710.00 88,361,000	- -	3.54
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,600	10,738.10 60,133,360	10,815.00 60,564,000	- -	2.42
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	6,900	8,565.22 59,100,068	7,775.00 53,647,500	- -	2.15
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	900	57,700.00 51,930,000	56,070.00 50,463,000	- -	2.02
5	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	60,600	501.83 30,411,345	600.10 36,366,060	- -	1.46
6	リクルートホールディン グ ス 日本	株式 サービ ス業	6,200	4,587.12 28,440,200	5,470.00 33,914,000	- -	1.36

7	任天堂	日本	株式 その他製品	500	65,810.00 32,905,000	64,620.00 32,310,000	- -	1.29
8	信越化学工業	日本	株式 化学	1,700	19,061.94 32,405,300	18,580.00 31,586,000	- -	1.26
9	日本電信電話	日本	株式 情報・通信業	10,400	2,767.14 28,778,291	2,894.50 30,102,800	- -	1.20
10	日本電産	日本	株式 電気機器	2,200	14,050.00 30,910,000	12,875.00 28,325,000	- -	1.13
11	武田薬品工業	日本	株式 医薬品	7,400	3,690.36 27,308,684	3,719.00 27,520,600	- -	1.10
12	日立製作所	日本	株式 電気機器	4,300	4,341.19 18,667,143	6,361.00 27,352,300	- -	1.09
13	HOYA	日本	株式 精密機器	1,800	13,920.00 25,056,000	14,730.00 26,514,000	- -	1.06
14	本田技研工業	日本	株式 輸送用機器	7,000	2,917.34 20,421,396	3,550.00 24,850,000	- -	0.99
15	ダイキン工業	日本	株式 機械	1,200	23,795.00 28,554,000	20,690.00 24,828,000	- -	0.99
16	KDDI	日本	株式 情報・通信業	7,000	3,234.00 22,638,000	3,465.00 24,255,000	- -	0.97
17	東京エレクトロン	日本	株式 電気機器	500	42,250.00 21,125,000	48,080.00 24,040,000	- -	0.96
18	三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式 銀行業	6,200	3,544.67 21,976,956	3,830.00 23,746,000	- -	0.95
19	村田製作所	日本	株式 電気機器	2,700	10,255.00 27,688,500	8,482.00 22,901,400	- -	0.92
20	ファナック	日本	株式 電気機器	800	27,675.00 22,140,000	26,795.00 21,436,000	- -	0.86
21	伊藤忠商事	日本	株式 卸売業	6,200	3,136.06 19,443,576	3,200.00 19,840,000	- -	0.79
22	S M C	日本	株式 機械	300	69,180.00 20,754,000	65,650.00 19,695,000	- -	0.79
23	セブン&アイ・ホールディングス	日本	株式 小売業	3,600	3,955.35 14,239,265	5,297.00 19,069,200	- -	0.76
24	みずほフィナンシャルグループ	日本	株式 銀行業	12,000	1,437.85 17,254,215	1,587.50 19,050,000	- -	0.76
25	三井物産	日本	株式 卸売業	6,900	2,000.00 13,800,000	2,500.50 17,253,450	- -	0.69
26	富士通	日本	株式 電気機器	800	16,020.00 12,816,000	20,800.00 16,640,000	- -	0.67
27	第一三共	日本	株式 医薬品	6,900	3,636.60 25,092,550	2,394.50 16,522,050	- -	0.66
28	三菱商事	日本	株式 卸売業	5,400	2,691.00 14,531,400	3,028.00 16,351,200	- -	0.65

29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,000	5,643.00 16,929,000	5,108.00 15,324,000	- -	0.61
30	デンソー 日本	株式 輸送用機器	2,000	5,932.00 11,864,000	7,579.00 15,158,000	- -	0.61

(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6月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.90
合計	96.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.55
情報・通信業		8.32
輸送用機器		7.60
化学		7.33
サービス業		5.49
機械		5.24
医薬品		5.14
銀行業		4.76
卸売業		4.48
小売業		4.46
食料品		3.35
陸運業		3.34
精密機器		2.68
その他製品		2.37
建設業		2.23
不動産業		1.93
保険業		1.77
電気・ガス業		1.21
その他金融業		1.04
鉄鋼		0.77
ガラス・土石製品		0.76
証券、商品先物取引業		0.73
非鉄金属		0.71
ゴム製品		0.70
金属製品		0.63
繊維製品		0.49
空運業		0.45
石油・石炭製品		0.40
海運業		0.33
パルプ・紙		0.24
鉱業		0.17
倉庫・運輸関連業		0.16
水産・農林業		0.09

合計	96.90
----	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	5,606	12,862.66 72,108,103	15,075.37 84,512,532	- -	3.94
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	2,395	24,149.56 57,838,211	30,011.41 71,877,331	- -	3.35
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	143	347,634.76 49,711,771	381,295.31 54,525,230	- -	2.54
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	803	30,826.38 24,753,588	38,911.99 31,246,332	- -	1.46
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	99	194,952.53 19,300,301	278,702.50 27,591,548	- -	1.29
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	100	194,777.82 19,477,782	270,417.86 27,041,786	- -	1.26
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	256	46,582.92 11,925,230	75,278.43 19,271,280	- -	0.90
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	207	60,291.53 12,480,347	88,582.31 18,336,540	- -	0.85
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	1,014	12,926.80 13,107,777	17,044.80 17,283,428	- -	0.81
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	881	16,153.52 14,231,256	18,138.43 15,979,963	- -	0.74

11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	566	23,518.15 13,311,275	26,091.34 14,767,704	- -	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	318	38,703.00 12,307,554	44,021.89 13,998,963	- -	0.65
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	457	24,493.46 11,193,515	30,543.29 13,958,288	- -	0.65
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	963	12,660.47 12,192,035	13,961.81 13,445,227	- -	0.63
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	359	29,853.28 10,717,328	35,190.97 12,633,561	- -	0.59
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	827	15,258.93 12,619,138	14,861.95 12,290,834	- -	0.57
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	296	38,101.44 11,278,027	40,693.43 12,045,258	- -	0.56
18	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	370	20,426.33 7,557,744	32,373.40 11,978,158	- -	0.56
19	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	607	15,767.60 9,570,934	19,233.17 11,674,539	- -	0.54
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	2,575	3,069.70 7,904,479	4,521.61 11,643,161	- -	0.54
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	140	46,671.42 6,533,999	77,619.03 10,866,665	- -	0.51
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	159	52,098.66 8,283,687	65,325.13 10,386,696	- -	0.48
23	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	1,403	4,083.71 5,729,458	6,924.51 9,715,100	- -	0.45
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	232	37,311.53 8,656,277	41,873.43 9,714,638	- -	0.45
25	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	1,520	5,217.16 7,930,089	6,252.19 9,503,333	- -	0.44
26	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	147	52,027.88 7,648,099	58,994.42 8,672,181	- -	0.40

27	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	1,378	6,617.10 9,118,373	6,174.78 8,508,856	- -	0.40
28	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,351	5,042.44 6,812,347	6,275.41 8,478,085	- -	0.40
29	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	306	28,671.17 8,773,381	27,181.66 8,317,590	- -	0.39
30	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・ア パレル・ 贅沢品	93	61,691.27 5,737,289	88,684.91 8,247,697	- -	0.38

(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6月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	90.98
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.95
合計	93.10

(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6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.06
銀行		5.69
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.49
半導体・半導体製造装置		4.37
情報技術サービス		4.36
医薬品		4.29
コンピュータ・周辺機器		4.23
インターネット販売・通信販売		3.08
資本市場		3.04
石油・ガス・消耗燃料		2.93
ヘルスケア機器・用品		2.81
保険		2.79
化学		1.97
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.82
ホテル・レストラン・レジャー		1.70
バイオテクノロジー		1.69
電力		1.62
機械		1.60
自動車		1.59
専門小売り		1.58

飲料	1.53
食品	1.51
繊維・アパレル・贅沢品	1.49
金属・鉱業	1.45
航空宇宙・防衛	1.39
娯楽	1.38
各種電気通信サービス	1.32
食品・生活必需品小売り	1.25
コングロマリット	1.08
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.07
メディア	1.04
家庭用品	1.02
陸運・鉄道	1.00
各種金融サービス	0.88
電気設備	0.84
総合公益事業	0.76
専門サービス	0.74
航空貨物・物流サービス	0.67
通信機器	0.64
タバコ	0.63
パーソナル用品	0.62
建設関連製品	0.58
電子装置・機器・部品	0.51
複合小売り	0.50
消費者金融	0.46
不動産管理・開発	0.43
商業サービス・用品	0.39
家庭用耐久財	0.35
商社・流通業	0.31
無線通信サービス	0.27
容器・包装	0.27
自動車部品	0.27
建設資材	0.26
建設・土木	0.20
ヘルスケア・テクノロジー	0.15
エネルギー設備・サービス	0.15
ガス	0.13
運送インフラ	0.13
紙製品・林産品	0.10
水道	0.10
販売	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08
レジャー用品	0.08
海運業	0.08
旅客航空輸送業	0.05
合計	90.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	97回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債 券	100,000,000	118.36 118,367,000	117.19 117,194,000	2.1 2029/12/28	1.25
2	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	116.59 116,593,000	2.22 2029/3/19	1.24
3	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	110,000,000	101.27 111,406,700	101.18 111,299,100	0.1 2028/3/20	1.19
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	107.14 107,143,000	2.11 2024/12/20	1.14
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	106.06 106,068,000	0.781 2030/12/6	1.13
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	101.91 101,912,000	0.484 2025/6/30	1.09
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	101.75 101,759,000	0.882 2023/6/16	1.09
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	101.73 101,732,000	0.645 2024/3/15	1.09
9	4回 第一三共社債 日本	社債券	100,000,000	101.75 101,757,000	101.59 101,594,000	0.846 2023/9/15	1.08
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	101.21 101,213,000	0.715 2023/3/20	1.08
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	101.14 101,148,000	0.67 2023/3/27	1.08
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	101.02 101,021,000	0.7 2022/12/22	1.08
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	100.95 100,956,000	0.205 2027/4/23	1.08
14	327回 政保日本高速道 路保有・債務返済機構 日本	特殊債 券	100,000,000	100.93 100,938,000	100.94 100,948,000	0.17 2027/10/29	1.08
15	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	100.84 100,849,000	0.195 2025/12/19	1.08
16	11回 プリヂストン社債 日本	社債券	100,000,000	99.94 99,949,000	100.54 100,543,000	0.295 2027/4/21	1.07
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	1.07

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	99.97 99,978,000	0.08 2022/9/20	1.07
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	102.11 91,902,600	0.4 2025/6/20	0.98
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	102.03 91,834,200	0.5 2024/9/20	0.98
21	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	90,000,000	101.12 91,014,300	101.02 90,921,600	0.1 2026/6/20	0.97
22	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	102.27 81,820,000	101.98 81,584,000	0.4 2025/3/20	0.87
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	101.97 81,581,600	0.6 2024/3/20	0.87
24	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.33 81,067,600	101.19 80,952,000	0.1 2028/6/20	0.86
25	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.33 81,070,000	101.17 80,936,000	0.1 2027/12/20	0.86
26	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.25 81,005,100	101.16 80,929,600	0.1 2028/12/20	0.86
27	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.27 81,022,300	101.15 80,925,600	0.1 2027/9/20	0.86
28	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.22 80,982,400	101.07 80,857,600	0.1 2026/12/20	0.86
29	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.17 80,942,400	101.02 80,818,400	0.1 2026/9/20	0.86
30	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.07 80,861,600	100.97 80,776,800	0.1 2026/3/20	0.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	78.42
地方債証券	8.78
特殊債券	6.67
社債券	5.43
合計	99.29

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証 券	1,105,800,000	112.17 1,240,439,785	109.48 1,210,678,217	2.625 2029/2/15	7.33
2	ITALY BTPS 1.5 06/01/25 イタリア	国債証 券	828,954,000	106.64 884,042,467	106.00 878,757,556	1.5 2025/6/1	5.32
3	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	774,060,000	101.19 783,282,199	101.32 784,280,007	1.625 2031/5/15	4.75
4	FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス	国債証 券	723,690,000	110.30 798,267,570	106.68 772,087,492	0.75 2028/11/25	4.68
5	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	552,900,000	118.61 655,834,426	112.98 624,669,007	3.125 2028/11/15	3.78
6	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証 券	552,900,000	116.31 643,091,812	111.09 614,237,343	2.875 2028/8/15	3.72
7	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	552,900,000	115.96 641,191,218	110.98 613,611,007	2.875 2028/5/15	3.72
8	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証 券	394,740,000	151.92 599,725,916	144.31 569,680,083	5.5 2029/4/25	3.45
9	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29 ドイツ	国債証 券	539,478,000	105.81 570,847,481	104.87 565,778,631	0.25 2029/2/15	3.43
10	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証 券	552,900,000	107.05 591,905,364	102.11 564,605,926	1.625 2029/8/15	3.42
11	CANADA 2.25 06/01/29 カナダ	国債証 券	490,325,000	113.44 556,262,123	107.49 527,053,284	2.25 2029/6/1	3.19
12	ITALY BTPS 0.6 08/01/31 イタリア	国債証 券	460,530,000	96.99 446,681,862	97.39 448,536,094	0.6 2031/8/1	2.72
13	FRANCE OAT 0.0 11/25/29 フランス	国債証 券	434,214,000	103.85 450,972,055	100.25 435,327,758	- 2029/11/25	2.64
14	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証 券	394,740,000	109.83 433,550,047	106.59 420,776,260	0.75 2028/5/25	2.55
15	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証 券	394,740,000	108.38 427,847,238	104.63 413,020,409	0.5 2029/5/25	2.50
16	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 ドイツ	国債証 券	394,740,000	103.09 406,939,044	102.11 403,069,014	- 2031/2/15	2.44
17	ITALY BTPS 0.95 08/01/30 イタリア	国債証 券	394,740,000	102.90 406,187,460	101.69 401,411,106	0.95 2030/8/1	2.43
18	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 ドイツ	国債証 券	250,002,000	166.02 415,060,820	157.52 393,823,150	6.25 2030/1/4	2.39
19	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	331,740,000	114.75 380,671,650	110.05 365,095,418	2.75 2028/2/15	2.21
20	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 ドイツ	国債証 券	250,002,000	143.59 358,997,871	137.31 343,302,746	4.75 2028/7/4	2.08
21	CANADA 1.25 06/01/30 カナダ	国債証 券	329,855,000	104.80 345,688,040	99.06 326,778,442	1.25 2030/6/1	1.98
22	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証 券	263,160,000	126.15 331,994,761	123.64 325,393,076	3.5 2030/3/1	1.97

23	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	263,160,000	128.35 337,776,386	122.37 322,032,049	2.5 2030/5/25	1.95
24	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	263,160,000	120.87 318,095,176	118.77 312,560,921	3 2029/8/1	1.89
25	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証券	263,160,000	118.26 311,223,805	116.47 306,524,346	2.8 2028/12/1	1.86
26	UK TREASURY 6.0 12/07/28 イギリス	国債証券	183,792,000	146.80 269,806,656	139.33 256,094,817	6 2028/12/7	1.55
27	UK TREASURY 4.25 12/07/27 イギリス	国債証券	183,792,000	127.10 233,605,298	123.85 227,633,559	4.25 2027/12/7	1.38
28	US T N/B 0.125 01/31/23 アメリカ	国債証券	221,160,000	99.98 221,116,805	99.90 220,944,021	0.125 2023/1/31	1.34
29	CANADA 0.5 09/01/25 カナダ	国債証券	205,045,000	98.58 202,151,191	98.38 201,743,775	0.5 2025/9/1	1.22
30	FRANCE OAT 0.5 05/25/40 フランス	国債証券	197,370,000	99.36 196,120,647	97.29 192,036,667	0.5 2040/5/25	1.16

（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6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.04
合計	99.04

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	4,423,200	107.56 4,757,704	105.78 4,678,916	2.75 2023/11/15	1.56
2	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	4,423,200	107.60 4,759,777	105.73 4,676,842	2.25 2024/11/15	1.56
3	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	4,423,200	106.88 4,727,640	105.01 4,644,877	2 2025/2/15	1.55
4	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証券	4,423,200	106.26 4,700,341	104.73 4,632,437	2.5 2023/8/15	1.55
5	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	4,423,200	106.24 4,699,303	104.70 4,631,228	2.125 2024/3/31	1.55
6	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	4,423,200	104.05 4,602,546	102.91 4,552,094	2 2023/2/15	1.52
7	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	4,423,200	103.84 4,593,216	102.82 4,548,293	1.75 2023/5/15	1.52
8	US T N/B 0.375 09/30/27 アメリカ	国債証券	4,423,200	95.34 4,217,167	95.46 4,222,600	0.375 2027/9/30	1.41
9	US T N/B 3.0 10/31/25 アメリカ	国債証券	3,317,400	112.54 3,733,629	109.53 3,633,847	3 2025/10/31	1.21

10	US T N/B 2.875 11/30/23 アメリカ	国債証券	3,317,400	108.02 3,583,569	106.12 3,520,720	2.875 2023/11/30	1.18
11	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	3,317,400	107.42 3,563,613	105.25 3,491,692	2 2025/8/15	1.17
12	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	3,317,400	105.93 3,514,370	103.64 3,438,433	1.625 2026/2/15	1.15
13	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	3,317,400	103.71 3,440,506	102.58 3,403,055	2 2022/11/30	1.14
14	US T N/B 5.375 02/15/31 アメリカ	国債証券	2,211,600	143.60 3,175,891	135.73 3,001,900	5.375 2031/2/15	1.00
15	ITALY BTPS 4.5 03/01/24 イタリア	国債証券	2,631,600	115.38 3,036,478	112.58 2,962,815	4.5 2024/3/1	0.99
16	ITALY BTPS 3.75 09/01/24 イタリア	国債証券	2,631,600	114.53 3,014,234	112.36 2,957,081	3.75 2024/9/1	0.99
17	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	2,631,600	114.77 3,020,516	111.43 2,932,591	4.25 2023/10/25	0.98
18	FRANCE OAT 1.0 11/25/25 フランス	国債証券	2,631,600	108.21 2,847,804	106.46 2,801,848	1 2025/11/25	0.94
19	AUSTRIA 1.75 10/20/23 オーストリア	国債証券	2,631,600	107.33 2,824,593	105.53 2,777,332	1.75 2023/10/20	0.93
20	DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23 ドイツ	国債証券	2,631,600	105.74 2,782,695	104.14 2,740,553	1.5 2023/5/15	0.92
21	UK TREASURY 4.25 12/07/49 イギリス	国債証券	1,531,600	187.75 2,875,579	172.40 2,640,610	4.25 2049/12/7	0.88
22	FRANCE OAT 0.0 11/25/29 フランス	国債証券	2,631,600	100.26 2,638,573	100.25 2,638,350	- 2029/11/25	0.88
23	US T N/B 3.0 02/15/49 アメリカ	国債証券	2,211,600	129.50 2,864,022	119.06 2,633,186	3 2049/2/15	0.88
24	US T N/B 3.0 08/15/48 アメリカ	国債証券	2,211,600	129.19 2,857,283	118.71 2,625,410	3 2048/8/15	0.88
25	FRANCE OAT 4.0 04/25/55 フランス	国債証券	1,315,800	212.62 2,797,785	187.50 2,467,256	4 2055/4/25	0.82
26	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	2,211,600	115.53 2,555,261	110.98 2,454,443	2.875 2028/5/15	0.82
27	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	2,211,600	114.35 2,528,998	110.05 2,433,968	2.75 2028/2/15	0.81
28	US T N/B 2.875 11/30/25 アメリカ	国債証券	2,211,600	112.09 2,479,065	109.09 2,412,717	2.875 2025/11/30	0.81
29	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	2,211,600	110.62 2,446,582	106.85 2,363,301	2.25 2027/11/15	0.79
30	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	2,211,600	110.44 2,442,608	106.84 2,363,042	2.25 2027/8/15	0.79

(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6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.16
合計	96.16

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

グローバル高金利通貨マザーファンド

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	IFC 8.25 01/30/23 国際機関	特殊債 券	345,705,800	106.19 367,122,274	104.04 359,673,351	8.25 2023/1/30	10.23
2	ASIAN DEV BANK 5.9 12/20/22 国際機関	特殊債 券	253,005,000	101.38 256,509,119	101.70 257,306,085	5.9 2022/12/20	7.32
3	EIB 8.5 09/17/24 国際機関	特殊債 券	223,300,000	107.33 239,672,356	106.66 238,180,712	8.5 2024/9/17	6.77
4	EBRD 0.25 11/20/23 国際機関	特殊債 券	232,760,800	99.32 231,185,009	98.56 229,419,104	0.25 2023/11/20	6.52
5	EIB 8.375 07/29/22 国際機関	特殊債 券	207,900,000	104.51 217,291,582	103.33 214,830,970	8.375 2022/7/29	6.11
6	EIB 09/05/22 国際機関	特殊債 券	246,983,100	80.43 198,673,205	83.87 207,157,075	- 2022/9/5	5.89
7	IFC 6.375 04/11/22 国際機関	特殊債 券	206,720,000	102.15 211,164,480	100.12 206,975,299	6.375 2022/4/11	5.88
8	IADB 7.875 03/14/23 国際機関	特殊債 券	177,100,000	104.88 185,751,335	105.23 186,362,330	7.875 2023/3/14	5.30
9	EIB 3.0 05/24/24 国際機関	特殊債 券	174,570,600	107.54 187,750,680	106.48 185,891,503	3 2024/5/24	5.29
10	EBRD 6.45 12/13/22 国際機関	特殊債 券	169,400,000	102.24 173,194,560	102.55 173,728,170	6.45 2022/12/13	4.94
11	EIB 7.75 01/30/25 国際機関	特殊債 券	128,321,600	108.44 139,164,775	103.84 133,255,565	7.75 2025/1/30	3.79
12	IFC 5.5 03/20/23 国際機関	特殊債 券	121,600,000	101.67 123,630,720	98.55 119,836,800	5.5 2023/3/20	3.41
13	IFC 7.25 02/02/24 国際機関	特殊債 券	108,794,400	105.65 114,952,163	102.11 111,100,841	7.25 2024/2/2	3.16
14	ASIAN DEV BANK 7.0 03/14/22 国際機関	特殊債 券	106,400,000	102.90 109,485,600	100.88 107,341,640	7 2022/3/14	3.05
15	EIB 5.5 01/23/23 国際機関	特殊債 券	100,983,520	101.80 102,811,321	99.38 100,367,520	5.5 2023/1/23	2.85
16	EIB 7.625 01/12/22 国際機関	特殊債 券	89,267,200	102.98 91,936,289	101.50 90,606,208	7.625 2022/1/12	2.58
17	EBRD 7.5 05/15/22 国際機関	特殊債 券	78,540,000	102.00 80,113,941	101.94 80,065,246	7.5 2022/5/15	2.28
18	IFC 7.0 02/14/24 国際機関	特殊債 券	69,141,160	102.22 70,677,476	98.96 68,426,240	7 2024/2/14	1.95
19	EBRD 24.0 09/10/21 国際機関	特殊債 券	63,329,000	102.51 64,921,293	100.34 63,546,851	24 2021/9/10	1.81
20	EBRD 24.0 10/05/22 国際機関	特殊債 券	56,996,100	108.21 61,681,179	102.41 58,375,405	24 2022/10/5	1.66

21	EBRD 6.0 02/07/23 国際機関	特殊債券	54,000,000	102.19 55,183,680	101.96 55,062,720	6 2023/2/7	1.57
22	IFC 6.3 11/25/24 国際機関	特殊債券	51,000,000	103.53 52,801,575	104.06 53,070,600	6.3 2024/11/25	1.51
23	IADB 26.5 10/25/21 国際機関	特殊債券	44,330,300	105.49 46,768,466	102.04 45,235,081	26.5 2021/10/25	1.29
24	IADB 5.5 08/23/21 国際機関	特殊債券	45,000,000	100.13 45,060,750	100.30 45,135,000	5.5 2021/8/23	1.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年6月30日現在

種類	投資比率(%)
特殊債券	96.41
合計	96.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	12,289	624,013.83 7,668,505,993	693,000.00 8,516,277,000	- -	6.66
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	10,920	625,686.03 6,832,491,530	683,000.00 7,458,360,000	- -	5.84
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	54,390	102,841.03 5,593,523,921	120,400.00 6,548,556,000	- -	5.12
4	GLP投資法人 日本	投資証券	34,121	167,000.65 5,698,229,386	191,600.00 6,537,583,600	- -	5.12
5	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	35,311	156,612.18 5,530,132,932	178,100.00 6,288,889,100	- -	4.92
6	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	17,263	332,996.48 5,748,518,336	353,500.00 6,102,470,500	- -	4.78
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	15,580	279,073.19 4,347,960,453	327,500.00 5,102,450,000	- -	3.99
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	21,757	174,623.45 3,799,282,567	213,800.00 4,651,646,600	- -	3.64
9	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	10,372	303,500.49 3,147,907,155	370,000.00 3,837,640,000	- -	3.00
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	23,353	138,230.11 3,228,087,912	160,700.00 3,752,827,100	- -	2.94

11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	15,435	185,371.88 2,861,215,055	211,900.00 3,270,676,500	- -	2.56
12	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	6,799	364,783.11 2,480,160,403	435,000.00 2,957,565,000	- -	2.31
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	32,117	75,251.56 2,416,854,533	92,000.00 2,954,764,000	- -	2.31
14	アクティブア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	5,472	417,972.33 2,287,144,628	526,000.00 2,878,272,000	- -	2.25
15	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	3,378	664,008.87 2,243,021,966	783,000.00 2,644,974,000	- -	2.07
16	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	13,209	164,912.37 2,178,327,548	187,600.00 2,478,008,400	- -	1.94
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	3,763	565,461.08 2,127,830,070	641,000.00 2,412,083,000	- -	1.89
18	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	7,135	310,157.41 2,212,973,142	334,000.00 2,383,090,000	- -	1.86
19	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	35,178	55,796.37 1,962,804,963	66,600.00 2,342,854,800	- -	1.83
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	3,811	517,700.49 1,972,956,590	592,000.00 2,256,112,000	- -	1.77
21	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	12,827	142,578.59 1,828,855,691	166,600.00 2,136,978,200	- -	1.67
22	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	45,658	35,020.44 1,598,963,340	42,800.00 1,954,162,400	- -	1.53
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	3,624	433,697.06 1,571,718,165	519,000.00 1,880,856,000	- -	1.47
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	11,076	138,175.38 1,530,430,520	164,500.00 1,822,002,000	- -	1.43
25	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	7,442	179,218.49 1,333,744,010	240,100.00 1,786,824,200	- -	1.40
26	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	2,309	661,295.03 1,526,930,226	773,000.00 1,784,857,000	- -	1.40
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	14,259	98,742.96 1,407,975,898	120,800.00 1,722,487,200	- -	1.35
28	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	4,909	295,007.69 1,448,192,754	350,000.00 1,718,150,000	- -	1.34
29	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	9,052	159,370.15 1,442,618,644	187,100.00 1,693,629,200	- -	1.33

30	日本リート投資法人 日本	投資証 券	3,547	369,843.15 1,311,833,670	456,500.00 1,619,205,500	- -	1.27
----	-----------------	----------	-------	-----------------------------	-----------------------------	--------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.18
合計	99.18

(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6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証 券	2,165	26,514.14 57,403,117	30,165.11 65,307,480	- -	8.70
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証 券	3,534	11,398.68 40,282,954	13,429.94 47,461,411	- -	6.32
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証 券	1,996	18,150.49 36,228,397	21,822.96 43,558,634	- -	5.80
4	EQUINIX INC アメリカ	投資証 券	428	89,424.54 38,273,705	88,721.64 37,972,866	- -	5.06
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証 券	723	25,590.28 18,501,777	33,558.81 24,263,025	- -	3.23
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証 券	1,564	7,285.74 11,394,906	14,484.87 22,654,343	- -	3.02
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	1,344	17,072.39 22,945,304	16,853.49 22,651,101	- -	3.02
8	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証 券	519	34,002.95 17,647,532	35,607.86 18,480,482	- -	2.46
9	WELLTOWER INC アメリカ	投資証 券	2,002	5,837.83 11,687,338	9,223.47 18,465,402	- -	2.46
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	668	16,125.90 10,772,103	23,256.07 15,535,061	- -	2.07
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	1,768	5,629.66 9,953,246	8,576.58 15,163,401	- -	2.02
12	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証 券	701	17,803.63 12,480,351	20,238.35 14,187,084	- -	1.89
13	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証 券	3,590	3,247.16 11,657,334	3,775.20 13,552,972	- -	1.80
14	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証 券	1,791	6,504.69 11,649,909	7,513.91 13,457,414	- -	1.79
15	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	1,796	4,579.47 8,224,741	6,399.26 11,493,079	- -	1.53

16	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	625	12,632.21 7,895,137	18,204.78 11,377,990	- -	1.51
17	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	2,716	3,064.30 8,322,640	4,148.96 11,268,579	- -	1.50
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	310	22,091.57 6,848,387	33,409.53 10,356,955	- -	1.38
19	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	546	13,025.00 7,111,655	18,782.01 10,254,979	- -	1.37
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	526	16,104.18 8,470,799	19,075.04 10,033,476	- -	1.34
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	2,584	2,938.42 7,592,894	3,724.33 9,623,680	- -	1.28
22	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証 券	1,795	4,257.49 7,642,209	5,290.14 9,495,814	- -	1.26
23	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	748	8,418.14 6,296,771	12,587.32 9,415,316	- -	1.25
24	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	2,580	2,563.85 6,614,750	3,432.40 8,855,600	- -	1.18
25	UDR INC アメリカ	投資証 券	1,413	3,561.83 5,032,866	5,470.39 7,729,664	- -	1.03
26	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	845	7,257.19 6,132,331	8,329.99 7,038,842	- -	0.94
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	833	6,965.01 5,801,858	8,321.14 6,931,513	- -	0.92
28	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証 券	453	10,071.38 4,562,338	14,812.18 6,709,922	- -	0.89
29	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証 券	1,373	3,025.78 4,154,396	4,679.74 6,425,290	- -	0.86
30	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証 券	3,351	1,184.07 3,967,837	1,871.01 6,269,766	- -	0.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.08
合計	99.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

グローバル高金利通貨マザーファンド

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2021年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0309月	買建	3	58,845,990	58,290,000	2.33

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

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

新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Sep21	買建	4	93,697,751	94,700,712	4.41
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep21	買建	7	37,787,144	37,740,433	1.76
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep21	買建	1	10,851,386	10,751,832	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。

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

グローバル高金利通貨マザーファンド

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2021年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2014年12月15日）	156	156	1.0986	1.0986
第2計算期間末 （2015年12月15日）	192	192	1.1107	1.1107
第3計算期間末 （2016年12月15日）	185	185	1.1246	1.1246
第4計算期間末 （2017年12月15日）	156	156	1.1917	1.1917
第5計算期間末 （2018年12月17日）	211	211	1.1409	1.1409
第6計算期間末 （2019年12月16日）	209	209	1.2304	1.2304
第7計算期間末 （2020年12月15日）	202	202	1.2539	1.2539
2020年6月末日	197	-	1.1750	-
7月末日	197	-	1.1769	-
8月末日	201	-	1.2128	-
9月末日	199	-	1.2023	-
10月末日	194	-	1.1818	-
11月末日	200	-	1.2440	-
12月末日	204	-	1.2634	-
2021年1月末日	204	-	1.2736	-
2月末日	206	-	1.2892	-
3月末日	211	-	1.3298	-
4月末日	211	-	1.3384	-
5月末日	213	-	1.3505	-
6月末日	215	-	1.3631	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
2020年12月16日～2021年6月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.9
第2計算期間	1.1
第3計算期間	1.3
第4計算期間	6.0
第5計算期間	4.3
第6計算期間	7.8
第7計算期間	1.9
2020年12月16日～2021年6月15日	9.3

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	145,283,614	3,105,708
第2計算期間	46,534,790	15,084,083
第3計算期間	7,924,566	16,949,228
第4計算期間	1,346,866	34,711,182
第5計算期間	86,746,251	32,517,890
第6計算期間	1,025,105	16,014,002
第7計算期間	595,709	9,581,529
2020年12月16日～ 2021年6月15日	0	3,374,324

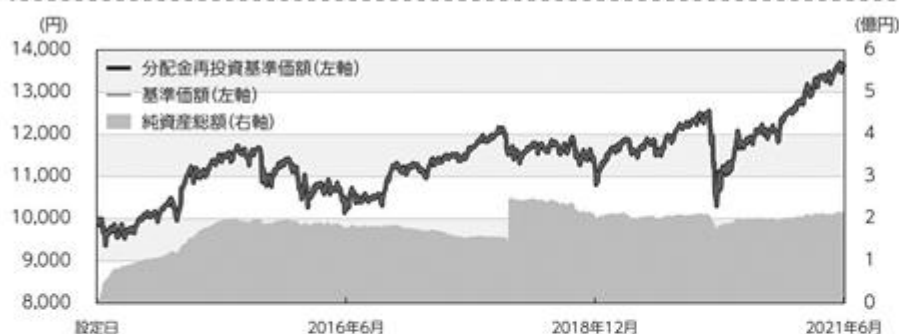
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

データの基準日:2021年6月30日

基準価額・純資産の推移 (2014年1月6日～2021年6月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2014年1月6日)

分配の推移(税引前)

2016年12月	0円
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	19.97
2	新光外国株式インデックスマザーファンド	15.32
3	海外国債マザーファンド	14.78
4	新光日本債券インデックスマザーファンド	14.70
5	新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	9.90
6	新光米国REITマザーファンド	5.26
7	ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF	5.19
8	新光J-REITマザーファンド	5.18
9	グローバル高金利通貨マザーファンド	4.97

■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	3.54
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.42
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.15
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.02
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.46

■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	3.94
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.35
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.54
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	1.46
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	1.29

○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。

■新光日本債券インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	特殊債券	日本	2.1	2029/12/28	1.25
2	18回 東京都公債 20年	地方債証券	日本	2.22	2029/3/19	1.24
3	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.19
4	36回 東日本旅客鉄道社債	社債券	日本	2.11	2024/12/20	1.14
5	12回 兵庫県公債 15年	地方債証券	日本	0.781	2030/12/6	1.13

■海外国債マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	アメリカ	2.625	2029/2/15	7.33
2	ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	イタリア	1.5	2025/6/1	5.32
3	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	4.75
4	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	フランス	0.75	2028/11/25	4.68
5	US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	3.78

■新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	1.56
2	US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	アメリカ	2.25	2024/11/15	1.56
3	US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	アメリカ	2	2025/2/15	1.55
4	US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	アメリカ	2.5	2023/8/15	1.55
5	US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	アメリカ	2.125	2024/3/31	1.55

■グローバル高金利通貨マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	IFC 8.25 01/30/23	特殊債券	国際機関	8.25	2023/1/30	10.23
2	ASIAN DEV BANK 5.9 12/20/22	特殊債券	国際機関	5.9	2022/12/20	7.32
3	EIB 8.5 09/17/24	特殊債券	国際機関	8.5	2024/9/17	6.77
4	EBRD 0.25 11/20/23	特殊債券	国際機関	0.25	2023/11/20	6.52
5	EIB 8.375 07/29/22	特殊債券	国際機関	8.375	2022/7/29	6.11

○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J-REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.66
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.84
3	日本都市ファンド投資法人	日本	5.12
4	GLP投資法人	日本	5.12
5	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.92

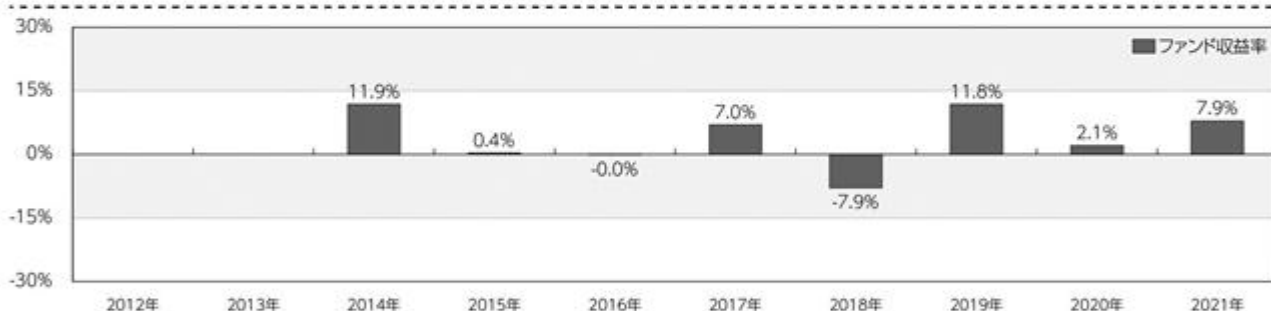
■新光米国REITマザーファンド

※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	8.70
2	PROLOGIS INC	アメリカ	6.32
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	アメリカ	5.80
4	EQUINIX INC	アメリカ	5.06
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.23

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2014年は設定日から年末までの収益率、および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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

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

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

2【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

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

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

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。

(注) 繰上償還(信託終了)が決定した場合には、信託期間は2021年11月15日までとなります。

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎年12月16日から翌年12月15日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

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

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

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

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

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

b. 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

c. 書面決議の手続き

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

d. 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

e. 運用報告書

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

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

f. 公告

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

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

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

g. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

h. 信託事務処理の再信託

(イ) 受託者は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

(ロ) 上記(イ)における株式会社日本カストディ銀行に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

i. 信託業務の委託等

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

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

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

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

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

j. 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

k．関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

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

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2019年12月17日から2020年12月15日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバル・ナビ】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 2019年12月16日現在	第7期 2020年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,662	-
コール・ローン	11,828,901	11,394,959
投資信託受益証券	10,825,598	10,212,470
親投資信託受益証券	188,687,785	182,329,139
未収配当金	-	110,847
流動資産合計	211,344,946	204,047,415
資産合計	211,344,946	204,047,415
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	56,033	54,568
未払委託者報酬	1,535,741	1,496,239
その他未払費用	4,173	3,819
流動負債合計	1,595,947	1,554,626
負債合計	1,595,947	1,554,626
純資産の部		
元本等		
元本	170,479,099	161,493,279
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	39,269,900	40,999,510
(分配準備積立金)	24,424,845	26,887,088
元本等合計	209,748,999	202,492,789
純資産合計	209,748,999	202,492,789
負債純資産合計	211,344,946	204,047,415

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期		第7期	
	自	2018年12月18日 至 2019年12月16日	自	2019年12月17日 至 2020年12月15日
営業収益				
受取配当金		255,690		404,904
有価証券売買等損益		19,468,820		7,209,684
為替差損益		346,363		483,034
営業収益合計		19,378,147		7,131,554
営業費用				
支払利息		6,773		4,459
受託者報酬		111,962		109,104
委託者報酬		3,068,154		2,991,495
その他費用		414,752		372,262
営業費用合計		3,601,641		3,477,320
営業利益又は営業損失()		15,776,506		3,654,234
経常利益又は経常損失()		15,776,506		3,654,234
当期純利益又は当期純損失()		15,776,506		3,654,234
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()		583,251		176,795
期首剰余金又は期首欠損金()		26,125,219		39,269,900
剰余金増加額又は欠損金減少額		176,862		104,291
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		176,862		104,291
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,225,436		2,205,710
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,225,436		2,205,710
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		39,269,900		40,999,510

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第7期	
	自 2019年12月17日	至 2020年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 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>	
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> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年12月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2019年12月16日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	2019年12月16日現在	2020年12月15日現在
1. 期首元本額	185,467,996円	170,479,099円
期中追加設定元本額	1,025,105円	595,709円
期中一部解約元本額	16,014,002円	9,581,529円
2. 受益権の総数	170,479,099口	161,493,279口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 2018年12月18日 至 2019年12月16日	自 2019年12月17日 至 2020年12月15日
1. その他費用	<p>その他費用の内訳は、監査費用（8,354円）、保管費用（395,598円）、その他（10,800円）となっております。</p>	<p>その他費用の内訳は、監査費用（7,684円）、保管費用（358,638円）、その他（5,940円）となっております。</p>

2. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,000,981円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(3,709,474円)、信託約款に規定される収益調整金(15,631,949円)及び分配準備積立金(16,714,390円)より分配対象収益は40,056,794円(1万口当たり2,349.66円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,367,458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(1,463,571円)、信託約款に規定される収益調整金(14,890,278円)及び分配準備積立金(23,056,059円)より分配対象収益は41,777,366円(1万口当たり2,586.94円)であります。分配を行っておりません。
-------------	--	--

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自 2018年12月18日 至 2019年12月16日	第7期 自 2019年12月17日 至 2020年12月15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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期	第7期
	2019年12月16日現在	2020年12月15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	第6期	第7期
	2019年12月16日現在	2020年12月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	1,031,427	1,400,811
親投資信託受益証券	15,549,770	6,574,839
合計	16,581,197	7,975,650

(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)

	第6期	第7期
	2019年12月16日現在	2020年12月15日現在
1口当たり純資産額	1,2304円	1,2539円
(1万口当たり純資産額)	(12,304円)	(12,539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

2020年12月15日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF	1,635.000	98,083.650	
	アメリカ・ドル	小計	1,635.000	98,083.650 (10,212,470)	
投資信託受益証券 合計			1,635	10,212,470 (10,212,470)	
親投資信託受益証券	日本円	海外国債マザーファンド	12,034,024	30,507,454	
		ニュー トピックス イン デックス マザーファンド	16,484,072	40,539,278	
		新光外国株式インデックス マザーファンド	10,668,851	30,615,334	
		新光日本債券インデックス マザーファンド	23,438,486	30,188,769	
		新光J-REITマザー ファンド	5,540,354	10,154,360	
		新光米国REITマザー ファンド	5,853,499	9,970,850	
		新光外国債券インデックス マザーファンド(為替ヘッ ジあり)	13,455,541	20,125,452	
	グローバル高金利通貨マ ザーファンド	9,390,912	10,227,642		
日本円 小計			96,865,739	182,329,139	
親投資信託受益証券 合計			96,865,739	182,329,139	
合計				192,541,609 (10,212,470)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	5.04	5.30

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2020年12月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	89,972,837
株式	2,427,329,480
派生商品評価勘定	1,023,350
未収入金	2,958,918
未収配当金	804,197
流動資産合計	2,522,088,782
資産合計	2,522,088,782
負債の部	
流動負債	
前受金	1,475,000
未払金	2,184,557
未払解約金	416,000
流動負債合計	4,075,557
負債合計	4,075,557
純資産の部	
元本等	
元本	1,023,862,517
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,494,150,708
元本等合計	2,518,013,225
純資産合計	2,518,013,225
負債純資産合計	2,522,088,782

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,338,753,892円
同期中追加設定元本額	162,385,234円
同期中一部解約元本額	477,276,609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	208,455,538円
新光7資産バランスファンド	258,644,104円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	68,667,804円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	391,413,347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)	19,212,775円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	31,067,505円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	11,138,375円
グローバル・ナビ	16,484,072円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,675,213円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	12,745,329円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	1,358,455円
計	1,023,862,517円
2. 受益権の総数	1,023,862,517口
3. 差入代用有価証券	
株式	165,800,350円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15日
----	--------------------------------

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年12月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	62,261,141
合計	62,261,141

（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1月15日から2020年12月15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	2020年12月15日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	87,850,000	-	88,875,000	1,025,000
合計	87,850,000	-	88,875,000	1,025,000

(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)

2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4593円 (24,593円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2020年12月15日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	1,300	428.00	556,400	
マルハニチロ	200	2,161.00	432,200	
雪国まいたけ	100	1,675.00	167,500	
サカタのタネ	200	3,525.00	705,000	
ホクト	100	2,111.00	211,100	
ショーボンドホールディングス	200	5,150.00	1,030,000	
ミライト・ホールディングス	400	1,674.00	669,600	
タマホーム	100	1,439.00	143,900	
日本アクア	100	637.00	63,700	
TATERU	300	176.00	52,800	
スペースバリューホールディングス	200	642.00	128,400	
住石ホールディングス	300	115.00	34,500	
三井松島ホールディングス	100	719.00	71,900	
国際石油開発帝石	4,900	579.00	2,837,100	
石油資源開発	200	1,871.00	374,200	
K&Oエナジーグループ	100	1,492.00	149,200	
安藤・間	800	720.00	576,000	
東急建設	400	509.00	203,600	

コムシスホールディングス	500	3,170.00	1,585,000	
ビーアールホールディングス	100	699.00	69,900	
高松コンストラクショングループ	100	2,067.00	206,700	
ヤマウラ	100	936.00	93,600	
大成建設	1,000	3,715.00	3,715,000	
大林組	3,100	928.00	2,876,800	
清水建設	3,200	814.00	2,604,800	
飛島建設	100	1,098.00	109,800	
長谷工コーポレーション	1,200	1,172.00	1,406,400	
松井建設	100	797.00	79,700	
鹿島建設	2,400	1,380.00	3,312,000	
不動テトラ	100	1,735.00	173,500	
鉄建建設	100	1,833.00	183,300	
西松建設	200	2,062.00	412,400	
三井住友建設	800	429.00	343,200	
大豊建設	100	3,515.00	351,500	
前田建設工業	800	958.00	766,400	
佐田建設	100	454.00	45,400	
ナカノフドー建設	100	415.00	41,500	
奥村組	100	2,495.00	249,500	
東鉄工業	100	2,782.00	278,200	
戸田建設	1,300	653.00	848,900	
熊谷組	100	2,543.00	254,300	
矢作建設工業	100	858.00	85,800	
ピーエス三菱	100	606.00	60,600	
日本ハウスホールディングス	200	286.00	57,200	
大東建託	300	9,640.00	2,892,000	
新日本建設	100	851.00	85,100	
N I P P O	300	2,775.00	832,500	
前田道路	300	1,736.00	520,800	
東亜建設工業	100	1,947.00	194,700	
日本国土開発	300	557.00	167,100	
若築建設	100	1,178.00	117,800	
東洋建設	300	427.00	128,100	
五洋建設	1,200	847.00	1,016,400	
世紀東急工業	100	836.00	83,600	
住友林業	800	1,972.00	1,577,600	
日本基礎技術	100	505.00	50,500	
巴コーポレーション	100	423.00	42,300	
大和ハウス工業	3,100	3,143.00	9,743,300	
ライト工業	200	1,770.00	354,000	
積水ハウス	3,400	1,984.00	6,745,600	
日特建設	100	789.00	78,900	
北陸電気工事	100	1,291.00	129,100	
ユアテック	200	786.00	157,200	
日本リーテック	100	2,379.00	237,900	
中電工	100	2,154.00	215,400	
関電工	400	807.00	322,800	
きんでん	700	1,641.00	1,148,700	
東京エネシス	100	859.00	85,900	

住友電設	100	2,614.00	261,400	
日本電設工業	200	2,123.00	424,600	
協和エクシオ	500	2,882.00	1,441,000	
新日本空調	100	2,190.00	219,000	
日本工営	100	2,758.00	275,800	
九電工	200	3,165.00	633,000	
三機工業	200	1,183.00	236,600	
日揮ホールディングス	1,000	978.00	978,000	
ヤマト	100	750.00	75,000	
太平電業	100	2,416.00	241,600	
高砂熱学工業	200	1,487.00	297,400	
NEC ネットズエスアイ	300	1,776.00	532,800	
明星工業	200	781.00	156,200	
大気社	200	2,774.00	554,800	
ダイダン	100	2,856.00	285,600	
日比谷総合設備	100	1,879.00	187,900	
日本製粉	300	1,621.00	486,300	
日清製粉グループ本社	1,100	1,659.00	1,824,900	
昭和産業	100	3,085.00	308,500	
鳥越製粉	100	1,025.00	102,500	
中部飼料	100	1,420.00	142,000	
フィード・ワン	100	894.00	89,400	
日本甜菜製糖	100	1,640.00	164,000	
三井製糖	100	1,795.00	179,500	
塩水港精糖	100	225.00	22,500	
LIFULL	300	401.00	120,300	
ミクシィ	200	2,641.00	528,200	
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,901.00	190,100	
日本M&Aセンター	700	6,750.00	4,725,000	
UTグループ	100	3,330.00	333,000	
タケエイ	100	1,288.00	128,800	
ビーネックスグループ	100	1,145.00	114,500	
コシダカホールディングス	200	472.00	94,400	
パソナグループ	100	2,147.00	214,700	
リンクアンドモチベーション	200	576.00	115,200	
GCA	100	739.00	73,900	
エス・エム・エス	300	3,640.00	1,092,000	
パーソルホールディングス	900	2,003.00	1,802,700	
クックパッド	300	321.00	96,300	
森永製菓	200	3,840.00	768,000	
江崎グリコ	300	4,565.00	1,369,500	
井村屋グループ	100	2,635.00	263,500	
不二家	100	2,471.00	247,100	
山崎製パン	700	1,730.00	1,211,000	
亀田製菓	100	4,840.00	484,000	
寿スピリッツ	100	5,230.00	523,000	
カルビー	500	3,075.00	1,537,500	
森永乳業	200	4,995.00	999,000	
六甲バター	100	1,942.00	194,200	
ヤクルト本社	700	5,160.00	3,612,000	

明治ホールディングス	700	7,280.00	5,096,000	
雪印メグミルク	200	2,212.00	442,400	
プリマハム	200	3,160.00	632,000	
日本ハム	400	4,715.00	1,886,000	
丸大食品	100	1,686.00	168,600	
S Foods	100	3,340.00	334,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	600	683.00	409,800	
システナ	300	2,127.00	638,100	
日鉄ソリューションズ	100	2,955.00	295,500	
総合警備保障	400	5,360.00	2,144,000	
キューブシステム	100	1,278.00	127,800	
いちご	1,200	316.00	379,200	
日本駐車場開発	1,000	147.00	147,000	
カカクコム	700	2,884.00	2,018,800	
セントケア・ホールディング	100	879.00	87,900	
ルネサンス	100	936.00	93,600	
ディップ	100	2,777.00	277,700	
SBSホールディングス	100	2,527.00	252,700	
デジタルホールディングス	100	1,984.00	198,400	
新日本科学	100	664.00	66,400	
ツクイホールディングス	200	563.00	112,600	
ベネフィット・ワン	300	3,050.00	915,000	
エムスリー	2,100	9,179.00	19,275,900	
ツカダ・グローバルホールディング	100	260.00	26,000	
アウトソーシング	500	1,498.00	749,000	
ウェルネット	100	486.00	48,600	
ディー・エヌ・エー	400	1,904.00	761,600	
博報堂DYホールディングス	1,300	1,412.00	1,835,600	
ぐるなび	200	525.00	105,000	
タカミヤ	100	520.00	52,000	
ジャパンベストレスキューシステム	100	929.00	92,900	
ファンコミュニケーションズ	300	432.00	129,600	
エスプール	200	746.00	149,200	
ティア	100	416.00	41,600	
パリュコマース	100	3,600.00	360,000	
インフォマート	1,000	931.00	931,000	
サッポロホールディングス	300	2,055.00	616,500	
アサヒグループホールディングス	2,200	4,292.00	9,442,400	
麒麟ホールディングス	4,200	2,389.50	10,035,900	
宝ホールディングス	700	1,245.00	871,500	
オエノンホールディングス	300	402.00	120,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	800	1,613.00	1,290,400	
サントリー食品インターナショナル	700	3,795.00	2,656,500	
ダイドーグループホールディングス	100	5,710.00	571,000	
伊藤園	300	6,650.00	1,995,000	
キーコーヒー	100	2,142.00	214,200	
日清オイリオグループ	100	3,005.00	300,500	
不二製油グループ本社	200	2,889.00	577,800	
J-オイルミルズ	100	3,535.00	353,500	

ローソン	200	4,735.00	947,000	
サンエー	100	4,215.00	421,500	
カワチ薬品	100	2,998.00	299,800	
エービーシー・マート	200	5,440.00	1,088,000	
アスクル	100	4,290.00	429,000	
ゲオホールディングス	200	1,241.00	248,200	
アダストリア	100	1,932.00	193,200	
ジーフット	100	417.00	41,700	
くら寿司	100	6,540.00	654,000	
エレマテック	100	1,058.00	105,800	
パルグループホールディングス	100	1,199.00	119,900	
エディオン	400	1,005.00	402,000	
あらた	100	5,060.00	506,000	
サーラコーポレーション	200	564.00	112,800	
J Pホールディングス	300	294.00	88,200	
フジオフードグループ本社	100	1,365.00	136,500	
ひらまつ	200	179.00	35,800	
フィールズ	100	391.00	39,100	
双日	5,400	236.00	1,274,400	
アルフレッサ ホールディングス	1,100	2,064.00	2,270,400	
ハニーズホールディングス	100	978.00	97,800	
キッコーマン	700	6,530.00	4,571,000	
味の素	2,200	2,356.50	5,184,300	
キュービー	600	2,209.00	1,325,400	
ハウス食品グループ本社	400	3,840.00	1,536,000	
カゴメ	400	3,735.00	1,494,000	
アリアケジャパン	100	7,090.00	709,000	
ニチレイ	500	2,801.00	1,400,500	
横浜冷凍	300	873.00	261,900	
東洋水産	500	5,110.00	2,555,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	830.00	83,000	
日清食品ホールディングス	400	8,560.00	3,424,000	
フジッコ	100	2,036.00	203,600	
ロック・フィールド	100	1,615.00	161,500	
日本たばこ産業	5,300	2,200.00	11,660,000	
ケンコーマヨネーズ	100	1,876.00	187,600	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,421.00	142,100	
なとり	100	1,940.00	194,000	
北の達人コーポレーション	300	482.00	144,600	
ユーグレナ	400	821.00	328,400	
スター・マイカ・ホールディングス	100	1,404.00	140,400	
A Dワークスグループ	200	164.00	32,800	
片倉工業	100	1,474.00	147,400	
グンゼ	100	3,505.00	350,500	
ヒューリック	2,100	1,119.00	2,349,900	
ラサ商事	100	909.00	90,900	
アルペン	100	2,431.00	243,100	
クオールホールディングス	100	1,145.00	114,500	
アルコニックス	100	1,465.00	146,500	
神戸物産	700	3,205.00	2,243,500	

ジーンズホールディングス	100	6,760.00	676,000	
ビックカメラ	600	1,137.00	682,200	
DCMホールディングス	600	1,185.00	711,000	
ペッパーフードサービス	100	289.00	28,900	
Monotaro	700	5,380.00	3,766,000	
あいホールディングス	100	2,185.00	218,500	
アークランドサービスホールディングス	100	2,131.00	213,100	
J.フロントリテイリング	1,200	894.00	1,072,800	
ドトール・日レスホールディングス	100	1,514.00	151,400	
マツモトキヨシホールディングス	400	4,610.00	1,844,000	
ブロンコビリー	100	2,429.00	242,900	
ZOZO	700	2,637.00	1,845,900	
ココカラファイン	100	7,600.00	760,000	
三越伊勢丹ホールディングス	1,700	618.00	1,050,600	
東洋紡	400	1,368.00	547,200	
ユニチカ	300	414.00	124,200	
日清紡ホールディングス	600	802.00	481,200	
倉敷紡績	100	1,896.00	189,600	
ダイワボウホールディングス	100	8,420.00	842,000	
シキボウ	100	1,032.00	103,200	
日東紡績	100	4,420.00	442,000	
トヨタ紡織	300	1,764.00	529,200	
マクニカ・富士エレホールディングス	200	2,011.00	402,200	
ウエルシアホールディングス	600	3,935.00	2,361,000	
クリエイトSDホールディングス	200	3,800.00	760,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	865.00	173,000	
八洲電機	100	980.00	98,000	
メディアスホールディングス	100	797.00	79,700	
レスターホールディングス	100	2,214.00	221,400	
丸善CHIホールディングス	100	367.00	36,700	
TOKAIホールディングス	500	1,013.00	506,500	
三洋貿易	100	996.00	99,600	
シュッピン	100	866.00	86,600	
オイシックス・ラ・大地	100	3,015.00	301,500	
ウイン・パートナーズ	100	1,228.00	122,800	
ネクステージ	200	1,325.00	265,000	
ジョイフル本田	300	1,469.00	440,700	
ホットランド	100	1,311.00	131,100	
すかいらーくホールディングス	1,100	1,634.00	1,797,400	
SFPホールディングス	100	1,273.00	127,300	
綿半ホールディングス	100	1,349.00	134,900	
日本毛織	300	1,032.00	309,600	
ダイトウボウ	200	108.00	21,600	
ダイドーリミテッド	100	192.00	19,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	1,134.00	340,200	
野村不動産ホールディングス	600	2,251.00	1,350,600	
三重交通グループホールディングス	200	477.00	95,400	

サムティ	100	1,720.00	172,000	
ディア・ライフ	100	419.00	41,900	
日本商業開発	100	1,761.00	176,100	
プレサンスコーポレーション	200	1,743.00	348,600	
日本管理センター	100	1,255.00	125,500	
フージャースホールディングス	200	734.00	146,800	
オープンハウス	300	3,795.00	1,138,500	
東急不動産ホールディングス	2,700	525.00	1,417,500	
飯田グループホールディングス	800	2,098.00	1,678,400	
ムゲンエステート	100	503.00	50,300	
帝国繊維	100	2,574.00	257,400	
日本コークス工業	800	72.00	57,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	919.00	91,900	
あさひ	100	1,711.00	171,100	
日本調剤	100	1,504.00	150,400	
コスモス薬品	100	17,050.00	1,705,000	
シップヘルスケアホールディングス	200	5,520.00	1,104,000	
セブン&アイ・ホールディングス	3,800	3,594.00	13,657,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	500	610.00	305,000	
ツルハホールディングス	200	16,050.00	3,210,000	
サンマルクホールディングス	100	1,408.00	140,800	
トリドールホールディングス	200	1,385.00	277,000	
帝人	800	1,943.00	1,554,400	
東レ	7,000	619.00	4,333,000	
クラレ	1,500	1,136.00	1,704,000	
旭化成	6,400	1,031.50	6,601,600	
T O K Y O B A S E	100	517.00	51,700	
稲葉製作所	100	1,387.00	138,700	
トーカロ	300	1,387.00	416,100	
S U M C O	1,300	2,273.00	2,954,900	
信和	100	694.00	69,400	
日本フェルト	100	451.00	45,100	
エコナックホールディングス	200	92.00	18,400	
アツギ	100	540.00	54,000	
J Mホールディングス	100	2,348.00	234,800	
コメダホールディングス	200	1,839.00	367,800	
バロックジャパンリミテッド	100	676.00	67,600	
クスリのアオキホールディングス	100	8,930.00	893,000	
共和レザー	100	688.00	68,800	
スシローグローバルホールディングス	500	3,550.00	1,775,000	
セーレン	200	1,606.00	321,200	
小松マテーレ	200	1,000.00	200,000	
ワコールホールディングス	200	2,083.00	416,600	
ホギメディカル	100	3,390.00	339,000	
T S Iホールディングス	300	219.00	65,700	
ワールド	100	1,260.00	126,000	
T I S	1,000	2,067.00	2,067,000	
グリー	600	606.00	363,600	
コーエーテクモホールディングス	200	6,370.00	1,274,000	

A G S	100	863.00	86,300
ファインデックス	100	1,268.00	126,800
K L a b	200	1,001.00	200,200
ポルトウウィン・ビットクルーホールディングス	100	1,065.00	106,500
ネクソン	2,500	3,090.00	7,725,000
アイスタイル	300	404.00	121,200
エイチーム	100	1,165.00	116,500
エニグモ	100	1,370.00	137,000
テクノスジャパン	100	710.00	71,000
e n i s h	100	477.00	47,700
コロプラ	300	975.00	292,500
オルトプラス	100	438.00	43,800
ブロードリーフ	500	724.00	362,000
デジタルハーツホールディングス	100	1,240.00	124,000
システム情報	100	1,106.00	110,600
じげん	200	363.00	72,600
ブイキューブ	100	3,200.00	320,000
ディー・エル・イー	100	334.00	33,400
フィックスターズ	100	958.00	95,800
オブティム	100	2,869.00	286,900
特種東海製紙	100	5,260.00	526,000
ティーガイア	100	1,850.00	185,000
日本アジアグループ	100	747.00	74,700
テクマトリックス	100	2,042.00	204,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	2,670.00	534,000
GMOペイメントゲートウェイ	200	13,890.00	2,778,000
インターネットイニシアティブ	100	4,165.00	416,500
さくらインターネット	100	701.00	70,100
S R Aホールディングス	100	2,517.00	251,700
朝日ネット	100	869.00	86,900
e B A S E	100	1,065.00	106,500
アバント	100	1,154.00	115,400
フリービット	100	1,010.00	101,000
コムチュア	100	2,998.00	299,800
アステリア	100	1,049.00	104,900
アイル	100	1,603.00	160,300
王子ホールディングス	4,100	551.00	2,259,100
日本製紙	400	1,200.00	480,000
三菱製紙	100	324.00	32,400
北越コーポレーション	600	387.00	232,200
大王製紙	500	1,843.00	921,500
メディカル・データ・ビジョン	100	2,606.00	260,600
g u m i	100	840.00	84,000
カナミックネットワーク	100	768.00	76,800
レンゴー	900	827.00	744,300
トーモク	100	1,711.00	171,100
ザ・バック	100	3,015.00	301,500
チェンジ	100	7,710.00	771,000

オークネット	100	1,420.00	142,000	
AOI TYO HOLDINGS	100	424.00	42,400	
マクロミル	200	699.00	139,800	
昭和電工	700	2,218.00	1,552,600	
住友化学	7,100	411.00	2,918,100	
日産化学	500	6,130.00	3,065,000	
クレハ	100	6,790.00	679,000	
テイカ	100	1,608.00	160,800	
石原産業	200	641.00	128,200	
日本曹達	100	2,946.00	294,600	
東ソー	1,500	1,732.00	2,598,000	
トクヤマ	300	2,354.00	706,200	
セントラル硝子	200	2,317.00	463,400	
東亜合成	600	1,283.00	769,800	
大阪ソーダ	100	2,653.00	265,300	
関東電化工業	200	799.00	159,800	
デンカ	400	3,880.00	1,552,000	
イビデン	600	5,020.00	3,012,000	
信越化学工業	1,700	17,160.00	29,172,000	
堺化学工業	100	2,028.00	202,800	
第一稀元素化学工業	100	823.00	82,300	
エア・ウォーター	900	1,845.00	1,660,500	
日本酸素ホールディングス	900	1,982.00	1,783,800	
日本パーカライジング	500	1,098.00	549,000	
高圧ガス工業	200	820.00	164,000	
四国化成工業	100	1,209.00	120,900	
ステラ ケミファ	100	3,370.00	337,000	
日本触媒	200	5,600.00	1,120,000	
大日精化工業	100	2,355.00	235,500	
カネカ	300	3,475.00	1,042,500	
協和キリン	1,000	2,734.00	2,734,000	
三菱瓦斯化学	900	2,300.00	2,070,000	
三井化学	900	2,854.00	2,568,600	
J S R	900	2,724.00	2,451,600	
東京応化工業	200	6,860.00	1,372,000	
大阪有機化学工業	100	2,986.00	298,600	
三菱ケミカルホールディングス	6,500	654.50	4,254,250	
KHネオケム	200	2,799.00	559,800	
ダイセル	1,200	742.00	890,400	
住友ベークライト	200	3,555.00	711,000	
積水化学工業	2,100	1,936.00	4,065,600	
日本ゼオン	900	1,401.00	1,260,900	
アイカ工業	300	3,640.00	1,092,000	
宇部興産	500	1,906.00	953,000	
積水樹脂	200	2,184.00	436,800	
タキロンシーアイ	200	708.00	141,600	
旭有機材	100	1,561.00	156,100	
ニチパン	100	1,658.00	165,800	
リケンテクノス	200	464.00	92,800	
積水化成成品工業	100	543.00	54,300	

タイガースポリマー	100	414.00	41,400	
ダイキョーニシカワ	200	827.00	165,400	
森六ホールディングス	100	2,268.00	226,800	
日本化薬	600	967.00	580,200	
カーリットホールディングス	100	745.00	74,500	
E P S ホールディングス	100	1,015.00	101,500	
プレステージ・インターナショナル	400	913.00	365,200	
プロトコーポレーション	100	1,026.00	102,600	
アミューズ	100	2,580.00	258,000	
野村総合研究所	1,400	3,380.00	4,732,000	
サイバネットシステム	100	996.00	99,600	
クイック	100	1,184.00	118,400	
T A C	100	237.00	23,700	
C E ホールディングス	100	565.00	56,500	
ケネディクス	800	748.00	598,400	
電通グループ	1,100	3,295.00	3,624,500	
インテージホールディングス	100	1,143.00	114,300	
ソースネクスト	500	301.00	150,500	
シーティーエス	100	1,017.00	101,700	
インフォコム	100	3,285.00	328,500	
メディカルシステムネットワーク	100	652.00	65,200	
日本精化	100	1,462.00	146,200	
扶桑化学工業	100	3,835.00	383,500	
ラクスル	100	4,635.00	463,500	
F I G	100	281.00	28,100	
A D E K A	400	1,820.00	728,000	
日油	400	5,100.00	2,040,000	
新日本理化	200	301.00	60,200	
ハリマ化成グループ	100	1,139.00	113,900	
イーソル	100	1,328.00	132,800	
アルテリア・ネットワークス	100	1,535.00	153,500	
花王	2,400	7,762.00	18,628,800	
三洋化成工業	100	4,950.00	495,000	
武田薬品工業	8,200	3,856.00	31,619,200	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	8,600	1,526.50	13,127,900	
大日本住友製薬	700	1,391.00	973,700	
塩野義製薬	1,200	5,492.00	6,590,400	
わかもと製薬	100	267.00	26,700	
あすか製薬	100	1,742.00	174,200	
日本新薬	300	7,250.00	2,175,000	
中外製薬	3,100	4,993.00	15,478,300	
科研製薬	200	3,910.00	782,000	
エーザイ	1,200	7,576.00	9,091,200	
理研ビタミン	100	1,382.00	138,200	
ロート製薬	500	3,145.00	1,572,500	
小野薬品工業	2,300	3,183.00	7,320,900	
久光製薬	300	6,240.00	1,872,000	
有機合成薬品工業	100	329.00	32,900	
持田製薬	100	3,995.00	399,500	

参天製薬	1,800	1,714.00	3,085,200
ツムラ	300	3,300.00	990,000
日医工	300	1,007.00	302,100
テルモ	2,800	3,990.00	11,172,000
H・U・グループホールディングス	300	2,931.00	879,300
キッセイ薬品工業	200	2,250.00	450,000
生化学工業	200	1,048.00	209,600
栄研化学	200	2,021.00	404,200
鳥居薬品	100	3,340.00	334,000
JCRファーマ	300	2,553.00	765,900
東和薬品	100	1,874.00	187,400
富士製薬工業	100	1,272.00	127,200
沢井製薬	200	4,870.00	974,000
ゼリア新薬工業	200	1,913.00	382,600
第一三共	8,500	3,419.00	29,061,500
キョーリン製薬ホールディングス	200	1,932.00	386,400
大幸薬品	100	1,622.00	162,200
ダイト	100	3,845.00	384,500
大塚ホールディングス	2,100	4,424.00	9,290,400
大正製薬ホールディングス	200	6,740.00	1,348,000
ペプチドリーム	500	5,430.00	2,715,000
大日本塗料	100	980.00	98,000
日本ペイントホールディングス	800	11,250.00	9,000,000
関西ペイント	1,100	3,010.00	3,311,000
神東塗料	100	196.00	19,600
中国塗料	300	1,023.00	306,900
日本特殊塗料	100	1,292.00	129,200
藤倉化成	100	561.00	56,100
太陽ホールディングス	100	6,300.00	630,000
DIC	400	2,652.00	1,060,800
サカタインクス	200	1,218.00	243,600
東洋インキSCホールディングス	200	2,038.00	407,600
T&K TOKA	100	908.00	90,800
アルプス技研	100	2,335.00	233,500
サニックス	200	263.00	52,600
日本空調サービス	100	787.00	78,700
オリエンタルランド	1,000	17,615.00	17,615,000
フォーカスシステムズ	100	919.00	91,900
ダスキン	200	2,938.00	587,600
パーク24	500	1,706.00	853,000
明光ネットワークジャパン	100	568.00	56,800
ファルコホールディングス	100	1,654.00	165,400
クレスコ	100	1,340.00	134,000
フジ・メディア・ホールディングス	900	1,131.00	1,017,900
ラウンドワン	300	946.00	283,800
リゾートトラスト	400	1,586.00	634,400
オービック	300	21,060.00	6,318,000
ジャストシステム	200	7,140.00	1,428,000
TDCソフト	100	1,006.00	100,600
Zホールディングス	13,300	613.40	8,158,220

ビー・エム・エル	100	3,575.00	357,500	
トレンドマイクロ	500	5,740.00	2,870,000	
りらいあコミュニケーションズ	200	1,337.00	267,400	
リソー教育	400	309.00	123,600	
日本オラクル	200	11,340.00	2,268,000	
フューチャー	100	1,779.00	177,900	
CAC Holdings	100	1,490.00	149,000	
ユー・エス・エス	1,100	2,092.00	2,301,200	
オービックビジネスコンサルタント	100	6,800.00	680,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,785.00	1,514,000	
アイティフォー	100	945.00	94,500	
サイバーエージェント	600	6,800.00	4,080,000	
楽天	4,400	1,020.00	4,488,000	
モーニングスター	100	457.00	45,700	
テー・オー・ダブリュー	200	283.00	56,600	
大塚商会	500	5,100.00	2,550,000	
サイボウズ	100	2,604.00	260,400	
山田コンサルティンググループ	100	977.00	97,700	
電通国際情報サービス	100	6,660.00	666,000	
ACCESS	100	783.00	78,300	
デジタルガレージ	200	4,210.00	842,000	
イーエムシステムズ	100	859.00	85,900	
CIJ	100	943.00	94,300	
日本エンタープライズ	100	222.00	22,200	
スカラ	100	840.00	84,000	
インテリジェント ウェイブ	100	700.00	70,000	
フルキャストホールディングス	100	1,755.00	175,500	
エン・ジャパン	200	3,385.00	677,000	
富士フイルムホールディングス	1,900	5,740.00	10,906,000	
コニカミノルタ	2,200	398.00	875,600	
資生堂	2,000	7,345.00	14,690,000	
ライオン	1,300	2,455.00	3,191,500	
高砂香料工業	100	2,593.00	259,300	
マンダム	200	1,681.00	336,200	
ミルボン	100	6,300.00	630,000	
ファンケル	400	4,425.00	1,770,000	
コーセー	200	17,580.00	3,516,000	
コタ	100	1,399.00	139,900	
ポーラ・オルビスホールディングス	400	2,072.00	828,800	
ノビアホールディングス	100	4,390.00	439,000	
エステー	100	2,029.00	202,900	
コニシ	200	1,683.00	336,600	
長谷川香料	200	2,114.00	422,800	
星光PMC	100	750.00	75,000	
小林製薬	300	12,790.00	3,837,000	
荒川化学工業	100	1,178.00	117,800	
メック	100	2,311.00	231,100	
タカラバイオ	300	2,902.00	870,600	
JCU	100	3,925.00	392,500	
新田ゼラチン	100	698.00	69,800	

デクセリアルズ	300	1,332.00	399,600	
アース製薬	100	5,980.00	598,000	
北興化学工業	100	1,115.00	111,500	
クミアイ化学工業	400	993.00	397,200	
日本農薬	200	532.00	106,400	
ニチレキ	100	1,631.00	163,100	
ユシロ化学工業	100	1,200.00	120,000	
富士石油	300	184.00	55,200	
出光興産	1,100	2,229.00	2,451,900	
E N E O Sホールディングス	14,900	358.70	5,344,630	
コスモエネルギーホールディングス	300	1,793.00	537,900	
横浜ゴム	600	1,608.00	964,800	
T O Y O T I R E	500	1,661.00	830,500	
ブリヂストン	2,600	3,590.00	9,334,000	
住友ゴム工業	900	927.00	834,300	
藤倉コンポジット	100	412.00	41,200	
オカモト	100	4,000.00	400,000	
アキレス	100	1,470.00	147,000	
ニッタ	100	2,368.00	236,800	
住友理工	200	578.00	115,600	
三ツ星ベルト	100	1,712.00	171,200	
パンドー化学	200	634.00	126,800	
A G C	900	3,550.00	3,195,000	
日本板硝子	500	460.00	230,000	
有沢製作所	200	1,009.00	201,800	
日本電気硝子	400	2,360.00	944,000	
住友大阪セメント	200	3,145.00	629,000	
太平洋セメント	600	2,746.00	1,647,600	
日本ヒューム	100	804.00	80,400	
日本コンクリート工業	200	333.00	66,600	
アジアパイルホールディングス	100	478.00	47,800	
東海カーボン	1,000	1,204.00	1,204,000	
日本カーボン	100	4,035.00	403,500	
東洋炭素	100	1,876.00	187,600	
ノリタケカンパニーリミテド	100	3,005.00	300,500	
T O T O	700	5,870.00	4,109,000	
日本碍子	1,200	1,675.00	2,010,000	
日本特殊陶業	800	1,859.00	1,487,200	
ダントーホールディングス	100	489.00	48,900	
ヨータイ	100	830.00	83,000	
イソライト工業	100	492.00	49,200	
東京窯業	100	368.00	36,800	
フジインコーポレーテッド	100	3,850.00	385,000	
ニチアス	300	2,471.00	741,300	
日本製鉄	4,400	1,300.00	5,720,000	
神戸製鋼所	1,800	539.00	970,200	
中山製鋼所	100	416.00	41,600	
合同製鐵	100	1,968.00	196,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,600	1,022.00	2,657,200	

東京製鐵	500	655.00	327,500	
共英製鋼	100	1,487.00	148,700	
大和工業	200	2,734.00	546,800	
大阪製鐵	100	1,292.00	129,200	
淀川製鋼所	100	2,027.00	202,700	
丸一鋼管	300	2,275.00	682,500	
大同特殊鋼	200	4,535.00	907,000	
日本冶金工業	100	1,810.00	181,000	
山陽特殊製鋼	100	1,310.00	131,000	
愛知製鋼	100	2,949.00	294,900	
日立金属	1,100	1,520.00	1,672,000	
大平洋金属	100	2,139.00	213,900	
新日本電工	600	310.00	186,000	
日本製鋼所	300	2,873.00	861,900	
三菱製鋼	100	746.00	74,600	
日亜鋼業	100	303.00	30,300	
大紀アルミニウム工業所	200	767.00	153,400	
日本軽金属ホールディングス	200	1,953.00	390,600	
三井金属鉱業	300	3,560.00	1,068,000	
東邦亜鉛	100	2,351.00	235,100	
三菱マテリアル	600	2,120.00	1,272,000	
住友金属鉱山	1,300	4,316.00	5,610,800	
DOWAホールディングス	200	3,665.00	733,000	
古河機械金属	200	1,257.00	251,400	
エス・サイエンス	400	42.00	16,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	980.00	98,000	
東邦チタニウム	200	823.00	164,600	
UACJ	100	1,894.00	189,400	
古河電気工業	300	2,899.00	869,700	
住友電気工業	3,700	1,279.50	4,734,150	
フジクラ	1,200	474.00	568,800	
昭和電線ホールディングス	100	1,822.00	182,200	
タツタ電線	200	743.00	148,600	
リョービ	100	1,351.00	135,100	
アーレスティ	100	379.00	37,900	
アサヒホールディングス	200	3,320.00	664,000	
東洋製罐グループホールディングス	600	1,130.00	678,000	
ホッカンホールディングス	100	1,442.00	144,200	
コロナ	100	974.00	97,400	
横河ブリッジホールディングス	200	2,134.00	426,800	
OSJBホールディングス	500	274.00	137,000	
三和ホールディングス	900	1,193.00	1,073,700	
文化シャッター	300	948.00	284,400	
三協立山	100	775.00	77,500	
アルインコ	100	923.00	92,300	
LIXIL	1,400	2,259.00	3,162,600	
日本フィルコン	100	544.00	54,400	
ノーリツ	200	1,670.00	334,000	
長府製作所	100	2,100.00	210,000	
リンナイ	200	11,980.00	2,396,000	

ユニプレス	200	1,048.00	209,600
ダイニチ工業	100	907.00	90,700
日東精工	100	444.00	44,400
岡部	200	790.00	158,000
ジーテクト	100	1,540.00	154,000
東ブレ	200	1,545.00	309,000
高周波熱錬	200	481.00	96,200
東京製綱	100	861.00	86,100
サンコール	100	449.00	44,900
モリテックスチール	100	514.00	51,400
パイオラックス	100	1,691.00	169,100
エイチワン	100	892.00	89,200
日本発条	1,100	710.00	781,000
三浦工業	400	5,560.00	2,224,000
タクマ	300	1,825.00	547,500
テクノプロ・ホールディングス	200	8,260.00	1,652,000
Keeper 技研	100	2,135.00	213,500
Gunosy	100	735.00	73,500
リブセンス	100	243.00	24,300
ジャパンマテリアル	300	1,390.00	417,000
ベクトル	100	931.00	93,100
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,231.00	123,100
I B J	100	794.00	79,400
N・フィールド	100	857.00	85,700
M&Aキャピタルパートナーズ	100	6,250.00	625,000
シグマクシス	100	1,768.00	176,800
ウィルグループ	100	1,059.00	105,900
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	316.00	31,600
リクルートホールディングス	6,800	4,100.00	27,880,000
エラン	100	3,065.00	306,500
ツガミ	200	1,622.00	324,400
オークマ	100	5,960.00	596,000
芝浦機械	100	2,260.00	226,000
アマダ	1,200	1,080.00	1,296,000
アイダエンジニアリング	300	979.00	293,700
F U J I	400	2,663.00	1,065,200
牧野フライス製作所	100	4,035.00	403,500
オーエスジー	500	1,869.00	934,500
旭ダイヤモンド工業	300	449.00	134,700
D M G 森精機	600	1,660.00	996,000
ソディック	200	870.00	174,000
ディスコ	100	34,400.00	3,440,000
日東工器	100	1,828.00	182,800
パンチ工業	100	467.00	46,700
日本郵政	7,800	772.90	6,028,620
ベルシステム24ホールディングス	200	1,724.00	344,800
鎌倉新書	100	1,050.00	105,000
エアトリ	100	1,271.00	127,100
ハイアス・アンド・カンパニー	100	210.00	21,000
ソラスト	300	1,449.00	434,700

豊田自動織機	800	8,120.00	6,496,000
豊和工業	100	886.00	88,600
東洋機械金属	100	437.00	43,700
島精機製作所	200	1,776.00	355,200
オプトラン	100	2,303.00	230,300
イワキ	100	837.00	83,700
フリー	100	1,105.00	110,500
ヤマシンフィルタ	200	1,100.00	220,000
日阪製作所	100	845.00	84,500
やまびこ	200	1,353.00	270,600
ペガサスミシン製造	100	348.00	34,800
ナプテスコ	600	4,365.00	2,619,000
三井海洋開発	100	1,889.00	188,900
レオン自動機	100	1,133.00	113,300
S M C	300	64,770.00	19,431,000
オイレス工業	100	1,663.00	166,300
サトーホールディングス	100	2,224.00	222,400
技研製作所	100	4,320.00	432,000
日精樹脂工業	100	889.00	88,900
小松製作所	4,500	2,781.00	12,514,500
住友重機械工業	600	2,469.00	1,481,400
日立建機	400	2,892.00	1,156,800
日工	100	688.00	68,800
井関農機	100	1,409.00	140,900
T O W A	100	1,951.00	195,100
シンニッタン	200	189.00	37,800
クボタ	5,200	2,190.50	11,390,600
東洋エンジニアリング	100	423.00	42,300
月島機械	200	1,354.00	270,800
帝国電機製作所	100	1,287.00	128,700
新東工業	200	785.00	157,000
澁谷工業	100	3,600.00	360,000
アイチコーポレーション	200	945.00	189,000
小森コーポレーション	300	745.00	223,500
鶴見製作所	100	1,806.00	180,600
荏原製作所	400	3,420.00	1,368,000
西島製作所	100	876.00	87,600
北越工業	100	1,064.00	106,400
ダイキン工業	1,300	22,550.00	29,315,000
栗田工業	500	3,985.00	1,992,500
椿本チエイン	100	2,819.00	281,900
日機装	300	1,056.00	316,800
木村化工機	100	614.00	61,400
レイズネクスト	200	1,181.00	236,200
アネスト岩田	200	1,049.00	209,800
ダイフク	500	12,300.00	6,150,000
加藤製作所	100	1,030.00	103,000
タダノ	500	893.00	446,500
フジテック	400	2,233.00	893,200
C K D	300	2,243.00	672,900

キトー	100	1,609.00	160,900
平和	300	1,461.00	438,300
理想科学工業	100	1,339.00	133,900
SANKYO	200	2,675.00	535,000
日本金銭機械	100	533.00	53,300
マースグループホールディングス	100	1,590.00	159,000
フクシマガリレイ	100	4,540.00	454,000
竹内製作所	200	2,436.00	487,200
アマノ	300	2,672.00	801,600
JUKI	100	538.00	53,800
サンデンホールディングス	100	371.00	37,100
蛇の目ミシン工業	100	818.00	81,800
ブラザー工業	1,200	2,096.00	2,515,200
マックス	200	1,414.00	282,800
モリタホールディングス	200	1,718.00	343,600
グローリー	300	2,108.00	632,400
新晃工業	100	1,727.00	172,700
大和冷機工業	200	1,126.00	225,200
セガサミーホールディングス	1,000	1,558.00	1,558,000
TPR	100	1,506.00	150,600
ツバキ・ナカシマ	200	963.00	192,600
ホシザキ	300	9,950.00	2,985,000
大豊工業	100	826.00	82,600
日本精工	1,900	917.00	1,742,300
NTN	2,300	257.00	591,100
ジェイテクト	1,000	817.00	817,000
不二越	100	4,430.00	443,000
ミネベアミツミ	1,800	2,172.00	3,909,600
日本トムソン	300	380.00	114,000
THK	600	3,320.00	1,992,000
ユーシン精機	100	901.00	90,100
イーグル工業	100	1,010.00	101,000
前澤工業	100	445.00	44,500
日本ピラー工業	100	1,585.00	158,500
キッツ	400	646.00	258,400
日立製作所	4,800	4,168.00	20,006,400
三菱電機	9,900	1,535.50	15,201,450
富士電機	600	3,650.00	2,190,000
安川電機	1,100	4,755.00	5,230,500
シンフォニアテクノロジー	100	1,504.00	150,400
明電舎	200	2,158.00	431,600
デンヨー	100	2,104.00	210,400
ベイカレント・コンサルティング	100	15,250.00	1,525,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	100	4,750.00	475,000
日総工産	100	750.00	75,000
RPAホールディングス	100	648.00	64,800
三櫻工業	100	915.00	91,500
マキタ	1,300	5,270.00	6,851,000
東芝テック	100	3,860.00	386,000

マブチモーター	300	4,515.00	1,354,500	
日本電産	2,400	12,620.00	30,288,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	458.00	45,800	
トレックス・セミコンダクター	100	1,382.00	138,200	
東光高岳	100	1,767.00	176,700	
ダブル・スコープ	200	891.00	178,200	
ダイヘン	100	4,980.00	498,000	
ヤーマン	200	2,085.00	417,000	
JVCケンウッド	800	151.00	120,800	
ミマキエンジニアリング	100	531.00	53,100	
日新電機	200	1,151.00	230,200	
大崎電気工業	200	575.00	115,000	
オムロン	900	9,040.00	8,136,000	
日東工業	100	2,006.00	200,600	
I D E C	100	1,880.00	188,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	300	2,765.00	829,500	
日本電気	1,200	5,380.00	6,456,000	
富士通	1,000	13,600.00	13,600,000	
沖電気工業	400	934.00	373,600	
サンケン電気	100	4,145.00	414,500	
アイホン	100	1,637.00	163,700	
ルネサスエレクトロニクス	4,200	1,057.00	4,439,400	
セイコーエプソン	1,200	1,631.00	1,957,200	
ワコム	700	948.00	663,600	
アルバック	200	4,425.00	885,000	
E I Z O	100	3,770.00	377,000	
ジャパンディスプレイ	2,900	50.00	145,000	
日本信号	300	975.00	292,500	
京三製作所	200	441.00	88,200	
能美防災	100	2,358.00	235,800	
ホーチキ	100	1,301.00	130,100	
エレコム	100	4,930.00	493,000	
パナソニック	11,300	1,161.00	13,119,300	代用有価証券 7,500株
シャープ	1,100	1,458.00	1,603,800	
アンリツ	600	2,348.00	1,408,800	
富士通ゼネラル	300	2,824.00	847,200	
ソニー	6,200	9,730.00	60,326,000	代用有価証券 3,700株
T D K	500	14,210.00	7,105,000	
タムラ製作所	300	588.00	176,400	
アルプスアルパイン	900	1,288.00	1,159,200	
日本電波工業	100	719.00	71,900	
ローランド ディー・ジー・	100	1,905.00	190,500	
フォスター電機	100	1,238.00	123,800	
ヨコオ	100	2,669.00	266,900	
ティアック	100	105.00	10,500	
ホシデン	300	977.00	293,100	
ヒロセ電機	200	15,150.00	3,030,000	
日本航空電子工業	200	1,603.00	320,600	

TOA	100	890.00	89,000	
マクセルホールディングス	200	1,322.00	264,400	
古野電気	100	1,194.00	119,400	
スミダコーポレーション	100	1,096.00	109,600	
アイコム	100	2,709.00	270,900	
本多通信工業	100	499.00	49,900	
船井電機	100	448.00	44,800	
横河電機	900	1,936.00	1,742,400	
アズビル	600	5,190.00	3,114,000	
日本光電工業	400	3,455.00	1,382,000	
共和電業	100	403.00	40,300	
堀場製作所	200	5,840.00	1,168,000	
アドバンテスト	700	7,420.00	5,194,000	
エスペック	100	1,993.00	199,300	
キーエンス	900	51,700.00	46,530,000	
シスメックス	700	11,580.00	8,106,000	
日本マイクロニクス	200	1,205.00	241,000	
メガチップス	100	3,070.00	307,000	
OBARA GROUP	100	3,965.00	396,500	
IMAGICA GROUP	100	360.00	36,000	
デンソー	2,200	5,800.00	12,760,000	
コーセル	100	1,249.00	124,900	
イリソ電子工業	100	4,785.00	478,500	
オブテックスグループ	200	1,981.00	396,200	
レーザーテック	400	11,330.00	4,532,000	
スタンレー電気	700	3,430.00	2,401,000	
ウシオ電機	500	1,303.00	651,500	
岡谷電機産業	100	409.00	40,900	
ヘリオス テクノ ホールディング	100	302.00	30,200	
日本セラミック	100	2,980.00	298,000	
古河電池	100	1,488.00	148,800	
山一電機	100	1,600.00	160,000	
図研	100	2,908.00	290,800	
日本電子	200	4,590.00	918,000	
カシオ計算機	900	1,915.00	1,723,500	
ファナック	900	26,150.00	23,535,000	
日本シイエムケイ	200	419.00	83,800	
エンプラス	100	4,250.00	425,000	
ローム	400	9,600.00	3,840,000	
浜松ホトニクス	700	5,970.00	4,179,000	
三井ハイテック	100	4,005.00	400,500	
新光電気工業	300	2,319.00	695,700	
京セラ	1,400	6,300.00	8,820,000	
太陽誘電	400	4,620.00	1,848,000	
村田製作所	2,900	8,898.00	25,804,200	
双葉電子工業	200	943.00	188,600	
日東電工	700	8,830.00	6,181,000	
東海理化電機製作所	300	1,752.00	525,600	
ニチコン	300	1,249.00	374,700	
日本ケミコン	100	1,949.00	194,900	

K O A	100	1,520.00	152,000	
三井E & Sホールディングス	400	373.00	149,200	
日立造船	800	443.00	354,400	
三菱重工業	1,700	2,983.00	5,071,100	
川崎重工業	800	2,104.00	1,683,200	
I H I	700	2,036.00	1,425,200	
名村造船所	300	171.00	51,300	
サノヤスホールディングス	100	174.00	17,400	
カーブスホールディングス	300	774.00	232,200	
三菱ロジスネクスト	100	1,248.00	124,800	
F P G	300	506.00	151,800	
じもとホールディングス	100	874.00	87,400	
全国保証	300	4,640.00	1,392,000	
めぶきフィナンシャルグループ	5,100	202.00	1,030,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	1,163.00	116,300	
九州フィナンシャルグループ	2,100	461.00	968,100	
かんぼ生命保険	300	1,886.00	565,800	
ゆうちょ銀行	2,800	858.00	2,402,400	
富山第一銀行	200	288.00	57,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,600	372.00	2,083,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	600	713.00	427,800	
アルヒ	200	1,812.00	362,400	
プレミアグループ	100	2,183.00	218,300	
日産自動車	11,700	566.80	6,631,560	
いすゞ自動車	2,900	1,054.00	3,056,600	
トヨタ自動車	11,100	7,905.00	87,745,500	代用有価証券 9,000株
日野自動車	1,200	1,039.00	1,246,800	
三菱自動車工業	3,700	208.00	769,600	
エフテック	100	665.00	66,500	
武蔵精密工業	200	1,626.00	325,200	
日産車体	200	937.00	187,400	
新明和工業	300	937.00	281,100	
極東開発工業	200	1,466.00	293,200	
トピー工業	100	1,231.00	123,100	
曙ブレーキ工業	500	133.00	66,500	
タチエス	200	1,256.00	251,200	
N O K	500	1,179.00	589,500	
フタバ産業	300	546.00	163,800	
K Y B	100	2,620.00	262,000	
市光工業	100	644.00	64,400	
大同メタル工業	200	491.00	98,200	
プレス工業	500	327.00	163,500	
ミクニ	100	296.00	29,600	
太平洋工業	200	1,101.00	220,200	
河西工業	100	412.00	41,200	
アイシン精機	800	3,130.00	2,504,000	
マツダ	2,900	679.00	1,969,100	

今仙電機製作所	100	821.00	82,100	
本田技研工業	7,800	3,061.00	23,875,800	代用有価証券 6,000株
スズキ	2,000	5,263.00	10,526,000	
S U B A R U	3,100	2,175.00	6,742,500	
ヤマハ発動機	1,400	2,127.00	2,977,800	
小糸製作所	600	7,100.00	4,260,000	
T B K	100	465.00	46,500	
エクセディ	100	1,345.00	134,500	
ミツバ	200	508.00	101,600	
豊田合成	300	3,030.00	909,000	
愛三工業	200	524.00	104,800	
日本プラスト	100	548.00	54,800	
ヨロズ	100	1,198.00	119,800	
エフ・シー・シー	200	2,034.00	406,800	
シマノ	400	24,185.00	9,674,000	
テイ・エス テック	200	3,260.00	652,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	600	514.00	308,400	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,262.00	126,200	
第四北越フィナンシャルグループ	200	2,350.00	470,000	
ひろぎんホールディングス	1,400	613.00	858,200	
小野建	100	1,204.00	120,400	
ノジマ	200	2,664.00	532,800	
佐鳥電機	100	807.00	80,700	
カッパ・クリエイト	100	1,480.00	148,000	
伯東	100	1,083.00	108,300	
コンドーテック	100	1,059.00	105,900	
中山福	100	586.00	58,600	
ライトオン	100	606.00	60,600	
ナガイレーベン	100	2,756.00	275,600	
三菱食品	100	2,874.00	287,400	
良品計画	1,300	2,035.00	2,645,500	
三城ホールディングス	100	299.00	29,900	
松田産業	100	1,831.00	183,100	
第一興商	100	3,695.00	369,500	
メディカルホールディングス	1,100	2,029.00	2,231,900	
アドヴァン	100	1,268.00	126,800	
アズワン	100	15,070.00	1,507,000	
シモジマ	100	1,417.00	141,700	
ドウシシャ	100	1,921.00	192,100	
コナカ	100	290.00	29,000	
高速	100	1,622.00	162,200	
G - 7ホールディングス	100	2,305.00	230,500	
イオン北海道	100	937.00	93,700	
コジマ	200	729.00	145,800	
コーナン商事	100	3,205.00	320,500	
ネットワンシステムズ	400	3,870.00	1,548,000	
ワタミ	100	886.00	88,600	
システムソフト	200	92.00	18,400	

パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	2,100	2,386.00	5,010,600	
丸文	100	533.00	53,300	
西松屋チェーン	200	1,519.00	303,800	
ゼンショーホールディングス	500	2,682.00	1,341,000	
ハビネット	100	1,535.00	153,500	
幸楽苑ホールディングス	100	1,710.00	171,000	
日本ライフライン	300	1,585.00	475,500	
サイゼリヤ	100	1,880.00	188,000	
タカショー	100	881.00	88,100	
VTホールディングス	400	389.00	155,600	
アルゴグラフィックス	100	3,105.00	310,500	
IDOM	300	539.00	161,700	
日本エム・ディ・エム	100	2,371.00	237,100	
ユナイテッドアローズ	100	1,652.00	165,200	
進和	100	2,201.00	220,100	
ハイデイ日高	100	1,723.00	172,300	
シークス	100	1,584.00	158,400	
京都きもの友禅	100	224.00	22,400	
コロワイド	300	1,612.00	483,600	
ピーシーデボコーポレーション	100	591.00	59,100	
壱番屋	100	5,080.00	508,000	
スギホールディングス	200	7,170.00	1,434,000	
島津製作所	1,200	3,755.00	4,506,000	
JMS	100	945.00	94,500	
長野計器	100	919.00	91,900	
スター精密	200	1,662.00	332,400	
東京計器	100	1,009.00	100,900	
インターアクション	100	1,970.00	197,000	
オーバル	100	332.00	33,200	
東京精密	200	4,955.00	991,000	
マニー	400	2,627.00	1,050,800	
ニコン	1,500	686.00	1,029,000	
トプコン	500	1,291.00	645,500	
オリンパス	5,500	2,156.50	11,860,750	
理研計器	100	2,972.00	297,200	
SCREENホールディングス	200	7,020.00	1,404,000	
キヤノン電子	100	1,517.00	151,700	
タムロン	100	1,772.00	177,200	
HOYA	2,000	13,235.00	26,470,000	
ノーリツ鋼機	100	2,515.00	251,500	
エー・アンド・デイ	100	1,041.00	104,100	
朝日インテック	1,100	3,545.00	3,899,500	
キヤノン	4,900	2,050.50	10,047,450	代用有価証券 4,100株
リコー	2,500	709.00	1,772,500	
シチズン時計	1,200	296.00	355,200	
大研医器	100	534.00	53,400	
メニコン	100	6,320.00	632,000	
スノーピーク	100	1,815.00	181,500	

パラマウントベッドホールディングス	100	4,470.00	447,000	
トランザクション	100	937.00	93,700	
ニホンフラッシュ	100	1,322.00	132,200	
前田工織	100	2,602.00	260,200	
永大産業	100	292.00	29,200	
アートネイチャー	100	644.00	64,400	
パンダイナムコホールディングス	1,000	9,501.00	9,501,000	
共立印刷	200	124.00	24,800	
S H O E I	100	3,610.00	361,000	
フランスベッドホールディングス	100	901.00	90,100	
マーベラス	100	864.00	86,400	
パイロットコーポレーション	200	2,970.00	594,000	
萩原工業	100	1,520.00	152,000	
エイベックス	200	1,025.00	205,000	
トッパン・フォームズ	200	1,049.00	209,800	
フジシールインターナショナル	200	2,043.00	408,600	
タカラトミー	400	941.00	376,400	
廣済堂	100	685.00	68,500	
レック	100	1,395.00	139,500	
三光合成	100	378.00	37,800	
プロネクサス	100	1,045.00	104,500	
ホクシン	100	109.00	10,900	
大建工業	100	1,885.00	188,500	
きもと	200	196.00	39,200	
凸版印刷	1,400	1,508.00	2,111,200	
大日本印刷	1,300	1,905.00	2,476,500	
N I S S H A	200	1,496.00	299,200	
藤森工業	100	4,775.00	477,500	
ヴィア・ホールディングス	100	236.00	23,600	
前澤化成工業	100	988.00	98,800	
未来工業	100	1,805.00	180,500	
アシックス	900	2,058.00	1,852,200	
J S P	100	1,714.00	171,400	
ニチハ	100	3,150.00	315,000	
エフピコ	200	4,210.00	842,000	
ヤマハ	600	6,070.00	3,642,000	
クリナップ	100	490.00	49,000	
ピジョン	600	4,565.00	2,739,000	
天馬	100	2,035.00	203,500	
キングジム	100	912.00	91,200	
象印マホービン	300	1,869.00	560,700	
リンテック	200	2,260.00	452,000	
信越ポリマー	200	976.00	195,200	
東リ	200	251.00	50,200	
イトーキ	200	359.00	71,800	
任天堂	600	61,620.00	36,972,000	
三菱鉛筆	200	1,469.00	293,800	
タカラスタANDARD	200	1,493.00	298,600	
コクヨ	500	1,462.00	731,000	
ナカバヤシ	100	623.00	62,300	

ニフコ	400	3,815.00	1,526,000	
オカムラ	300	949.00	284,700	
バルカー	100	2,079.00	207,900	
伊藤忠商事	6,800	2,906.50	19,764,200	
丸紅	10,200	670.30	6,837,060	
スクロール	100	726.00	72,600	
ヨンドシーホールディングス	100	1,959.00	195,900	
三陽商会	100	575.00	57,500	
長瀬産業	500	1,487.00	743,500	
蝶理	100	1,617.00	161,700	
豊田通商	1,100	3,895.00	4,284,500	
オンワードホールディングス	600	210.00	126,000	
三共生興	100	485.00	48,500	
兼松	400	1,277.00	510,800	
美津濃	100	1,992.00	199,200	
三井物産	8,400	1,881.50	15,804,600	
日本紙パルプ商事	100	3,610.00	361,000	
東京エレクトロン	600	36,450.00	21,870,000	
カメイ	100	1,212.00	121,200	
セイコーホールディングス	100	1,389.00	138,900	
山善	400	1,064.00	425,600	
住友商事	6,200	1,332.50	8,261,500	
日本ユニシス	300	3,875.00	1,162,500	
三菱商事	6,400	2,528.50	16,182,400	代用有価証券 5,200株
キヤノンマーケティングジャパン	200	2,330.00	466,000	
西華産業	100	1,334.00	133,400	
佐藤商事	100	997.00	99,700	
菱洋エレクトロ	100	2,798.00	279,800	
東京産業	100	586.00	58,600	
ユアサ商事	100	3,485.00	348,500	
トルク	100	260.00	26,000	
阪和興業	200	2,788.00	557,600	
正栄食品工業	100	3,725.00	372,500	
カナデン	100	1,331.00	133,100	
菱電商事	100	1,512.00	151,200	
ニプロ	700	1,243.00	870,100	
フルサト工業	100	1,322.00	132,200	
岩谷産業	300	6,180.00	1,854,000	
イワキ	100	530.00	53,000	
兼松エレクトロニクス	100	4,095.00	409,500	
三愛石油	200	1,219.00	243,800	
稲畑産業	200	1,453.00	290,600	
明和産業	100	479.00	47,900	
キムラタン	600	25.00	15,000	
ヤマエ久野	100	1,222.00	122,200	
ゴールドウイン	200	7,170.00	1,434,000	
ユニ・チャーム	2,100	4,825.00	10,132,500	
デサント	200	1,873.00	374,600	
ワキタ	200	1,121.00	224,200	

ヤマトインターナショナル	100	343.00	34,300	
東邦ホールディングス	300	1,885.00	565,500	
サンゲツ	300	1,536.00	460,800	
ミツウロコグループホールディングス	100	1,407.00	140,700	
伊藤忠エネクス	200	1,018.00	203,600	
サンリオ	300	1,498.00	449,400	
サンワテクノス	100	1,018.00	101,800	
リョーサン	100	1,894.00	189,400	
新光商事	100	740.00	74,000	
三信電気	100	2,162.00	216,200	
東陽テクニカ	100	1,125.00	112,500	
モスフードサービス	100	2,894.00	289,400	
加賀電子	100	2,295.00	229,500	
三益半導体工業	100	2,767.00	276,700	
ソーダニッカ	100	530.00	53,000	
立花エレテック	100	1,668.00	166,800	
木曽路	100	2,408.00	240,800	
S R Sホールディングス	100	848.00	84,800	
千趣会	200	350.00	70,000	
タカキュー	100	135.00	13,500	
リテールパートナーズ	100	1,438.00	143,800	
ケーヨー	200	746.00	149,200	
上新電機	100	2,775.00	277,500	
日本瓦斯	200	5,630.00	1,126,000	
ロイヤルホールディングス	200	1,935.00	387,000	
いなげや	100	1,904.00	190,400	
島忠	200	5,480.00	1,096,000	
チヨダ	100	932.00	93,200	
ライフコーポレーション	100	3,555.00	355,500	
リンガーハット	100	2,339.00	233,900	
MrMaxHD	100	840.00	84,000	
テンアライド	100	321.00	32,100	
AOKIホールディングス	200	502.00	100,400	
オークワ	200	1,337.00	267,400	
コメリ	200	2,853.00	570,600	
青山商事	200	523.00	104,600	
しまむら	100	10,450.00	1,045,000	
はせがわ	100	297.00	29,700	
高島屋	700	861.00	602,700	
松屋	200	777.00	155,400	
エイチ・ツー・オーリテイリング	500	695.00	347,500	
丸井グループ	900	1,928.00	1,735,200	
クレディセゾン	700	1,237.00	865,900	
アクシアルリテイリング	100	4,865.00	486,500	
井筒屋	100	182.00	18,200	
イオン	3,800	3,050.00	11,590,000	
イズミ	200	3,815.00	763,000	
平和堂	200	2,153.00	430,600	
フジ	100	1,966.00	196,600	
ヤオコー	100	6,980.00	698,000	

ゼビオホールディングス	100	835.00	83,500	
ケーズホールディングス	900	1,319.00	1,187,100	
PALTAC	200	5,740.00	1,148,000	
三谷産業	100	508.00	50,800	
Olympicグループ	100	958.00	95,800	
日産東京販売ホールディングス	100	258.00	25,800	
新生銀行	700	1,234.00	863,800	
あおぞら銀行	600	1,894.00	1,136,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	66,800	445.60	29,766,080	
りそなホールディングス	10,600	371.20	3,934,720	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,800	3,145.00	5,661,000	
三井住友フィナンシャルグループ	6,800	3,123.00	21,236,400	
千葉銀行	3,300	587.00	1,937,100	
群馬銀行	1,900	327.00	621,300	
武蔵野銀行	100	1,564.00	156,400	
千葉興業銀行	300	264.00	79,200	
筑波銀行	400	195.00	78,000	
七十七銀行	300	1,441.00	432,300	
青森銀行	100	2,471.00	247,100	
秋田銀行	100	1,381.00	138,100	
山形銀行	100	1,053.00	105,300	
岩手銀行	100	2,083.00	208,300	
東邦銀行	900	219.00	197,100	
みちのく銀行	100	1,114.00	111,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	800	1,882.00	1,505,600	
静岡銀行	2,400	765.00	1,836,000	
十六銀行	100	1,938.00	193,800	
スルガ銀行	1,000	333.00	333,000	
八十二銀行	2,400	353.00	847,200	
山梨中央銀行	100	769.00	76,900	
大垣共立銀行	200	2,247.00	449,400	
福井銀行	100	1,865.00	186,500	
北國銀行	100	2,775.00	277,500	
滋賀銀行	200	2,315.00	463,000	
南都銀行	200	1,831.00	366,200	
百五銀行	900	308.00	277,200	
京都銀行	300	5,370.00	1,611,000	
紀陽銀行	300	1,532.00	459,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	700	1,036.00	725,200	
山陰合同銀行	600	529.00	317,400	
中国銀行	800	856.00	684,800	
伊予銀行	1,400	673.00	942,200	
百十四銀行	100	1,565.00	156,500	
四国銀行	100	704.00	70,400	
阿波銀行	200	2,455.00	491,000	
大分銀行	100	2,184.00	218,400	
宮崎銀行	100	2,245.00	224,500	
佐賀銀行	100	1,351.00	135,100	
沖縄銀行	100	2,914.00	291,400	
琉球銀行	200	825.00	165,000	

セブン銀行	3,300	220.00	726,000
みずほフィナンシャルグループ	13,300	1,324.00	17,609,200
山口フィナンシャルグループ	1,200	624.00	748,800
芙蓉総合リース	100	6,550.00	655,000
みずほリース	200	2,966.00	593,200
東京センチュリー	200	7,310.00	1,462,000
SBIホールディングス	1,100	2,770.00	3,047,000
日本証券金融	400	523.00	209,200
アイフル	1,500	262.00	393,000
日本アジア投資	100	223.00	22,300
名古屋銀行	100	2,626.00	262,600
北洋銀行	1,500	233.00	349,500
愛媛銀行	100	1,026.00	102,600
京葉銀行	400	442.00	176,800
栃木銀行	500	182.00	91,000
東和銀行	200	621.00	124,200
福島銀行	100	206.00	20,600
大東銀行	100	628.00	62,800
リコーリース	100	3,050.00	305,000
イオンフィナンシャルサービス	600	1,230.00	738,000
アコム	2,000	461.00	922,000
ジャックス	100	1,838.00	183,800
オリエントコーポレーション	2,600	114.00	296,400
日立キャピタル	200	2,403.00	480,600
オリックス	6,100	1,565.00	9,546,500
三菱UFJリース	2,500	478.00	1,195,000
ジャフコグループ	200	4,770.00	954,000
トモニホールディングス	800	332.00	265,600
大和証券グループ本社	7,800	469.20	3,659,760
野村ホールディングス	17,200	537.50	9,245,000
岡三証券グループ	800	377.00	301,600
丸三証券	300	476.00	142,800
東洋証券	300	139.00	41,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,100	309.00	339,900
水戸証券	300	237.00	71,100
いちよし証券	200	478.00	95,600
松井証券	600	812.00	487,200
SOMPOホールディングス	1,800	4,050.00	7,290,000
日本取引所グループ	2,800	2,464.50	6,900,600
マネックスグループ	700	341.00	238,700
極東証券	100	701.00	70,100
岩井コスモホールディングス	100	1,278.00	127,800
藍澤證券	200	740.00	148,000
フィデアホールディングス	900	111.00	99,900
池田泉州ホールディングス	1,100	149.00	163,900
アニコムホールディングス	300	1,052.00	315,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,600	3,093.00	8,041,800
マネーパートナーズグループ	100	203.00	20,300

スパークス・グループ	500	258.00	129,000	
第一生命ホールディングス	5,500	1,605.00	8,827,500	
東京海上ホールディングス	3,500	5,208.00	18,228,000	
イー・ギャランティ	100	2,082.00	208,200	
アサックス	100	703.00	70,300	
T & Dホールディングス	2,900	1,180.00	3,422,000	
三井不動産	4,700	2,265.50	10,647,850	
三菱地所	6,800	1,738.00	11,818,400	
平和不動産	200	3,495.00	699,000	
東京建物	1,000	1,468.00	1,468,000	
ダイビル	300	1,344.00	403,200	
京阪神ビルディング	200	1,924.00	384,800	
住友不動産	2,200	3,461.00	7,614,200	
テオーシー	200	692.00	138,400	
レオパレス21	1,300	136.00	176,800	
スターツコーポレーション	100	3,010.00	301,000	
フジ住宅	100	650.00	65,000	
空港施設	100	481.00	48,100	
明和地所	100	550.00	55,000	
ゴールドクレスト	100	1,582.00	158,200	
リログループ	500	2,670.00	1,335,000	
日神グループホールディングス	100	418.00	41,800	
日本エスコン	200	907.00	181,400	
タカラレーベン	400	309.00	123,600	
AVANTIA	100	855.00	85,500	
イオンモール	500	1,660.00	830,000	
ランド	5,300	9.00	47,700	
カチタス	200	3,125.00	625,000	
東祥	100	1,588.00	158,800	
トーセイ	100	1,204.00	120,400	
サンフロンティア不動産	100	897.00	89,700	
エフ・ジェー・ネクスト	100	1,026.00	102,600	
グランディハウス	100	387.00	38,700	
東武鉄道	1,000	3,115.00	3,115,000	
相鉄ホールディングス	300	2,636.00	790,800	
東急	2,500	1,292.00	3,230,000	
京浜急行電鉄	1,300	1,789.00	2,325,700	
小田急電鉄	1,500	3,300.00	4,950,000	
京王電鉄	500	7,790.00	3,895,000	
京成電鉄	700	3,725.00	2,607,500	
富士急行	100	4,570.00	457,000	
東日本旅客鉄道	1,700	6,965.00	11,840,500	
西日本旅客鉄道	900	5,417.00	4,875,300	
東海旅客鉄道	800	14,465.00	11,572,000	
西武ホールディングス	1,300	1,064.00	1,383,200	
鴻池運輸	200	1,010.00	202,000	
西日本鉄道	300	3,020.00	906,000	
ハマキョウレックス	100	2,868.00	286,800	
サカイ引越センター	100	5,350.00	535,000	
近鉄グループホールディングス	900	4,660.00	4,194,000	

阪急阪神ホールディングス	1,300	3,460.00	4,498,000
南海電気鉄道	400	2,662.00	1,064,800
京阪ホールディングス	400	4,975.00	1,990,000
名古屋鉄道	800	2,768.00	2,214,400
山陽電気鉄道	100	1,987.00	198,700
日本通運	300	7,010.00	2,103,000
ヤマトホールディングス	1,600	2,578.00	4,124,800
山九	300	4,015.00	1,204,500
日新	100	1,221.00	122,100
丸運	100	260.00	26,000
丸全昭和運輸	100	3,410.00	341,000
センコーグループホールディングス	500	1,023.00	511,500
ニッコンホールディングス	300	2,084.00	625,200
福山通運	100	4,445.00	444,500
セイノーホールディングス	700	1,438.00	1,006,600
日立物流	200	3,035.00	607,000
丸和運輸機関	100	4,355.00	435,500
C & F ロジホールディングス	100	1,861.00	186,100
日本郵船	800	2,290.00	1,832,000
商船三井	600	3,025.00	1,815,000
川崎汽船	300	1,949.00	584,700
N S ユナイテッド海運	100	1,398.00	139,800
明治海運	100	409.00	40,900
飯野海運	400	427.00	170,800
九州旅客鉄道	800	2,284.00	1,827,200
S Gホールディングス	2,000	2,861.00	5,722,000
日本航空	2,100	1,944.00	4,082,400
A N Aホールディングス	2,300	2,275.50	5,233,650
国際紙パルプ商事	200	251.00	50,200
ブックオフグループホールディングス	100	835.00	83,500
三菱倉庫	300	2,940.00	882,000
三井倉庫ホールディングス	100	2,276.00	227,600
住友倉庫	300	1,359.00	407,700
澁澤倉庫	100	2,368.00	236,800
東陽倉庫	200	327.00	65,400
乾汽船	100	948.00	94,800
日本トランスシティ	200	586.00	117,200
中央倉庫	100	1,162.00	116,200
安田倉庫	100	986.00	98,600
宇徳	100	487.00	48,700
上組	500	1,884.00	942,000
近鉄エクスプレス	200	2,269.00	453,800
東海運	100	322.00	32,200
エーアイティー	100	1,009.00	100,900
T B Sホールディングス	600	1,948.00	1,168,800
日本テレビホールディングス	800	1,160.00	928,000
朝日放送グループホールディングス	100	692.00	69,200
テレビ朝日ホールディングス	300	1,728.00	518,400
スカパーJ S A Tホールディングス	600	513.00	307,800
テレビ東京ホールディングス	100	2,304.00	230,400

ビジョン	100	1,104.00	110,400
コネクシオ	100	1,380.00	138,000
日本通信	800	191.00	152,800
日本電信電話	13,000	2,650.00	34,450,000
KDDI	7,100	2,960.50	21,019,550
ソフトバンク	8,800	1,341.50	11,805,200
光通信	100	25,070.00	2,507,000
エムティーアイ	100	816.00	81,600
GMOインターネット	300	2,925.00	877,500
KADOKAWA	300	3,575.00	1,072,500
学研ホールディングス	100	1,751.00	175,100
ゼンリン	200	1,279.00	255,800
インプレスホールディングス	100	173.00	17,300
東京電力ホールディングス	7,900	272.00	2,148,800
中部電力	3,000	1,224.50	3,673,500
関西電力	3,800	943.60	3,585,680
中国電力	1,400	1,233.00	1,726,200
北陸電力	900	671.00	603,900
東北電力	2,500	840.00	2,100,000
四国電力	900	681.00	612,900
九州電力	2,000	867.00	1,734,000
北海道電力	900	380.00	342,000
沖縄電力	200	1,372.00	274,400
電源開発	800	1,365.00	1,092,000
エフオン	100	1,145.00	114,500
イーレックス	100	1,937.00	193,700
レノバ	200	3,125.00	625,000
東京瓦斯	1,900	2,265.50	4,304,450
大阪瓦斯	1,900	2,034.00	3,864,600
東邦瓦斯	500	6,450.00	3,225,000
北海道瓦斯	100	1,519.00	151,900
広島ガス	200	367.00	73,400
西部瓦斯	100	3,315.00	331,500
静岡ガス	300	1,016.00	304,800
メタウォーター	100	2,303.00	230,300
松竹	100	14,300.00	1,430,000
東宝	600	4,385.00	2,631,000
エイチ・アイ・エス	100	1,683.00	168,300
エヌ・ティ・ティ・データ	2,600	1,362.00	3,541,200
共立メンテナンス	200	3,805.00	761,000
イチネンホールディングス	100	1,314.00	131,400
建設技術研究所	100	2,116.00	211,600
スペース	100	797.00	79,700
アインホールディングス	100	6,420.00	642,000
東京都競馬	100	4,705.00	470,500
カナモト	200	2,306.00	461,200
東京ドーム	400	1,301.00	520,400
DTS	200	2,238.00	447,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	6,420.00	2,568,000

シーイーシー	100	1,543.00	154,300	
カブコン	500	6,590.00	3,295,000	
西尾レントオール	100	2,181.00	218,100	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	500	24.00	12,000	
日本空港ビルデング	300	6,720.00	2,016,000	
トランス・コスモス	100	2,741.00	274,100	
乃村工藝社	400	881.00	352,400	
ジャステック	100	1,337.00	133,700	
SCSK	200	5,760.00	1,152,000	
KNT-CTホールディングス	100	953.00	95,300	
日本管財	100	2,046.00	204,600	
トーカイ	100	2,060.00	206,000	
セコム	1,000	9,762.00	9,762,000	
アイネス	100	1,428.00	142,800	
丹青社	200	867.00	173,400	
メイテック	100	5,160.00	516,000	
TKC	100	6,900.00	690,000	
富士ソフト	100	5,020.00	502,000	
応用地質	100	1,265.00	126,500	
船井総研ホールディングス	200	2,575.00	515,000	
NSD	300	2,021.00	606,300	
オオバ	100	750.00	75,000	
コナミホールディングス	400	6,000.00	2,400,000	
ベネッセホールディングス	300	2,119.00	635,700	
イオンディライト	100	2,569.00	256,900	
ナック	100	930.00	93,000	
ダイセキ	200	3,020.00	604,000	
日鉄物産	100	3,830.00	383,000	
トラスコ中山	200	2,857.00	571,400	
ヤマダホールディングス	3,000	529.00	1,587,000	
オートバックスセブン	400	1,379.00	551,600	
モリト	100	642.00	64,200	
アークランドサカモト	200	1,765.00	353,000	
ニトリホールディングス	400	21,430.00	8,572,000	
グルメ杵屋	100	1,004.00	100,400	
愛眼	100	255.00	25,500	
ケーユーホールディングス	100	827.00	82,700	
吉野家ホールディングス	300	1,921.00	576,300	
加藤産業	100	3,420.00	342,000	
イノテック	100	1,012.00	101,200	
イエローハット	200	1,561.00	312,200	
JBCホールディングス	100	1,483.00	148,300	
JKホールディングス	100	867.00	86,700	
サガミホールディングス	100	1,261.00	126,100	
日伝	100	2,271.00	227,100	
関西スーパーマーケット	100	1,265.00	126,500	
ミロク情報サービス	100	2,027.00	202,700	
北沢産業	100	269.00	26,900	
杉本商事	100	2,474.00	247,400	

因幡電機産業	300	2,501.00	750,300	
王将フードサービス	100	5,930.00	593,000	
プレナス	100	1,742.00	174,200	
ミニストップ	100	1,416.00	141,600	
アークス	200	2,235.00	447,000	
バローホールディングス	200	2,624.00	524,800	
ミスミグループ本社	1,200	3,420.00	4,104,000	
アルテック	100	301.00	30,100	
大 庄	100	1,011.00	101,100	
ファーストリテイリング	100	84,380.00	8,438,000	
ソフトバンクグループ	7,700	7,999.00	61,592,300	
スズケン	400	3,940.00	1,576,000	
サンドラッグ	400	4,245.00	1,698,000	
サックスパー ホールディングス	100	546.00	54,600	
ジェコス	100	963.00	96,300	
グローセル	100	443.00	44,300	
ペルーナ	200	934.00	186,800	
合計	1,042,000		2,427,329,480	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

新光外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年12月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	100,674,889
コール・ローン	5,311,296
株式	1,829,534,223
新株予約権証券	10,712
投資信託受益証券	3,590,811
投資証券	37,297,531
派生商品評価勘定	148,122
未収入金	3,684
未収配当金	1,913,150
差入委託証拠金	51,419,865
流動資産合計	2,029,904,283
資産合計	2,029,904,283
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	661,518
未払金	3,657,687
流動負債合計	4,319,205
負債合計	4,319,205
純資産の部	
元本等	
元本	705,883,416
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,319,701,662
元本等合計	2,025,585,078
純資産合計	2,025,585,078
負債純資産合計	2,029,904,283

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15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>
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	2020年12月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	979,392,436円
同期中追加設定元本額	160,921,161円
同期中一部解約元本額	434,430,181円
元本の内訳 ファンド名	
新光7資産バランスファンド	219,462,544円
新光外国株式インデックスVA	307,072,820円

世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	135,644,143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)	5,512,007円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	18,039,020円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	9,484,031円
グローバル・ナビ	10,668,851円
計	705,883,416円
2. 受益権の総数	705,883,416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 2019年12月17日 至 2020年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年12月15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	2020年12月15日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	67,342,400	
新株予約権証券	1,041	
投資信託受益証券	71,566	
投資証券	84,141	
合計	67,328,784	

(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2020年12月15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	2020年12月15日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	149,759,041	-	149,245,645	513,396
合計	149,759,041	-	149,245,645	513,396

(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)

	2020年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8696円 (28,696円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2020年12月15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	166	3,156.970	524,057.020	
	ABBOTT LABORATORIES	693	106.790	74,005.470	
	AES CORP	262	21.300	5,580.600	
	ABIOMED INC	20	267.620	5,352.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	342	123.530	42,247.260	
	ADVANCED MICRO DEVICES	454	94.780	43,030.120	
	ADOBE INC	187	486.420	90,960.540	
	CHUBB LTD	180	150.860	27,154.800	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	89	265.400	23,620.600	
	ALLEGHANY CORP	7	586.970	4,108.790	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	34	169.540	5,764.360	
	ALLSTATE CORP	121	104.870	12,689.270	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	275	211.850	58,258.750	
	AMGEN INC	224	229.460	51,399.040	
	HESS CORP	110	53.900	5,929.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	265	117.360	31,100.400	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	193	82.210	15,866.530	
	AFLAC INC	256	44.200	11,315.200	
	AMERICAN INTL GROUP	324	38.160	12,363.840	
	AMERCO	2	429.100	858.200	
	ANALOG DEVICES	146	142.330	20,780.180	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	79	156.310	12,348.490	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	294	45.100	13,259.400	
	VALERO ENERGY CORP	158	56.390	8,909.620	
	ANSYS INC	34	343.390	11,675.260	
	APPLE INC	6,654	121.780	810,324.120	
	APPLIED MATERIALS INC	365	88.500	32,302.500	
	ALBEMARLE CORP	43	134.570	5,786.510	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	234	48.690	11,393.460	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	34	79.140	2,690.760	
	AMEREN CORP	92	77.240	7,106.080	
	ARROW ELECTRONICS INC	21	95.080	1,996.680	
	AUTOLIV INC	26	90.540	2,354.040	
	AUTODESK INC	83	288.330	23,931.390	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	165	173.150	28,569.750		
AUTOZONE INC	9	1,151.130	10,360.170		
AVERY DENNISON CORP	32	148.770	4,760.640		
BALL CORP	129	90.300	11,648.700		

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	543	222.850	121,007.550	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	310	39.830	12,347.300	
BAXTER INTERNATIONAL INC	203	78.830	16,002.490	
BECTON DICKINSON & CO	112	240.000	26,880.000	
AMETEK INC	88	116.300	10,234.400	
VERIZON COMM INC	1,608	59.980	96,447.840	
WR BERKLEY CORP	47	64.110	3,013.170	
BEST BUY CO INC	93	101.280	9,419.040	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	8	579.650	4,637.200	
YUM! BRANDS INC	120	105.500	12,660.000	
FIRSTENERGY CORP	236	30.350	7,162.600	
BOEING CO	208	228.620	47,552.960	
ROBERT HALF INTL INC	53	63.080	3,343.240	
BORGWARNER INC	76	36.340	2,761.840	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	530	33.450	17,728.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	46	91.780	4,221.880	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	44	195.200	8,588.800	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	10	1,139.260	11,392.600	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	878	59.970	52,653.660	
ONEOK INC	171	40.140	6,863.940	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24	86.850	2,084.400	
UNITED RENTALS INC	26	238.890	6,211.140	
SEMPRA ENERGY	110	128.040	14,084.400	
FEDEX CORP	98	285.540	27,982.920	
VERISIGN INC	44	212.110	9,332.840	
AMPHENOL CORP	115	130.300	14,984.500	
BROWN-FORMAN CORP	126	75.530	9,516.780	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	494	6.330	3,127.020	
CSX CORP	289	88.920	25,697.880	
CABOT OIL & GAS CORP	185	17.250	3,191.250	
CAMPBELL SOUP CO	87	46.710	4,063.770	
SEAGATE TECHNOLOGY	97	64.640	6,270.080	
CONSTELLATION BRANDS INC	65	207.000	13,455.000	
CARDINAL HEALTH INC	123	53.550	6,586.650	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	214	20.930	4,479.020	
CATERPILLAR INC	211	178.050	37,568.550	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	42	122.520	5,145.840	
CITRIX SYSTEMS INC	42	128.430	5,394.060	
CENTURYLINK INC	422	10.420	4,397.240	
CERNER CORP	115	74.250	8,538.750	

JPMORGAN CHASE & CO	1,181	118.300	139,712.300	
CHURCH & DWIGHT CO INC	95	86.060	8,175.700	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	69	79.610	5,493.090	
CINTAS CORP	34	347.260	11,806.840	
CISCO SYSTEMS INC	1,621	44.240	71,713.040	
CLOROX COMPANY	47	202.380	9,511.860	
COCA-COLA CO/THE	1,584	53.270	84,379.680	
COPART INC	82	118.290	9,699.780	
COGNEX CORP	70	77.840	5,448.800	
COLGATE-PALMOLIVE CO	309	84.190	26,014.710	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	112	126.620	14,181.440	
MOLINA HEALTHCARE INC	27	199.680	5,391.360	
NRG ENERGY, INC.	115	32.630	3,752.450	
COMCAST CORP-CL A	1,764	50.990	89,946.360	
CONAGRA BRANDS INC	193	35.630	6,876.590	
CONSOLIDATED EDISON INC	126	72.410	9,123.660	
CMS ENERGY CORP	110	59.220	6,514.200	
COOPER COS INC	20	342.850	6,857.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	66	45.920	3,030.720	
CORNING INC	300	36.810	11,043.000	
SEALED AIR CORP	49	43.700	2,141.300	
HEICO CORP-CL A	36	120.550	4,339.800	
CUMMINS INC	57	216.410	12,335.370	
DR HORTON INC	139	70.400	9,785.600	
DANAHER CORP	252	221.100	55,717.200	
MOODY'S CORP	68	274.620	18,674.160	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	221	79.190	17,500.990	
TARGET CORP	196	170.990	33,514.040	
DEERE & CO	118	252.720	29,820.960	
MORGAN STANLEY	523	61.880	32,363.240	
REPUBLIC SERVICES INC	90	94.900	8,541.000	
COSTAR GROUP INC	15	853.200	12,798.000	
THE WALT DISNEY CO	704	169.300	119,187.200	
DOLLAR TREE INC	88	107.680	9,475.840	
DOVER CORP	54	120.130	6,487.020	
OMNICOM GROUP	94	63.580	5,976.520	
DTE ENERGY CO	81	123.520	10,005.120	
DUKE ENERGY CORP	287	91.130	26,154.310	
DARDEN RESTAURANTS INC	55	112.510	6,188.050	
EBAY INC	280	49.570	13,879.600	
BANK OF AMERICA CORP	3,016	28.220	85,111.520	
CITIGROUP INC	793	58.740	46,580.820	
EASTMAN CHEMICAL CO	55	100.190	5,510.450	
EATON CORP PLC	161	113.840	18,328.240	
CADENCE DESIGN SYS INC	111	121.310	13,465.410	
DISH NETWORK CORP	103	35.030	3,608.090	

ECOLAB INC	99	217.000	21,483.000	
PERKINELMER INC	41	145.320	5,958.120	
ELECTRONIC ARTS INC	119	137.540	16,367.260	
SALESFORCE.COM INC	356	221.270	78,772.120	
ERIE INDEMNITY CO	6	235.720	1,414.320	
EMERSON ELECTRIC CO	243	80.410	19,539.630	
ATMOS ENERGY CORP	44	99.510	4,378.440	
ENTERGY CORP	73	101.410	7,402.930	
EOG RESOURCES INC	233	52.080	12,134.640	
EQUIFAX INC	45	189.120	8,510.400	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	86	247.450	21,280.700	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	55	90.180	4,959.900	
EXXON MOBIL CORP	1,622	42.220	68,480.840	
FMC CORP	47	114.520	5,382.440	
NEXTERA ENERGY INC	769	73.550	56,559.950	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12	344.890	4,138.680	
FAIR ISAAC CORP	11	517.640	5,694.040	
ASSURANT INC	17	131.650	2,238.050	
FASTENAL CO	227	49.220	11,172.940	
FIFTH THIRD BANCORP	285	26.620	7,586.700	
M&T BANK CORP	48	124.760	5,988.480	
FISERV INC	217	113.630	24,657.710	
FORD MOTOR CO	1,582	8.910	14,095.620	
FRANKLIN RESOURCES INC	142	23.730	3,369.660	
FREEMPORT-MCMORAN INC	586	23.800	13,946.800	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	72	120.500	8,676.000	
DENTSPLY SIRONA INC	89	52.230	4,648.470	
GENERAL DYNAMICS CORP	92	153.340	14,107.280	
GENERAL MILLS INC	241	59.350	14,303.350	
GENUINE PARTS CO	62	95.820	5,940.840	
GILEAD SCIENCES INC	473	59.840	28,304.320	
GARTNER INC	31	154.590	4,792.290	
MCKESSON CORP	66	172.330	11,373.780	
NVIDIA CORP	241	532.350	128,296.350	
GENERAL ELECTRIC CO	3,390	10.830	36,713.700	
WW GRAINGER INC	17	400.460	6,807.820	
HALLIBURTON CO	348	18.960	6,598.080	
MONSTER BEVERAGE CORP	161	88.420	14,235.620	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	123	237.790	29,248.170	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	85	189.950	16,145.750	
HASBRO INC	54	90.110	4,865.940	
HENRY SCHEIN INC	59	68.070	4,016.130	
HEICO CORP	13	132.330	1,720.290	
HERSHEY FOODS CORP	55	149.140	8,202.700	
HP INC	567	23.210	13,160.070	
F5 NETWORKS INC	19	171.200	3,252.800	
CROWN HOLDINGS INC NPR	52	95.190	4,949.880	

JUNIPER NETWORKS INC	161	22.080	3,554.880	
HOLOGIC INC	97	74.170	7,194.490	
HOME DEPOT INC	419	265.580	111,278.020	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	81	82.850	6,710.850	
HORMEL FOODS CORP	102	47.200	4,814.400	
CENTERPOINT ENERGY INC	182	21.640	3,938.480	
LENNOX INTERNATIONAL INC	15	273.000	4,095.000	
HUMANA INC	51	388.230	19,799.730	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	38	133.780	5,083.640	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	459	12.510	5,742.090	
BIOGEN INC	59	245.250	14,469.750	
IDEX CORP	26	192.670	5,009.420	
ILLINOIS TOOL WORKS	122	199.670	24,359.740	
INTUIT INC	101	365.510	36,916.510	
IDEXX LABORATORIES INC	33	458.170	15,119.610	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	63	47.830	3,013.290	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	96	137.710	13,220.160	
INTEL CORP	1,642	50.470	82,871.740	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	29	109.250	3,168.250	
INTERNATIONAL PAPER CO	129	48.010	6,193.290	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	144	23.700	3,412.800	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	48	105.260	5,052.480	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	29	157.380	4,564.020	
INCYTE CORP	83	86.810	7,205.230	
JOHNSON & JOHNSON	1,026	149.070	152,945.820	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	140	45.540	6,375.600	
KLA CORPORATION	59	260.130	15,347.670	
KELLOGG CO	98	61.920	6,068.160	
KEYCORP	333	15.430	5,138.190	
KIMBERLY-CLARK CORP	136	136.000	18,496.000	
BLACKROCK INC/NEW YORK	60	683.920	41,035.200	
KROGER CO	316	31.300	9,890.800	
LAM RESEARCH CORP	56	491.870	27,544.720	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	13	380.900	4,951.700	
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	131.680	4,608.800	
AKAMAI TECHNOLOGIES	59	103.270	6,092.930	
LENNAR CORP	112	74.680	8,364.160	
ELI LILLY & CO	332	157.910	52,426.120	

LINCOLN NATIONAL CORP	67	50.050	3,353.350	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	275	166.620	45,820.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	126	116.740	14,709.240	
LOCKHEED MARTIN CORP	98	357.660	35,050.680	
LOEWS CORP	116	42.870	4,972.920	
LOWE'S COS INC	297	160.090	47,546.730	
DOMINION ENERGY INC	329	74.470	24,500.630	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	181	29.510	5,341.310	
MCCORMICK & CO INC	108	93.280	10,074.240	
MCDONALD'S CORPORATION	293	211.920	62,092.560	
S&P GLOBAL INC	93	323.680	30,102.240	
EVEREST RE GROUP LTD	19	229.700	4,364.300	
MARKEL CORPORATION	5	992.690	4,963.450	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	246	83.570	20,558.220	
MARSH & MCLENNAN COS	196	114.920	22,524.320	
MASCO CORP	94	55.060	5,175.640	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	26	259.700	6,752.200	
METLIFE INC	309	45.840	14,164.560	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	103	85.310	8,786.930	
MEDTRONIC PLC	523	111.970	58,560.310	
ACTIVISION BLIZZARD INC	304	85.940	26,125.760	
CVS HEALTH CORP	505	69.720	35,208.600	
MERCK & CO. INC.	991	80.320	79,597.120	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	184	30.820	5,670.880	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	39	204.110	7,960.290	
MICROSOFT CORP	2,797	214.200	599,117.400	
MICRON TECH INC	425	71.540	30,404.500	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	103	141.500	14,574.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	259	44.330	11,481.470	
3M CO	223	173.080	38,596.840	
MOHAWK INDUSTRIES INC	25	131.530	3,288.250	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	68	165.920	11,282.560	
KANSAS CITY SOUTHERN	37	192.020	7,104.740	
ILLUMINA INC	56	347.110	19,438.160	
XCEL ENERGY INC	199	65.040	12,942.960	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	40	93.460	3,738.400	
NETAPP INC	94	61.670	5,796.980	
NEWELL BRANDS INC	181	20.320	3,677.920	
NEWMONT CORP	299	57.560	17,210.440	
NVR INC	1	4,022.000	4,022.000	

NIKE INC-CL B	488	136.280	66,504.640	
NORDSON CORP	22	199.720	4,393.840	
NORFOLK SOUTHERN CORP	99	229.250	22,695.750	
EVERSOURCE ENERGY	132	85.460	11,280.720	
NISOURCE INC	157	22.650	3,556.050	
NORTHERN TRUST CORP	72	88.580	6,377.760	
NORTHROP GRUMMAN CORP	61	298.000	18,178.000	
WELLS FARGO & CO	1,490	28.640	42,673.600	
NUCOR CORP	125	55.660	6,957.500	
CHENIERE ENERGY INC	73	59.180	4,320.140	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	176	90.420	15,913.920	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	370	19.170	7,092.900	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	35	195.350	6,837.250	
OGE ENERGY CORP	71	32.080	2,277.680	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	27	447.550	12,083.850	
ORACLE CORP	770	60.760	46,785.200	
PACCAR INC	136	84.460	11,486.560	
PTC INC	40	113.830	4,553.200	
EXELON CORP	385	41.060	15,808.100	
PARKER HANNIFIN CORP	52	270.090	14,044.680	
PAYCHEX INC	121	91.330	11,050.930	
ALIGN TECHNOLOGY INC	29	504.310	14,624.990	
PPL CORPORATION	287	27.600	7,921.200	
PEPSICO INC	532	144.230	76,730.360	
PENTAIR PLC	48	51.360	2,465.280	
PFIZER INC	2,163	39.210	84,811.230	
ESSENTIAL UTILITIES INC	83	47.070	3,906.810	
CONOCOPHILLIPS	437	42.320	18,493.840	
PG&E CORP	524	11.850	6,209.400	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	64	113.110	7,239.040	
ALTRIA GROUP INC	716	42.900	30,716.400	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	164	141.790	23,253.560	
BROWN & BROWN INC	112	45.450	5,090.400	
GARMIN LTD	58	117.210	6,798.180	
PPG INDUSTRIES INC	91	141.760	12,900.160	
IPG PHOTONICS CORP	18	209.110	3,763.980	
COSTCO WHOLESALE CORP	171	374.380	64,018.980	
T ROWE PRICE GROUP INC	93	147.860	13,750.980	
QUEST DIAGNOSTICS	46	123.160	5,665.360	
PROCTER & GAMBLE CO	970	135.850	131,774.500	
PROGRESSIVE CORP	227	94.100	21,360.700	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	196	56.430	11,060.280	
PULTE GROUP INC	98	42.120	4,127.760	

GLOBAL PAYMENTS INC	116	191.880	22,258.080	
QUALCOMM INC	438	146.290	64,075.020	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	54	91.460	4,938.840	
EXACT SCIENCES CORP	65	129.800	8,437.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	24	165.480	3,971.520	
REGENERON PHARMACEUTICALS	41	500.380	20,515.580	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	19	117.630	2,234.970	
RESMED INC	57	206.380	11,763.660	
US BANCORP	527	44.810	23,614.870	
SEAGEN INC	50	193.590	9,679.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	145	33.570	4,867.650	
ROSS STORES INC	141	110.550	15,587.550	
ROLLINS INC	100	38.460	3,846.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	40	422.890	16,915.600	
ROCKWELL AUTOMATION INC	46	242.990	11,177.540	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	71	74.060	5,258.260	
RPM INTERNATIONAL INC	50	86.440	4,322.000	
ACCENTURE PLC-CL A	249	243.750	60,693.750	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	550	57.290	31,509.500	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	48	205.760	9,876.480	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	102	133.990	13,666.980	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	242	144.220	34,901.240	
BOOKING HOLDINGS INC	16	2,066.010	33,056.160	
SCHLUMBERGER LTD	520	22.180	11,533.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	595	49.840	29,654.800	
POOL CORP	13	346.580	4,505.540	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	79	142.590	11,264.610	
BUNGE LTD	45	63.780	2,870.100	
SEI INVESTMENTS CO	33	55.490	1,831.170	
ANTHEM INC	98	310.100	30,389.800	
AMERISOURCEBERGEN CORP	56	97.120	5,438.720	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	118	47.820	5,642.760	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	33	718.850	23,722.050	
CENTENE CORP	231	59.730	13,797.630	
SVB FINANCIAL GROUP	20	349.490	6,989.800	
SMITH (A.O.) CORP	63	55.410	3,490.830	
SNAP-ON INC	15	175.180	2,627.700	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	151	76.610	11,568.110	
ADVANCE AUTO PARTS	31	157.560	4,884.360	

EDISON INTERNATIONAL	159	62.260	9,899.340	
SOUTHERN CO	418	59.660	24,937.880	
TRUIST FINANCIAL CORP	532	45.910	24,424.120	
SOUTHWEST AIRLINES	68	45.260	3,077.680	
AT&T INC	2,763	30.550	84,409.650	
CHEVRON CORP	749	89.440	66,990.560	
STANLEY BLACK & DECKER INC	64	170.400	10,905.600	
STATE STREET CORP	142	70.700	10,039.400	
STARBUCKS CORP	457	103.320	47,217.240	
STEEL DYNAMICS INC	67	37.940	2,541.980	
STRYKER CORP	130	230.950	30,023.500	
NETFLIX INC	171	522.420	89,333.820	
NORTONLIFELOCK INC	249	19.870	4,947.630	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	58	40.680	2,359.440	
SYNOPSIS INC	61	238.860	14,570.460	
SYSCO CORP	192	73.430	14,098.560	
INTUITIVE SURGICAL INC	45	764.790	34,415.550	
TELEFLEX INC	17	380.670	6,471.390	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	357	10.310	3,680.670	
TERADYNE INC	58	117.180	6,796.440	
TEXAS INSTRUMENTS INC	355	160.120	56,842.600	
TEXTRON INC	91	46.740	4,253.340	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	156	467.130	72,872.280	
TIFFANY & CO	49	131.110	6,424.390	
GLOBE LIFE INC	31	91.770	2,844.870	
DAVITA INC	29	109.190	3,166.510	
TRACTOR SUPPLY CO	47	140.530	6,604.910	
TRIMBLE INC	102	64.640	6,593.280	
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	446.490	6,697.350	
TYSON FOODS INC	111	69.780	7,745.580	
UGI CORP	101	34.980	3,532.980	
UNION PACIFIC CORP	263	198.000	52,074.000	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	603	70.800	42,692.400	
UNITEDHEALTH GROUP INC	370	336.130	124,368.100	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	29	134.560	3,902.240	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	35	174.130	6,094.550	
VF CORP	128	85.750	10,976.000	
VIACOMCBS INC	241	34.670	8,355.470	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	104	228.130	23,725.520	
VULCAN MATERIALS CO	52	135.440	7,042.880	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	298	41.480	12,361.040	
WALMART INC	554	145.650	80,690.100	
WASTE MANAGEMENT INC	169	114.780	19,397.820	
WATERS CORP	23	240.750	5,537.250	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	31	264.920	8,212.520	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	42	113.250	4,756.500	
VAIL RESORTS INC	17	278.760	4,738.920	
WESTERN DIGITAL CORP	124	51.140	6,341.360	
WABTEC CORP	80	73.260	5,860.800	
WHIRLPOOL CORP	21	184.030	3,864.630	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	66	139.260	9,191.160	
WYNN RESORTS LTD	43	107.540	4,624.220	
NASDAQ INC	43	124.040	5,333.720	
CME GROUP INC	136	177.550	24,146.800	
WILLIAMS COS INC	497	21.510	10,690.470	
LKQ CORP	92	36.610	3,368.120	
ALLIANT ENERGY CORP	84	51.340	4,312.560	
WEC ENERGY GROUP INC	120	91.580	10,989.600	
CARMAX INC	63	92.540	5,830.020	
XILINX INC	94	149.030	14,008.820	
TJX COMPANIES INC	463	65.340	30,252.420	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	20	383.460	7,669.200	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	343	4.230	1,450.890	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	100	55.950	5,595.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	100	25.830	2,583.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	44	132.690	5,838.360	
CBRE GROUP INC	131	65.130	8,532.030	
LIBERTY GLOBAL PLC	59	24.570	1,449.630	
REGIONS FINANCIAL CORP	392	15.150	5,938.800	
DOMINO'S PIZZA INC	17	383.230	6,514.910	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	18	319.460	5,750.280	
T-MOBILE US INC	222	129.360	28,717.920	
LAS VEGAS SANDS CORP	149	56.530	8,422.970	
MOSAIC CO/THE	166	22.680	3,764.880	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	16	551.150	8,818.400	
CELANESE CORP	42	128.990	5,417.580	
DEXCOM INC	37	353.590	13,082.830	
DISCOVERY INC-A	95	28.650	2,721.750	
EXPEDIA GROUP INC	52	123.330	6,413.160	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	98	38.820	3,804.360	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	45	190.990	8,594.550	

LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	177	23.630	4,182.510	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	217	107.710	23,373.070	
LIVE NATION	61	70.350	4,291.350	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11	1,309.520	14,404.720	
TRANSDIGM GROUP INC	21	595.820	12,512.220	
MASTERCARD INC	345	331.150	114,246.750	
WESTERN UNION CO	179	22.070	3,950.530	
OWENS CORNING	51	72.650	3,705.150	
LEIDOS HOLDINGS INC	61	104.130	6,351.930	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	126	18.000	2,268.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	45	146.100	6,574.500	
DELTA AIR LINES INC	71	40.690	2,888.990	
INSULET CORP	25	239.050	5,976.250	
DISCOVER FINANCIAL	126	82.630	10,411.380	
TE CONNECTIVITY LTD	133	117.170	15,583.610	
MASIMO CORP	22	263.000	5,786.000	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	78	61.590	4,804.020	
LULULEMON ATHLETICA INC	48	352.370	16,913.760	
VMWARE INC	37	143.660	5,315.420	
MERCADOLIBRE INC	18	1,618.060	29,125.080	
ULTA BEAUTY INC	20	265.790	5,315.800	
INVESCO LTD	193	17.100	3,300.300	
MSCI INC	32	423.900	13,564.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	602	84.400	50,808.800	
VISA INC	653	207.250	135,334.250	
KEURIG DR PEPPER INC	190	30.350	5,766.500	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	71	148.550	10,547.050	
DISCOVERY INC-C	89	25.210	2,243.690	
MARATHON PETROLEUM CORP	256	40.760	10,434.560	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	57	83.070	4,734.990	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	762	14.310	10,904.220	
XYLEM INC	78	97.140	7,576.920	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	109	87.100	9,493.900	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	14	174.980	2,449.720	
SPLUNK INC	62	159.380	9,881.560	
EPAM SYSTEMS INC	19	325.220	6,179.180	
ZILLOW GROUP INC	26	137.650	3,578.900	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	60	47.830	2,869.800	
HCA HEALTHCARE INC	104	160.860	16,729.440	
VERISK ANALYTICS INC	60	194.770	11,686.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	149.230	2,387.680	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	31	271.160	8,405.960	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	67	129.260	8,660.420	
NXP SEMICONDUCTOR NV	113	158.460	17,905.980	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	62	88.290	5,473.980	
LEAR CORP	21	156.070	3,277.470	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	37	88.250	3,265.250	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	101	71.490	7,220.490	
DOLLAR GENERAL CORP	97	205.900	19,972.300	
FORTINET INC	51	130.690	6,665.190	
HORIZON PHARMA PLC	78	77.870	6,073.860	
TESLA INC	290	639.830	185,550.700	
GENERAC HOLDINGS INC	20	218.060	4,361.200	
ENPHASE ENERGY INC	44	145.070	6,383.080	
GENERAL MOTORS CO	505	41.620	21,018.100	
XPO LOGISTICS INC	42	120.000	5,040.000	
ALLY FINANCIAL INC	119	33.670	4,006.730	
VOYA FINANCIAL INC	35	57.490	2,012.150	
APTIV PLC	109	121.650	13,259.850	
PHILLIPS 66	172	67.190	11,556.680	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	32	126.230	4,039.360	
FACEBOOK INC	934	274.190	256,093.460	
IQVIA HOLDINGS INC	73	167.300	12,212.900	
SERVICENOW INC	75	532.480	39,936.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	38	314.280	11,942.640	
WORKDAY INC	69	220.370	15,205.530	
ABBVIE INC	681	104.200	70,960.200	
ZOETIS INC	186	159.500	29,667.000	
NEWS CORP/NEW-CL A	154	17.750	2,733.500	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	59	55.860	3,295.740	
CDW CORP	55	131.730	7,245.150	
HOWMET AEROSPACE INC	117	26.810	3,136.770	
TWILIO INC	52	350.090	18,204.680	
COUPA SOFTWARE INC	26	314.790	8,184.540	
SNAP INC	367	51.600	18,937.200	
TRADE DESK INC A	17	922.420	15,681.140	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	90	42.660	3,839.400	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	39	42.520	1,658.280	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	55	42.760	2,351.800	
OKTA INC	48	251.540	12,073.920	

BLACK KNIGHT INC	68	87.930	5,979.240	
BAKER HUGHES CO	258	21.680	5,593.440	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	62	76.540	4,745.480	
ALTICE USA INC-A	99	34.590	3,424.410	
BROADCOM INC	157	411.800	64,652.600	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	29	352.520	10,223.080	
MONGODB INC	20	340.120	6,802.400	
BURLINGTON STORES INC	24	230.510	5,532.240	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	157	28.710	4,507.470	
VEEVA SYSTEMS INC	53	264.780	14,033.340	
TWITTER INC	321	52.020	16,698.420	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	49	49.940	2,447.060	
EVERGY INC	74	54.410	4,026.340	
ALLEGION PLC	42	109.690	4,606.980	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	60	98.750	5,925.000	
STERIS PLC	37	186.330	6,894.210	
DOCUSIGN INC	70	228.330	15,983.100	
WIX.COM LTD	22	260.940	5,740.680	
DROPBOX INC	115	23.320	2,681.800	
KKR & CO INC	194	39.220	7,608.680	
PERRIGO CO PLC	50	46.630	2,331.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	67	395.990	26,531.330	
MODERNA INC	110	155.070	17,057.700	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	116	103.040	11,952.640	
ARAMARK	70	37.240	2,606.800	
CIGNA CORP	140	203.150	28,441.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	106	72.430	7,677.580	
DOW INC	290	53.060	15,387.400	
AMCOR PLC	626	11.270	7,055.020	
PINTEREST INC	175	69.790	12,213.250	
PELOTON INTERACTIVE INC	72	121.910	8,777.520	
FOX CORP-A	156	28.780	4,489.680	
FOX CORP-B	87	28.340	2,465.580	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	54	173.800	9,385.200	
CHEWY INC	40	82.810	3,312.400	
AVANTOR INC	206	26.800	5,520.800	
DYNATRACE INC	62	38.450	2,383.900	
CLOUDFLARE INC	59	81.430	4,804.370	
TRADEWEB MARKETS INC	39	64.700	2,523.300	
CARRIER GLOBAL CORP	332	36.620	12,157.840	
OTIS WORLDWIDE CORP	154	62.780	9,668.120	
UBER TECHNOLOGIES INC	375	51.460	19,297.500	
CORTEVA INC	298	38.760	11,550.480	
MATCH GROUP INC	98	144.810	14,191.380	
SLACK TECHNOLOGIES INC	148	42.260	6,254.480	
BLACKSTONE GROUP INC	253	63.110	15,966.830	

CARLYLE GROUP INC	75	29.400	2,205.000	
10X GENOMICS INC	22	151.750	3,338.500	
DATADOG INC	50	102.270	5,113.500	
INGERSOLL RAND INC	137	43.860	6,008.820	
PAYCOM SOFTWARE INC	18	425.980	7,667.640	
PPD INC	35	34.040	1,191.400	
AON PLC	110	203.960	22,435.600	
IAC/INTERACTIVECORP	31	150.750	4,673.250	
ZENDESK INC	38	137.300	5,217.400	
ROYALTY PHARMA PLC	23	43.120	991.760	
VIATRIS INC	469	17.330	8,127.770	
DRAFTKINGS INC	64	50.580	3,237.120	
SNOWFLAKE INC	11	329.150	3,620.650	
ARISTA NETWORKS INC	23	274.480	6,313.040	
IHS MARKIT LTD	151	88.970	13,434.470	
FNF GROUP	127	37.510	4,763.770	
CATALENT INC	59	97.930	5,777.870	
SYNCHRONY FINANCIAL	213	31.910	6,796.830	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	144	34.620	4,985.280	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	112.760	902.080	
WAYFAIR INC	26	253.480	6,590.480	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	69	123.720	8,536.680	
HUBSPOT INC	15	381.970	5,729.550	
QORVO INC	44	154.510	6,798.440	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	4	158.590	634.360	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	42	161.220	6,771.240	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	77	28.710	2,210.670	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	22	293.320	6,453.040	
GODADDY INC	63	84.600	5,329.800	
ETSY INC	50	169.970	8,498.500	
TRANSUNION	69	97.640	6,737.160	
SQUARE INC	147	215.860	31,731.420	
DUPONT DE NEMOURS INC	281	65.760	18,478.560	
CARVANA CO	26	250.970	6,525.220	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	87	47.000	4,089.000	
TELADOC HEALTH INC	47	194.630	9,147.610	
WESTROCK CO	120	43.020	5,162.400	
KRAFT HEINZ CO	262	34.420	9,018.040	
NOVOCURE LTD	28	168.990	4,731.720	
FORTIVE CORP	121	68.260	8,259.460	
WASTE CONNECTIONS INC	104	101.220	10,526.880	
ALPHABET INC-CL A	116	1,752.260	203,262.160	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	464	11.870	5,507.680	
	PAYPAL HOLDINGS INC	437	220.790	96,485.230	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	156	25.270	3,942.120	
	SUNRUN INC	55	57.100	3,140.500	
	ZILLOW GROUP INC-C	50	134.170	6,708.500	
	ALPHABET INC-CL C	117	1,760.060	205,927.020	
	ZSCALER INC	23	183.450	4,219.350	
	CABLE ONE INC	2	2,144.010	4,288.020	
	LINDE PLC	205	247.600	50,758.000	
	ATHENE HOLDING LTD	44	41.750	1,837.000	
	ROKU INC	40	324.320	12,972.800	
	AVALARA INC	36	169.020	6,084.720	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	55	649.670	35,731.850	
	VISTRA CORP	208	18.140	3,773.120	
アメリカ・ドル	小計	121,575		12,541,600.530 (1,305,831,446)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	144	14.160	2,039.040	
	ASHTAD GROUP	182	33.480	6,093.360	
	SEVERN TRENT PLC	102	23.100	2,356.200	
	BHP GROUP PLC	817	19.404	15,853.060	
	BARCLAYS PLC	6,504	1.423	9,255.190	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	389	6.056	2,355.780	
	BT GROUP PLC	3,397	1.343	4,562.170	
	BUNZL PLC	141	24.790	3,495.390	
	AVIVA PLC	1,384	3.203	4,432.950	
	CRODA INTERNATIONAL	44	64.040	2,817.760	
	DIAGEO PLC	903	29.940	27,035.820	
	SCHRODERS PLC	69	32.100	2,214.900	
	DCC PLC	46	54.980	2,529.080	
	NATIONAL GRID PLC	1,369	8.808	12,058.150	
	KINGFISHER PLC	1,004	2.701	2,711.800	
	BAE SYSTEMS PLC	1,215	5.040	6,123.600	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	893	28.855	25,767.510	
	HALMA PLC	175	23.630	4,135.250	
	NEXT PLC	52	67.460	3,507.920	
	IMPERIAL BRANDS PLC	358	15.640	5,599.120	
	JOHNSON MATTHEY PLC	52	24.100	1,253.200	
	ANGLO AMERICAN PLC	474	24.050	11,399.700	
	COMPASS GROUP PLC	702	14.490	10,171.980	
	HSBC HOLDINGS PLC	7,862	4.034	31,715.300	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,405	2.489	5,986.040	
	UNILEVER PLC	1,065	43.630	46,465.950	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	706	1.806	1,275.030	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	304	9.318	2,832.670	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	442	6.760	2,987.920	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	145	22.840	3,311.800	
PEARSON PLC	373	6.622	2,470.000	
PERSIMMON PLC	130	25.840	3,359.200	
PRUDENTIAL PLC	1,023	13.130	13,431.990	
RIO TINTO PLC	441	55.420	24,440.220	
VODAFONE GROUP PLC	10,724	1.311	14,059.160	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	277	65.440	18,126.880	
RELX PLC	734	17.950	13,175.300	
RENTOKIL INITIAL PLC	662	5.008	3,315.290	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	2,848	1.187	3,380.570	
NATWEST GROUP PLC	2,193	1.578	3,460.550	
ST JAMES'S PLACE PLC	267	10.810	2,886.270	
SSE PLC	439	14.445	6,341.350	
BP PLC	7,809	2.697	21,060.870	
SAGE GROUP PLC(THE)	445	5.860	2,607.700	
SMITHS GROUP PLC	175	15.880	2,779.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	115.000	3,335.000	
STANDARD CHARTERED PLC	1,162	4.747	5,516.010	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	27,809	0.357	9,927.810	
TAYLOR WIMPLEY PLC	1,666	1.567	2,610.620	
TESCO PLC	3,579	2.263	8,099.270	
3I GROUP PLC	329	11.365	3,739.080	
SMITH & NEPHEW PLC	383	15.280	5,852.240	
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,903	13.928	26,504.980	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	125	87.100	10,887.500	
WPP PLC	398	7.838	3,119.520	
ASTRAZENECA PLC	514	76.920	39,536.880	
WHITBREAD PLC	63	31.050	1,956.150	
INTERTEK GROUP PLC	73	57.900	4,226.700	
BURBERRY GROUP PLC	184	18.265	3,360.760	
INTERCONTINENTAL HOTELS	73	46.790	3,415.670	
SAINSBURY (J) PLC	716	2.260	1,618.160	
ADMIRAL GROUP PLC	59	28.650	1,690.350	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	37	43.250	1,600.250	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,646	13.602	22,388.890	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,422	13.094	18,619.660	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	43	25.160	1,081.880	

	AVEVA GROUP PLC	29	31.700	919.300	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,109	2.785	3,088.560	
	EXPERIAN PLC	367	27.510	10,096.170	
	MONDI PLC	190	17.850	3,391.500	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	162	14.445	2,340.090	
	FRESNILLO PLC NPR	28	11.175	312.900	
	OCADO GROUP PLC	213	22.750	4,845.750	
	INFORMA PLC	667	5.544	3,697.840	
	GLENCORE PLC	3,749	2.359	8,843.890	
	ENTAIN PLC	288	10.880	3,133.440	
	EVRAZ PLC	68	4.553	309.600	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	372	2.978	1,107.810	
	COCA-COLA HBC AG	72	23.320	1,679.040	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	130	7.074	919.620	
	FERGUSON PLC	91	87.560	7,967.960	
	M&G PLC	858	1.894	1,625.050	
	JD SPORTS FASHION PLC	119	7.906	940.810	
	AUTO TRADER GROUP PLC	284	5.740	1,630.160	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	1,586	1.630	2,585.180	
イギリス・ポンド 小計		114,480		635,760.040 (88,326,142)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	566	22.390	12,672.740	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	529	19.600	10,368.400	
	ELBIT SYSTEMS LTD	8	390.200	3,121.600	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	204	12.130	2,474.520	
	ICL GROUP LTD	193	15.410	2,974.130	
	NICE LTD	26	796.800	20,716.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	85	71.000	6,035.000	
	AZRIELI GROUP	17	202.800	3,447.600	
イスラエル・シュケル 小計		1,628		61,810.790 (1,974,855)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	65	63.000	4,095.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,101	23.180	25,521.180	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,386	20.030	27,761.580	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	681	22.160	15,090.960	
	TELSTRA CORP LTD	1,589	3.030	4,814.670	
	AMP LTD	697	1.745	1,216.260	
	ASX LTD	70	75.060	5,254.200	
	BHP GROUP LTD	1,129	42.740	48,253.460	
	AMPOL LTD	130	30.640	3,983.200	
	COMPUTERSHARE LT	212	14.350	3,042.200	

CSL LIMITED	174	286.500	49,851.000	
REA GROUP LTD	17	143.740	2,443.580	
TRANSURBAN GROUP	1,044	13.750	14,355.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	102	12.790	1,304.580	
COCHLEAR LTD	22	195.720	4,305.840	
ORIGIN ENERGY LTD	776	5.050	3,918.800	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	689	83.920	57,820.880	
RIO TINTO LIMITED	139	113.940	15,837.660	
APA GROUP	564	10.250	5,781.000	
ARISTOCRAT LEISU	199	30.010	5,971.990	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	925	5.120	4,736.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	185	37.260	6,893.100	
ORICA LTD	100	15.560	1,556.000	
CIMIC GROUP LTD	36	25.700	925.200	
LEND LEASE CORP LTD	336	13.610	4,572.960	
BLUESCOPE STEEL LTD	224	17.030	3,814.720	
SYDNEY AIRPORT	525	6.590	3,459.750	
MACQUARIE GROUP LTD	136	137.800	18,740.800	
SUNCORP GROUP LTD	547	10.160	5,557.520	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,297	23.550	30,544.350	
NEWCREST MINING LTD	355	26.810	9,517.550	
OIL SEARCH LTD	865	3.750	3,243.750	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	136	5.070	689.520	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	678	9.860	6,685.080	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	333	12.170	4,052.610	
SANTOS LTD	714	6.570	4,690.980	
SONIC HEALTHCARE	211	32.540	6,865.940	
TABCORP HOLDINGS LTD	899	3.950	3,551.050	
WESFARMERS LTD	454	50.940	23,126.760	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	318	23.190	7,374.420	
WOOLWORTHS GROUP LTD	521	39.170	20,407.570	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	35	54.830	1,919.050	
SEEK LTD	158	26.690	4,217.020	
AUSNET SERVICES	648	1.845	1,195.560	
AGL ENERGY LTD	269	13.510	3,634.190	
BRAMBLES LTD	669	10.570	7,071.330	
CROWN RESORTS LTD	251	9.790	2,457.290	
EVOLUTION MINING LTD	688	4.800	3,302.400	
AURIZON HOLDINGS LTD	934	4.180	3,904.120	
TREASURY WINE ESTATES LTD	355	9.390	3,333.450	
XERO LTD	41	143.940	5,901.540	

	AFTERPAY LTD	85	109.930	9,344.050	
	MEDIBANK PVT LTD	807	2.870	2,316.090	
	SOUTH32 LTD(AUD)	1,797	2.600	4,672.200	
	COLES GROUP LTD	541	18.180	9,835.380	
	WISETECH GLOBAL LTD	39	30.460	1,187.940	
オーストラリア・ドル 小計		27,898		535,920.280 (42,064,383)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	91	87.660	7,977.060	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	358	44.650	15,984.700	
	BARRICK GOLD CORP	717	28.620	20,520.540	
	ATCO LTD	31	38.160	1,182.960	
	BANK OF MONTREAL	246	96.120	23,645.520	
	BANK OF NOVA SCOTIA	464	68.160	31,626.240	
	NATIONAL BANK OF CANADA	145	72.390	10,496.550	
	BCE INC	58	56.520	3,278.160	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	486	51.840	25,194.240	
	BAUSCH HEALTH COS INC	119	26.290	3,128.510	
	SAPUTO INC	99	37.000	3,663.000	
	BLACKBERRY LTD	332	10.540	3,499.280	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	248	20.380	5,054.240	
	CGI INC	97	96.970	9,406.090	
	CCL INDUSTRIES INC	53	59.460	3,151.380	
	CAE INC	111	31.280	3,472.080	
	CAMECO CORP	227	16.960	3,849.920	
	ROGERS COMM-CL B	135	60.100	8,113.500	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	176	110.750	19,492.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	450	31.270	14,071.500	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	18	164.610	2,962.980	
	CANADIAN UTILITIES LTD	69	31.990	2,207.310	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	276	139.630	38,537.880	
	YAMANA GOLD INC	384	6.710	2,576.640	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	53	34.510	1,829.030	
	OPEN TEXT CORP	111	58.680	6,513.480	
	EMPIRE CO LTD	48	35.540	1,705.920	
	KINROSS GOLD CORP	533	8.790	4,685.070	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	52	89.450	4,651.400	
	FORTIS INC	186	53.110	9,878.460	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	198	20.420	4,043.160	
	TELUS CORP	88	25.470	2,241.360	
GREAT WEST LIFECO INC	70	29.140	2,039.800		
IMPERIAL OIL LTD	76	24.520	1,863.520		
ENBRIDGE INC	759	42.530	32,280.270		

IGM FINANCIAL INC	35	35.170	1,230.950	
MANULIFE FINANCIAL CORP	741	22.400	16,598.400	
LOBLAW CO LTD	60	65.200	3,912.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	117	79.440	9,294.480	
SUN LIFE FINANCIAL INC	239	56.590	13,525.010	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	448.020	5,376.240	
METRO INC	85	59.000	5,015.000	
EMERA INC	100	54.550	5,455.000	
ONEX CORP	45	72.640	3,268.800	
PAN AMERICAN SILVER CORP	107	36.860	3,944.020	
POWER CORP OF CANADA	202	29.460	5,950.920	
QUEBECOR INC-B	38	33.620	1,277.560	
ROYAL BANK OF CANADA	545	104.860	57,148.700	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	53	427.600	22,662.800	
SHAW COMM INC-B	192	23.180	4,450.560	
SUNCOR ENERGY INC	580	23.080	13,386.400	
LUNDIN MINING CORP	321	9.840	3,158.640	
TECK RESOURCES LTD-CL B	193	22.640	4,369.520	
THOMSON REUTERS CORP	65	102.630	6,670.950	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	19	93.400	1,774.600	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	690	71.690	49,466.100	
TC ENERGY CORP	380	56.410	21,435.800	
WESTON (GEORGE) LTD	36	99.150	3,569.400	
INTACT FINANCIAL CORP	58	149.000	8,642.000	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	172	51.340	8,830.480	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	8	1,668.180	13,345.440	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	75	165.760	12,432.000	
B2GOLD CORP	413	6.880	2,841.440	
CI FINANCIAL CORP	68	16.640	1,131.520	
KEYERA CORP	42	23.390	982.380	
PARKLAND CORP	80	41.310	3,304.800	
ALTAGAS LTD	171	18.770	3,209.670	
PEMBINA PIPELINE CORP	213	33.550	7,146.150	
DOLLARAMA INC	126	53.940	6,796.440	
CENOVUS ENERGY INC W/I	290	7.700	2,233.000	
NORTHLAND POWER INC	47	44.730	2,102.310	
TMX GROUP LTD	29	125.980	3,653.420	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	118	49.780	5,874.040	
INTER PIPELINE LTD	188	13.290	2,498.520	
NUTRIEN LTD	231	62.390	14,412.090	
SSR MINING INC	36	22.890	824.040	
WSP GLOBAL INC	50	125.120	6,256.000	
IA FINANCIAL CORP INC	57	56.350	3,211.950	
GFL ENVIRONMENTAL INC	58	34.450	1,998.100	

	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28	63.110	1,767.080	
	AIR CANADA	21	26.100	548.100	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	115	78.370	9,012.550	
	SHOPIFY INC	42	1,350.260	56,710.920	
	FIRSTSERVICE CORP	9	166.120	1,495.080	
	CANOPY GROWTH CORP	109	32.310	3,521.790	
	HYDRO ONE LTD	137	29.090	3,985.330	
カナダ・ドル 小計		15,410		786,532.240 (64,212,492)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	600	3.870	2,322.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	700	25.450	17,815.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	200	7.970	1,594.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	300	9.350	2,805.000	
	CAPITALAND LTD	1,000	3.270	3,270.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	3,700	0.850	3,145.000	
	KEPPEL CORP LTD	300	5.290	1,587.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,400	10.130	14,182.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,000	2.350	7,050.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	600	4.420	2,652.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	500	22.920	11,460.000	
	UOL GROUP LIMITED	300	7.710	2,313.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	500	4.230	2,115.000	
シンガポール・ドル 小計		13,100		72,310.000 (5,647,411)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	986	11.120	10,964.320	
	LOGITECH INTL-REG	69	79.540	5,488.260	
	NESTLE SA-REGISTERED	1,129	99.700	112,561.300	
	CIE FINANC RICHEMONT	228	77.340	17,633.520	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	275	304.250	83,668.750	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	13	247.000	3,211.000	
	SIKA INHABER	57	230.900	13,161.300	
	SGS SA-REG	2	2,600.000	5,200.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	870	81.260	70,696.200	
	BALOISE HOLDING AG -R	17	151.400	2,573.800	
	BARRY CALLEBAUT AG	1	2,030.000	2,030.000	
	CLARIANT AG-REG	69	17.965	1,239.580	
	SWISSCOM AG-REG	10	475.900	4,759.000	
	ABB LTD	741	23.880	17,695.080	
	ADECCO GROUP AG-REG	74	57.000	4,218.000	
	GEBERIT AG	13	527.000	6,851.000	
	LONZA GROUP AG-REG	30	552.400	16,572.000	
GIVAUDAN-REG	4	3,632.000	14,528.000		

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	58	357.000	20,706.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	201	46.470	9,340.470	
	TEMENOS GROUP	30	114.600	3,438.000	
	SONOVA HOLDING AG	22	222.200	4,888.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	21	199.550	4,190.550	
	STRAUMANN HOLDING AG	4	1,020.000	4,080.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	12	228.800	2,745.600	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	44.540	445.400	
	SCHINDLER NAMEN	12	242.400	2,908.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	13	398.200	5,176.600	
	BANQUE CANTONALE VAUD	7	94.800	663.600	
	VIFOR PHARMA AG	16	132.600	2,121.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING	3	821.000	2,463.000	
	SWISS PRIME SITE AG	22	86.350	1,899.700	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	7	971.600	6,801.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	89	49.440	4,400.160	
	SWISS RE LTD	116	80.580	9,347.280	
	ALCON INC	200	57.420	11,484.000	
	UBS GROUP AG	1,443	12.435	17,943.700	
スイス・フラン	小計	6,874		508,095.170 (59,680,859)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	272	427.700	116,334.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	148	372.800	55,174.400	
	ERICSSON LM-B SHS	1,129	99.380	112,200.020	
	LUNDBERGS B	37	433.000	16,021.000	
	SKF AB-B SHS	126	217.600	27,417.600	
	SANDVIK AB	458	199.600	91,416.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	714	88.500	63,189.000	
	SKANSKA AB-B SHS	112	204.800	22,937.600	
	SWEDBANK AB	320	155.960	49,907.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	263	141.600	37,240.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	686	82.980	56,924.280	
	VOLVO AB-B SHS	565	192.300	108,649.500	
	SWEDISH MATCH AB	61	648.800	39,576.800	
	TELE2 AB-B SHS	145	111.350	16,145.750	
	INDUSTRIVARDEN A	14	267.600	3,746.400	
	INDUSTRIVARDEN C	40	260.300	10,412.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	58	197.550	11,457.900	
	SECURITAS AB-B SHS	164	135.200	22,172.800	
	INVESTOR AB-B SHS	179	587.200	105,108.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	355	183.000	64,965.000	
	ASSA ABLOY AB-B	401	205.000	82,205.000	
	TELIA CO AB	969	34.580	33,508.020	

	LUNDIN ENERGY AB	81	224.700	18,200.700	
	BOLIDEN AB	92	279.900	25,750.800	
	ALFA LAVAL AB	107	222.700	23,828.900	
	KINNEVIK AB-B	108	390.950	42,222.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	24	427.300	10,255.200	
	ICA GRUPPEN AB	38	411.200	15,625.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	213	105.300	22,428.900	
	NIBE INDUSTRIER AB	111	260.700	28,937.700	
	HEXAGON AB	111	694.000	77,034.000	
	EPIROC AB-A	308	148.450	45,722.600	
	EPIROC AB-B	98	140.800	13,798.400	
	ESSITY AB-B	211	271.400	57,265.400	
	EQT AB	78	191.650	14,948.700	
	EVOLUTION GAMING GROUP AB	62	813.200	50,418.400	
	NORDEA BANK ABP	1,323	73.170	96,803.910	
	INVESTMENT AB LATOUR	23	193.200	4,443.600	
スウェーデン・クローナ 小計		10,204		1,694,396.480 (21,027,460)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	40	953.000	38,120.000	
	A P MOLLER A/S	3	13,485.000	40,455.000	
	AP MOLLER MAERSK A	1	12,670.000	12,670.000	
	DANSKE BANK A/S	314	101.050	31,729.700	
	GENMAB A/S	26	2,420.000	62,920.000	
	NOVOZYMES-B SHS	67	341.200	22,860.400	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	1	2,158.000	2,158.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	668	426.700	285,035.600	
	GN STORE NORD A/S	59	493.500	29,116.500	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	80	1,268.500	101,480.000	
	COLOPLAST-B	48	936.200	44,937.600	
	DSV PANALPINA A S	85	980.000	83,300.000	
	DEMANT A/S	33	230.500	7,606.500	
	H LUNDBECK A/S	15	205.600	3,084.000	
	TRYG A/S	44	182.200	8,016.800	
	PANDORA A/S	45	618.400	27,828.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	35	610.800	21,378.000	
	AMBU A/S B	75	213.000	15,975.000	
ORSTED A/S	78	1,076.000	83,928.000		
デンマーク・クローネ 小計		1,717		922,599.100 (15,693,411)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	512	7.950	4,070.400	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	101	15.000	1,515.000	
	A2 MILK CO LTD	367	14.060	5,160.020	
	FISHER & PAYKEL	259	32.070	8,306.130	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	789	4.505	3,554.440	

	MIGHTY RIVER POWER LTD	87	6.250	543.750	
	MERIDIAN ENERGY LTD	456	6.530	2,977.680	
ニュージーランド・ドル 小計		2,571		26,127.420 (1,926,897)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	203	178.350	36,205.050	
	DNB ASA	398	162.300	64,595.400	
	NORSK HYDRO ASA	358	39.490	14,137.420	
	TELENOR ASA	268	150.900	40,441.200	
	SCHIBSTED ASA	9	339.800	3,058.200	
	ORKLA ASA	375	85.280	31,980.000	
	EQUINOR ASA	383	147.250	56,396.750	
	YARA INTERNATIONAL ASA	46	348.400	16,026.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	84	184.300	15,481.200	
	ADEVINTA ASA	72	133.200	9,590.400	
	SCHIBSTED ASA	58	294.200	17,063.600	
ノルウェー・クローネ 小計		2,254		304,975.620 (3,641,409)	
ユーロ	CRH PLC	301	32.730	9,851.730	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	57	165.650	9,442.050	
	KERRY GROUP PLC-A	71	120.900	8,583.900	
	KINGSPAN GROUP PLC	70	71.450	5,001.500	
	UMICORE	70	36.900	2,583.000	
	AIR LIQUIDE	181	136.200	24,652.200	
	AIRBUS SE	229	92.050	21,079.450	
	AXA SA	773	19.678	15,211.090	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	227	19.615	4,452.600	
	ADIDAS AG	76	287.500	21,850.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	386	14.260	5,504.360	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.000	0.000	
	DANONE	245	52.460	12,852.700	
	SAFRAN SA	128	119.300	15,270.400	
	INTESA SANPAOLO	6,375	1.939	12,361.120	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	128	71.910	9,204.480	
	ACCOR SA	56	29.480	1,650.880	
	BOUYGUES	81	33.850	2,741.850	
	BNP PARIBAS	427	44.150	18,852.050	
	THALES SA	36	76.640	2,759.040	
	CAPGEMINI SA	65	115.100	7,481.500	
	UNICREDIT SPA	834	7.694	6,416.790	
	NATIXIS	473	2.618	1,238.310	
	KONINKLIJKE DSM NV	67	135.100	9,051.700	
COMMERZBANK AG	351	5.132	1,801.330		
EIFFAGE	26	80.280	2,087.280		
FRESENIUS SE & CO KGAA	153	38.020	5,817.060		
UNITED INTERNET	60	33.740	2,024.400		

FUCHS PETROLUB SE PREF	21	45.960	965.160	
PUBLICIS GROUPE	98	40.920	4,010.160	
FAURECIA	14	40.210	562.940	
IBERDROLA SA	2,331	11.285	26,305.330	
ENI SPA	1,005	8.678	8,721.390	
JERONIMO MARTINS	148	14.580	2,157.840	
KESKO OYJ-B	72	20.660	1,487.520	
KBC GROUPE	100	60.340	6,034.000	
HANNOVER RUECK SE	24	132.100	3,170.400	
WARTSILA OYJ	111	8.206	910.860	
L'OREAL	98	302.700	29,664.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	108	509.200	54,993.600	
GEA GROUP AG	83	27.490	2,281.670	
BOLLORE	503	3.396	1,708.180	
MEDIOBANCA SPA	225	7.352	1,654.200	
MICHELIN(CGDE) -B	67	106.700	7,148.900	
CONTINENTAL AG	39	110.000	4,290.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	386	39.250	15,150.500	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	111	28.500	3,163.500	
OMV AG	59	32.340	1,908.060	
VERBUND AG	13	59.650	775.450	
PERNOD-RICARD	78	160.650	12,530.700	
PEUGEOT SA	264	21.060	5,559.840	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	69	54.020	3,727.380	
RENAULT SA	94	35.735	3,359.090	
REPSOL SA	549	8.620	4,732.380	
REMY COINTREAU	12	151.000	1,812.000	
MERCK KGAA	52	135.950	7,069.400	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	209	38.540	8,054.860	
RWE AG	268	33.140	8,881.520	
SEB SA	9	145.000	1,305.000	
SOCIETE GENERALE-A	342	16.992	5,811.260	
VINCI S.A.	194	84.960	16,482.240	
SODEXO	26	72.140	1,875.640	
SOFINA	8	264.500	2,116.000	
SOLVAY SA	32	97.400	3,116.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	213	116.150	24,739.950	
VIVENDI SA	300	25.730	7,719.000	
SAP SE	402	99.930	40,171.860	
TELEFONICA S.A	1,932	3.526	6,812.230	
TOTAL SE	972	36.600	35,575.200	
VALEO	108	31.700	3,423.600	
E.ON SE	931	8.858	8,246.790	
VOEST-ALPINE AG	26	28.130	731.380	
HENKEL AG & CO KGAA	31	78.200	2,424.200	

SIEMENS AG-REG	302	112.700	34,035.400	
UPM-KYMMENE OYJ	225	29.280	6,588.000	
ING GROEP NV-CVA	1,467	7.906	11,598.100	
PUMA AG	42	84.440	3,546.480	
BAYER AG	394	47.160	18,581.040	
STORA ENSO OYJ-R SHS	239	14.875	3,555.120	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	73	88.560	6,464.880	
DAIMLER AG	323	56.370	18,207.510	
BASF SE	350	63.900	22,365.000	
BEIERSDORF AG	34	92.240	3,136.160	
HOCHTIEF AG	11	76.600	842.600	
HEIDELBERGCEMENT AG	59	58.540	3,453.860	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	84	67.780	5,693.520	
ORANGE	704	10.000	7,040.000	
SAMPO OYJ-A SHS	187	34.500	6,451.500	
RANDSTAD NV	32	53.200	1,702.400	
ALLIANZ SE	161	191.980	30,908.780	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	967	4.800	4,641.600	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	431	23.430	10,098.330	
HERMES INTL	13	844.600	10,979.800	
ENDESA S.A.	143	22.750	3,253.250	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	94	9.750	916.500	
ERSTE GROUP BANK AG	128	25.040	3,205.120	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	55	238.400	13,112.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	263	17.388	4,573.040	
DASSAULT SYSTEMES SA	54	156.300	8,440.200	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	95	26.520	2,519.400	
HEINEKEN NV	104	91.980	9,565.920	
AKZO NOBEL	72	86.440	6,223.680	
ASML HOLDING NV	166	376.000	62,416.000	
AEGON NV	863	2.976	2,568.280	
VOLKSWAGEN AG	17	154.500	2,626.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	71	139.680	9,917.280	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,493	4.028	10,041.800	
KERING	29	564.100	16,358.900	
CNP ASSURANCES	121	12.950	1,566.950	
FORTUM OYJ	149	18.790	2,799.710	
AGEAS	50	42.150	2,107.500	
UCB SA	48	87.400	4,195.200	
NEMETSCHEK SE	31	57.100	1,770.100	
CARREFOUR SA	232	13.750	3,190.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	107	19.410	2,076.870	
ATOS SE	48	73.180	3,512.640	

NOKIA OYJ	2,286	3.272	7,479.790	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	368	43.035	15,836.880	
WOLTERS KLUWER-CVA	104	68.160	7,088.640	
SANOFI	438	77.850	34,098.300	
STMICROELECTRONICS NV	245	28.950	7,092.750	
ELISA OYJ	49	44.810	2,195.690	
BANCO SANTANDER SA	6,520	2.623	17,101.960	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	206	16.860	3,473.160	
QIAGEN N.V.	105	42.790	4,492.950	
DEUTSCHE BANK AG-REG	749	8.795	6,587.450	
BMW VORZUG	19	54.300	1,031.700	
ENEL SPA	3,118	8.122	25,324.390	
COLRUYT NV	6	49.200	295.200	
VOPAK (KON.)	38	42.670	1,621.460	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,331	14.790	19,685.490	
SARTORIUS AG	15	362.600	5,439.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	27	77.000	2,079.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	505	29.450	14,872.250	
RATIONAL AG	1	718.500	718.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG	12	108.000	1,296.000	
BECHTLE AG	7	174.900	1,224.300	
KONINKLIJKE KPN NV	1,386	2.461	3,410.940	
EUROFINS SCIENTIFIC	60	66.630	3,997.800	
TELEPERFORMANCE	22	264.600	5,821.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	71	138.550	9,837.050	
EURAZEO	23	55.000	1,265.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	43	81.720	3,513.960	
HEINEKEN HOLDING NV-A	50	79.800	3,990.000	
INDITEX	447	27.450	12,270.150	
ESSILORLUXOTTICA	116	129.550	15,027.800	
SNAM SPA	926	4.563	4,225.330	
CREDIT AGRICOLE SA	428	10.485	4,487.580	
ORPEA	19	107.100	2,034.900	
ENAGAS	61	20.380	1,243.180	
WENDEL	13	98.600	1,281.800	
TENARIS SA	163	6.712	1,094.050	
TELECOM ITALIA SPA	1,206	0.385	464.310	
TELECOM ITALIA-RNC	3,436	0.418	1,436.240	
ATLANTIA SPA	206	14.500	2,987.000	
ILIAD SA	2	174.150	348.300	
PROXIMUS	94	17.320	1,628.080	
SES FDR	156	7.780	1,213.680	
TERNA SPA	664	6.104	4,053.050	
BIOMERIEUX	17	119.700	2,034.900	
GRIFOLS SA	143	24.680	3,529.240	
FERROVIAL SA	197	23.290	4,588.130	
LANXESS AG	26	60.740	1,579.240	

NESTE OYJ	173	57.640	9,971.720	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	91	16.470	1,498.770	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	33	44.770	1,477.410	
GALAPAGOS NV	22	98.120	2,158.640	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	290	9.366	2,716.140	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	18	206.000	3,708.000	
KONE OYJ	139	67.220	9,343.580	
ELIA GROUP	4	94.000	376.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	11	291.400	3,205.400	
ENGIE	725	12.525	9,080.620	
ALSTOM	80	45.910	3,672.800	
ELECTRICITE DE FRANCE	195	12.370	2,412.150	
IPSEN SA	21	69.000	1,449.000	
DEUTSCHE WOHNEN	115	42.720	4,912.800	
ARKEMA SA	28	95.000	2,660.000	
LEGRAND SA	101	70.880	7,158.880	
AMPLIFON SPA	27	33.610	907.470	
ADP	10	105.000	1,050.000	
ORION OYJ	46	38.040	1,749.840	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	236	8.964	2,115.500	
SYMRISE AG	57	106.350	6,061.950	
SCOR SE	71	27.040	1,919.840	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	109	37.760	4,115.840	
PRYSMIAN SPA	121	27.520	3,329.920	
DIASORIN SPA	11	170.700	1,877.700	
CAIXABANK	1,237	2.230	2,758.510	
BUREAU VERITAS SA	95	22.570	2,144.150	
GETLINK	218	13.410	2,923.380	
SUEZ SA	164	15.900	2,607.600	
AMADEUS IT GROUP SA	172	59.920	10,306.240	
BRENTAG AG	66	63.340	4,180.440	
EVONIK INDUSTRIES AG	105	26.100	2,740.500	
EDENRED	109	46.010	5,015.090	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	686	2.273	1,559.270	
LEG IMMOBILIEN AG	33	121.340	4,004.220	
KION GROUP AG	28	69.040	1,933.120	
VONOVIA SE	203	57.620	11,696.860	
KNORR-BREMSE AG	22	106.060	2,333.320	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	85	40.455	3,438.670	
FERRARI NV	47	178.900	8,408.300	
CNH INDUSTRIAL NV	376	9.128	3,432.120	
AROUNDTOWN SA	443	6.188	2,741.280	

LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	25	35.560	889.000	
MONCLER SPA	88	47.880	4,213.440	
NEXI SPA	160	16.100	2,576.000	
TEAMVIEWER AG	62	39.800	2,467.600	
PROSUS NV	192	90.080	17,295.360	
TELEFONICA SA-RTS	1,932	0.195	376.740	
JDE PEET'S BV	9	33.580	302.220	
SIEMENS ENERGY AG	157	25.650	4,027.050	
WORLDLINE SA	93	75.140	6,988.020	
NN GROUP NV	109	33.500	3,651.500	
FINECOBANK SPA	248	13.110	3,251.280	
ARGENX SE	15	254.000	3,810.000	
ZALANDO SE	52	84.520	4,395.040	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	485	13.820	6,702.700	
AENA SME SA	25	135.900	3,397.500	
CELLNEX TELECOM SAU	117	51.280	5,999.760	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	54	87.260	4,712.040	
ABN AMRO BANK NV	203	8.094	1,643.080	
EXOR NV	29	59.640	1,729.560	
ALTICE EUROPE NV	103	4.403	453.500	
SCOUT24 AG	50	66.450	3,322.500	
COVESTRO AG	83	50.540	4,194.820	
HELLOFRESH SE	52	60.700	3,156.400	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	296	57.600	17,049.600	
POSTE ITALIANE SPA	238	8.350	1,987.300	
AMUNDI SA	30	66.550	1,996.500	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	59	9.900	584.100	
ADYEN NV	7	1,837.000	12,859.000	
UNIPER SE	61	27.900	1,701.900	
DELIVERY HERO SE	53	114.650	6,076.450	
ユーロ 小計	90,880		1,589,373.040 (201,214,627)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	100	98.550	9,855.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	864	19.840	17,141.760	
BANK OF EAST ASIA	267	17.020	4,544.340	
CLP HOLDINGS LTD	735	70.850	52,074.750	
PCCW LTD	884	4.820	4,260.880	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	39.800	19,900.000	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	466	387.800	180,714.800	
MTR CORP	903	42.550	38,422.650	
HANG SENG BANK LTD	300	136.900	41,070.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,086	31.150	33,828.900	

POWER ASSETS HOLDINGS LTD	567	40.900	23,190.300	
HONG KONG & CHINA GAS	3,348	11.720	39,238.560	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	60.650	32,569.050	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,184	24.650	29,185.600	
NEW WORLD DEVELOPMENT	890	37.000	32,930.000	
SINO LAND CO	576	10.680	6,151.680	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	105.300	52,650.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	773	103.500	80,005.500	
SJM HOLDINGS LTD	1,000	9.150	9,150.000	
WYNN MACAU LTD	699	13.640	9,534.360	
AIA GROUP LTD	4,751	90.000	427,590.000	
HKT TRUST / HKT LTD	2,080	10.320	21,465.600	
SANDS CHINA LTD	974	34.450	33,554.300	
SWIRE PROPERTIES LTD	32	23.350	747.200	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,000	40.050	40,050.000	
ESR CAYMAN LTD	400	23.950	9,580.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	500	26.650	13,325.000	
WH GROUP LTD	3,000	6.500	19,500.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,034	55.050	56,921.700	
CK ASSET HOLDINGS LTD	534	42.950	22,935.300	
香港・ドル 小計	30,484		1,362,087.230 (18,292,831)	
合計	439,075		1,829,534,223 (1,829,534,223)	

(2) 株式以外の有価証券

2020年12月15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	91.200	
	スイス・フラン	小計	456.000	91.200 (10,712)	
新株予約権証券 合計			456	10,712 (10,712)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	393.000	3,863.190	
		GOODMAN GROUP	703.000	12,513.400	
		GPT GROUP	956.000	4,531.440	
		MIRVAC GROUP	1,078.000	2,942.940	
		SCENTRE GROUP	1,683.000	4,695.570	
		STOCKLAND	1,002.000	4,438.860	
	VICINITY CENTRES	1,672.000	2,808.960		
オーストラリア・ドル 小計			7,487.000	35,794.360 (2,809,499)	

シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,100.000	3,267.000		
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,125.000	4,590.000		
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	200.000	422.000		
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	500.000	965.000		
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	500.000	760.000		
シンガポール・ドル 小計		4,425.000	10,004.000 (781,312)		
投資信託受益証券 合計		11,912	3,590,811 (3,590,811)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	191.000	2,922.300	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	54.000	9,332.820	
		AMERICAN TOWER CORP	172.000	37,275.840	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	549.000	4,523.760	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	53.000	8,462.510	
		BOSTON PROPERTIES INC	66.000	6,501.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	33.000	3,184.500	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	169.000	26,227.110	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	106.000	13,577.540	
		DUKE REALTY TRUST	152.000	5,883.920	
		EQUINIX INC	35.000	24,151.050	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	67.000	4,085.660	
		EQUITY RESIDENTIAL	130.000	7,527.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	23.000	5,525.980	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	58.000	6,373.040	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	189.000	5,458.320	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	326.000	4,573.780	
		INVITATION HOMES INC	246.000	7,079.880	
		IRON MOUNTAIN INC	83.000	2,429.410	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	198.000	4,118.400	
		MID AMERICA	47.000	5,707.680	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	113.000	4,236.370	
		PROLOGIS INC	296.000	28,673.520	
		PUBLIC STORAGE	62.000	13,871.880	
		REALTY INCOME CORP	127.000	7,698.740	
REGENCY CENTERS CORP	69.000	3,234.720			
SBA COMMUNICATIONS CORP	43.000	11,789.310			
SIMON PROPERTY GROUP INC	117.000	10,216.440			

	SUN COMMUNITIES INC	41.000	5,872.020	
	UDR INC	131.000	4,924.290	
	VENTAS INC	142.000	6,793.280	
	VEREIT INC	454.000	3,409.540	
	VICI PROPERTIES INC	207.000	5,253.660	
	VORNADO REALTY TRUST	57.000	2,170.560	
	WELLTOWER INC	166.000	10,497.840	
	WEYERHAEUSER CO	284.000	9,190.240	
	WP CAREY INC	73.000	5,048.680	
アメリカ・ドル	小計	5,329.000	327,802.590 (34,130,807)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	255.000	1,229.610	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	322.000	2,247.560	
	SEGRO PLC	481.000	4,371.320	
イギリス・ポンド	小計	1,058.000	7,848.490 (1,090,391)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	10.000	507.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	93.000	1,654.470	
カナダ・ドル	小計	103.000	2,162.070 (176,511)	
ユーロ	COVIVIO	21.000	1,579.200	
	GECINA SA	18.000	2,268.000	
	KLEPIERRE	82.000	1,522.740	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	61.000	3,712.460	
ユーロ	小計	182.000	9,082.400 (1,149,832)	
香港・ドル	LINK REIT	807.000	55,844.400	
香港・ドル	小計	807.000	55,844.400 (749,990)	
投資証券	合計	7,479	37,297,531 (37,297,531)	
合計			40,899,054 (40,899,054)	

(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)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	組入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	594銘柄	64.47	-	-	-	71.64
	投資証券	37銘柄	-	-	-	1.68	
イギリス・ポンド	株式	85銘柄	4.36	-	-	-	4.78
	投資証券	3銘柄	-	-	-	0.05	
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.10	-	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式	56銘柄	2.08	-	-	-	2.40
	投資信託受益証券	7銘柄	-	-	0.14	-	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.17	-	-	-	3.44
	投資証券	2銘柄	-	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式	13銘柄	0.28	-	-	-	0.34
	投資信託受益証券	5銘柄	-	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式	37銘柄	2.95	-	-	-	3.19
	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	1.04	-	-	-	1.12
デンマーク・クローネ	株式	19銘柄	0.77	-	-	-	0.84
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.10	-	-	-	0.10
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.18	-	-	-	0.19
ユーロ	株式	236銘柄	9.93	-	-	-	10.82
	投資証券	4銘柄	-	-	-	0.06	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.90	-	-	-	1.02
	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。

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)

2020年12月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	65,132,223
国債証券	7,036,940,700
地方債証券	825,493,820
特殊債証券	728,692,000
社債証券	509,768,000
未収利息	21,422,153
前払費用	775,158
流動資産合計	9,188,224,054
資産合計	
9,188,224,054	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	514,000
流動負債合計	514,000
負債合計	
514,000	
純資産の部	
元本等	
元本	7,133,049,465
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,054,660,589
元本等合計	9,187,710,054
純資産合計	
9,187,710,054	
負債純資産合計	
9,188,224,054	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,938,461,315円
同期中追加設定元本額	1,406,119,608円
同期中一部解約元本額	1,211,531,458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	626,954,094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	5,277,708,889円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	587,561,476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）	35,126,159円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	74,827,438円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	35,317,778円
グローバル・ナビ	23,438,486円
計	7,133,049,465円
2. 受益権の総数	7,133,049,465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 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15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	2020年12月15日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	17,205,000	
地方債証券	799,870	
特殊債券	13,000	
社債券	61,000	
合計	17,956,870	

(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2020年12月15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)

2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.2880円
(1万口当たり純資産額)	(12,880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

2020年12月15日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考

国債証券	418回 利付国庫債券(2年)	50,000,000	50,244,500	
	131回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,173,400	
	132回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,145,200	
	133回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,220,500	
	134回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,308,400	
	135回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,169,800	
	136回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,308,500	
	137回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,346,500	
	138回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	80,604,800	
	139回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,409,000	
	140回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,352,800	
	141回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,378,000	
	142回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,403,200	
	143回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,314,700	
	144回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	80,871,200	
	145回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,330,300	
	1回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,663,200	
	2回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,226,700	
	3回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,284,300	
	4回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	28,671,800	
	5回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	27,771,800	
	6回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	27,397,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	26,355,200	
	8回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	24,651,600	
	9回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	27,689,700	
	10回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	32,438,400	
	11回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	31,491,300	
	12回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	28,490,100	
	13回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	18,943,200	
	321回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,711,500	

3 2 2 回 利付国庫債券(10年)	20,000,000	20,259,400	
3 2 4 回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,711,000	
3 2 5 回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,664,000	
3 2 6 回 利付国庫債券(10年)	10,000,000	10,169,300	
3 2 7 回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,758,000	
3 2 8 回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,172,500	
3 2 9 回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,656,900	
3 3 0 回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	41,042,400	
3 3 2 回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,342,200	
3 3 3 回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,936,800	
3 3 4 回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,565,400	
3 3 5 回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	92,178,000	
3 3 6 回 利付国庫債券(10年)	30,000,000	30,774,300	
3 3 7 回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,709,600	
3 3 8 回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,849,600	
3 3 9 回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	92,205,000	
3 4 0 回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,537,800	
3 4 1 回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,517,600	
3 4 2 回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,952,000	
3 4 3 回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,123,200	
3 4 4 回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,044,000	
3 4 5 回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,065,600	
3 4 6 回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,970,900	
3 4 7 回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,987,000	
3 4 8 回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,025,500	

349回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,215,200	
350回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,382,400	
351回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,907,800	
352回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,039,500	
353回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,160,800	
354回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,987,700	
355回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,820,800	
356回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,924,000	
357回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,732,000	
358回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,695,400	
359回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,732,900	
360回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,390,400	
10回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,421,800	
11回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,969,400	
12回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,496,500	
15回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,275,400	
17回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,078,600	
19回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,016,100	
20回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,336,000	
21回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,079,400	
22回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,405,300	
23回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,449,700	
26回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,390,200	
27回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,619,600	
28回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,376,600	

29回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,151,000	
30回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,385,400	
31回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,702,000	
32回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,774,800	
33回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,221,400	
34回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,536,900	
35回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,504,300	
36回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,636,900	
37回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	52,220,400	
38回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,775,200	
39回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,222,000	
40回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,841,400	
41回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,451,600	
42回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,478,000	
43回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,504,800	
44回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,530,800	
45回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,657,400	
46回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	37,010,400	
47回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	37,698,900	
48回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	36,349,500	
49回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	36,366,000	
50回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,090,100	
51回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,987,600	
52回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,863,500	
53回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,366,400	

54回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,318,200	
55回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,304,600	
56回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,290,400	
57回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,275,800	
58回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,853,100	
59回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,716,800	
60回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,712,000	
61回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,652,800	
62回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,587,600	
63回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,026,000	
64回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,972,200	
65回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,941,400	
66回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,910,200	
67回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,887,500	
68回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,899,400	
55回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,268,800	
59回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,372,100	
64回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,565,500	
70回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,791,600	
72回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,694,000	
78回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,846,600	
81回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,020,500	
84回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,071,500	
88回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,345,300	
90回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,349,200	

92回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	34,032,300	
95回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,167,800	
99回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,565,500	
105回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,707,100	
108回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,591,700	
110回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,802,300	
111回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,933,000	
112回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,695,000	
113回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,676,000	
114回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,929,900	
116回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,064,500	
117回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,943,400	
118回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,913,200	
120回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,065,000	
121回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,709,400	
122回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,514,000	
123回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,180,200	
124回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,980,200	
125回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,231,500	
126回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,026,800	
127回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,924,400	
128回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,918,200	
129回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,708,600	
130回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,771,800	
131回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,778,700	

132回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,813,300	
133回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,845,600	
134回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,856,900	
135回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,840,400	
136回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,457,000	
137回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,735,600	
138回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,639,300	
139回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,507,200	
140回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	59,472,500	
141回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,680,400	
142回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,078,000	
143回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,470,500	
144回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,404,600	
145回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,877,600	
146回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	59,967,000	
147回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,553,600	
148回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,111,200	
149回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,181,200	
150回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,710,000	
151回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,669,200	
152回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,703,200	
153回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,334,800	
154回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,800,800	
155回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	44,630,800	
156回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,032,400	

157回	利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,790,400		
158回	利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,579,200		
159回	利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,155,200		
160回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,058,900		
161回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,564,500		
162回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,536,900		
163回	利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,010,000		
164回	利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,312,400		
165回	利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,262,000		
166回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,942,500		
167回	利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,156,000		
168回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,309,300		
169回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,739,000		
170回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,709,600		
171回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,679,600		
172回	利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,188,700		
173回	利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,181,600		
174回	利付国庫債券(20年)	20,000,000	20,073,400		
国債証券 合計		6,500,000,000	7,036,940,700		
地方債証券	18回	東京都公募公債 20年	100,000,000	117,600,000	
	200回	神奈川県公募公債	35,000,000	35,788,200	
	218回	神奈川県公募公債	100,000,000	100,951,000	
	412回	大阪府公募公債 10年	50,000,000	50,028,500	
	12回	兵庫県公募公債 15年	100,000,000	106,521,000	
	24年度3回	広島県公募公債	66,000,000	66,951,720	
	24年度7回	広島県公募公債	100,000,000	101,504,000	
	24年度1回	福岡県公募公債 30年	10,000,000	13,217,300	
	169回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,949,000	

	485回 名古屋市公募公債 10年	30,000,000	30,590,100	
	24年度2回 広島市公募公債	100,000,000	101,393,000	
地方債証券 合計		791,000,000	825,493,820	
特殊債券	104回 日本高速道路保有・ 債務返済機構	100,000,000	101,570,000	
	97回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	118,382,000	
	249回政保日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	102,174,000	
	327回 政保日本高速道路保 有・債務返済機構	100,000,000	101,133,000	
	34回 政保地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	101,150,000	
	49回 政保地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	102,206,000	
	58回 政保地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	102,077,000	
特殊債券 合計		700,000,000	728,692,000	
社債券	50回 西日本高速道路債券	100,000,000	99,964,000	
	4回 第一三共社債	100,000,000	101,710,000	
	11回 プリヂストン社債	100,000,000	100,075,000	
	44回 ホンダファイナンス社 債	100,000,000	99,813,000	
	36回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,206,000	
社債券 合計		500,000,000	509,768,000	
合計			9,100,894,520	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2020年12月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	48,659,535
コール・ローン	69,959,389
国債証券	16,826,752,877
派生商品評価勘定	10,211
未収利息	84,398,045
前払費用	20,326,890
流動資産合計	17,050,106,947
資産合計	17,050,106,947
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,972
未払解約金	18,900,000
流動負債合計	18,944,972
負債合計	18,944,972
純資産の部	
元本等	
元本	6,718,227,380
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,312,934,595
元本等合計	17,031,161,975
純資産合計	17,031,161,975
負債純資産合計	17,050,106,947

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2020年12月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,644,675,360円
同期中追加設定元本額	71,397,654円
同期中一部解約元本額	997,845,634円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	4,973,916,839円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	823,094,907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）	21,926,544円
海外国債ファンド（変額年金）	644,728,872円
グローバル・ナビ	12,034,024円
計	6,718,227,380円
2. 受益権の総数	6,718,227,380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 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15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）は短時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	2020年12月15日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	26,837,260
合計	26,837,260

（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2020年12月15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	2020年12月15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	48,541,339	-	48,576,100	34,761
アメリカ・ドル	24,004,356	-	24,020,943	16,587
イギリス・ポンド	9,006,731	-	9,028,751	22,020
カナダ・ドル	6,927,817	-	6,917,606	10,211
ユーロ	8,602,435	-	8,608,800	6,365
合計	48,541,339	-	48,576,100	34,761

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5351円 (25,351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

2020年12月15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 0.625 08/15/30	3,000,000.000	2,930,156.250	
		US T N/B 1.5 02/15/30	4,000,000.000	4,236,875.000	
		US T N/B 1.625 08/15/29	5,000,000.000	5,355,859.350	
		US T N/B 1.75 11/15/29	5,000,000.000	5,410,937.500	
		US T N/B 1.75 12/31/24	4,000,000.000	4,238,750.000	
		US T N/B 2.25 11/15/27	6,000,000.000	6,669,375.000	
		US T N/B 2.375 05/15/29	5,000,000.000	5,657,031.250	

	US T N/B 2.625 02/15/29	5,000,000.000	5,746,093.740	
	US T N/B 2.75 02/15/28	5,000,000.000	5,741,796.850	
	US T N/B 2.875 05/15/28	5,000,000.000	5,802,343.750	
	US T N/B 2.875 08/15/28	5,000,000.000	5,815,234.340	
	US T N/B 3.125 11/15/28	5,000,000.000	5,928,125.000	
アメリカ・ドル	小計	57,000,000.000 (5,934,840,000)	63,532,578.030 (6,615,012,024)	
イギリス・ボ ンド	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,300,000.000	1,380,087.540	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	800,000.000	863,955.200	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	800,000.000	883,040.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,000,000.000	1,120,601.400	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	700,000.000	905,491.440	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,200,000.000	1,759,809.600	
イギリス・ボ ンド	小計	5,800,000.000 (805,794,000)	6,912,985.180 (960,421,031)	
カナダ・ドル	CANADA 1.25 06/01/30	7,500,000.000	7,865,250.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,500,000.000	1,657,470.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	2,000,000.000	2,266,240.000	
カナダ・ドル	小計	11,000,000.000 (898,040,000)	11,788,960.000 (962,450,694)	
ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,000,000.000	2,122,380.000	
	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,700,000.000	1,836,698.700	
	DEUTSCHLAND 08/15/29	1,500,000.000	1,590,712.500	
	DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	5,600,000.000	5,884,737.600	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,900,000.000	2,717,798.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,000,000.000	1,466,220.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,900,000.000	3,138,021.000	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,300,000.000	3,433,428.900	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,000,000.000	3,255,717.000	
	FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,000,000.000	3,297,366.000	
	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,500,000.000	3,862,159.000	
	FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,000,000.000	3,848,316.000	
	FRANCE OAT 2.75 10/25/27	1,000,000.000	1,235,388.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	4,544,844.000	
	ITALY BTPS 0.95 08/01/30	3,000,000.000	3,139,500.000	
	ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,800,000.000	1,932,667.200	
	ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,000,000.000	1,125,612.000	
	ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,000,000.000	1,252,200.000	
	ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,000,000.000	2,392,080.000	
	ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,000,000.000	2,446,422.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,000,000.000	2,556,964.000		

	ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.000	2,677,268.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	4,000,000.000	5,716,400.000	
	ユーロ 小計	54,200,000.000 (6,861,720,000)	65,472,899.900 (8,288,869,128)	
国債証券 合計		14,500,394,000 (14,500,394,000)	16,826,752,877 (16,826,752,877)	
合計			16,826,752,877 (16,826,752,877)	

(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 12銘柄	38.84	39.31
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	5.64	5.71
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	5.65	5.72
ユーロ	国債証券 23銘柄	48.67	49.26

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

(単位:円)

2020年12月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,187,444
コール・ローン	2,779,963
国債証券	314,326,584
派生商品評価勘定	212,623
未収入金	1,496
未収利息	1,837,901
前払費用	88,449
差入委託証拠金	1,866
流動資産合計	324,436,326
資産合計	324,436,326
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,355,329
未払金	20,561
流動負債合計	2,375,890
負債合計	2,375,890
純資産の部	
元本等	
元本	215,323,208
剰余金	
剰余金又は欠損金()	106,737,228
元本等合計	322,060,436
純資産合計	322,060,436
負債純資産合計	324,436,326

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2020年12月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	775,797,780円
同期中追加設定元本額	15,869,680円
同期中一部解約元本額	576,344,252円
元本の内訳	
ファンド名	
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	90,566,758円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	80,706,513円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	30,594,396円
グローバル・ナビ	13,455,541円
計	215,323,208円
2. 受益権の総数	215,323,208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 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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	2020年12月15日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,286,231
合計	2,286,231

(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2020年12月15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	2020年12月15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	317,758,816	-	319,901,522	2,142,706
アメリカ・ドル	138,046,350	-	137,889,906	156,444
イギリス・ポンド	21,753,378	-	21,708,507	44,871
オーストラリア・ドル	8,846,996	-	9,039,744	192,748
カナダ・ドル	6,223,856	-	6,316,614	92,758
シンガポール・ドル	1,477,561	-	1,482,950	5,389
スウェーデン・クローナ	1,058,617	-	1,077,188	18,571
デンマーク・クローネ	1,776,579	-	1,803,060	26,481
ノルウェー・クローネ	1,047,094	-	1,061,770	14,676
ポーランド・ズロチ	2,176,662	-	2,233,899	57,237
メキシコ・ペソ	3,029,287	-	3,017,979	11,308
ユーロ	132,322,436	-	134,269,905	1,947,469
合計	317,758,816	-	319,901,522	2,142,706

（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）

	2020年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4957円 (14,957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

2020年12月15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 0.125 04/30/22	40,000.000	40,012.500	

US T N/B 0.125 05/31/22	20,000.000	20,002.340	
US T N/B 0.125 06/30/22	20,000.000	20,003.900	
US T N/B 0.125 07/31/22	20,000.000	20,000.780	
US T N/B 0.125 08/31/22	10,000.000	10,001.170	
US T N/B 0.25 07/31/25	10,000.000	9,962.500	
US T N/B 0.625 05/15/30	10,000.000	9,792.180	
US T N/B 1.5 08/15/22	20,000.000	20,464.840	
US T N/B 1.5 08/15/26	20,000.000	21,178.120	
US T N/B 1.625 02/15/26	30,000.000	31,912.500	
US T N/B 1.75 05/15/22	40,000.000	40,928.120	
US T N/B 1.75 05/15/23	40,000.000	41,562.500	
US T N/B 1.75 11/15/29	10,000.000	10,821.870	
US T N/B 2.0 02/15/22	20,000.000	20,447.650	
US T N/B 2.0 02/15/23	40,000.000	41,628.120	
US T N/B 2.0 02/15/25	40,000.000	42,831.250	
US T N/B 2.0 08/15/25	30,000.000	32,332.030	
US T N/B 2.0 11/15/26	20,000.000	21,779.680	
US T N/B 2.0 11/30/22	30,000.000	31,103.900	
US T N/B 2.125 03/31/24	40,000.000	42,534.370	
US T N/B 2.125 12/31/22	10,000.000	10,407.030	
US T N/B 2.25 02/15/27	10,000.000	11,056.250	
US T N/B 2.25 08/15/27	20,000.000	22,198.430	
US T N/B 2.25 11/15/24	40,000.000	43,106.250	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,000.000	10,921.870	
US T N/B 2.25 11/15/27	20,000.000	22,231.250	
US T N/B 2.375 05/15/27	10,000.000	11,165.620	
US T N/B 2.375 08/15/24	10,000.000	10,785.150	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,000.000	10,782.810	
US T N/B 2.5 05/15/46	10,000.000	11,994.530	
US T N/B 2.5 08/15/23	40,000.000	42,528.120	
US T N/B 2.625 02/15/29	10,000.000	11,492.180	
US T N/B 2.75 02/15/24	20,000.000	21,628.120	
US T N/B 2.75 02/15/28	20,000.000	22,967.180	
US T N/B 2.75 08/15/47	10,000.000	12,591.400	
US T N/B 2.75 11/15/23	40,000.000	43,031.250	
US T N/B 2.75 11/15/42	10,000.000	12,434.370	
US T N/B 2.75 11/15/47	10,000.000	12,601.560	
US T N/B 2.875 05/15/28	20,000.000	23,209.370	
US T N/B 2.875 05/15/43	10,000.000	12,692.960	
US T N/B 2.875 08/15/28	10,000.000	11,630.460	
US T N/B 2.875 09/30/23	20,000.000	21,515.620	
US T N/B 2.875 11/15/46	10,000.000	12,826.560	
US T N/B 2.875 11/30/23	30,000.000	32,407.030	
US T N/B 2.875 11/30/25	20,000.000	22,478.120	
US T N/B 3.0 02/15/47	10,000.000	13,127.340	
US T N/B 3.0 02/15/49	20,000.000	26,495.310	
US T N/B 3.0 05/15/47	10,000.000	13,141.400	
US T N/B 3.0 08/15/48	30,000.000	39,611.710	
US T N/B 3.0 10/31/25	30,000.000	33,834.370	

	US T N/B 3.0 11/15/44	10,000.000	12,991.400	
	US T N/B 3.125 05/15/48	10,000.000	13,478.900	
	US T N/B 3.125 08/15/44	10,000.000	13,239.060	
	US T N/B 3.125 11/15/28	10,000.000	11,856.250	
	US T N/B 3.375 05/15/44	10,000.000	13,728.900	
	US T N/B 3.375 11/15/48	10,000.000	14,093.750	
	US T N/B 3.625 02/15/44	10,000.000	14,212.500	
	US T N/B 3.75 08/15/41	10,000.000	14,275.000	
	US T N/B 4.25 11/15/40	10,000.000	15,106.250	
	US T N/B 4.625 02/15/40	10,000.000	15,667.180	
	US T N/B 5.375 02/15/31	20,000.000	28,842.180	
	US T N/B 6.125 11/15/27	10,000.000	13,764.840	
アメリカ・ドル 小計		1,170,000.000 (121,820,400)	1,317,450.150 (137,172,911)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.625 06/07/25	10,000.000	10,310.020	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	10,000.000	10,367.860	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	10,000.000	11,780.210	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	10,000.000	12,521.320	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	10,000.000	13,405.020	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	10,000.000	15,468.400	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	10,000.000	14,419.150	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	10,000.000	12,935.590	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	10,000.000	16,701.990	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	10,000.000	19,122.270	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	10,000.000	14,665.080		
イギリス・ポンド 小計		110,000.000 (15,282,300)	151,696.910 (21,075,252)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	10,000.000	9,955.780	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	10,000.000	10,034.190	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	20,000.000	22,302.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	10,000.000	11,443.630	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	10,000.000	10,883.680	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	10,000.000	11,289.470	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	20,000.000	23,992.940	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	10,000.000	13,360.510		
オーストラリア・ドル 小計		100,000.000 (7,849,000)	113,262.200 (8,889,950)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 11/01/22	10,000.000	10,004.500	
	CANADA 1.0 06/01/27	10,000.000	10,307.100	
	CANADA 2.5 06/01/24	20,000.000	21,504.600	
	CANADA 2.75 12/01/48	10,000.000	13,548.300	

	CANADA 5.75 06/01/29	10,000.000	14,201.400	
カナダ・ドル	小計	60,000.000 (4,898,400)	69,565.900 (5,679,360)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.875 09/01/30	10,000.000	11,814.500	
シンガポール・ドル	小計	10,000.000 (781,000)	11,814.500 (922,712)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	20,000.000	21,474.280	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	20,000.000	31,547.200	
スウェーデン・クローナ	小計	40,000.000 (496,400)	53,021.480 (657,997)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/29	10,000.000	10,927.600	
	DENMARK 1.75 11/15/25	10,000.000	11,199.680	
	DENMARK 4.5 11/15/39	30,000.000	57,833.790	
デンマーク・クローネ	小計	50,000.000 (850,500)	79,961.070 (1,360,138)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.375 08/19/30	10,000.000	10,466.950	
	NORWAY 1.75 02/17/27	20,000.000	21,319.680	
	NORWAY 1.75 03/13/25	10,000.000	10,534.420	
	NORWAY 2.0 05/24/23	20,000.000	20,842.280	
ノルウェー・クローネ	小計	60,000.000 (716,400)	63,163.330 (754,170)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.5 07/25/27	50,000.000	55,193.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	10,000.000	13,852.000	
ポーランド・ズロチ	小計	60,000.000 (1,711,800)	69,045.500 (1,969,868)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	103,000.000	142,183.260	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	136,000.000	164,350.560	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	107,000.000	129,898.000	
メキシコ・ペソ	小計	346,000.000 (1,781,900)	436,431.820 (2,247,624)	
ユーロ	AUSTRIA 1.2 10/20/25	10,000.000	10,953.910	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	10,000.000	10,938.490	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	20,000.000	21,437.920	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	20,000.000	21,613.480	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	10,000.000	17,220.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	10,000.000	10,701.650	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	10,000.000	13,437.130	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	10,000.000	18,344.460	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	10,000.000	14,538.800	
	BUNDESOBL 04/14/23	10,000.000	10,192.180	
	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	10,000.000	10,654.900	

DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	10,000.000	10,804.110	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	10,000.000	10,769.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	10,000.000	10,560.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	10,000.000	10,691.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	10,000.000	10,869.320	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	10,000.000	10,864.200	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	10,000.000	14,278.060	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	20,000.000	21,134.900	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	10,000.000	17,428.590	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	10,000.000	17,456.160	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	10,000.000	16,404.500	
FINLAND 0.75 04/15/31	10,000.000	11,247.720	
FINLAND 4.0 07/04/25	10,000.000	12,202.330	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	10,000.000	10,538.160	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	10,000.000	10,548.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	10,000.000	11,063.880	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	20,000.000	21,704.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	10,000.000	11,975.110	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	10,000.000	12,103.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	10,000.000	11,980.770	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	10,000.000	13,456.500	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	30,000.000	31,697.970	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	10,000.000	12,827.720	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	10,000.000	12,353.880	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	10,000.000	21,893.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	20,000.000	22,908.200	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	10,000.000	19,069.040	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	10,000.000	15,149.480	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	10,000.000	17,356.470	
IRISH 0.9 05/15/28	10,000.000	11,043.040	
IRISH 2.4 05/15/30	10,000.000	12,657.780	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	10,000.000	10,737.040	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	10,000.000	11,111.950	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	10,000.000	11,256.120	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	10,000.000	14,750.550	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	20,000.000	22,970.760	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	10,000.000	14,475.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	20,000.000	23,104.100	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	10,000.000	12,363.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	10,000.000	11,179.690	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	10,000.000	11,369.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	10,000.000	13,386.340	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	10,000.000	15,405.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	10,000.000	14,250.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	10,000.000	11,118.460	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	10,000.000	15,870.000	

	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	10,000.000	14,291.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	10,000.000	14,228.000	
	NETHERLANDS 0.25 07/15/25	10,000.000	10,472.340	
	NETHERLANDS 0.5 07/15/26	10,000.000	10,695.000	
	NETHERLANDS 0.75 07/15/28	10,000.000	11,085.530	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	10,000.000	18,829.210	
	SPAIN 1.4 04/30/28	10,000.000	11,217.280	
	SPAIN 1.45 04/30/29	10,000.000	11,346.150	
	SPAIN 2.35 07/30/33	10,000.000	12,690.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	10,000.000	14,855.470	
	SPAIN 2.75 10/31/24	10,000.000	11,296.690	
	SPAIN 4.7 07/30/41	10,000.000	18,069.890	
	SPAIN 5.4 01/31/23	20,000.000	22,574.940	
	SPAIN 5.75 07/30/32	10,000.000	16,543.100	
	SPAIN 5.9 07/30/26	10,000.000	13,600.620	
	SPAIN 6.0 01/31/29	10,000.000	15,053.080	
	ユーロ 小計	830,000.000 (105,078,000)	1,055,265.420 (133,596,602)	
国債証券 合計		261,266,100 (261,266,100)	314,326,584 (314,326,584)	
合計			314,326,584 (314,326,584)	

(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 62銘柄	42.59	43.64
イギリス・ポンド	国債証券 11銘柄	6.54	6.70
オーストラリア・ドル	国債証券 8銘柄	2.76	2.83
カナダ・ドル	国債証券 5銘柄	1.76	1.81
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	0.29	0.29
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	0.20	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 3銘柄	0.42	0.43
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	0.23	0.24
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	0.61	0.63
メキシコ・ペソ	国債証券 3銘柄	0.70	0.72
ユーロ	国債証券 73銘柄	41.48	42.50

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

グローバル高金利通貨マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2020年12月15日現在

資産の部		
流動資産		
預金		12,660
コール・ローン		9,184,597
特殊債券		3,549,112,637
未収利息		119,984,976
前払費用		13,363,606
流動資産合計		3,691,658,476
資産合計		3,691,658,476
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本		3,389,588,927
剰余金		
剰余金又は欠損金()		302,069,549
元本等合計		3,691,658,476
純資産合計		3,691,658,476
負債純資産合計		3,691,658,476

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2020年12月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,139,279,103円
同期中追加設定元本額	1,066,853円
同期中一部解約元本額	750,757,029円
元本の内訳	
ファンド名	
高金利通貨ファンド	3,380,198,015円
グローバル・ナビ	9,390,912円
計	3,389,588,927円
2. 受益権の総数	3,389,588,927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 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15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	2020年12月15日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
特殊債券		8,676,046
合計		8,676,046

(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3月10日から2020年12月15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)

2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0891円 (10,891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

2020年12月15日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券	インド・ルピー	ASIAN DEV BANK 5.9 12/20/22	192,000,000.000	196,368,000.000	
		EBRD 6.0 02/07/23	36,000,000.000	37,711,800.000	
		IADB 5.5 08/23/21	30,000,000.000	30,154,029.000	
		IFC 6.3 11/25/24	34,000,000.000	35,425,450.000	

インド・ルピー 小計		292,000,000.000 (414,640,000)	299,659,279.000 (425,516,176)	
インドネシア・ルピア	EBRD 6.45 12/13/22	22,000,000,000.000	22,904,200,000.000	
	EBRD 7.5 05/15/22	14,000,000,000.000	14,565,880,000.000	
	IADB 7.875 03/14/23	23,000,000,000.000	24,735,350,000.000	
インドネシア・ルピア 小計		59,000,000,000.000 (436,600,000)	62,205,430,000.000 (460,320,182)	
トルコ・リラ	EBRD 24.0 09/10/21	5,500,000.000	5,779,295.500	
	EBRD 24.0 10/05/22	4,500,000.000	5,041,800.000	
	EIB 09/05/22	19,500,000.000	15,525,900.000	
	IADB 26.5 10/25/21	3,500,000.000	3,798,032.000	
トルコ・リラ 小計		33,000,000.000 (437,250,000)	30,145,027.500 (399,421,614)	
ブラジル・リアル	IFC 7.0 02/14/24	3,100,000.000	3,271,616.000	
	IFC 8.25 01/30/23	15,500,000.000	16,889,575.000	
ブラジル・リアル 小計		18,600,000.000 (378,324,000)	20,161,191.000 (410,078,625)	
ポーランド・ズロチ	EBRD 0.25 11/20/23	9,000,000.000	8,982,421.740	
	EIB 3.0 05/24/24	6,000,000.000	6,554,100.000	
ポーランド・ズロチ 小計		15,000,000.000 (427,950,000)	15,536,521.740 (443,256,965)	
メキシコ・ペソ	EIB 4.75 01/19/21	20,000,000.000	20,017,000.000	
	EIB 5.5 01/23/23	18,100,000.000	18,530,780.000	
	EIB 7.625 01/12/22	21,500,000.000	22,258,520.000	
	EIB 7.75 01/30/25	25,000,000.000	27,512,500.000	
メキシコ・ペソ 小計		84,600,000.000 (435,690,000)	88,318,800.000 (454,841,820)	
ロシア・ルーブル	ASIAN DEV BANK 7.0 03/14/22	97,000,000.000	100,909,100.000	
	IFC 5.5 03/20/23	80,000,000.000	82,520,000.000	
	IFC 6.375 04/11/22	136,000,000.000	140,666,296.000	
ロシア・ルーブル 小計		313,000,000.000 (444,460,000)	324,095,396.000 (460,215,462)	
南アフリカ・ランド	EIB 8.375 07/29/22	37,000,000.000	39,299,698.000	
	EIB 8.5 09/17/24	29,000,000.000	32,195,510.000	
南アフリカ・ランド 小計		66,000,000.000 (457,380,000)	71,495,208.000 (495,461,793)	
特殊債券 合計		3,432,294,000 (3,432,294,000)	3,549,112,637 (3,549,112,637)	
合計			3,549,112,637 (3,549,112,637)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
インド・ルピー	特殊債券 4銘柄	11.53	11.99
インドネシア・ルピア	特殊債券 3銘柄	12.47	12.97
トルコ・リラ	特殊債券 4銘柄	10.82	11.25
ブラジル・リアル	特殊債券 2銘柄	11.11	11.55
ポーランド・ズロチ	特殊債券 2銘柄	12.01	12.49
メキシコ・ペソ	特殊債券 4銘柄	12.32	12.82
ロシア・ルーブル	特殊債券 3銘柄	12.47	12.97
南アフリカ・ランド	特殊債券 2銘柄	13.42	13.96

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年12月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,405,278
投資証券	1,535,325,050
未収入金	3,715,060
未収配当金	10,719,439
流動資産合計	1,554,164,827
資産合計	1,554,164,827
負債の部	
流動負債	
未払金	1,118,163
未払解約金	3,444,000
流動負債合計	4,562,163
負債合計	4,562,163
純資産の部	
元本等	
元本	845,470,776
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	704,131,888
元本等合計	1,549,602,664
純資産合計	1,549,602,664
負債純資産合計	1,554,164,827

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,103,895,941円
同期中追加設定元本額	168,949,447円
同期中一部解約元本額	427,374,612円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	335,584,322円
グローバル・ナビ	5,540,354円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	504,346,100円
計	845,470,776円
2. 受益権の総数	845,470,776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 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15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	2020年12月15日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券		30,718,086
合計		30,718,086

(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10月21日から2020年12月15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)

2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8328円 (18,328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

2020年12月15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	46	7,153,000	
	GLP投資法人	523	81,117,300	

MCUBS MidCity投資法人	205	17,999,000	
Oneリート投資法人	26	6,461,000	
SOSILA物流リート投資法人	44	5,293,200	
いちごオフィスリート投資法人	139	9,896,800	
いちごホテルリート投資法人	29	2,044,500	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	84	34,524,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	159	47,620,500	
イオンリート投資法人	170	21,165,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,075	15,060,750	
インヴィンシブル投資法人	700	23,730,000	
エスコンジャパンリート投資法人	27	3,075,300	
オリックス不動産投資法人	333	53,246,700	
グローバル・ワン不動産投資法人	116	11,600,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	52	34,996,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	109	19,412,900	
ケネディクス商業リート投資法人	62	15,041,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	73	20,673,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人	32	3,321,600	
サンケイリアルエステート投資法人	41	3,956,500	
ザイマックス・リート投資法人	26	2,368,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	539	28,728,700	
ジャパンエクセレント投資法人	155	18,817,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	167	94,355,000	
スターアジア不動産投資法人	172	8,350,600	
スターツプロシード投資法人	26	5,015,400	
タカラレーベン不動産投資法人	50	4,425,000	
トーセイ・リート投資法人	37	4,025,600	
ヒューリックリート投資法人	135	19,575,000	
フロンティア不動産投資法人	56	21,784,000	
プレミア投資法人	151	18,271,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	36	4,500,000	
マリモ地方創生リート投資法人	16	1,816,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	358	45,036,400	
ラサールロジポート投資法人	187	29,284,200	

伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	65	8,411,000	
阪急阪神リート投資法人	76	9,401,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	58	29,058,000	
三菱地所物流リート投資法人	38	15,010,000	
産業ファンド投資法人	237	41,854,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	36	4,129,200	
森トラスト総合リート投資法人	120	15,216,000	
森ヒルズリート投資法人	197	27,126,900	
星野リゾート・リート投資法人	25	12,487,500	
積水ハウス・リート投資法人	492	37,736,400	
大江戸温泉リート投資法人	27	1,860,300	
大和ハウスリート投資法人	239	59,439,300	
大和証券オフィス投資法人	36	22,212,000	
大和証券リビング投資法人	219	19,994,700	
投資法人みらい	181	6,932,300	
東急リアル・エステート投資法人	112	17,158,400	
日本アコモデーションファンド投資法人	58	32,074,000	
日本ビルファンド投資法人	188	109,792,000	
日本プライムリアルティ投資法人	104	34,372,000	
日本プロロジスリート投資法人	253	80,074,500	
日本リート投資法人	54	19,305,000	
日本リテールファンド投資法人	314	55,546,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	109	32,176,800	
福岡リート投資法人	87	12,823,800	
平和不動産リート投資法人	103	12,246,700	
野村不動産マスターファンド投資法人	541	75,144,900	
投資証券 合計	10,125	1,535,325,050	
合計		1,535,325,050	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2020年12月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,392,663
コール・ローン	1,364,475
投資証券	608,710,847
未収配当金	1,228,674
流動資産合計	612,696,659
資産合計	612,696,659
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	359,689,197
剰余金	
剰余金又は欠損金()	253,007,462
元本等合計	612,696,659
純資産合計	612,696,659
負債純資産合計	612,696,659

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	369,050,948円
同期中追加設定元本額	99,125,885円
同期中一部解約元本額	108,487,636円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	353,835,698円
グローバル・ナビ	5,853,499円
計	359,689,197円
2. 受益権の総数	359,689,197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 2019年12月17日 至 2020年12月15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	2020年12月15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	2020年12月15日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券	24,057,414	
合計	24,057,414	

(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10月21日から2020年12月15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)

	2020年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7034円 (17,034円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2020年12月15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	451.000	6,598.130	
		AGREE REALTY CORP	278.000	18,489.780	

ALEXANDER & BALDWIN INC	380.000	6,129.400	
ALEXANDER'S INC.	11.000	3,066.690	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	658.000	113,722.140	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	267.000	7,670.910	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	719.000	30,766.010	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	570.000	4,314.900	
AMERICAN HOMES 4 RENT	1,363.000	40,535.620	
AMERICAN TOWER CORP	2,316.000	501,923.520	
AMERICOLD REALTY TRUST	1,069.000	36,217.720	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	786.000	31,707.240	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,100.000	14,003.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	309.000	3,389.730	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	739.000	117,996.130	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	128.000	1,387.520	
BOSTON PROPERTIES INC	817.000	80,474.500	
BRANDYWINE REALTY TRUST	884.000	10,413.520	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,555.000	24,724.500	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	245.000	3,858.750	
BRT APARTMENTS CORP	60.000	905.400	
CAMDEN PROPERTY TRUST	495.000	47,767.500	
CARETRUST REIT INC	499.000	11,052.850	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	254.000	2,504.440	
CHATHAM LODGING TRUST	246.000	2,829.000	
CITY OFFICE REIT INC	227.000	2,190.550	
CLIPPER REALTY INC	88.000	565.840	
COLONY CAPITAL INC	2,507.000	11,858.110	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	608.000	8,609.280	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	1,009.000	11,104.040	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	112.000	5,269.600	
CORECIVIC INC	624.000	4,904.640	
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	79.000	604.350	
COREPOINT LODGING INC	205.000	1,353.000	
CORESITE REALTY CORP	211.000	25,052.030	

CORPORATE OFFICE PROPERTIES	589.000	15,384.680	
COUSINS PROPERTIES INC	777.000	26,767.650	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2,181.000	338,469.390	
CUBESMART	1,014.000	33,046.260	
CYRUSONE INC	612.000	40,808.160	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,061.000	8,604.710	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,405.000	179,966.450	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	1,259.000	5,426.290	
DOUGLAS EMMETT INC	873.000	26,879.670	
DUKE REALTY TRUST	1,934.000	74,865.140	
EAST GROUP	202.000	26,874.080	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	418.000	9,003.720	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	756.000	7,340.760	
EPR PROPERTIES	388.000	12,128.880	
EQUINIX INC	462.000	318,793.860	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	913.000	55,674.740	
EQUITY RESIDENTIAL	1,931.000	111,804.900	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	485.000	9,884.300	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	342.000	82,168.920	
EXTRA SPACE STORAGE INC	662.000	72,740.560	
FARMLAND PARTNERS INC	139.000	1,185.670	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	395.000	35,103.650	
FIRST INDUSTRIAL RT	663.000	27,322.230	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	367.000	10,716.400	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	542.000	2,601.600	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	261.000	4,222.980	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,081.000	45,553.340	
GEO GROUP INC	626.000	6,047.160	
GETTY REALTY CORP	178.000	5,131.740	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	179.000	3,284.650	
GLADSTONE LAND CORP	102.000	1,523.880	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	220.000	3,141.600	
GLOBAL NET LEASE INC	479.000	8,071.150	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	705.000	20,621.250	

HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,141.000	29,859.970	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,832.000	81,788.160	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	178.000	1,459.600	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	540.000	21,232.800	
HOST HOTELS & RESORTS INC	3,670.000	51,490.100	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	788.000	19,715.760	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	504.000	6,657.840	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	345.000	8,035.050	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	68.000	4,739.600	
INVITATION HOMES INC	2,946.000	84,785.880	
IRON MOUNTAIN INC	1,502.000	43,963.540	
JBG SMITH PROPERTIES	639.000	19,981.530	
KILROY REALTY CORP	603.000	35,727.750	
KIMCO REALTY	2,168.000	31,284.240	
KITE REALTY GROUP TRUST	433.000	6,486.340	
LAMAR ADVERTISING CO	451.000	35,398.990	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,428.000	15,351.000	
LIFE STORAGE INC	245.000	27,726.650	
LTC PROPERTIES INC	206.000	7,931.000	
MACK CALI	461.000	6,122.080	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,730.000	56,784.000	
MID AMERICA	598.000	72,621.120	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	504.000	8,144.640	
NATIONAL HEALTH INVS INC	225.000	15,025.500	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	899.000	35,870.100	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	329.000	11,202.450	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	435.000	2,557.800	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	115.000	4,959.950	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	254.000	6,070.600	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	1,181.000	44,275.690	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	84.000	1,792.560	
OUTFRONT MEDIA INC	755.000	14,450.700	
PARAMOUNT GROUP INC	1,011.000	9,291.090	
PARK HOTELS & RESORTS INC	1,234.000	20,595.460	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	679.000	11,930.030	
PHYSICIANS REALTY TRUST	1,089.000	19,471.320	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	659.000	10,649.440	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	80.000	1,080.800	
POTLATCH CORP	342.000	16,549.380	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	248.000	1,889.760	
PROLOGIS INC	3,864.000	374,305.680	
PS BUSINESS PARKS	105.000	13,761.300	
PUBLIC STORAGE	792.000	177,202.080	
QTS REALTY TRUST INC	320.000	18,707.200	
RAYONIER INC	692.000	21,092.160	
REALTY INCOME CORP	1,807.000	109,540.340	
REGENCY CENTERS CORP	885.000	41,488.800	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	606.000	8,114.340	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,119.000	9,891.960	
RETAIL VALUE INC	91.000	1,264.900	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	648.000	30,345.840	
RLJ LODGING TRUST	857.000	11,449.520	
RPT REALTY	432.000	3,594.240	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	263.000	16,618.970	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,072.000	18,695.680	
SAFEHOLD INC	92.000	6,390.320	
SAUL CENTERS INC	63.000	2,090.970	
SBA COMMUNICATIONS CORP	581.000	159,292.770	
SERVICE PROPERTIES TRUST	856.000	9,818.320	
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,696.000	148,094.720	
SITE CENTERS CORP	799.000	8,069.900	
SL GREEN	383.000	22,348.050	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	540.000	21,632.400	
STAG INDUSTRIAL INC	782.000	23,749.340	
STORE CAPITAL CORP	1,223.000	39,588.510	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	540.000	5,022.000	
SUN COMMUNITIES INC	508.000	72,755.760	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,122.000	12,207.360	
TANGER FACTORY OUTLET	473.000	5,150.970	
TAUBMAN CENTERS INC	315.000	13,510.350	
TERRENO REALTY CORP	348.000	19,341.840	
THE MACERICH COMPANY	785.000	8,642.850	

	UDR INC	1,538.000	57,813.420	
	UMH PROPERTIES INC	195.000	3,028.350	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	67.000	4,661.190	
	URBAN EDGE PROPERTIES	617.000	8,489.920	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	158.000	2,275.200	
	VENTAS INC	1,960.000	93,766.400	
	VEREIT INC	5,669.000	42,574.190	
	VICI PROPERTIES INC	2,807.000	71,241.660	
	VORNADO REALTY TRUST	921.000	35,071.680	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,143.000	1,200.150	
	WASHINGTON REIT	431.000	9,990.580	
	WEINGARTEN REALTY INVST	637.000	14,103.180	
	WELLTOWER INC	2,196.000	138,875.040	
	WEYERHAEUSER CO	3,923.000	126,948.280	
	WHITESTONE REIT	208.000	1,645.280	
	WP CAREY INC	898.000	62,105.680	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	602.000	8,602.580	
	アメリカ・ドル 小計	129,298.000	5,846,243.250 (608,710,847)	
投資証券 合計		129,298	608,710,847 (608,710,847)	
合計			608,710,847 (608,710,847)	

(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 158銘柄	99.35	100.00

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間計算期間(2020年12月16日から2021年6月15日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【グローバル・ナビ】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第7期 2020年12月15日現在	第8期中間計算期間末 2021年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,394,959	11,899,105
投資信託受益証券	10,212,470	11,118,907
親投資信託受益証券	182,329,139	195,340,290
未収配当金	110,847	69,944
流動資産合計	204,047,415	218,428,246
資産合計	204,047,415	218,428,246
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	54,568	57,373
未払委託者報酬	1,496,239	1,573,075
その他未払費用	3,819	3,982
流動負債合計	1,554,626	1,634,430
負債合計	1,554,626	1,634,430
純資産の部		
元本等		
元本	161,493,279	158,118,955
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	40,999,510	58,674,861
(分配準備積立金)	26,887,088	26,325,291
元本等合計	202,492,789	216,793,816
純資産合計	202,492,789	216,793,816
負債純資産合計	204,047,415	218,428,246

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第7期中間計算期間 自 2019年12月17日 至 2020年6月16日	第8期中間計算期間 自 2020年12月16日 至 2021年6月15日
営業収益		
受取配当金	301,531	69,945
有価証券売買等損益	6,655,195	19,964,634
為替差損益	188,612	538,779
営業収益合計	6,542,276	20,573,358
営業費用		
支払利息	2,360	775
受託者報酬	54,536	57,373
委託者報酬	1,495,256	1,573,075
その他費用	202,693	230,692
営業費用合計	1,754,845	1,861,915
営業利益又は営業損失()	8,297,121	18,711,443
経常利益又は経常損失()	8,297,121	18,711,443
中間純利益又は中間純損失()	8,297,121	18,711,443
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	2,761	179,420
期首剰余金又は期首欠損金()	39,269,900	40,999,510
剰余金増加額又は欠損金減少額	89,362	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	89,362	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	603,603	856,672
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	603,603	856,672
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	30,455,777	58,674,861

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第8期中間計算期間	
	自 2020年12月16日	至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 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>	
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>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第7期	第8期中間計算期間末
	2020年12月15日現在	2021年6月15日現在
1. 期首元本額	170,479,099円	161,493,279円
期中追加設定元本額	595,709円	- 円
期中一部解約元本額	9,581,529円	3,374,324円
2. 受益権の総数	161,493,279口	158,118,955口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期中間計算期間	第8期中間計算期間
	自 2019年12月17日 至 2020年6月16日	自 2020年12月16日 至 2021年6月15日
1. その他費用	<p>その他費用の内訳は、監査費用（3,865円）、保管費用（198,828円）となっております。</p>	<p>その他費用の内訳は、監査費用（3,982円）、保管費用（226,710円）となっております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期	第8期中間計算期間末
	2020年12月15日現在	2021年6月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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>	<p>中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</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)」にて記載していません。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第7期 2020年12月15日現在	第8期中間計算期間末 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2539円 (12,539円)	1,3711円 (13,711円)

(重要な後発事象に関する注記)

第8期中間計算期間末 自 2020年12月16日 至 2021年6月15日
委託会社は、当ファンドについて信託約款第53条の規定に基づき、2021年7月7日付で繰上償還するための手続を進めることを決定いたしました。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2021年6月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	56,241,316
株式	2,491,814,520
派生商品評価勘定	329,010
未収配当金	15,652,762
前払金	105,000
差入委託証拠金	2,430,000
流動資産合計	2,566,572,608
資産合計	2,566,572,608
負債の部	
流動負債	
未払金	473,952
流動負債合計	473,952
負債合計	473,952
純資産の部	
元本等	
元本	930,600,246
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,635,498,410
元本等合計	2,566,098,656
純資産合計	2,566,098,656
負債純資産合計	2,566,572,608

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12月16日 至 2021年6月15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6月15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	1,023,862,517円
同期中追加設定元本額	14,138,283円
同期中一部解約元本額	107,400,554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	190,847,972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)	69,109,194円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	346,120,998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)	14,655,922円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	27,707,886円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	9,970,099円
グローバル・ナビ	15,848,888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	11,841,771円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	847,746円
計	930,600,246円
2. 受益権の総数	930,600,246口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6月15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	<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>

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年6月15日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	58,845,000	-	59,175,000	330,000
合計	58,845,000	-	59,175,000	330,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.7575円
(1万口当たり純資産額)	(27,575円)

新光外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年6月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	83,200,044
コール・ローン	4,863,308
株式	1,937,905,298
新株予約権証券	36,846
投資信託受益証券	3,608,857
投資証券	42,717,523
派生商品評価勘定	249,124
未収入金	34,607
未収配当金	2,176,113
差入委託証拠金	78,038,758
流動資産合計	2,152,830,478
資産合計	2,152,830,478
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,333
未払解約金	9,000
流動負債合計	18,333
負債合計	18,333
純資産の部	
元本等	
元本	607,166,582
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,545,645,563
元本等合計	2,152,812,145
純資産合計	2,152,812,145
負債純資産合計	2,152,830,478

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12月16日 至 2021年6月15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>
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6月15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	705,883,416円
同期中追加設定元本額	- 円
同期中一部解約元本額	98,716,834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V A	253,043,191円

世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	107,811,735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)	3,809,437円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	15,014,541円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	7,977,272円
グローバル・ナビ	9,249,187円
計	607,166,582円
2. 受益権の総数	607,166,582口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年6月15日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引					
先物取引					
買建	166,144,096	-	166,383,887		239,791
合計	166,144,096	-	166,383,887		239,791

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月15日現在

1口当たり純資産額	3,5457円
(1万口当たり純資産額)	(35,457円)

新光日本債券インデックスマザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年6月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	71,889,900
国債証券	7,392,277,200
地方債証券	822,841,020
特殊債券	624,977,000
社債券	509,374,000
未収利息	21,597,489
前払費用	478,488
流動資産合計	9,443,435,097
資産合計	
9,443,435,097	
負債の部	
流動負債	
未払金	50,828,300
未払解約金	5,530,000
流動負債合計	56,358,300
負債合計	
56,358,300	
純資産の部	
元本等	
元本	7,299,479,682
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,087,597,115
元本等合計	9,387,076,797
純資産合計	9,387,076,797
負債純資産合計	9,443,435,097

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12月16日 至 2021年6月15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6月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,133,049,465円
同期中追加設定元本額	524,916,104円
同期中一部解約元本額	358,485,887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	768,593,022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	5,316,022,845円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	575,093,611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）	30,986,067円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	77,161,858円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	34,851,578円
グローバル・ナビ	24,655,556円
計	7,299,479,682円
2. 受益権の総数	7,299,479,682口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6月15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る場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.2860円
(1万口当たり純資産額)	(12,860円)

海外国債マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2021年6月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	99,742,593
国債証券	16,587,515,695
未収入金	55,364,668
未収利息	62,689,465
前払費用	7,700,024
流動資産合計	16,813,012,445
資産合計	16,813,012,445
負債の部	
流動負債	
前受金	55,384,352
流動負債合計	55,384,352
負債合計	55,384,352
純資産の部	
元本等	
元本	6,375,408,800
剰余金	
剰余金又は欠損金()	10,382,219,293
元本等合計	16,757,628,093
純資産合計	16,757,628,093
負債純資産合計	16,813,012,445

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12月16日 至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年6月15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	6,718,227,380円
同期中追加設定元本額	47,311,294円
同期中一部解約元本額	390,129,874円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	4,660,068,481円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	797,969,783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）	21,063,822円
海外国債ファンド（変額年金）	641,515,644円
グローバル・ナビ	12,264,876円
計	6,375,408,800円
2. 受益権の総数	6,375,408,800口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.6285円
(1万口当たり純資産額)	(26,285円)

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

(単位:円)

2021年6月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	8,999,703
コール・ローン	303,071
国債証券	301,264,630
派生商品評価勘定	366,915
未収利息	1,745,618
前払費用	36,875
差入委託証拠金	1,973
流動資産合計	312,718,785
資産合計	
312,718,785	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	947,833
未払金	5,066
流動負債合計	952,899
負債合計	
952,899	
純資産の部	
元本等	
元本	215,786,552
剰余金	
剰余金又は欠損金()	95,979,334
元本等合計	311,765,886
純資産合計	
311,765,886	
負債純資産合計	
312,718,785	

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12月16日 至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年6月15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	215,323,208円
同期中追加設定元本額	13,701,220円
同期中一部解約元本額	13,237,876円
元本の内訳	
ファンド名	
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	82,945,316円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	86,890,269円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	31,155,244円
グローバル・ナビ	14,795,723円
計	215,786,552円
2. 受益権の総数	215,786,552口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	--

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年6月15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					
アメリカ・ドル	309,746,556	-	310,327,474	580,918	
イギリス・ポンド	136,718,311	-	137,610,132	891,821	
オーストラリア・ドル	20,723,777	-	20,709,394	14,383	
カナダ・ドル	6,857,921	-	6,876,470	18,549	
シンガポール・ドル	6,743,762	-	6,753,372	9,610	
シンガポール・ドル	1,514,949	-	1,518,155	3,206	
スウェーデン・クローナ	1,091,019	-	1,092,657	1,638	
デンマーク・クローネ	1,823,983	-	1,820,130	3,853	
ノルウェー・クローネ	1,170,056	-	1,176,580	6,524	
ポーランド・ズロチ	2,266,442	-	2,235,346	31,096	
メキシコ・ペソ	2,918,565	-	2,935,050	16,485	
ユーロ	127,917,771	-	127,600,188	317,583	
合計	309,746,556	-	310,327,474	580,918	

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.4448円
(1万口当たり純資産額)	(14,448円)

グローバル高金利通貨マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年6月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	17,827,485
コール・ローン	5,621,679
特殊債券	3,435,872,019
未収利息	110,048,807
前払費用	74,427
流動資産合計	3,569,444,417
資産合計	3,569,444,417
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	3,049,465,891
剰余金	
剰余金又は欠損金()	519,978,526
元本等合計	3,569,444,417
純資産合計	3,569,444,417
負債純資産合計	3,569,444,417

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12月16日 至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. 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6月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,389,588,927円
同期中追加設定元本額	234,388円
同期中一部解約元本額	340,357,424円
元本の内訳	
ファンド名	
高金利通貨ファンド	3,040,221,390円
グローバル・ナビ	9,244,501円
計	3,049,465,891円
2. 受益権の総数	3,049,465,891口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	1,1705円
(1万口当たり純資産額)	(11,705円)

新光J-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年6月15日現在

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		775,121,206
投資証券		128,665,357,200
未収入金		135,008,489
未収配当金		754,080,573
流動資産合計		130,329,567,468
資産合計		130,329,567,468
負債の部		
流動負債		
未払解約金		675,606,000
流動負債合計		675,606,000
負債合計		675,606,000
純資産の部		
元本等		
元本		55,312,079,722
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		74,341,881,746
元本等合計		129,653,961,468
純資産合計		129,653,961,468
負債純資産合計		130,329,567,468

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12月16日 至 2021年6月15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6月15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	845,470,776円
同期中追加設定元本額	60,918,695,478円
同期中一部解約元本額	6,452,086,532円
元本の内訳	
ファンド名	
J-REITパッケージ	2,868,836,631円
新光J-REITオープン	50,427,683,862円
One DC 国内リートインデックスファンド	970,689,383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	4,749,778円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	732,445,912円
計	55,312,079,722円
2. 受益権の総数	55,312,079,722口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6月15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）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	2,344円
(1万口当たり純資産額)	(23,440円)

新光米国REITマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年6月15日現在

資産の部		
流動資産		
預金		2,741,439
コール・ローン		1,446,148
投資証券		760,246,647
未収配当金		1,275,988
流動資産合計		765,710,222
資産合計		765,710,222
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		331,569,477
剰余金		
剰余金又は欠損金()		434,140,745
元本等合計		765,710,222
純資産合計		765,710,222
負債純資産合計		765,710,222

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12月16日 至 2021年6月15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6月15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	359,689,197円
同期中追加設定元本額	- 円
同期中一部解約元本額	28,119,720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	5,008,159円
計	331,569,477円
2. 受益権の総数	331,569,477口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	2,3094円
(1万口当たり純資産額)	(23,094円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年6月30日現在

資産総額	215,676,039円
負債総額	138,666円
純資産総額(-)	215,537,373円
発行済数量	158,118,955口
1口当たり純資産額(/)	1.3631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6月30日現在

資産総額	2,499,293,297円
負債総額	555,990円
純資産総額(-)	2,498,737,307円
発行済数量	919,868,265口
1口当たり純資産額(/)	2.7164円

新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	2,151,302,430円
負債総額	5,913,656円
純資産総額(-)	2,145,388,774円
発行済数量	601,049,306口
1口当たり純資産額(/)	3.5694円

新光日本債券インデックスマザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	9,439,891,075円
負債総額	67,221,000円
純資産総額(-)	9,372,670,075円
発行済数量	7,295,877,374口
1口当たり純資産額(/)	1.2847円

海外国債マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	17,984,649,416円
負債総額	1,477,520,415円
純資産総額(-)	16,507,129,001円
発行済数量	6,356,798,054口
1口当たり純資産額(/)	2.5968円

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

2021年6月30日現在

資産総額	300,993,651円
負債総額	1,542,293円
純資産総額(-)	299,451,358円
発行済数量	207,537,982口
1口当たり純資産額(/)	1.4429円

グローバル高金利通貨マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	3,517,162,847円
負債総額	0円
純資産総額(-)	3,517,162,847円
発行済数量	3,036,569,321口
1口当たり純資産額(/)	1.1583円

新光J-REITマザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	128,076,274,040円
負債総額	276,628,000円
純資産総額(-)	127,799,646,040円
発行済数量	54,390,533,087口
1口当たり純資産額(/)	2.3497円

新光米国REITマザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	751,033,369円
負債総額	0円
純資産総額(-)	751,033,369円
発行済数量	331,569,477口
1口当たり純資産額(/)	2.2651円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2021年6月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2021年6月30日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年6月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,450,767,809,461
追加型株式投資信託	832	15,901,915,328,451
単位型公社債投資信託	29	62,455,496,430
単位型株式投資信託	213	1,310,125,137,088
合計	1,100	18,725,263,771,430

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あります。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 その他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(2020年3月31日現在)

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

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 その他有価証券(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) 通常の見積り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

2021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
みずほ証券株式会社（ ）	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
大山日ノ丸証券株式会社	215	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

() 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

2【関係業務の概要】

「受託会社」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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

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1月22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」に掲げられているグローバル・ナビの2019年12月17日から2020年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・ナビの2020年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月30日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

中間監査意見

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」に掲げられているグローバル・ナビの2020年12月16日から2021年6月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・ナビの2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2020年12月16日から2021年6月15日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

強調事項

重要な後発事象に関する注記に記載されているとおり、委託会社は、信託約款第53条に基づき2021年7月7日に繰上償還するための手続を進めることを決定した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。