

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券報告書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2022年1月20日提出
<b>【計算期間】</b>	第30特定期間(自 2021年4月21日至 2021年10月20日)
<b>【ファンド名】</b>	新光7資産バランスファンド
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【連絡場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類の定義

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

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分の定義

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

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

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

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

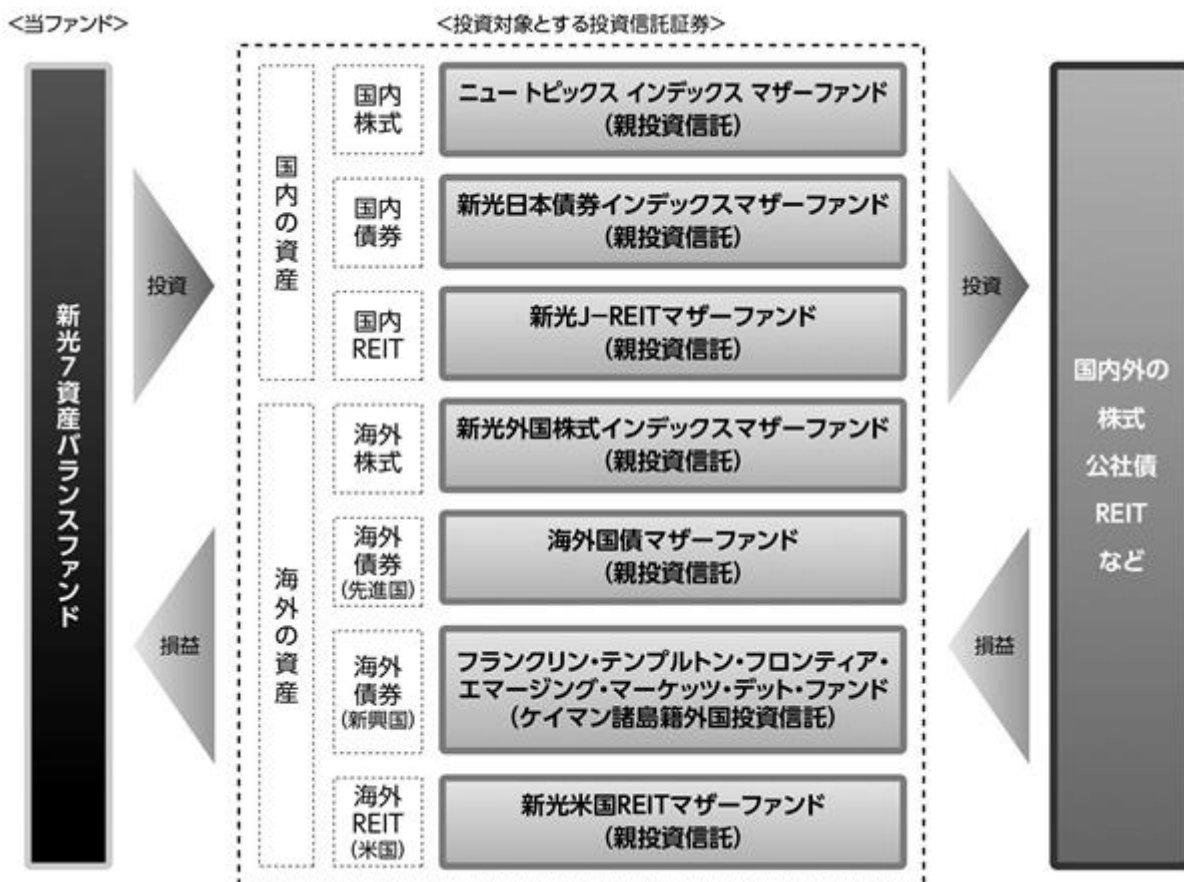
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



## b. ファンドの特色

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

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

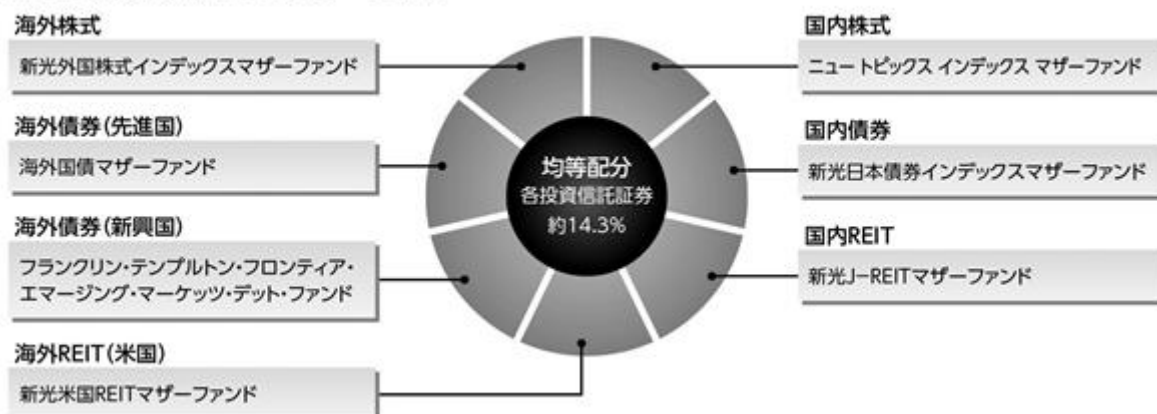


# 2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

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

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

## <基本投資配分比率のイメージ図>



## ■ 分配方針

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



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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

## 収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

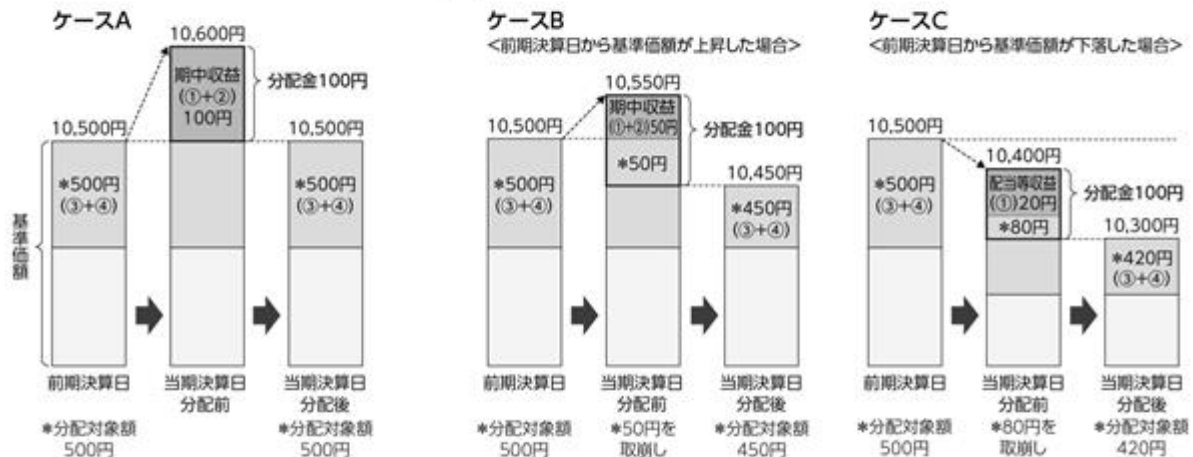
### 分配金額と基準価額の関係(イメージ)

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

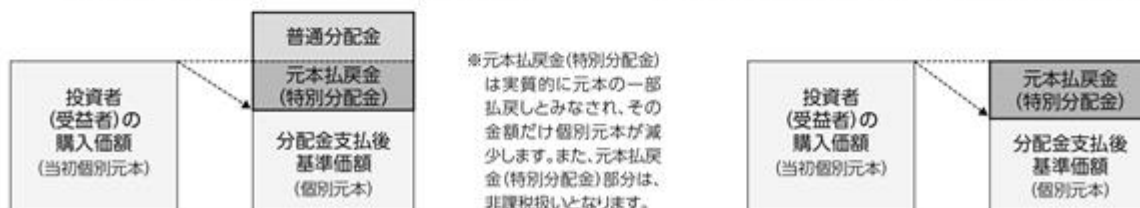
ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円  
 ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円  
 ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

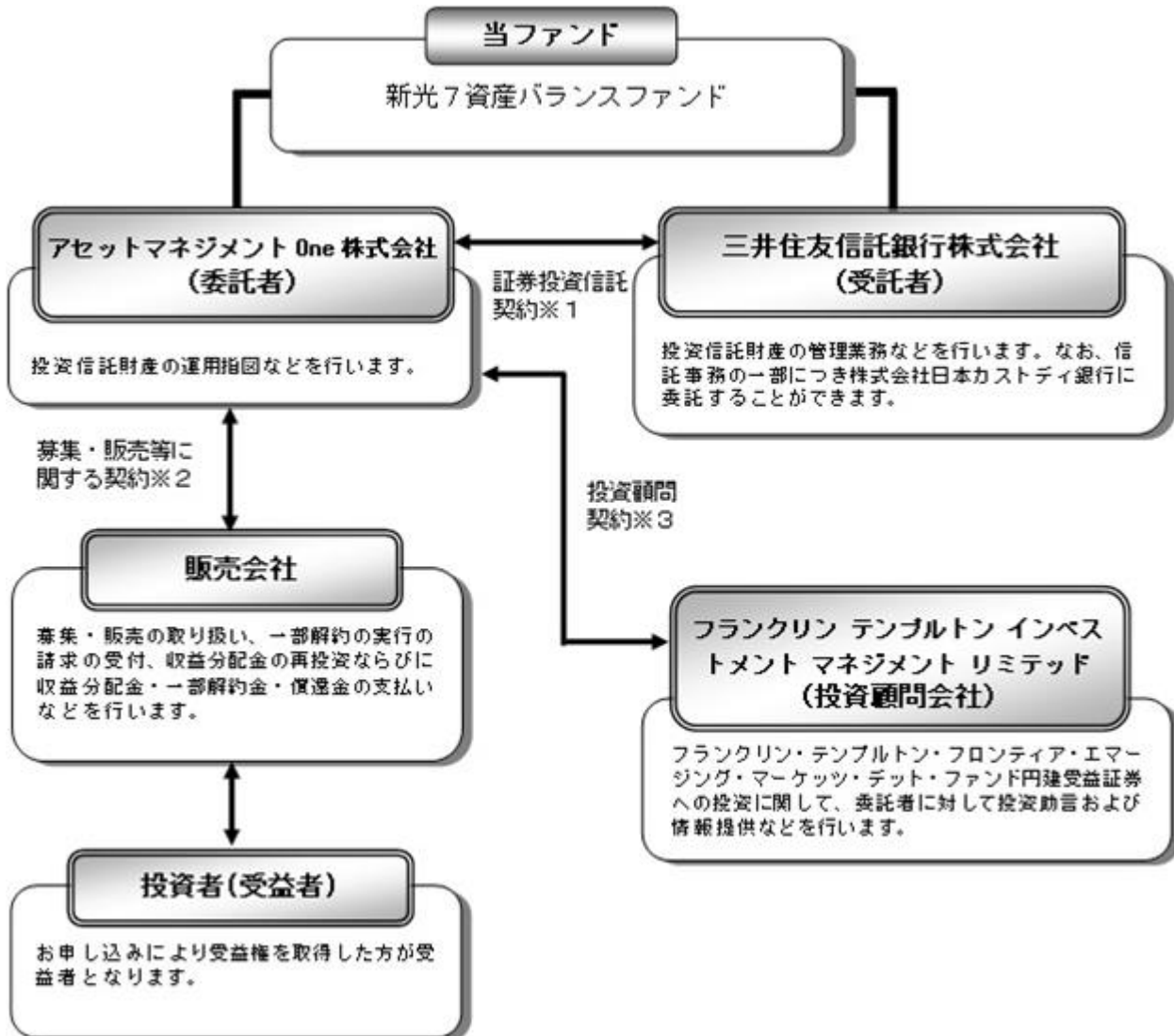
元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

## (2) 【ファンドの沿革】

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

## (3) 【ファンドの仕組み】

## a. ファンドの仕組み



## 1 証券投資信託契約

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

## 2 募集・販売等に関する契約

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

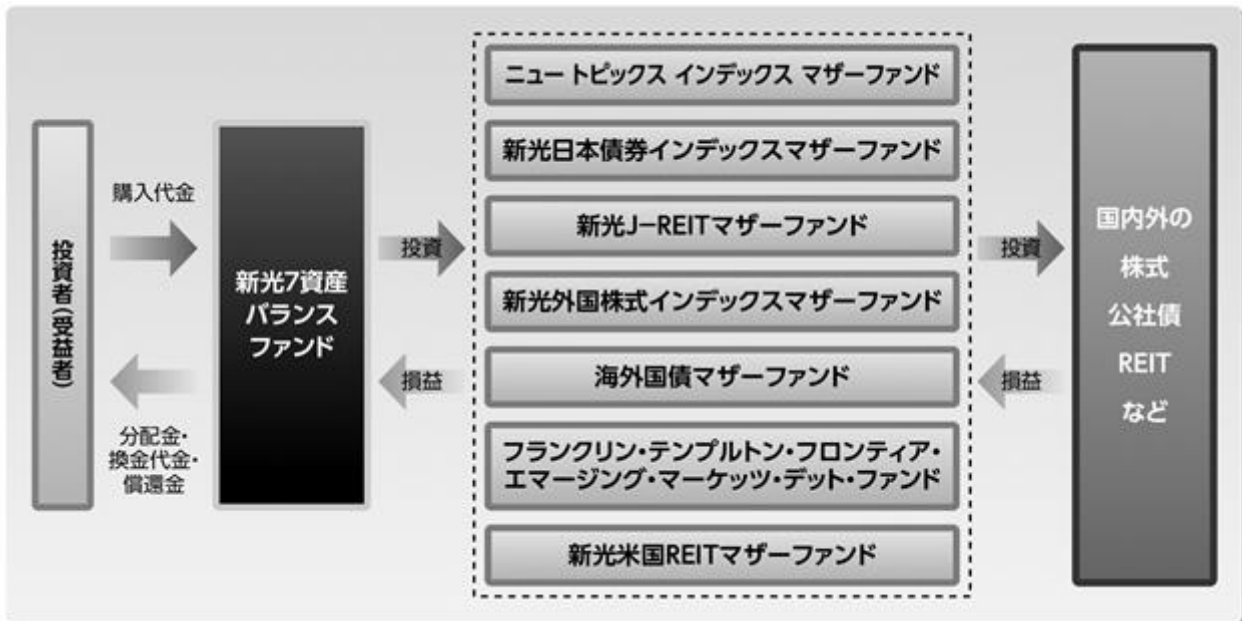


### 3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



## b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2021年10月29日現在）

## 委託会社の沿革

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

## 大株主の状況

（2021年10月29日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### a. 基本方針

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

#### b. 運用の方法

##### (イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

##### (ロ) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

## (2) 【投資対象】

## a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

## b. 運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

8. コマーシャル・ペーパー

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

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

11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

## 当ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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。</li> <li>・ 東京証券取引所第一部に上場されている株式<sup>*1</sup>を投資対象とします。</li> <li>・ 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<sup>*2</sup>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。</li> <li>・ 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<sup>*2</sup>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。</li> <li>・ 株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>・ 株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>*1 東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年3月16日に「東京証券取引所第一部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更を行う予定です。</p> <p>*2 東証市場再編のため、2022年3月16日に「東京証券取引所」から「東証株価指数」に変更を行う予定です。</p> </div>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年1月14日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2002年1月15日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 東証株価指数について

東証株価指数(TOPIX)とは、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークであり、株式会社東京証券取引所(以下「㈱東京証券取引所」といいます。)が算出、公表を行っています。

なお、東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

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

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

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

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

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

㈱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。

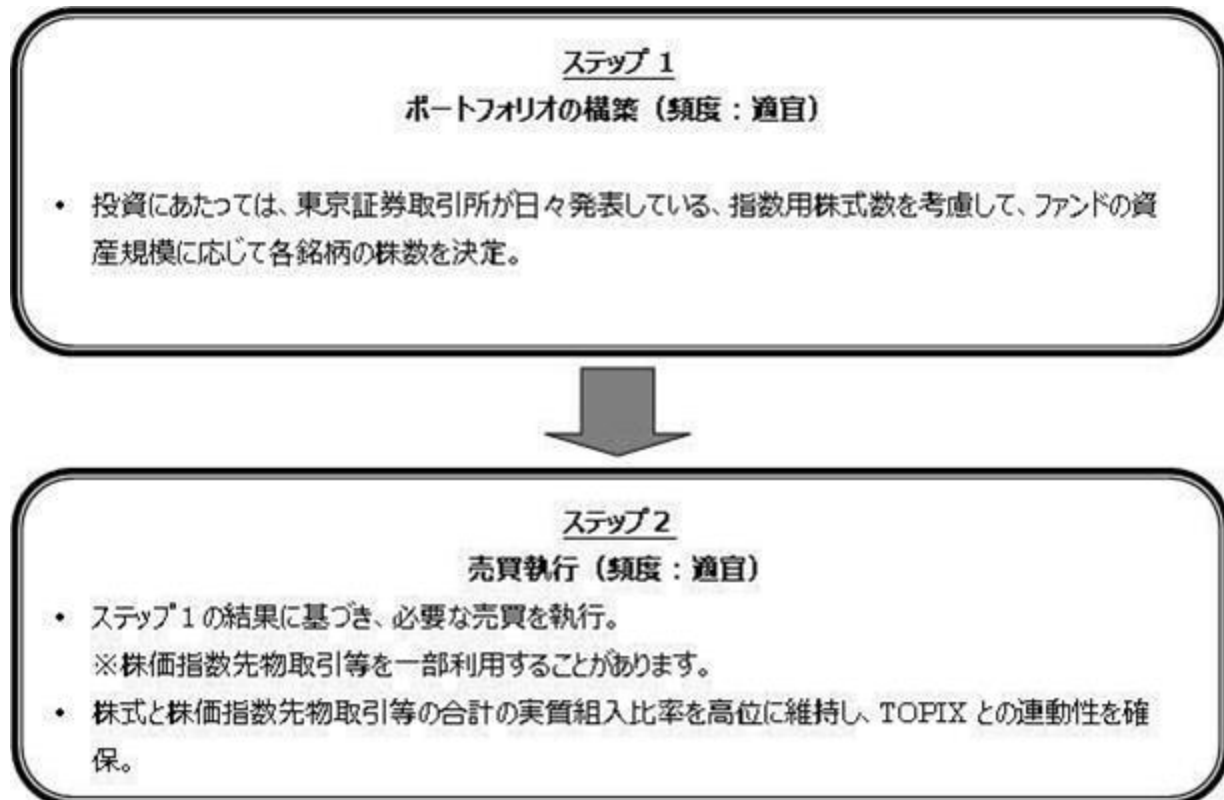
㈱東京証券取引所は、委託会社またはニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

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

## 運用プロセス

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



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2021年10月29日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。



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

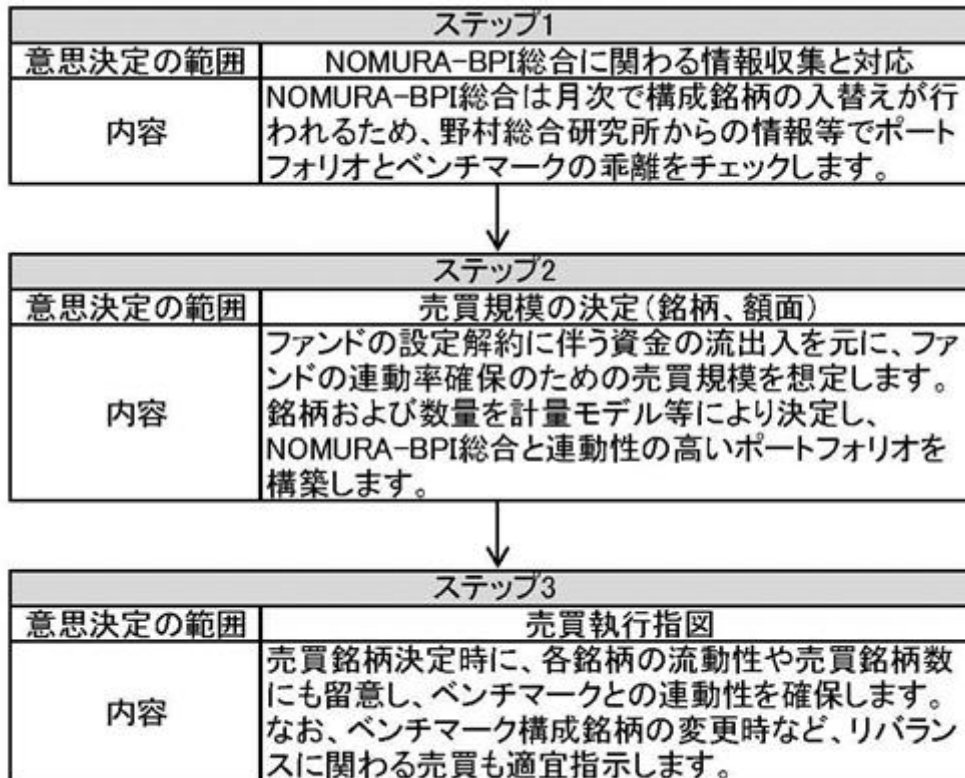
#### NOMURA - B P I 総合について

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

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

## 運用プロセス

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



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2021年10月29日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光J-REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"><li>・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。</li><li>・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。</li><li>・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。</li><li>・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li></ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>・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。</li><li>・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。</li><li>・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。</li><li>・外貨建資産への直接投資は行いません。</li><li>・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。</li></ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 東証REIT指数(配当込み)について

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

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

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

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

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

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

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

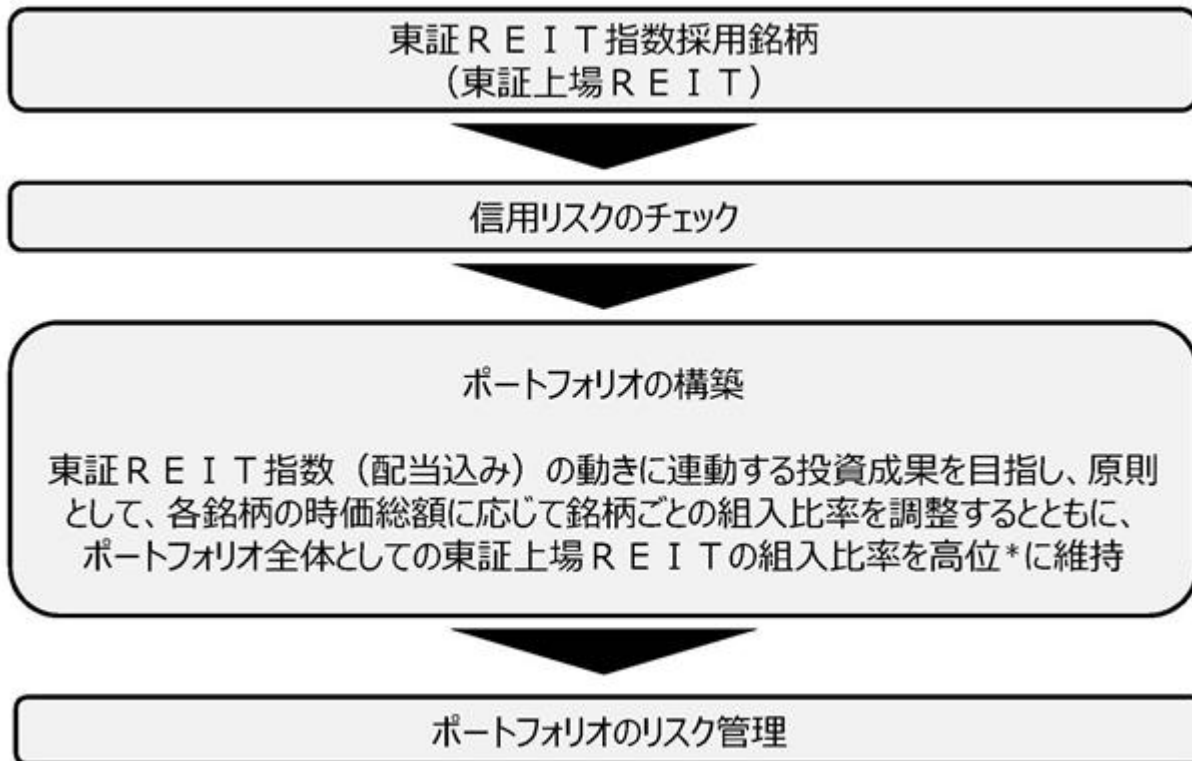
株東京証券取引所は、委託会社または新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数(配当込み)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

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

## 運用プロセス

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



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

\*不動産投信指数先物取引を一部利用することがあります。

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

運用プロセスは2021年10月29日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"><li>・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。</li><li>・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。</li><li>・株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。</li><li>・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。</li></ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>・株式への投資割合には制限を設けません。</li><li>・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。</li><li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li></ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年8月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)について

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

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

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

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

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

## 運用プロセス

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

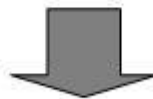
### ステップ 1 リスクモニタリング

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



### ステップ 2 ポートフォリオの構築

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



### ステップ 3 売買執行

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

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2021年10月29日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。



ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 通貨アロケーション</li> <li>・ イールドカーブ戦略</li> <li>・ セクターアロケーション</li> <li>・ デュレーション調整</li> </ul> </li> <li>・ 外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限りません。</li> <li>・ 外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年11月4日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2001年11月5日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、7~10年、円ベース)について

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

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

## 運用プロセス

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



運用プロセスは2021年10月29日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

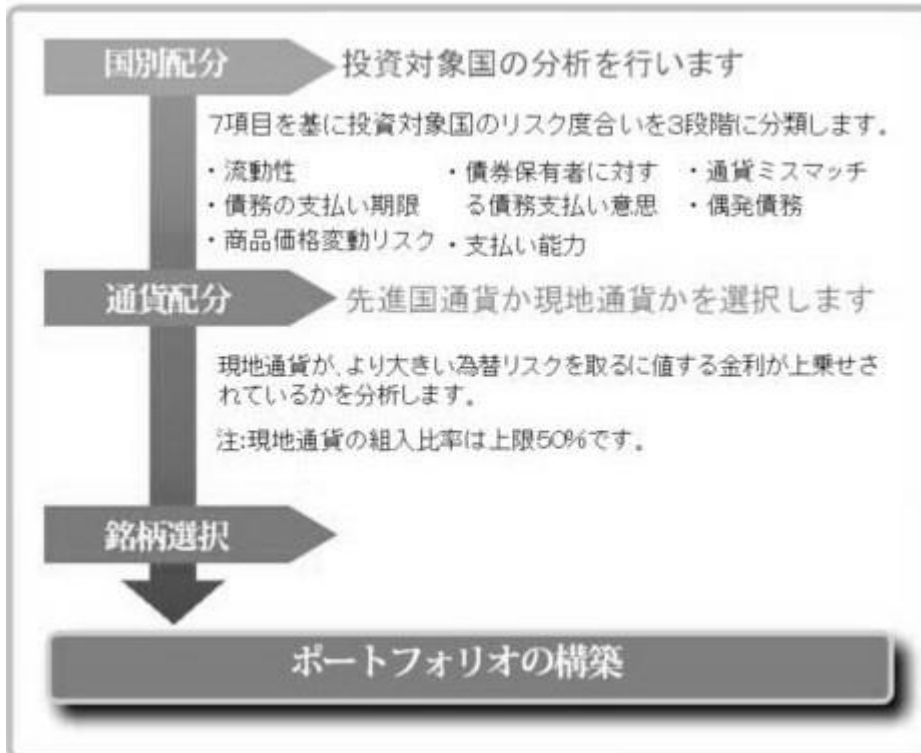
ファンド名	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。</li> <li>・ 単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超え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

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド ( F T I M L 社 ) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン・テンプレートン ( 設立 : 1947年、運用総資産 : 約171.2兆円 ) の一員です。 F T I M L 社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2021年9月末現在、1米ドル = 111.92円で換算

## 運用プロセス



出所 : F T I M L 社資料を基にアセットマネジメントOne作成

運用プロセスは2021年10月29日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光米国REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。</li> <li>・REITの組入比率は原則として高位を保ちます。</li> <li>・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。</li> <li>・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・REITへの投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

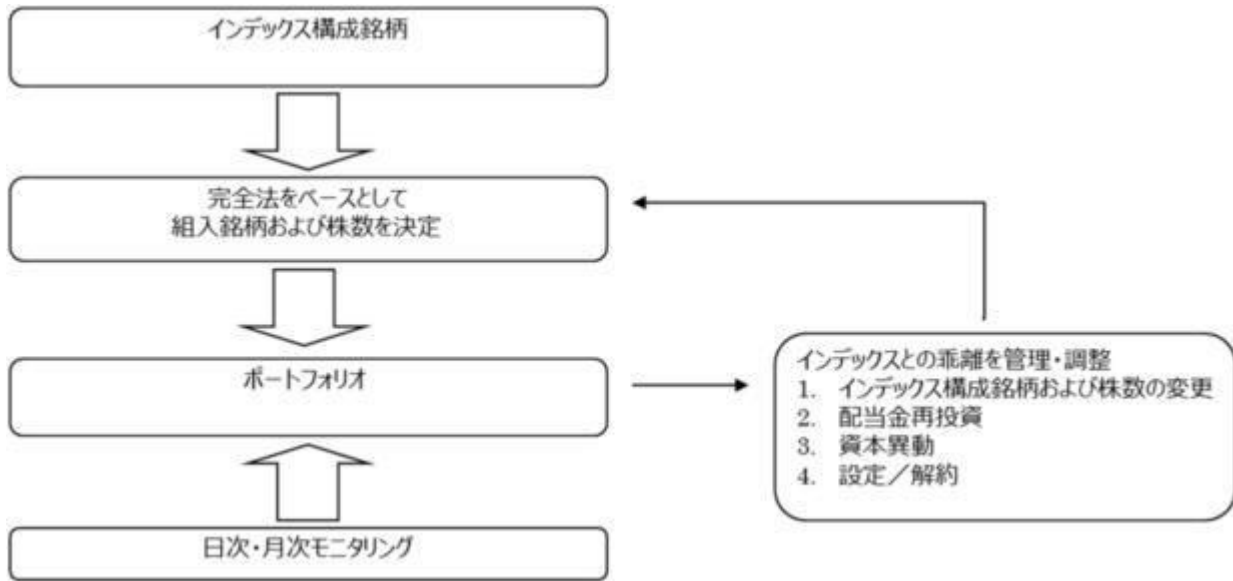
#### FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスについて

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

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

運用プロセス

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



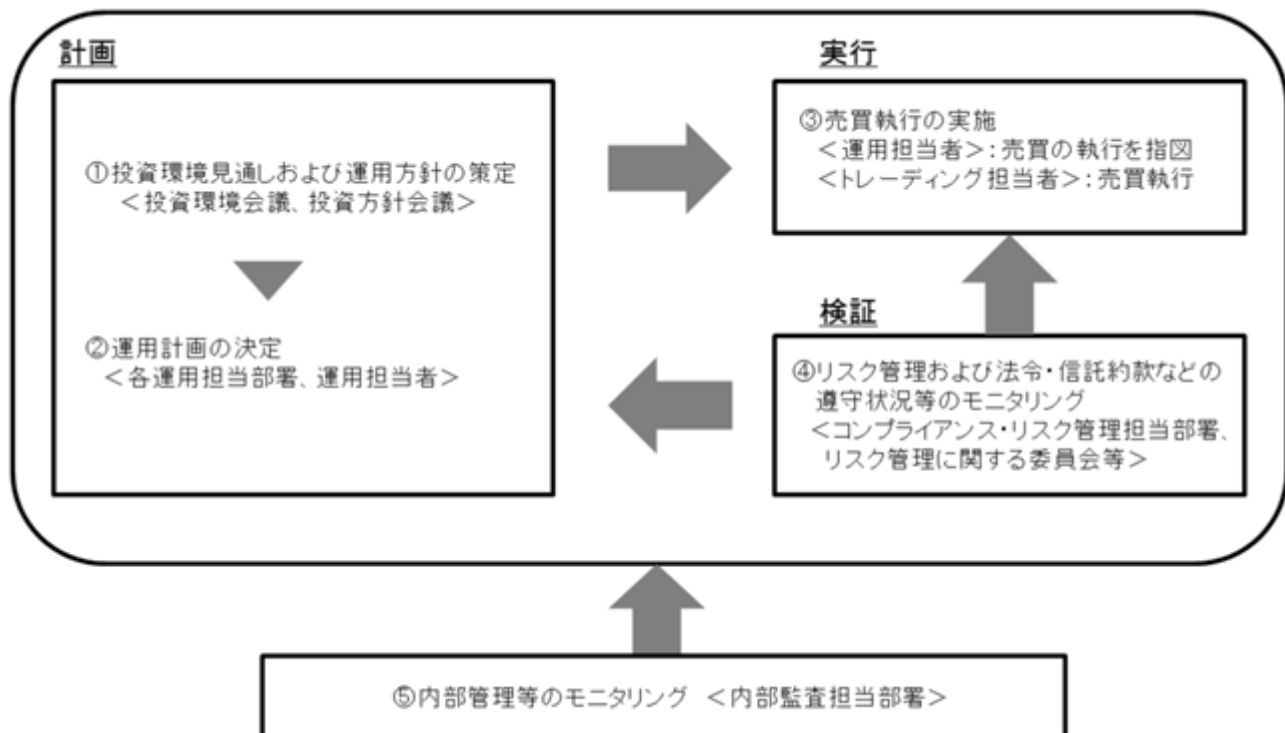
運用プロセスは2021年10月29日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は2022年1月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

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

定期的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

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10月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

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

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

#### (5)【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

- a. 投資信託証券への投資割合  
投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- b. 外貨建資産への投資割合  
外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- c. 公社債の借り入れ

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



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

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

(ニ) 借入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d. 同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

e. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

f. 外国為替予約の指図

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

g. 資金の借入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

#### h. 受託者の自己または利害関係人等との取引

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

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

#### i. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

#### j. 信用リスク集中回避のための投資制限

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

#### k. ファンドの投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### a. 資産配分リスク

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

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

b. 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

c. REITの価格変動リスク

REITの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

d. 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

e. カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

f. 金利変動リスク

金利の上昇(公社債の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

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

## g. 信用リスク

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

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

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

## h. 流動性リスク

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

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

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

## i. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- (ロ) 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- (ハ) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- (ニ) 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。
- (ホ) 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。
- (ヘ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。

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

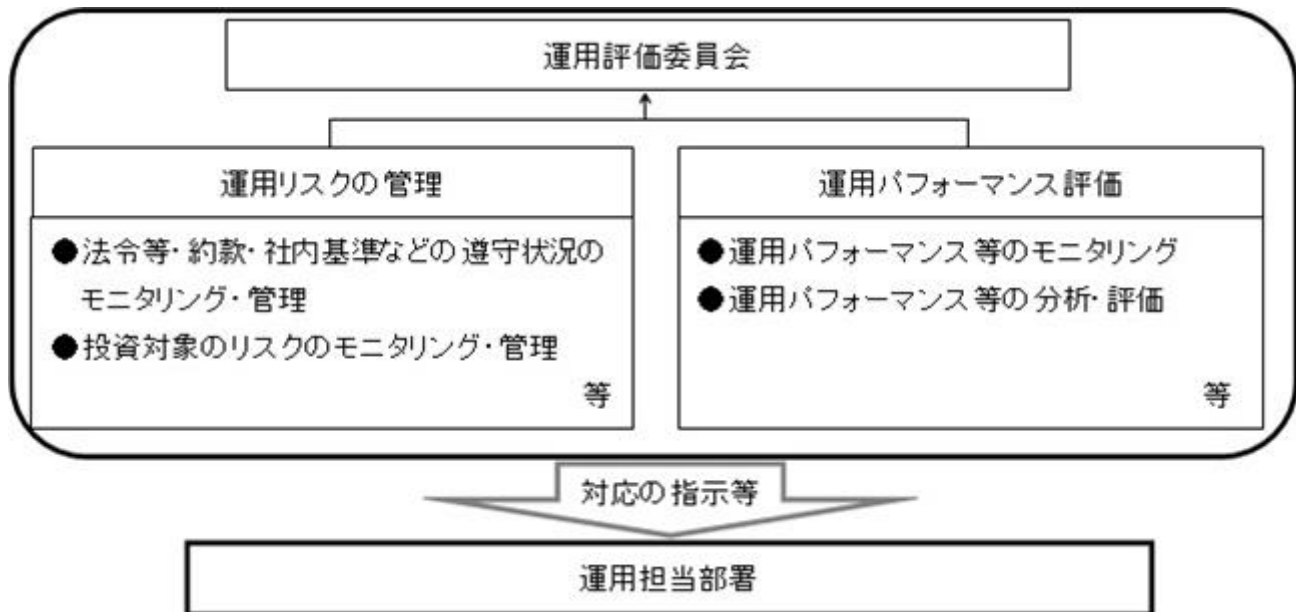
(チ) 投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券(ベビーファンド)が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券(ベビーファンド)の価額が変動する可能性があります。

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

## （２）リスク管理体制

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・運用評価委員会：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、運用評価委員会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10月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 流動性リスク管理体制

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

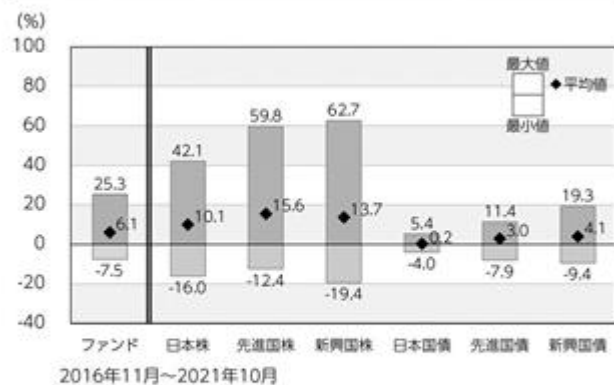
流動性リスク管理体制は2022年1月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

- \*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- \*すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) <sup>*</sup> (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範囲に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数は、株式会社東京証券取引所(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、利用など同指数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。
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。

\*東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

## 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時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

### (2)【換金（解約）手数料】

#### a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

#### b. 信託財産留保額

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

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



## (3) 【信託報酬等】

<p>ファンド</p>	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.045%（税抜0.95%）</p> <p>信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率</p> <p>運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。</p> <p>運用管理費用（信託報酬）の配分は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。</p> <table border="1" data-bbox="416 490 1377 1176"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円未満の部分</td> <td>年率0.42%</td> <td>年率0.45%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>300億円以上 500億円未満の部分</td> <td>年率0.37%</td> <td>年率0.50%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>500億円以上の部分</td> <td>年率0.32%</td> <td>年率0.55%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table> <p>委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド）に対する投資顧問報酬（投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうちファンドにおける保有分に対し年率0.05%）が含まれます。</p>	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）				各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社	300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%	300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%	500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%	主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）																									
各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社																						
300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%																						
300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%																						
500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%																						
主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価																						
<p>投資対象とする外国投資信託</p>	<p>フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865%</p> <p>当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</p>																								
<p>実質的な負担</p>	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.12365%（税抜1.02865%）程度</p> <p>上記は概算の数値です。実際の運用管理費用（信託報酬）は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。</p>																								

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

### 個人の受益者に対する課税

#### 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。

#### 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。

#### 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。

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

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

## 個別元本方式について

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

### < 個別元本について >

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。

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。

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、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

### < 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10月29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	637,623,000	13.47
内 ケイマン諸島	637,623,000	13.47
親投資信託受益証券	3,970,451,728	83.86
内 日本	3,970,451,728	83.86
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	126,433,188	2.67
純資産総額	4,734,507,916	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10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	2,378,718,830	96.56
内 日本	2,378,718,830	96.56
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	84,632,439	3.44
純資産総額	2,463,351,269	100.00

その他資産の投資状況

2021年10月29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)	79,700,000	3.24
内 日本	79,700,000	3.24

(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10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	7,383,316,900	79.16
内 日本	7,383,316,900	79.16
地方債証券	754,202,600	8.09
内 日本	754,202,600	8.09
特殊債券	622,805,000	6.68
内 日本	622,805,000	6.68
社債券	507,534,000	5.44
内 日本	507,534,000	5.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	59,222,687	0.63
純資産総額	9,327,081,187	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10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	113,418,353,400	98.08
内 日本	113,418,353,400	98.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,217,037,041	1.92
純資産総額	115,635,390,441	100.00

## その他資産の投資状況

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	2,096,352,000	1.81
内 日本	2,096,352,000	1.81

(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10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,829,066,994	91.40
内 アメリカ	1,279,908,938	63.96
内 イギリス	77,048,703	3.85
内 カナダ	67,712,584	3.38
内 スイス	62,029,850	3.10
内 フランス	58,861,896	2.94
内 ドイツ	50,631,332	2.53
内 オランダ	38,663,136	1.93
内 オーストラリア	36,591,621	1.83
内 アイルランド	35,129,118	1.76
内 スウェーデン	20,086,433	1.00
内 デンマーク	15,821,444	0.79
内 スペイン	13,813,996	0.69
内 香港	12,671,516	0.63
内 イタリア	10,575,309	0.53
内 ジャージー	7,579,348	0.38
内 フィンランド	7,250,728	0.36
内 シンガポール	5,296,473	0.26
内 バミューダ	4,969,978	0.25
内 ベルギー	4,476,530	0.22
内 ノルウェー	3,982,138	0.20
内 イスラエル	3,708,574	0.19
内 ケイマン諸島	3,274,174	0.16
内 ルクセンブルグ	1,915,578	0.10
内 ニューージーランド	1,789,750	0.09
内 オランダ領キュラソー	1,480,017	0.07
内 オーストリア	1,150,766	0.06
内 ポルトガル	806,643	0.04
内 リベリア	679,945	0.03
内 パナマ	509,455	0.03
内 マン島	493,962	0.02

	内 パプアニューギニア	157,059	0.01
新株予約権証券		37,538	0.00
	内 スイス	37,538	0.00
投資信託受益証券		3,223,641	0.16
	内 オーストラリア	2,546,824	0.13
	内 シンガポール	676,817	0.03
投資証券		39,869,126	1.99
	内 アメリカ	36,964,200	1.85
	内 イギリス	1,135,594	0.06
	内 フランス	1,095,057	0.05
	内 香港	616,766	0.03
	内 カナダ	57,509	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		128,968,254	6.44
純資産総額		2,001,165,553	100.00

### その他資産の投資状況

2021年10月29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）	123,139,207	6.15
内 アメリカ	78,219,168	3.91
内 ドイツ	33,601,431	1.68
内 イギリス	11,318,608	0.57

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

### 海外国債マザーファンド

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	15,903,464,363	98.88
内 アメリカ	6,299,958,610	39.17
内 フランス	3,409,884,155	21.20
内 イタリア	2,910,154,313	18.09
内 イギリス	1,467,397,511	9.12
内 カナダ	1,061,359,157	6.60
内 ドイツ	754,710,617	4.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	179,451,718	1.12
純資産総額	16,082,916,081	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10月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	658,025,019	99.22
内 アメリカ	658,025,019	99.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,201,505	0.78
純資産総額	663,226,524	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10月29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	239,469,774	2.8558 683,901,727	2.8186 674,969,504	- -	14.26
2	新光米国REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	263,704,883	2.4554 647,500,970	2.5150 663,217,780	- -	14.01
3	海外国債マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	252,129,390	2.6447 666,831,810	2.6304 663,201,147	- -	14.01
4	新光外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	170,194,056	3.8529 655,757,697	3.8789 660,165,723	- -	13.94
5	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	510,950,097	1.2830 655,600,069	1.2841 656,111,019	- -	13.86
6	新光J-REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	282,017,780	2.3147 652,814,757	2.3147 652,786,555	- -	13.79
7	フランクリン・テンブルト ン・フロンティア・エマー ジング・マーケット・デッ ト・ファンド ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	314,100	2,046.0000 642,648,600	2,030.0000 637,623,000	- -	13.47

(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10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	13.47
親投資信託受益証券	83.86
合計	97.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資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10月29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	44,100	1,582.68 69,796,261	2,006.50 88,486,650	- -	3.59
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,500	10,790.72 59,348,997	13,140.00 72,270,000	- -	2.93
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	800	57,700.00 46,160,000	68,510.00 54,808,000	- -	2.22
4	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	6,400	4,853.11 31,059,907	7,572.00 48,460,800	- -	1.97
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	55,100	502.77 27,702,971	622.50 34,299,750	- -	1.39
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	10,000	2,780.29 27,802,997	3,188.00 31,880,000	- -	1.29
7	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	600	43,949.12 26,369,475	52,850.00 31,710,000	- -	1.29
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	5,100	8,521.64 43,460,388	6,164.00 31,436,400	- -	1.28
9	信越化学工業 日本	株式 化学	1,500	19,061.94 28,592,912	20,255.00 30,382,500	- -	1.23
10	日本電産 日本	株式 電気機器	2,300	13,833.31 31,816,628	12,570.00 28,911,000	- -	1.17
11	HOYA 日本	株式 精密機器	1,700	13,920.00 23,664,000	16,725.00 28,432,500	- -	1.15
12	日立製作所 日本	株式 電気機器	4,200	4,442.02 18,656,519	6,554.00 27,526,800	- -	1.12
13	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,100	23,795.00 26,174,500	24,890.00 27,379,000	- -	1.11
14	任天堂 日本	株式 その他製品	500	65,810.00 32,905,000	50,200.00 25,100,000	- -	1.02
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	6,400	2,860.30 18,305,974	3,612.00 23,116,800	- -	0.94
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	6,900	2,947.18 20,335,599	3,349.00 23,108,100	- -	0.94
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	2,600	10,190.46 26,495,214	8,653.00 22,497,800	- -	0.91
18	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	6,000	3,551.66 21,310,013	3,721.00 22,326,000	- -	0.91
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	6,900	3,692.06 25,475,242	3,203.00 22,100,700	- -	0.90
20	KDDI 日本	株式 情報・通信業	6,200	3,239.14 20,082,670	3,528.00 21,873,600	- -	0.89

21	S M C 日本	株式 機械	300	69,180.00 20,754,000	67,940.00 20,382,000	- -	0.83
22	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	13,000	1,434.95 18,654,405	1,554.50 20,208,500	- -	0.82
23	第一三共 日本	株式 医薬品	6,800	3,585.42 24,380,889	2,867.00 19,495,600	- -	0.79
24	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	6,000	3,139.50 18,837,016	3,242.00 19,452,000	- -	0.79
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	1,000	16,616.82 16,616,820	17,940.00 17,940,000	- -	0.73
26	ファナック 日本	株式 電気機器	800	27,675.00 22,140,000	22,310.00 17,848,000	- -	0.72
27	三井物産 日本	株式 卸売業	6,700	2,014.98 13,500,408	2,592.00 17,366,400	- -	0.70
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	2,800	5,643.00 15,800,400	5,998.00 16,794,400	- -	0.68
29	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	11,000	1,439.97 15,839,685	1,505.00 16,555,000	- -	0.67
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	3,400	3,982.85 13,541,711	4,782.00 16,258,800	- -	0.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.56
合計	96.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2021年10月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	18.31
情報・通信業		7.99
輸送用機器		7.78
化学		6.74
サービス業		6.35
機械		5.33
卸売業		4.88
医薬品		4.74
銀行業		4.52
小売業		4.11
食料品		3.23
陸運業		3.04
精密機器		2.78
建設業		2.18
その他製品		2.13

保険業	1.89
不動産業	1.85
その他金融業	1.11
電気・ガス業	1.03
鉄鋼	0.76
証券、商品先物取引業	0.73
ガラス・土石製品	0.72
ゴム製品	0.68
非鉄金属	0.66
金属製品	0.60
海運業	0.47
繊維製品	0.46
空運業	0.42
石油・石炭製品	0.41
パルプ・紙	0.22
鉱業	0.20
倉庫・運輸関連業	0.17
水産・農林業	0.08
合計	96.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 新光日本債券インデックスマザーファンド

2021年10月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	97回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債 券	100,000,000	118.36 118,367,000	116.34 116,340,000	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	115.67 115,673,000	2.22 2029/3/19	1.24
3	36回 東日本旅客鉄道社 債 日本	社債券	100,000,000	108.25 108,250,000	106.32 106,329,000	2.11 2024/12/20	1.14
4	12回 兵庫県公募公債 15年 日本	地方債 証券	100,000,000	106.14 106,149,000	105.90 105,906,000	0.781 2030/12/6	1.14
5	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	101.73 101,738,000	0.484 2025/6/30	1.09
6	58回 政保地方公共団体 金融機構債券 日本	特殊債 券	100,000,000	102.08 102,088,000	101.50 101,508,000	0.645 2024/3/15	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	101.46 101,462,000	0.882 2023/6/16	1.09
8	4回 第一三共社債 日本	社債券	100,000,000	101.75 101,757,000	101.39 101,392,000	0.846 2023/9/15	1.09

9	104回 日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	101.58 101,589,000	100.97 100,979,000	0.715 2023/3/20	1.08
10	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	100,000,000	101.24 101,243,900	100.96 100,960,000	0.1 2028/3/20	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	100.93 100,936,000	0.67 2023/3/27	1.08
12	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	100.93 100,930,000	0.205 2027/4/23	1.08
13	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	100,000,000	101.16 101,165,800	100.90 100,901,000	0.1 2026/12/20	1.08
14	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	100.79 100,798,000	0.7 2022/12/22	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	100.78 100,786,000	0.195 2025/12/19	1.08
16	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	100.77 100,778,000	0.17 2027/10/29	1.08
17	11回 プリヂストーン社債 日本	社債券	100,000,000	99.94 99,949,000	100.41 100,415,000	0.295 2027/4/21	1.08
18	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
19	494回 九州電力社債 日本	社債券	100,000,000	100.37 100,378,000	99.39 99,398,000	0.31 2031/5/23	1.07
20	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	90,000,000	102.38 92,145,600	101.80 91,623,600	0.4 2025/6/20	0.98
21	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	90,000,000	102.42 92,179,800	101.73 91,561,500	0.5 2024/9/20	0.98
22	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	90,000,000	101.12 91,014,300	100.86 90,774,000	0.1 2026/6/20	0.97
23	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	102.27 81,820,000	101.67 81,342,400	0.4 2025/3/20	0.87
24	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	102.44 81,952,800	101.67 81,336,000	0.6 2024/3/20	0.87
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	100.98 80,788,000	0.1 2027/12/20	0.87
26	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.27 81,022,300	100.97 80,779,200	0.1 2027/9/20	0.87

27	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.33 81,067,600	100.96 80,771,200	0.1 2028/6/20	0.87
28	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.24 80,994,500	100.94 80,756,000	0.1 2027/3/20	0.87
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	100.88 80,705,600	0.1 2026/9/20	0.87
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	100.81 80,650,400	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10月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	79.16
地方債証券	8.09
特殊債券	6.68
社債券	5.44
合計	99.37

(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10月29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	11,239	739,000.00 8,305,621,000	740,000.00 8,316,860,000	- -	7.19
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	9,917	707,000.00 7,011,319,000	698,000.00 6,922,066,000	- -	5.99
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	15,711	376,000.00 5,907,336,000	380,500.00 5,978,035,500	- -	5.17
4	GLP投資法人 日本	投資証券	32,118	187,200.00 6,012,489,600	185,900.00 5,970,736,200	- -	5.16
5	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	32,069	170,800.00 5,477,385,200	170,700.00 5,474,178,300	- -	4.73
6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	50,036	108,000.00 5,403,888,000	104,500.00 5,228,762,000	- -	4.52
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	14,890	329,500.00 4,906,255,000	327,000.00 4,869,030,000	- -	4.21
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	19,759	190,200.00 3,758,161,800	188,900.00 3,732,475,100	- -	3.23

9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	9,915	372,500.00 3,693,337,500	374,000.00 3,708,210,000	- -	3.21
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	22,325	143,300.00 3,199,172,500	142,000.00 3,170,150,000	- -	2.74
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	14,079	206,500.00 2,907,313,500	208,500.00 2,935,471,500	- -	2.54
12	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	6,517	414,000.00 2,698,038,000	417,500.00 2,720,847,500	- -	2.35
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	29,168	93,300.00 2,721,374,400	86,200.00 2,514,281,600	- -	2.17
14	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	5,285	457,000.00 2,415,245,000	467,000.00 2,468,095,000	- -	2.13
15	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	12,140	190,100.00 2,307,814,000	189,600.00 2,301,744,000	- -	1.99
16	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	3,686	593,000.00 2,185,798,000	606,000.00 2,233,716,000	- -	1.93
17	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	3,068	725,000.00 2,224,300,000	721,000.00 2,212,028,000	- -	1.91
18	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	6,480	337,500.00 2,187,000,000	340,500.00 2,206,440,000	- -	1.91
19	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	3,424	634,000.00 2,170,816,000	635,000.00 2,174,240,000	- -	1.88
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	30,381	66,700.00 2,026,412,700	68,800.00 2,090,212,800	- -	1.81
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	43,648	43,050.00 1,879,046,400	45,000.00 1,964,160,000	- -	1.70
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	11,661	152,300.00 1,775,970,300	154,400.00 1,800,458,400	- -	1.56
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	11,662	154,400.00 1,800,612,800	154,000.00 1,795,948,000	- -	1.55
24	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	3,476	508,000.00 1,765,808,000	504,000.00 1,751,904,000	- -	1.52
25	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	9,251	176,368.04 1,631,580,774	172,500.00 1,595,797,500	- -	1.38
26	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	2,097	740,000.00 1,551,780,000	735,000.00 1,541,295,000	- -	1.33
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	13,400	113,500.00 1,520,900,000	115,000.00 1,541,000,000	- -	1.33

28	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	6,773	217,400.00 1,472,450,200	219,200.00 1,484,641,600	- -	1.28
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	4,465	334,000.00 1,491,310,000	332,000.00 1,482,380,000	- -	1.28
30	NTT都市開発リート投資法人 日本	投資証券	8,957	154,900.00 1,387,439,300	151,400.00 1,356,089,800	- -	1.17

(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10月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.08
合計	98.08

(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。

#### 新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年10月29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	4,802	13,222.09 63,492,497	17,342.63 83,279,318	- -	4.16
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	2,055	24,824.39 51,014,124	36,868.86 75,765,516	- -	3.79
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	130	357,861.97 46,522,057	391,771.60 50,930,309	- -	2.55
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	235	48,703.30 11,445,276	122,427.13 28,770,377	- -	1.44
5	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	86	200,220.60 17,218,972	331,573.11 28,515,288	- -	1.42



6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	84	200,400.20 16,833,617	332,209.66 27,905,612	- -	1.39
7	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	688	31,687.78 21,801,196	36,024.29 24,784,715	- -	1.24
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	714	15,494.08 11,062,777	28,350.43 20,242,210	- -	1.01
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	871	13,288.02 11,573,868	19,364.82 16,866,759	- -	0.84
10	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	272	39,784.50 10,821,384	51,769.86 14,081,403	- -	0.70
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	758	16,604.91 12,586,524	18,511.15 14,031,458	- -	0.70
12	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	305	30,687.48 9,359,684	42,236.36 12,882,090	- -	0.64
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	384	25,177.90 9,668,315	32,932.47 12,646,069	- -	0.63
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	821	13,154.02 10,799,455	14,957.62 12,280,207	- -	0.61
15	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	2,212	3,155.47 6,979,919	5,431.15 12,013,709	- -	0.60
16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	484	24,175.33 11,700,862	23,852.51 11,544,616	- -	0.58
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	708	15,685.32 11,105,208	16,218.43 11,482,652	- -	0.57
18	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	121	47,093.51 5,698,315	92,726.56 11,219,914	- -	0.56

19	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	526	16,208.20 8,525,515	19,287.52 10,145,238	- -	0.51
20	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	136	53,554.47 7,283,409	72,666.95 9,882,706	- -	0.49
21	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	127	53,481.73 6,792,180	76,619.25 9,730,646	- -	0.49
22	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	252	39,166.13 9,869,866	37,855.51 9,539,591	- -	0.48
23	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	277	28,362.90 7,856,525	33,916.85 9,394,968	- -	0.47
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	200	38,766.08 7,753,216	44,503.66 8,900,732	- -	0.44
25	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,210	4,197.83 5,079,378	7,310.11 8,845,242	- -	0.44
26	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	318	20,997.11 6,677,084	26,920.46 8,560,708	- -	0.43
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサイエンス・ツール/サービス	113	55,128.80 6,229,555	70,483.35 7,964,619	- -	0.40
28	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	1,609	4,218.90 6,788,213	4,908.27 7,897,407	- -	0.39
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	1,214	4,342.19 5,271,423	6,392.80 7,760,860	- -	0.39
30	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	1,315	5,362.95 7,052,280	5,899.47 7,757,806	- -	0.39

(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10月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	91.40
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.99
合計	93.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2021年10月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
----	-------	---------

ソフトウェア	外国	7.76
銀行		5.88
半導体・半導体製造装置		4.49
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.44
コンピュータ・周辺機器		4.42
医薬品		4.24
情報技術サービス		4.07
資本市場		3.22
インターネット販売・通信販売		3.11
石油・ガス・消耗燃料		3.09
保険		2.83
ヘルスケア機器・用品		2.81
自動車		2.11
化学		1.96
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.84
ホテル・レストラン・レジャー		1.70
専門小売り		1.63
電力		1.60
バイオテクノロジー		1.56
機械		1.53
飲料		1.48
食品		1.43
娯楽		1.43
繊維・アパレル・贅沢品		1.41
食品・生活必需品小売り		1.30
金属・鉱業		1.27
航空宇宙・防衛		1.26
各種電気通信サービス		1.15
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.12
陸運・鉄道		1.05
コングロマリット		1.00
家庭用品		0.97
メディア		0.94
電気設備		0.87
各種金融サービス		0.85
専門サービス		0.76
総合公益事業		0.72
通信機器		0.64
航空貨物・物流サービス		0.59
建設関連製品		0.57
パーソナル用品		0.56
タバコ		0.56
電子装置・機器・部品		0.55
複合小売り		0.48
消費者金融		0.44
商業サービス・用品		0.42
不動産管理・開発		0.38
家庭用耐久財		0.33
商社・流通業		0.31
容器・包装		0.26

自動車部品	0.24
建設資材	0.23
無線通信サービス	0.23
建設・土木	0.20
エネルギー設備・サービス	0.15
ヘルスケア・テクノロジー	0.15
運送インフラ	0.13
ガス	0.13
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
紙製品・林産品	0.09
販売	0.09
水道	0.09
海運業	0.08
レジャー用品	0.06
旅客航空輸送業	0.04
合計	91.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 海外国債マザーファンド

2021年10月29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 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,523,178,000	96.85 1,475,299,760	97.10 1,479,089,122	1.25 2031/8/15	9.20
2	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	1,091,232,000	102.52 1,118,735,387	100.66 1,098,435,831	1.625 2031/5/15	6.83
3	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証 券	988,929,000	111.75 1,105,222,962	108.14 1,069,511,255	2.625 2029/2/15	6.65
4	FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス	国債証 券	863,005,000	110.02 949,518,595	105.99 914,703,314	0.75 2028/11/25	5.69
5	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証 券	730,235,000	125.23 914,504,491	121.93 890,412,047	3.5 2030/3/1	5.54
6	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証 券	738,855,000	106.30 785,424,175	101.16 747,455,730	1.625 2029/8/15	4.65
7	ITALY BTPS 0.6 08/01/31 イタリア	国債証 券	663,850,000	97.63 648,130,032	96.51 640,730,977	0.6 2031/8/1	3.98
8	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	568,350,000	118.61 674,160,782	111.32 632,711,193	3.125 2028/11/15	3.93
9	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証 券	398,310,000	151.92 605,149,793	141.95 565,433,507	5.5 2029/4/25	3.52
10	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	568,350,000	95.96 545,437,964	92.67 526,745,001	0.625 2030/8/15	3.28
11	FRANCE OAT 0.0 11/25/29 フランス	国債証 券	438,141,000	103.85 455,050,613	99.93 437,834,865	- 2029/11/25	2.72
12	US T N/B 1.375 10/15/22 アメリカ	国債証 券	429,672,600	101.20 434,867,230	101.18 434,783,352	1.375 2022/10/15	2.70
13	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証 券	398,310,000	109.83 437,471,042	105.89 421,790,374	0.75 2028/5/25	2.62

14	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	398,310,000	108.38 431,716,658	104.08 414,571,603	0.5 2029/5/25	2.58
15	ITALY BTPS 0.95 08/01/30 イタリア	国債証券	398,310,000	102.90 409,860,990	100.71 401,138,001	0.95 2030/8/1	2.49
16	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 ドイツ	国債証券	252,263,000	166.02 418,814,600	154.55 389,890,124	6.25 2030/1/4	2.42
17	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 ドイツ	国債証券	358,479,000	103.06 369,471,957	101.76 364,820,493	- 2031/2/15	2.27
18	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	265,540,000	128.35 340,831,211	121.26 322,000,176	2.5 2030/5/25	2.00
19	UK TREASURY 4.75 12/07/30 イギリス	国債証券	235,200,000	137.93 324,427,824	133.45 313,877,880	4.75 2030/12/7	1.95
20	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	265,540,000	120.87 320,972,006	117.21 311,246,869	3 2029/8/1	1.94
21	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	284,175,000	116.31 330,530,308	109.51 311,227,126	2.875 2028/8/15	1.94
22	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証券	265,540,000	118.26 314,038,491	114.97 305,292,931	2.8 2028/12/1	1.90
23	UK TREASURY 0.875 10/22/29 イギリス	国債証券	282,240,000	103.39 291,813,894	100.15 282,685,600	0.875 2029/10/22	1.76
24	CANADA 1.5 06/01/31 カナダ	国債証券	275,850,000	99.91 275,618,010	98.68 272,236,089	1.5 2031/6/1	1.69
25	UK TREASURY 6.0 12/07/28 イギリス	国債証券	188,160,000	146.80 276,218,880	135.91 255,741,427	6 2028/12/7	1.59
26	CANADA 0.25 11/01/22 カナダ	国債証券	252,862,500	99.82 252,418,473	99.55 251,743,077	0.25 2022/11/1	1.57
27	UK TREASURY 0.125 01/31/23 イギリス	国債証券	239,904,000	99.62 239,008,875	99.51 238,730,869	0.125 2023/1/31	1.48
28	CANADA 2.25 06/01/29 カナダ	国債証券	220,680,000	113.36 250,167,261	105.19 232,140,574	2.25 2029/6/1	1.44
29	ITALY BTPS 2.0 02/01/28 イタリア	国債証券	199,155,000	111.12 221,312,985	109.11 217,304,592	2 2028/2/1	1.35
30	FRANCE OAT 0.0 11/25/31 フランス	国債証券	212,432,000	98.59 209,440,293	98.02 208,227,120	- 2031/11/25	1.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.88
合計	98.88

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資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10月29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	1,727	31,020.54 53,572,477	32,510.75 56,146,076	- -	8.47
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	2,820	15,813.77 44,594,832	16,671.97 47,014,980	- -	7.09
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	1,648	19,651.26 32,385,292	20,676.57 34,074,992	- -	5.14
4	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	342	88,625.08 30,309,780	96,312.59 32,938,906	- -	4.97
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	576	36,488.06 21,017,128	37,695.24 21,712,461	- -	3.27
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	1,247	16,236.62 20,247,068	16,723.12 20,853,743	- -	3.14
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,073	17,040.26 18,284,209	18,197.42 19,525,842	- -	2.94
8	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証券	414	37,758.89 15,632,184	40,127.78 16,612,902	- -	2.50
9	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	1,616	9,556.23 15,442,878	9,403.91 15,196,733	- -	2.29
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	533	25,973.59 13,843,926	27,189.86 14,492,197	- -	2.19
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	1,409	9,548.27 13,453,526	10,004.09 14,095,772	- -	2.13
12	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	590	23,093.19 13,624,986	23,406.92 13,810,086	- -	2.08
13	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	1,489	7,961.44 11,854,594	8,314.96 12,380,976	- -	1.87
14	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証券	2,864	4,179.64 11,970,505	4,137.58 11,850,052	- -	1.79
15	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	501	20,853.89 10,447,802	22,006.51 11,025,262	- -	1.66
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	2,204	4,568.39 10,068,747	4,704.80 10,369,382	- -	1.56
17	MID AMERICA アメリカ	投資証券	441	22,416.85 9,885,835	23,446.70 10,339,999	- -	1.56
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	438	22,336.15 9,783,235	22,310.00 9,771,784	- -	1.47
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	248	37,520.19 9,305,008	39,299.12 9,746,184	- -	1.47
20	VENTAS INC アメリカ	投資証券	1,501	6,354.15 9,537,583	6,310.95 9,472,748	- -	1.43
21	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	1,431	6,116.58 8,752,829	6,449.63 9,229,428	- -	1.39
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,061	3,914.79 8,068,392	4,108.03 8,466,657	- -	1.28

23	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	597	13,200.49 7,880,696	12,976.56 7,747,010	- -	1.17
24	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,244	3,423.74 7,682,873	3,410.09 7,652,264	- -	1.15
25	UDR INC アメリカ	投資証券	1,129	6,131.35 6,922,305	6,395.07 7,220,038	- -	1.09
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	372	17,732.51 6,596,497	18,511.15 6,886,151	- -	1.04
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	664	9,596.02 6,371,758	9,688.09 6,432,894	- -	0.97
28	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	698	8,707.12 6,077,571	9,035.62 6,306,868	- -	0.95
29	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	1,095	5,109.46 5,594,865	5,276.56 5,777,834	- -	0.87
30	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	2,220	2,573.48 5,713,145	2,584.85 5,738,379	- -	0.87

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.22
合計	99.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

新光J-R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2021年10月29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 0312月	買建	4	81,371,320	79,700,000	3.24

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

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

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

2021年10月29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 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0312月	買建	1,004	2,095,886,860	2,096,352,000	1.81

(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10月29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 Dec21	買建	3	76,573,795	78,219,168	3.91
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec21	買建	6	33,195,487	33,601,431	1.68
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec21	買建	1	11,007,360	11,318,608	0.57

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

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

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(2021年10月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。



	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第11特定期間末 (2012年 4月20日)	8,395	8,423	0.5983	0.6003
第12特定期間末 (2012年10月22日)	7,563	7,588	0.5969	0.5989
第13特定期間末 (2013年 4月22日)	9,376	9,400	0.7854	0.7874
第14特定期間末 (2013年10月21日)	8,609	8,631	0.7728	0.7748
第15特定期間末 (2014年 4月21日)	8,104	8,125	0.7970	0.7990
第16特定期間末 (2014年10月20日)	7,644	7,663	0.8254	0.8274
第17特定期間末 (2015年 4月20日)	7,692	7,709	0.9283	0.9303
第18特定期間末 (2015年10月20日)	6,937	6,952	0.8993	0.9013
第19特定期間末 (2016年 4月20日)	6,329	6,344	0.8666	0.8686
第20特定期間末 (2016年10月20日)	5,699	5,713	0.8330	0.8350
第21特定期間末 (2017年 4月20日)	5,622	5,635	0.8684	0.8704
第22特定期間末 (2017年10月20日)	5,597	5,609	0.9138	0.9158
第23特定期間末 (2018年 4月20日)	5,336	5,348	0.8885	0.8905
第24特定期間末 (2018年10月22日)	5,115	5,126	0.8935	0.8955
第25特定期間末 (2019年 4月22日)	5,013	5,024	0.9197	0.9217
第26特定期間末 (2019年10月21日)	4,980	4,991	0.9464	0.9484
第27特定期間末 (2020年4月20日)	4,234	4,244	0.8402	0.8422
第28特定期間末 (2020年10月20日)	4,344	4,353	0.8946	0.8966
第29特定期間末 (2021年4月20日)	4,642	4,651	1.0067	1.0087
第30特定期間末 (2021年10月20日)	4,749	4,758	1.0661	1.0681
2020年10月末日	4,213	-	0.8722	-
11月末日	4,371	-	0.9171	-
12月末日	4,413	-	0.9332	-
2021年1月末日	4,439	-	0.9436	-
2月末日	4,495	-	0.9636	-

3月末日	4,632	-	1.0019	-
4月末日	4,668	-	1.0151	-
5月末日	4,705	-	1.0256	-
6月末日	4,761	-	1.0402	-
7月末日	4,736	-	1.0421	-
8月末日	4,747	-	1.0512	-
9月末日	4,673	-	1.0431	-
10月末日	4,734	-	1.0668	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第11特定期間	0.0120
第12特定期間	0.0120
第13特定期間	0.0120
第14特定期間	0.0120
第15特定期間	0.0120
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0120
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0120
第26特定期間	0.0120
第27特定期間	0.0120
第28特定期間	0.0120
第29特定期間	0.0120
第30特定期間	0.0120

## 【収益率の推移】

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

第26特定期間	4.2
第27特定期間	10.0
第28特定期間	7.9
第29特定期間	13.9
第30特定期間	7.1

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第11特定期間	24,129,070	3,124,126,893
第12特定期間	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	22,407,208	820,891,392
第15特定期間	25,208,228	996,341,985
第16特定期間	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	13,815,643	989,033,927
第18特定期間	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	5,348,676	374,412,075
第22特定期間	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	45,095,213	164,575,560
第24特定期間	4,817,074	285,434,876
第25特定期間	13,966,043	287,993,351
第26特定期間	34,127,005	222,623,381
第27特定期間	9,232,953	232,290,245
第28特定期間	14,557,001	198,285,857
第29特定期間	8,969,863	253,533,579
第30特定期間	20,473,306	177,049,394

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 参考情報

データの基準日:2021年10月29日

## 基準価額・純資産の推移 (2011年10月31日～2021年10月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2006年10月31日)

## 分配の推移(税引前)

2021年 6月	20円
2021年 7月	20円
2021年 8月	20円
2021年 9月	20円
2021年10月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	4,640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	14.26
2	新光米国REITマザーファンド	14.01
3	海外国債マザーファンド	14.01
4	新光外国株式インデックスマザーファンド	13.94
5	新光日本債券インデックスマザーファンド	13.86
6	新光J-REITマザーファンド	13.79
7	フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	13.47

## ■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	3.59
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.93
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.22
4	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.97
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.39

## ■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 東京都公募公債 20年	地方債証券	日本	2.22	2029/3/19	1.24
3	36回 東日本旅客鉄道社債	社債券	日本	2.11	2024/12/20	1.14
4	12回 兵庫県公募公債 15年	地方債証券	日本	0.781	2030/12/6	1.14
5	249回政保日本高速道路保有・債務返済機構	特殊債券	日本	0.484	2025/6/30	1.09

## ■新光J-REITマザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	7.19
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.99
3	日本プロロジスリート投資法人	日本	5.17
4	GLP投資法人	日本	5.16
5	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.73

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### ■新光外国株式インデックスマザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.16
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.79
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.55
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.44
5	ALPHABET INC-CL A	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	1.42

### ■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 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	9.20
2	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	6.83
3	US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	アメリカ	2.625	2029/2/15	6.65
4	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	フランス	0.75	2028/11/25	5.69
5	ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	イタリア	3.5	2030/3/1	5.54

### ■フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド(現地2021年10月14日現在)

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

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

#### ①組入公社債の上位5通貨

順位	通貨	比率(%)
1	米ドル	46.6
2	ユーロ	6.6
3	メキシコペソ	6.6
4	ウルグアイペソ	4.5
5	コロンビアペソ	4.4

#### ②組入公社債の上位5カ国

順位	国/地域	比率(%)
1	メキシコ	8.5
2	その他	7.3
3	南アフリカ	5.7
4	ウルグアイ	4.5
5	コロンビア	4.4

### ■新光米国REITマザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	8.47
2	PROLOGIS INC	アメリカ	7.09
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	アメリカ	5.14
4	EQUINIX INC	アメリカ	4.97
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.27

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2021年については年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、販売会社取引口座を開設のうえ、申込金額に手数料および当該手数料にかかる消費税等を加算した金額を販売会社が指定する期日までに支払うものとします。

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

### 2【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。)

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、受益者的一部解約の実行の請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。ただし、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

(チ)上記(ト)により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合、またはすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付が取り消された場合には、受益者は当該受付中止または取消以前に行った一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止または取り消しを解除した後の最初の基準価額の計算日(この日が一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。)に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記(二)の規定に準じて計算された価額とします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。)

インターネットホームページ

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

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

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

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了(投資信託契約の解約)

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



- (ロ) 委託者は、上記(イ)の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の投資信託契約の解約にかかる公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、投資信託契約の解約をしません。
- (ホ) 委託者は、上記(ニ)の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ヘ) 上記(ハ)から(ホ)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(ホ)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (ト) 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。
- (チ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。
- 上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、約款第53条第4項に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。
- (リ) 受託者は、委託者の承諾を受けて、その任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、下記「b. 投資信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託者を選任します。
- 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### b. 投資信託約款の変更

- (イ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- 委託者は、上記の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 上記の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- 上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、投資信託約款の変更をしません。

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

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

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d. 運用報告書

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

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

e. 公告

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

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

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

f. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g. 信託事務処理の再信託

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

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

h. 信託業務の委託等

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

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

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

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

1. 投資信託財産の保存にかかる業務

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

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

4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

i. 関係法人との契約の更改

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### a．収益分配金請求権

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

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

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

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

##### b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### c．一部解約請求権

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

##### d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

## 1【財務諸表】

## 【新光7資産バランスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月20日現在	当期 2021年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	128,082,865	78,560,474
投資信託受益証券	594,905,400	642,648,600
親投資信託受益証券	3,937,133,692	4,041,573,431
流動資産合計	4,660,121,957	4,762,782,505
資産合計	4,660,121,957	4,762,782,505
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	9,222,820	8,909,668
未払解約金	4,549,500	537,705
未払受託者報酬	324,444	326,234
未払委託者報酬	3,528,405	3,547,874
その他未払費用	14,423	14,502
流動負債合計	17,639,592	13,335,983
負債合計	17,639,592	13,335,983
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,611,410,297	4,454,834,209
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	31,072,068	294,612,313
(分配準備積立金)	517,420,993	529,851,600
元本等合計	4,642,482,365	4,749,446,522
純資産合計	4,642,482,365	4,749,446,522
負債純資産合計	4,660,121,957	4,762,782,505

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年10月21日 至 2021年4月20日	当期 自 2021年4月21日 至 2021年10月20日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	51,138,000	52,038,000
有価証券売買等損益	556,125,952	296,342,939
営業収益合計	607,263,952	348,380,939
<b>営業費用</b>		
支払利息	8,837	7,343
受託者報酬	1,958,843	2,081,569
委託者報酬	21,302,927	22,637,461
その他費用	87,080	92,539
営業費用合計	23,357,687	24,818,912
営業利益又は営業損失( )	583,906,265	323,562,027
経常利益又は経常損失( )	583,906,265	323,562,027
当期純利益又は当期純損失( )	583,906,265	323,562,027
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( )	2,223,731	1,557,804
期首剰余金又は期首欠損金( )	511,836,116	31,072,068
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,954,164	791,388
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,954,164	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	791,388
剰余金減少額又は欠損金増加額	404,139	4,849,178
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,849,178
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	404,139	-
分配金	56,324,375	54,406,188
期末剰余金又は期末欠損金( )	31,072,068	294,612,313

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。  親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月20日現在	2021年10月20日現在
1. 期首元本額	4,855,974,013円	4,611,410,297円
期中追加設定元本額	8,969,863円	20,473,306円
期中一部解約元本額	253,533,579円	177,049,394円
2. 受益権の総数	4,611,410,297口	4,454,834,209口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月21日 至 2021年4月20日	自 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 分配金の計算過程	(自2020年10月21日 至2020年11月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,266,964円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,274,668円)及び分配準備積立金(502,950,924円)より分配対象収益は527,492,556円(1万口当たり1,098.25円)であり、うち9,606,038円(1万口当たり20円)を分配金額としております。	(自2021年4月21日 至2021年5月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,093,211円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,873,727円)及び分配準備積立金(514,826,965円)より分配対象収益は538,793,903円(1万口当たり1,173.77円)であり、うち9,180,541円(1万口当たり20円)を分配金額としております。



<p>(自2020年11月21日 至2020年12月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,182,699円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,191,226円)及び分配準備積立金(499,723,540円)より分配対象収益は524,097,465円(1万口当たり1,106.07円)であり、うち9,476,715円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年5月21日 至2021年6月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,545,480円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(13,209,264円)及び分配準備積立金(515,507,653円)より分配対象収益は542,262,397円(1万口当たり1,183.37円)であり、うち9,164,664円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2020年12月22日 至2021年1月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,033,926円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,266,511円)及び分配準備積立金(500,876,408円)より分配対象収益は527,176,845円(1万口当たり1,117.95円)であり、うち9,431,056円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年6月22日 至2021年7月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,441,955円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(13,358,459円)及び分配準備積立金(518,587,676円)より分配対象収益は544,388,090円(1万口当たり1,190.58円)であり、うち9,144,848円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2021年1月21日 至2021年2月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,318,438円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,532,583円)及び分配準備積立金(500,749,054円)より分配対象収益は527,600,075円(1万口当たり1,130.80円)であり、うち9,331,440円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年7月21日 至2021年8月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,537,296円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(13,450,318円)及び分配準備積立金(515,171,162円)より分配対象収益は541,158,776円(1万口当たり1,198.35円)であり、うち9,031,683円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>

	<p>(自2021年2月23日 至2021年3月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,706,731円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,537,649円)及び分配準備積立金(502,559,260円)より分配対象収益は530,803,640円(1万口当たり1,146.90円)であり、うち9,256,306円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年3月23日 至2021年4月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,685,033円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,703,939円)及び分配準備積立金(507,958,780円)より分配対象収益は538,347,752円(1万口当たり1,167.42円)であり、うち9,222,820円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年8月21日 至2021年9月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,990,109円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(13,613,126円)及び分配準備積立金(515,164,824円)より分配対象収益は543,768,059円(1万口当たり1,211.76円)であり、うち8,974,784円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年9月22日 至2021年10月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,440,597円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(13,593,635円)及び分配準備積立金(517,320,671円)より分配対象収益は552,354,903円(1万口当たり1,239.90円)であり、うち8,909,668円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
--	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 2021年4月20日現在	当期 2021年10月20日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	5,682,000	6,596,100
親投資信託受益証券	87,159,619	99,146,679
合計	81,477,619	105,742,779

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	前期 2021年4月20日現在	当期 2021年10月20日現在
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	1.0067円 ( 10,067円 )	1.0661円 ( 10,661円 )

#### ( 4 ) 【 附属明細表 】

##### 第 1 有価証券明細表

###### ( 1 ) 株式

該当事項はありません。

###### ( 2 ) 株式以外の有価証券

2021年10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 ( 円 )	評価額 ( 円 )	備考
投資信託受益証券	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	314,100	642,648,600	
投資信託受益証券 合計		314,100	642,648,600	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	252,129,390	666,831,810	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	239,469,774	683,901,727	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	177,969,300	685,715,712	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	510,950,097	655,600,069	
	新光 J - R E I T マザーファンド	282,017,780	652,814,757	
	新光米国 R E I T マザーファンド	283,745,767	696,709,356	
親投資信託受益証券 合計		1,746,282,108	4,041,573,431	
合計			4,684,222,031	

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

##### 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

( 参考 )

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

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2021年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	97,599,842
株式	2,420,358,100
派生商品評価勘定	94,670
未収配当金	19,814,602
前払金	1,625,000
差入委託証拠金	3,975,000
流動資産合計	2,543,467,214
資産合計	2,543,467,214
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	615,660
未払金	1,061,320
未払解約金	173,000
流動負債合計	1,849,980
負債合計	1,849,980
純資産の部	
元本等	
元本	889,961,797
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,651,655,437
元本等合計	2,541,617,234
純資産合計	2,541,617,234
負債純資産合計	2,543,467,214

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	929,716,185円
同期中追加設定元本額	36,614,822円
同期中一部解約元本額	76,369,210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	186,448,296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)	62,978,635円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	327,582,786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)	12,631,548円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	20,123,700円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	9,713,235円
グローバル・ナビ	14,654,897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	11,419,011円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	759,919円
計	889,961,797円
2. 受益権の総数	889,961,797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 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年10月20日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	185,196,531
合計	185,196,531

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年1月15日から2021年10月20日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連



種類	2021年10月20日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	61,390,000	-	60,870,000	520,000
合計	61,390,000	-	60,870,000	520,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年10月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8559円 (28,559円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月20日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	1,100	648.00	712,800	
マルハニチロ	200	2,622.00	524,400	
雪国まいたけ	100	1,452.00	145,200	
サカタのタネ	100	3,440.00	344,000	
ホクト	100	1,935.00	193,500	
ショーボンドホールディングス	200	4,785.00	957,000	
ミライト・ホールディングス	400	2,202.00	880,800	
タマホーム	100	2,375.00	237,500	
Robot Home	200	290.00	58,000	
スペースバリューホールディングス	200	806.00	161,200	
住石ホールディングス	200	148.00	29,600	
三井松島ホールディングス	100	1,482.00	148,200	
INPEX	4,700	969.00	4,554,300	
石油資源開発	200	2,153.00	430,600	
K&Oエナジーグループ	100	1,650.00	165,000	
安藤・間	800	796.00	636,800	
東急建設	400	812.00	324,800	
コムシスホールディングス	400	2,928.00	1,171,200	
ビーアールホールディングス	200	437.00	87,400	
高松コンストラクショングループ	100	2,004.00	200,400	
ヤマウラ	100	920.00	92,000	

オリエンタル白石	400	270.00	108,000	
大成建設	900	3,680.00	3,312,000	
大林組	2,700	976.00	2,635,200	
清水建設	2,500	859.00	2,147,500	
飛鳥建設	100	1,086.00	108,600	
長谷工コーポレーション	900	1,512.00	1,360,800	
松井建設	100	754.00	75,400	
鹿島建設	1,900	1,461.00	2,775,900	
不動テトラ	100	1,809.00	180,900	
鉄建建設	100	1,816.00	181,600	
西松建設	200	3,425.00	685,000	
三井住友建設	700	496.00	347,200	
大豊建設	100	3,890.00	389,000	
佐田建設	100	490.00	49,000	
ナカノフドー建設	100	353.00	35,300	
奥村組	200	2,983.00	596,600	
東鉄工業	100	2,509.00	250,900	
戸田建設	1,200	752.00	902,400	
熊谷組	100	2,853.00	285,300	
矢作建設工業	100	791.00	79,100	
ピーエス三菱	100	669.00	66,900	
日本ハウスホールディングス	200	421.00	84,200	
大東建託	300	13,800.00	4,140,000	
新日本建設	100	853.00	85,300	
N I P P O	200	4,045.00	809,000	
東亜建設工業	100	2,478.00	247,800	
日本国土開発	300	604.00	181,200	
若築建設	100	2,037.00	203,700	
東洋建設	300	582.00	174,600	
五洋建設	1,200	775.00	930,000	
世紀東急工業	100	824.00	82,400	
住友林業	700	2,145.00	1,501,500	
日本基礎技術	100	520.00	52,000	
巴コーポレーション	100	452.00	45,200	
大和ハウス工業	2,400	3,791.00	9,098,400	
ライト工業	200	2,025.00	405,000	
積水ハウス	2,900	2,392.50	6,938,250	
日特建設	100	718.00	71,800	
ユアテック	200	699.00	139,800	
日本リーテック	100	1,514.00	151,400	
中電工	100	2,257.00	225,700	
関電工	500	904.00	452,000	
きんでん	600	1,900.00	1,140,000	
東京エネシス	100	1,080.00	108,000	
住友電設	100	2,202.00	220,200	
日本電設工業	200	1,858.00	371,600	
エクシオグループ	400	2,695.00	1,078,000	
新日本空調	100	2,369.00	236,900	
日本工営	100	3,470.00	347,000	
九電工	200	3,710.00	742,000	

三機工業	200	1,447.00	289,400
日揮ホールディングス	1,000	1,111.00	1,111,000
ヤマト	100	754.00	75,400
太平電業	100	2,783.00	278,300
高砂熱学工業	300	2,104.00	631,200
NEC ネットエスアイ	300	2,088.00	626,400
明星工業	200	725.00	145,000
大気社	100	3,375.00	337,500
ダイダン	100	2,466.00	246,600
日比谷総合設備	100	1,912.00	191,200
ニッポン	300	1,635.00	490,500
日清製粉グループ本社	1,000	1,856.00	1,856,000
昭和産業	100	2,825.00	282,500
鳥越製粉	100	762.00	76,200
中部飼料	100	1,100.00	110,000
フィード・ワン	100	745.00	74,500
DM三井製糖ホールディングス	100	2,040.00	204,000
塩水港精糖	100	222.00	22,200
LIFULL	300	373.00	111,900
ミクシィ	200	2,635.00	527,000
ジェイエイシーリクルートメント	100	2,254.00	225,400
日本M&Aセンターホールディングス	1,400	3,395.00	4,753,000
UTグループ	100	3,570.00	357,000
夢真ビーネックスグループ	200	1,385.00	277,000
コシダカホールディングス	200	712.00	142,400
パソナグループ	100	3,100.00	310,000
リンクアンドモチベーション	200	1,122.00	224,400
エス・エム・エス	300	4,320.00	1,296,000
パーソルホールディングス	900	2,960.00	2,664,000
クックパッド	300	237.00	71,100
森永製菓	200	4,055.00	811,000
江崎グリコ	300	4,225.00	1,267,500
井村屋グループ	100	2,344.00	234,400
不二家	100	2,393.00	239,300
山崎製パン	700	1,869.00	1,308,300
亀田製菓	100	4,515.00	451,500
寿スピリッツ	100	7,410.00	741,000
カルビー	400	2,780.00	1,112,000
森永乳業	200	6,750.00	1,350,000
六甲バター	100	1,660.00	166,000
ヤクルト本社	600	5,750.00	3,450,000
明治ホールディングス	600	7,110.00	4,266,000
雪印メグミルク	200	2,225.00	445,000
プリマハム	100	2,747.00	274,700
日本ハム	300	4,060.00	1,218,000
丸大食品	100	1,748.00	174,800
S Foods	100	2,994.00	299,400
伊藤ハム米久ホールディングス	600	709.00	425,400
システナ	300	2,151.00	645,300
デジタルアーツ	100	9,610.00	961,000

日鉄ソリューションズ	100	3,760.00	376,000
総合警備保障	300	5,010.00	1,503,000
いちご	1,000	336.00	336,000
日本駐車場開発	1,000	151.00	151,000
カカクコム	600	3,820.00	2,292,000
セントケア・ホールディング	100	891.00	89,100
ルネサンス	100	1,201.00	120,100
ディップ	100	4,215.00	421,500
SBSホールディングス	100	4,180.00	418,000
デジタルホールディングス	100	1,826.00	182,600
新日本科学	100	1,157.00	115,700
ベネフィット・ワン	300	5,490.00	1,647,000
エムスリー	1,400	7,379.00	10,330,600
ツカダ・グローバルホールディング	100	339.00	33,900
アウトソーシング	500	2,043.00	1,021,500
ウェルネット	100	509.00	50,900
ディー・エヌ・エー	400	2,185.00	874,000
博報堂DYホールディングス	1,200	1,891.00	2,269,200
ぐるなび	200	548.00	109,600
タカミヤ	100	454.00	45,400
ジャパンベストレスキューシステム	100	1,078.00	107,800
ファンコミュニケーションズ	200	466.00	93,200
エスプール	200	1,229.00	245,800
ティア	100	492.00	49,200
アドウェイズ	100	835.00	83,500
バリューコマース	100	4,625.00	462,500
インフォマート	1,000	1,110.00	1,110,000
サッポロホールディングス	300	2,557.00	767,100
アサヒグループホールディングス	1,900	5,231.00	9,938,900
麒麟ホールディングス	3,200	2,032.00	6,502,400
宝ホールディングス	700	1,607.00	1,124,900
オエノンホールディングス	300	378.00	113,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	600	1,620.00	972,000
サントリー食品インターナショナル	600	4,455.00	2,673,000
ダイドーグループホールディングス	100	5,530.00	553,000
伊藤園	300	7,290.00	2,187,000
キーコーヒー	100	2,226.00	222,600
日清オイリオグループ	100	3,045.00	304,500
不二製油グループ本社	200	2,706.00	541,200
J・オイルミルズ	100	1,833.00	183,300
ローソン	200	5,350.00	1,070,000
サンエー	100	4,120.00	412,000
カワチ薬品	100	2,246.00	224,600
エービーシー・マート	100	5,630.00	563,000
アスクル	100	1,651.00	165,100
ゲオホールディングス	100	1,202.00	120,200
アダストリア	100	1,947.00	194,700
ジーフット	100	399.00	39,900
くら寿司	100	3,650.00	365,000

エレマテック	100	1,137.00	113,700
パルグループホールディングス	100	1,610.00	161,000
エディオン	400	1,083.00	433,200
あらた	100	4,000.00	400,000
サーラコーポレーション	200	616.00	123,200
J Pホールディングス	200	259.00	51,800
フジオフードグループ本社	100	1,384.00	138,400
ひらまつ	200	218.00	43,600
フィールズ	100	512.00	51,200
双日	900	1,934.00	1,740,600
アルフレッサ ホールディングス	900	1,655.00	1,489,500
ハニーズホールディングス	100	1,056.00	105,600
キッコーマン	700	9,570.00	6,699,000
味の素	2,000	3,411.00	6,822,000
キュービー	500	2,537.00	1,268,500
ハウス食品グループ本社	300	3,315.00	994,500
カゴメ	300	2,878.00	863,400
アリアケジャパン	100	7,280.00	728,000
ニチレイ	400	2,862.00	1,144,800
横浜冷凍	300	878.00	263,400
東洋水産	500	4,835.00	2,417,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	750.00	75,000
日清食品ホールディングス	400	8,820.00	3,528,000
フジッコ	100	1,927.00	192,700
ロック・フィールド	100	1,785.00	178,500
日本たばこ産業	4,600	2,295.50	10,559,300
ケンコーマヨネーズ	100	1,542.00	154,200
わらべや日洋ホールディングス	100	2,262.00	226,200
なとり	100	1,951.00	195,100
ファーマフーズ	100	2,718.00	271,800
北の達人コーポレーション	300	445.00	133,500
ユーグレナ	500	869.00	434,500
紀文食品	100	1,235.00	123,500
A Dワークスグループ	200	162.00	32,400
片倉工業	100	1,777.00	177,700
ゲンゼ	100	4,310.00	431,000
ヒューリック	1,900	1,128.00	2,143,200
アルペン	100	2,906.00	290,600
ラクーンホールディングス	100	1,596.00	159,600
クオールホールディングス	100	1,659.00	165,900
アルコニックス	100	1,734.00	173,400
神戸物産	700	3,890.00	2,723,000
ジンズホールディングス	100	7,310.00	731,000
ビックカメラ	500	1,006.00	503,000
D C Mホールディングス	600	1,152.00	691,200
ペッパーフードサービス	100	380.00	38,000
Monotaro	1,100	2,623.00	2,885,300
あい ホールディングス	100	2,168.00	216,800
アークランドサービスホールディングス	100	2,284.00	228,400

J・フロントリテイリング	1,100	1,072.00	1,179,200
ドトール・日レスホールディングス	100	1,731.00	173,100
マツキヨココカラ&カンパニー	500	5,160.00	2,580,000
ブロンコビリー	100	2,471.00	247,100
ZOZO	500	4,240.00	2,120,000
三越伊勢丹ホールディングス	1,500	838.00	1,257,000
東洋紡	400	1,363.00	545,200
ユニチカ	300	367.00	110,100
日清紡ホールディングス	600	898.00	538,800
倉敷紡績	100	1,905.00	190,500
ダイワボウホールディングス	400	1,993.00	797,200
シキボウ	100	940.00	94,000
日東紡績	100	3,625.00	362,500
トヨタ紡織	300	2,101.00	630,300
マクニカ・富士エレホールディングス	200	2,563.00	512,600
ウエルシアホールディングス	500	4,215.00	2,107,500
クリエイトSDホールディングス	100	3,620.00	362,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	775.00	155,000
八洲電機	100	966.00	96,600
メディアスホールディングス	100	897.00	89,700
レスターホールディングス	100	1,897.00	189,700
丸善CHIホールディングス	100	378.00	37,800
TOKAIホールディングス	400	885.00	354,000
三洋貿易	100	1,132.00	113,200
シュッピン	100	1,323.00	132,300
オイシックス・ラ・大地	100	5,060.00	506,000
ウイン・パートナーズ	100	968.00	96,800
ネクステージ	200	2,133.00	426,600
ジョイフル本田	300	1,596.00	478,800
ホットランド	100	1,375.00	137,500
すかいらーくホールディングス	1,200	1,573.00	1,887,600
綿半ホールディングス	100	1,232.00	123,200
日本毛織	300	928.00	278,400
ダイドーリミテッド	100	171.00	17,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	1,064.00	319,200
野村不動産ホールディングス	500	2,954.00	1,477,000
三重交通グループホールディングス	200	532.00	106,400
サムティ	100	2,358.00	235,800
ディア・ライフ	100	565.00	56,500
日本商業開発	100	1,760.00	176,000
プレサンスコーポレーション	100	1,872.00	187,200
フージャースホールディングス	100	697.00	69,700
オープンハウス	300	7,090.00	2,127,000
東急不動産ホールディングス	2,200	675.00	1,485,000
飯田グループホールディングス	700	2,799.00	1,959,300
ムゲンエステート	100	498.00	49,800
帝国繊維	100	2,046.00	204,600
日本コークス工業	800	147.00	117,600

あさひ	100	1,325.00	132,500
日本調剤	100	1,662.00	166,200
コスモス薬品	100	17,960.00	1,796,000
シップヘルスケアホールディングス	300	2,959.00	887,700
セブン&アイ・ホールディングス	3,300	4,765.00	15,724,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	500	1,060.00	530,000
ツルハホールディングス	200	13,850.00	2,770,000
サンマルクホールディングス	100	1,571.00	157,100
トリドールホールディングス	200	2,797.00	559,400
帝人	800	1,571.00	1,256,800
東レ	6,000	719.50	4,317,000
クラレ	1,300	1,053.00	1,368,900
旭化成	5,600	1,216.00	6,809,600
T O K Y O B A S E	100	740.00	74,000
稲葉製作所	100	1,348.00	134,800
トーカロ	200	1,327.00	265,400
S U M C O	1,300	2,199.00	2,858,700
ビーロッド	100	565.00	56,500
日本フェルト	100	443.00	44,300
アツギ	100	667.00	66,700
J Mホールディングス	100	1,902.00	190,200
コメダホールディングス	200	2,090.00	418,000
アレンザホールディングス	100	1,206.00	120,600
バロックジャパンリミテッド	100	851.00	85,100
クスリのアオキホールディングス	100	7,550.00	755,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	500	4,915.00	2,457,500
セーレン	200	2,333.00	466,600
小松マテーレ	100	927.00	92,700
ワコールホールディングス	200	2,260.00	452,000
ホギメディカル	100	3,100.00	310,000
T S Iホールディングス	300	352.00	105,600
ワールド	100	1,393.00	139,300
T I S	900	3,150.00	2,835,000
グリー	500	947.00	473,500
コーエーテクモホールディングス	200	5,170.00	1,034,000
ファインデックス	100	985.00	98,500
K L a b	200	647.00	129,400
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	100	1,039.00	103,900
ネクソン	1,900	1,995.00	3,790,500
アイスタイル	300	419.00	125,700
エイチーム	100	1,628.00	162,800
エニグモ	100	1,139.00	113,900
テクノスジャパン	100	601.00	60,100
コロブラ	300	821.00	246,300
オルトプラス	100	409.00	40,900
ブロードリーフ	400	564.00	225,600
システム情報	100	938.00	93,800

じげん	200	407.00	81,400
ビキューブ	100	1,615.00	161,500
フィックスターズ	100	770.00	77,000
オブティム	100	1,890.00	189,000
特種東海製紙	100	4,435.00	443,500
ティーガイア	100	2,057.00	205,700
テクマトリックス	100	1,843.00	184,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	2,123.00	424,600
GMOペイメントゲートウェイ	200	14,510.00	2,902,000
インターネットイニシアティブ	200	3,990.00	798,000
さくらインターネット	100	608.00	60,800
朝日ネット	100	716.00	71,600
eBASE	100	800.00	80,000
アバント	100	1,701.00	170,100
フリービット	100	1,278.00	127,800
コムチュア	100	3,060.00	306,000
アステリア	100	713.00	71,300
王子ホールディングス	3,800	562.00	2,135,600
日本製紙	400	1,177.00	470,800
三菱製紙	100	359.00	35,900
北越コーポレーション	600	742.00	445,200
大王製紙	400	2,024.00	809,600
メディカル・データ・ビジョン	100	1,522.00	152,200
gumi	100	904.00	90,400
ラクス	300	3,405.00	1,021,500
オープンドア	100	2,619.00	261,900
カナミックネットワーク	100	627.00	62,700
レンゴー	900	867.00	780,300
トーモク	100	1,938.00	193,800
ザ・バック	100	2,942.00	294,200
チェンジ	200	2,269.00	453,800
シンクロ・フード	100	390.00	39,000
マクロミル	200	834.00	166,800
マネーフォワード	100	7,020.00	702,000
昭和電工	700	2,866.00	2,006,200
住友化学	6,600	573.00	3,781,800
日産化学	500	6,440.00	3,220,000
クレハ	100	7,530.00	753,000
テイカ	100	1,338.00	133,800
石原産業	200	1,231.00	246,200
日本曹達	100	3,475.00	347,500
東ソー	1,400	1,930.00	2,702,000
トクヤマ	300	2,066.00	619,800
セントラル硝子	200	2,120.00	424,000
東亜合成	500	1,285.00	642,500
大阪ソーダ	100	2,873.00	287,300
関東電化工業	200	1,013.00	202,600
デンカ	300	3,865.00	1,159,500
イビデン	400	6,180.00	2,472,000



信越化学工業	1,500	19,510.00	29,265,000	
堺化学工業	100	2,031.00	203,100	
第一稀元素化学工業	100	1,462.00	146,200	
エア・ウォーター	900	1,733.00	1,559,700	
日本酸素ホールディングス	700	2,715.00	1,900,500	
日本パーカライジング	400	1,172.00	468,800	
高压ガス工業	100	763.00	76,300	
四国化成工業	100	1,389.00	138,900	
日本触媒	200	5,820.00	1,164,000	
大日精化工業	100	2,642.00	264,200	
カネカ	200	4,500.00	900,000	
協和キリン	1,100	3,775.00	4,152,500	
三菱瓦斯化学	900	2,355.00	2,119,500	
三井化学	800	3,570.00	2,856,000	
J S R	900	3,945.00	3,550,500	
東京応化工業	200	6,990.00	1,398,000	
大阪有機化学工業	100	3,470.00	347,000	
三菱ケミカルホールディングス	5,700	974.20	5,552,940	
K Hネオケム	100	3,055.00	305,500	
ダイセル	1,200	867.00	1,040,400	
住友ベークライト	100	4,955.00	495,500	
積水化学工業	1,800	1,868.00	3,362,400	
日本ゼオン	800	1,503.00	1,202,400	
アイカ工業	200	3,585.00	717,000	
宇部興産	400	2,214.00	885,600	
積水樹脂	100	2,174.00	217,400	
タキロンシーアイ	200	620.00	124,000	
旭有機材	100	1,383.00	138,300	
リケンテクノス	200	549.00	109,800	
積水化成品工業	100	579.00	57,900	
ダイキョーニシカワ	200	678.00	135,600	
日本化薬	600	1,217.00	730,200	
カーリットホールディングス	100	773.00	77,300	
プレステージ・インターナショナル	300	782.00	234,600	
プロトコーポレーション	100	1,534.00	153,400	
野村総合研究所	1,400	4,190.00	5,866,000	
サイバネットシステム	100	634.00	63,400	
クイック	100	1,384.00	138,400	
電通グループ	900	4,275.00	3,847,500	
インテージホールディングス	100	1,742.00	174,200	
ソースネクスト	400	217.00	86,800	
シーティーエス	100	803.00	80,300	
インフォコム	100	2,408.00	240,800	
メディカルシステムネットワーク	100	717.00	71,700	
日本精化	100	2,274.00	227,400	
扶桑化学工業	100	5,230.00	523,000	
トリケミカル研究所	100	3,365.00	336,500	
ラクスル	100	6,200.00	620,000	
F I G	100	289.00	28,900	
A D E K A	400	2,530.00	1,012,000	

日油	300	5,860.00	1,758,000
新日本理化	100	324.00	32,400
ハリマ化成グループ	100	874.00	87,400
イーソル	100	883.00	88,300
アルテリア・ネットワークス	100	1,645.00	164,500
Sansan	100	12,340.00	1,234,000
ギフトィ	100	4,100.00	410,000
花王	1,900	6,555.00	12,454,500
三洋化成工業	100	5,580.00	558,000
武田薬品工業	7,100	3,246.00	23,046,600
アステラス製薬	7,400	1,950.50	14,433,700
大日本住友製薬	700	1,916.00	1,341,200
塩野義製薬	1,100	7,618.00	8,379,800
わかもと製薬	100	337.00	33,700
日本新薬	300	8,910.00	2,673,000
中外製薬	2,600	3,968.00	10,316,800
科研製薬	200	4,475.00	895,000
エーザイ	1,000	8,251.00	8,251,000
理研ビタミン	100	1,857.00	185,700
ロート製薬	400	3,450.00	1,380,000
小野薬品工業	1,900	2,441.50	4,638,850
久光製薬	300	4,195.00	1,258,500
有機合成薬品工業	100	322.00	32,200
持田製薬	100	3,285.00	328,500
参天製薬	1,500	1,644.00	2,466,000
ツムラ	300	3,525.00	1,057,500
日医工	300	882.00	264,600
テルモ	2,600	5,103.00	13,267,800
H.U.グループホールディングス	200	2,861.00	572,200
キッセイ薬品工業	200	2,433.00	486,600
生化学工業	200	1,027.00	205,400
栄研化学	200	1,995.00	399,000
JCRファーマ	300	2,940.00	882,000
東和薬品	100	3,450.00	345,000
富士製薬工業	100	1,126.00	112,600
ゼリア新薬工業	200	2,027.00	405,400
第一三共	6,700	2,760.00	18,492,000
キョーリン製薬ホールディングス	200	1,810.00	362,000
大幸薬品	100	854.00	85,400
ダイト	100	3,265.00	326,500
大塚ホールディングス	1,800	4,725.00	8,505,000
大正製薬ホールディングス	200	6,410.00	1,282,000
ペプチドリーム	500	2,741.00	1,370,500
大日本塗料	100	861.00	86,100
日本ペイントホールディングス	3,100	1,194.00	3,701,400
関西ペイント	1,000	2,674.00	2,674,000
神東塗料	100	190.00	19,000
中国塗料	200	901.00	180,200
日本特殊塗料	100	1,006.00	100,600
藤倉化成	100	534.00	53,400

太陽ホールディングス	200	2,812.00	562,400
D I C	400	3,100.00	1,240,000
サカティンクス	200	1,114.00	222,800
東洋インキ S C ホールディングス	200	2,032.00	406,400
T & K T O K A	100	810.00	81,000
アルプス技研	100	2,032.00	203,200
サニックス	100	336.00	33,600
日本空調サービス	100	811.00	81,100
オリエンタルランド	900	17,955.00	16,159,500
フォーカスシステムズ	100	997.00	99,700
ダスキン	200	2,687.00	537,400
パーク24	500	1,808.00	904,000
明光ネットワークジャパン	100	615.00	61,500
クレスコ	100	2,037.00	203,700
フジ・メディア・ホールディングス	900	1,201.00	1,080,900
ラウンドワン	300	1,406.00	421,800
リゾートトラスト	400	2,045.00	818,000
オービック	300	22,110.00	6,633,000
ジャストシステム	100	5,970.00	597,000
T D C ソフト	100	1,317.00	131,700
Zホールディングス	11,600	701.30	8,135,080
ピー・エム・エル	100	4,060.00	406,000
トレンドマイクロ	500	6,370.00	3,185,000
りらいあコミュニケーションズ	100	1,227.00	122,700
I D ホールディングス	100	936.00	93,600
リソー教育	400	512.00	204,800
日本オラクル	200	10,560.00	2,112,000
フューチャー	100	2,858.00	285,800
C A C H o l d i n g s	100	1,641.00	164,100
ユー・エス・エス	1,000	1,837.00	1,837,000
オービックビジネスコンサルタント	100	5,890.00	589,000
伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,635.00	1,454,000
アイティフォー	100	881.00	88,100
東京個別指導学院	100	737.00	73,700
サイバーエージェント	1,900	2,081.00	3,953,900
楽天グループ	4,200	1,233.00	5,178,600
モーニングスター	100	528.00	52,800
テー・オー・ダブリュー	200	337.00	67,400
大塚商会	500	5,760.00	2,880,000
サイボウズ	100	2,514.00	251,400
山田コンサルティンググループ	100	1,150.00	115,000
電通国際情報サービス	100	4,040.00	404,000
A C C E S S	100	918.00	91,800
デジタルガレージ	100	5,070.00	507,000
イーエムシステムズ	100	771.00	77,100
C I J	100	852.00	85,200
日本エンタープライズ	100	203.00	20,300
スカラ	100	722.00	72,200
インテリジェント ウェイブ	100	620.00	62,000
フルキャストホールディングス	100	2,614.00	261,400

エン・ジャパン	200	4,555.00	911,000
あすか製薬ホールディングス	100	1,007.00	100,700
サワイグループホールディングス	200	5,060.00	1,012,000
富士フイルムホールディングス	1,500	8,811.00	13,216,500
コニカミノルタ	1,700	609.00	1,035,300
資生堂	1,600	7,482.00	11,971,200
ライオン	1,100	1,908.00	2,098,800
高砂香料工業	100	2,977.00	297,700
マンダム	200	1,667.00	333,400
ミルボン	100	6,820.00	682,000
ファンケル	300	3,580.00	1,074,000
コーセー	200	14,040.00	2,808,000
コタ	100	1,615.00	161,500
ポーラ・オルビスホールディングス	400	2,543.00	1,017,200
ノエビアホールディングス	100	5,560.00	556,000
エステー	100	1,702.00	170,200
コニシ	100	1,802.00	180,200
長谷川香料	200	2,838.00	567,600
星光PMC	100	804.00	80,400
小林製薬	300	8,720.00	2,616,000
荒川化学工業	100	1,231.00	123,100
メック	100	3,150.00	315,000
タカラバイオ	200	3,035.00	607,000
JCU	100	4,500.00	450,000
新田ゼラチン	100	624.00	62,400
デクセリアルズ	300	2,224.00	667,200
アース製薬	100	7,110.00	711,000
北興化学工業	100	1,038.00	103,800
クミアイ化学工業	300	848.00	254,400
日本農薬	200	538.00	107,600
ニチレキ	100	1,345.00	134,500
ユシロ化学工業	100	1,172.00	117,200
富士石油	200	283.00	56,600
出光興産	1,000	3,265.00	3,265,000
ENEOSホールディングス	12,900	466.00	6,011,400
コスモエネルギーホールディングス	300	2,497.00	749,100
テスホールディングス	100	2,253.00	225,300
インフロニア・ホールディングス	1,100	920.00	1,012,000
横浜ゴム	500	1,996.00	998,000
TOYO TIRE	500	1,888.00	944,000
ブリヂストン	2,400	5,097.00	12,232,800
住友ゴム工業	800	1,446.00	1,156,800
藤倉コンポジット	100	822.00	82,200
オカモト	100	4,040.00	404,000
アキレス	100	1,356.00	135,600
ニッタ	100	2,670.00	267,000
住友理工	200	760.00	152,000
三ツ星ベルト	100	1,934.00	193,400
バンドー化学	200	882.00	176,400
AGC	800	5,800.00	4,640,000

日本板硝子	500	633.00	316,500
有沢製作所	100	895.00	89,500
日本電気硝子	400	2,839.00	1,135,600
住友大阪セメント	200	3,325.00	665,000
太平洋セメント	500	2,414.00	1,207,000
日本ヒューム	100	759.00	75,900
日本コンクリート工業	200	300.00	60,000
アジアパイルホールディングス	100	468.00	46,800
東海カーボン	800	1,463.00	1,170,400
東洋炭素	100	3,025.00	302,500
ノリタケカンパニーリミテド	100	4,930.00	493,000
TOTO	600	5,760.00	3,456,000
日本碍子	1,000	1,951.00	1,951,000
日本特殊陶業	700	1,721.00	1,204,700
ヨータイ	100	1,268.00	126,800
東京窯業	100	328.00	32,800
フジインコーポレーテッド	100	7,000.00	700,000
ニチアス	200	2,709.00	541,800
日本製鉄	4,100	1,986.50	8,144,650
神戸製鋼所	1,500	658.00	987,000
中山製鋼所	100	424.00	42,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,400	1,735.00	4,164,000
東京製鐵	400	1,099.00	439,600
共英製鋼	100	1,355.00	135,500
大和工業	200	3,545.00	709,000
淀川製鋼所	100	2,467.00	246,700
丸一鋼管	300	2,601.00	780,300
大同特殊鋼	100	4,750.00	475,000
日本冶金工業	100	2,649.00	264,900
山陽特殊製鋼	100	1,735.00	173,500
愛知製鋼	100	2,688.00	268,800
日立金属	800	2,164.00	1,731,200
大平洋金属	100	2,076.00	207,600
新日本電工	600	370.00	222,000
日本製鋼所	300	3,290.00	987,000
三菱製鋼	100	1,126.00	112,600
日亜鋼業	100	290.00	29,000
大紀アルミニウム工業所	100	1,854.00	185,400
日本軽金属ホールディングス	200	1,978.00	395,600
三井金属鉱業	200	3,450.00	690,000
三菱マテリアル	600	2,279.00	1,367,400
住友金属鉱山	1,100	4,488.00	4,936,800
DOWAホールディングス	200	4,920.00	984,000
古河機械金属	100	1,274.00	127,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	806.00	80,600
東邦チタニウム	200	1,233.00	246,600
UACJ	100	2,845.00	284,500
古河電気工業	300	2,545.00	763,500
住友電気工業	2,900	1,552.00	4,500,800

フジクラ	1,100	661.00	727,100
昭和電線ホールディングス	100	2,173.00	217,300
タツタ電線	200	536.00	107,200
リョービ	100	1,228.00	122,800
アーレスティ	100	431.00	43,100
アサヒホールディングス	300	2,188.00	656,400
東洋製罐グループホールディングス	600	1,345.00	807,000
横河ブリッジホールディングス	200	2,310.00	462,000
三和ホールディングス	800	1,447.00	1,157,600
文化シャッター	300	1,124.00	337,200
三協立山	100	759.00	75,900
アルインコ	100	1,004.00	100,400
LIXIL	1,200	3,115.00	3,738,000
日本フィルコン	100	550.00	55,000
ノーリツ	200	1,863.00	372,600
長府製作所	100	2,067.00	206,700
リンナイ	200	11,920.00	2,384,000
ユニプレス	100	942.00	94,200
日東精工	100	659.00	65,900
岡部	200	687.00	137,400
ジーテクト	100	1,456.00	145,600
東プレ	200	1,352.00	270,400
高周波熱錬	200	638.00	127,600
東京製綱	100	880.00	88,000
サンコール	100	455.00	45,500
モリテックスチール	100	439.00	43,900
パイオラックス	100	1,615.00	161,500
エイチワン	100	739.00	73,900
日本発条	900	858.00	772,200
三浦工業	400	4,400.00	1,760,000
タクマ	300	1,545.00	463,500
テクノプロ・ホールディングス	500	3,600.00	1,800,000
Keeper 技研	100	3,370.00	337,000
Gunosy	100	696.00	69,600
ジャパンマテリアル	300	1,523.00	456,900
ベクトル	100	1,234.00	123,400
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,765.00	176,500
IBJ	100	1,106.00	110,600
M&Aキャピタルパートナーズ	100	6,470.00	647,000
ウィルグループ	100	1,303.00	130,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	215.00	21,500
メドピア	100	3,660.00	366,000
リクルートホールディングス	5,800	7,232.00	41,945,600
エラン	100	1,250.00	125,000
ツガミ	200	1,553.00	310,600
オークマ	100	5,470.00	547,000
芝浦機械	100	2,658.00	265,800
アマダ	1,300	1,159.00	1,506,700
アイダエンジニアリング	200	1,032.00	206,400
FUJI	400	2,638.00	1,055,200

牧野フライス製作所	100	4,200.00	420,000
オーエスジー	400	1,823.00	729,200
旭ダイヤモンド工業	200	688.00	137,600
D M G 森精機	500	1,977.00	988,500
ソディック	200	873.00	174,600
ディスコ	100	30,750.00	3,075,000
日進工具	100	1,550.00	155,000
パンチ工業	100	603.00	60,300
日本郵政	6,200	904.30	5,606,660
ベルシステム24ホールディングス	100	1,600.00	160,000
鎌倉新書	100	875.00	87,500
エアトリ	100	4,175.00	417,500
アトラエ	100	2,456.00	245,600
ソラスト	200	1,409.00	281,800
インソース	100	2,305.00	230,500
豊田自動織機	700	9,700.00	6,790,000
東洋機械金属	100	521.00	52,100
島精機製作所	100	2,246.00	224,600
オプトラン	100	2,294.00	229,400
イワキ	100	983.00	98,300
フリー	100	1,641.00	164,100
ヤマシンフィルタ	200	683.00	136,600
日阪製作所	100	852.00	85,200
やまびこ	200	1,205.00	241,000
ペガサスミシン製造	100	465.00	46,500
ナブテスコ	500	3,965.00	1,982,500
三井海洋開発	100	1,991.00	199,100
レオン自動機	100	1,452.00	145,200
S M C	300	66,640.00	19,992,000
オイレス工業	100	1,706.00	170,600
サトーホールディングス	100	2,644.00	264,400
技研製作所	100	4,445.00	444,500
日精樹脂工業	100	1,102.00	110,200
小松製作所	3,900	2,830.00	11,037,000
住友重機械工業	500	2,923.00	1,461,500
日立建機	400	3,375.00	1,350,000
日工	100	664.00	66,400
井関農機	100	1,639.00	163,900
T O W A	100	2,428.00	242,800
シンニッタン	100	233.00	23,300
クボタ	4,100	2,400.00	9,840,000
東洋エンジニアリング	100	884.00	88,400
月島機械	200	1,151.00	230,200
帝国電機製作所	100	1,450.00	145,000
新東工業	200	752.00	150,400
澁谷工業	100	3,065.00	306,500
アイチコーポレーション	200	787.00	157,400
小森コーポレーション	200	785.00	157,000
鶴見製作所	100	1,748.00	174,800
荏原製作所	400	6,140.00	2,456,000

西島製作所	100	906.00	90,600	
北越工業	100	944.00	94,400	
ダイキン工業	1,200	25,730.00	30,876,000	
栗田工業	500	5,640.00	2,820,000	
椿本チエイン	100	3,350.00	335,000	
日機装	300	1,014.00	304,200	
木村化工機	100	773.00	77,300	
レイズネクスト	200	1,228.00	245,600	
アネスト岩田	200	923.00	184,600	
ダイフク	500	10,300.00	5,150,000	
タダノ	400	1,233.00	493,200	
フジテック	300	2,515.00	754,500	
C K D	200	2,242.00	448,400	
キトー	100	1,651.00	165,100	
平和	300	2,076.00	622,800	
理想科学工業	100	2,409.00	240,900	
SANKYO	200	2,787.00	557,400	
日本金銭機械	100	761.00	76,100	
マースグループホールディングス	100	1,639.00	163,900	
フクシマガリレイ	100	4,680.00	468,000	
竹内製作所	200	2,898.00	579,600	
アマノ	200	2,688.00	537,600	
JUKI	100	851.00	85,100	
サンデンホールディングス	100	283.00	28,300	
ジャノメ	100	747.00	74,700	
ブラザー工業	1,100	2,353.00	2,588,300	
マックス	100	1,801.00	180,100	
モリタホールディングス	100	1,438.00	143,800	
グローリー	200	2,414.00	482,800	
新晃工業	100	2,090.00	209,000	
大和冷機工業	100	1,260.00	126,000	
セガサミーホールディングス	800	1,628.00	1,302,400	
T P R	100	1,480.00	148,000	
ツバキ・ナカシマ	200	1,602.00	320,400	
ホシザキ	300	9,810.00	2,943,000	
大豊工業	100	840.00	84,000	
日本精工	1,800	818.00	1,472,400	
NTN	1,900	264.00	501,600	
ジェイテクト	900	1,029.00	926,100	
不二越	100	4,230.00	423,000	
ミネベアミツミ	1,500	2,855.00	4,282,500	
日本トムソン	200	547.00	109,400	
THK	500	2,532.00	1,266,000	
ユーシン精機	100	777.00	77,700	
前澤給装工業	100	1,058.00	105,800	
イーグル工業	100	1,212.00	121,200	
前澤工業	100	697.00	69,700	
日本ピラー工業	100	2,580.00	258,000	
キッツ	300	767.00	230,100	
日立製作所	4,100	6,830.00	28,003,000	



東芝	1,700	4,890.00	8,313,000
三菱電機	8,600	1,606.50	13,815,900
富士電機	500	5,130.00	2,565,000
安川電機	1,000	5,070.00	5,070,000
シンフォニアテクノロジー	100	1,199.00	119,900
明電舎	200	2,449.00	489,800
デンヨー	100	2,046.00	204,600
ベイカレント・コンサルティング	100	45,100.00	4,510,000
グレイステクノロジー	100	1,087.00	108,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	300	2,473.00	741,900
日総工産	100	738.00	73,800
RPAホールディングス	100	517.00	51,700
三櫻工業	100	1,038.00	103,800
マキタ	1,200	5,770.00	6,924,000
東芝テック	100	4,715.00	471,500
マブチモーター	200	3,960.00	792,000
日本電産	2,000	12,620.00	25,240,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	656.00	65,600
ダブル・スコープ	200	940.00	188,000
ダイヘン	100	4,665.00	466,500
ヤーマン	100	1,229.00	122,900
JVCケンウッド	800	206.00	164,800
ミマキエンジニアリング	100	911.00	91,100
日新電機	200	1,378.00	275,600
大崎電気工業	200	553.00	110,600
オムロン	800	10,960.00	8,768,000
日東工業	100	1,707.00	170,700
I D E C	100	2,273.00	227,300
ジーエス・ユアサコーポレーション	300	2,591.00	777,300
日本電気	1,200	6,320.00	7,584,000
富士通	800	21,460.00	17,168,000
沖電気工業	400	967.00	386,800
サンケン電気	100	5,340.00	534,000
アイホン	100	2,421.00	242,100
ルネサスエレクトロニクス	4,600	1,372.00	6,311,200
セイコーエプソン	1,100	2,160.00	2,376,000
ワコム	700	732.00	512,400
アルバック	200	6,340.00	1,268,000
E I Z O	100	4,295.00	429,500
ジャパンディスプレイ	3,000	36.00	108,000
日本信号	200	968.00	193,600
京三製作所	200	481.00	96,200
能美防災	100	2,086.00	208,600
ホーチキ	100	1,202.00	120,200
エレコム	200	1,776.00	355,200
パナソニック	9,200	1,396.00	12,843,200
シャープ	1,200	1,379.00	1,654,800
アンリツ	500	2,035.00	1,017,500
富士通ゼネラル	300	2,837.00	851,100

ソニーグループ	5,400	12,820.00	69,228,000	
T D K	1,200	4,000.00	4,800,000	
タムラ製作所	300	771.00	231,300	
アルプスアルパイン	700	1,185.00	829,500	
日本電波工業	100	983.00	98,300	
メイコー	100	3,155.00	315,500	
ローランド ディー・ジー	100	2,960.00	296,000	
フォスター電機	100	893.00	89,300	
ヨコオ	100	2,566.00	256,600	
ホシデン	200	963.00	192,600	
ヒロセ電機	100	18,660.00	1,866,000	
日本航空電子工業	200	1,642.00	328,400	
T O A	100	821.00	82,100	
マクセル	200	1,317.00	263,400	
古野電気	100	1,249.00	124,900	
スミダコーポレーション	100	1,363.00	136,300	
本多通信工業	100	462.00	46,200	
横河電機	900	2,214.00	1,992,600	
アズビル	600	4,795.00	2,877,000	
日本光電工業	400	3,650.00	1,460,000	
共和電業	100	398.00	39,800	
堀場製作所	200	7,560.00	1,512,000	
アドバンテスト	700	9,250.00	6,475,000	
エスベック	100	2,340.00	234,000	
キーエンス	900	68,410.00	61,569,000	
シスメックス	700	14,030.00	9,821,000	
日本マイクロニクス	200	1,441.00	288,200	
メガチップス	100	3,500.00	350,000	
I M A G I C A G R O U P	100	490.00	49,000	
デンソー	1,900	7,878.00	14,968,200	
コーセル	100	934.00	93,400	
イリソ電子工業	100	4,995.00	499,500	
オブテックスグループ	100	1,485.00	148,500	
レーザーテック	400	26,800.00	10,720,000	
スタンレー電気	600	2,851.00	1,710,600	
ウシオ電機	500	2,107.00	1,053,500	
岡谷電機産業	100	350.00	35,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	100	325.00	32,500	
日本セラミック	100	3,025.00	302,500	
古河電池	100	1,591.00	159,100	
山一電機	100	1,689.00	168,900	
図研	100	4,220.00	422,000	
日本電子	200	8,580.00	1,716,000	
カシオ計算機	700	1,680.00	1,176,000	
ファナック	800	24,890.00	19,912,000	
日本シイエムケイ	200	431.00	86,200	
ローム	400	10,130.00	4,052,000	
浜松ホトニクス	700	6,670.00	4,669,000	
三井ハイテック	100	7,630.00	763,000	
新光電気工業	300	3,865.00	1,159,500	

京セラ	1,400	6,819.00	9,546,600
太陽誘電	400	5,590.00	2,236,000
村田製作所	2,500	8,652.00	21,630,000
双葉電子工業	200	770.00	154,000
日東電工	500	8,090.00	4,045,000
東海理化電機製作所	200	1,637.00	327,400
ニチコン	300	1,083.00	324,900
日本ケミコン	100	2,108.00	210,800
K O A	100	1,719.00	171,900
三井E & Sホールディングス	400	564.00	225,600
日立造船	700	900.00	630,000
三菱重工業	1,400	3,061.00	4,285,400
川崎重工業	700	2,347.00	1,642,900
I H I	600	2,713.00	1,627,800
名村造船所	300	232.00	69,600
サノヤスホールディングス	100	133.00	13,300
カーブスホールディングス	200	961.00	192,200
フォーラムエンジニアリング	100	932.00	93,200
三菱ロジスネクスト	100	1,118.00	111,800
ヤマエグループホールディングス	100	1,072.00	107,200
F P G	300	707.00	212,100
じもとホールディングス	100	656.00	65,600
全国保証	200	5,500.00	1,100,000
めぶきフィナンシャルグループ	4,400	240.00	1,056,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	100	1,306.00	130,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	1,498.00	149,800
九州フィナンシャルグループ	1,700	399.00	678,300
かんぽ生命保険	1,100	1,912.00	2,103,200
ゆうちょ銀行	2,300	934.00	2,148,200
富山第一銀行	200	293.00	58,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,200	474.00	2,464,800
西日本フィナンシャルホールディングス	600	706.00	423,600
アルヒ	100	1,326.00	132,600
日産自動車	10,000	604.00	6,040,000
いすゞ自動車	2,200	1,568.00	3,449,600
トヨタ自動車	43,500	2,031.50	88,370,250
日野自動車	1,100	1,140.00	1,254,000
三菱自動車工業	3,200	380.00	1,216,000
エフテック	100	636.00	63,600
武蔵精密工業	200	2,146.00	429,200
日産車体	100	804.00	80,400
新明和工業	300	954.00	286,200
極東開発工業	200	1,635.00	327,000
トビー工業	100	1,203.00	120,300
曙ブレーキ工業	500	245.00	122,500
タチエス	100	1,353.00	135,300
N O K	400	1,351.00	540,400

フタバ産業	200	477.00	95,400
K Y B	100	3,065.00	306,500
市光工業	100	581.00	58,100
大同メタル工業	200	627.00	125,400
プレス工業	500	336.00	168,000
ミクニ	100	319.00	31,900
太平洋工業	200	1,221.00	244,200
河西工業	100	359.00	35,900
アイシン	700	4,175.00	2,922,500
マツダ	2,700	1,061.00	2,864,700
今仙電機製作所	100	677.00	67,700
本田技研工業	6,700	3,489.00	23,376,300
スズキ	1,700	5,250.00	8,925,000
S U B A R U	2,400	2,304.00	5,529,600
ヤマハ発動機	1,200	3,120.00	3,744,000
小糸製作所	500	6,810.00	3,405,000
T B K	100	412.00	41,200
エクセディ	100	1,747.00	174,700
ミツバ	200	659.00	131,800
豊田合成	300	2,348.00	704,400
愛三工業	100	835.00	83,500
日本プラスト	100	637.00	63,700
ヨロズ	100	1,195.00	119,500
エフ・シー・シー	100	1,621.00	162,100
シマノ	400	30,110.00	12,044,000
テイ・エス テック	400	1,508.00	603,200
三十三フィナンシャルグループ	100	1,410.00	141,000
第四北越フィナンシャルグループ	100	2,586.00	258,600
ひろぎんホールディングス	1,300	643.00	835,900
おきなわフィナンシャルグループ	100	2,517.00	251,700
十六フィナンシャルグループ	100	2,089.00	208,900
北國フィナンシャルホールディングス	100	2,039.00	203,900
ジャムコ	100	1,014.00	101,400
小野建	100	1,672.00	167,200
ノジマ	200	2,824.00	564,800
佐島電機	100	956.00	95,600
カッパ・クリエイト	100	1,368.00	136,800
伯東	100	1,897.00	189,700
コンドーテック	100	980.00	98,000
中山福	100	410.00	41,000
ライトオン	100	692.00	69,200
ナガイレーベン	100	2,352.00	235,200
三菱食品	100	2,949.00	294,900
良品計画	1,000	2,321.00	2,321,000
三城ホールディングス	100	260.00	26,000
松田産業	100	3,520.00	352,000
第一興商	200	4,090.00	818,000
メディカルホールディングス	900	2,136.00	1,922,400
アドヴァングループ	100	966.00	96,600
アズワン	100	15,840.00	1,584,000

シモジマ	100	1,144.00	114,400	
ドウシシャ	100	1,733.00	173,300	
コナカ	100	335.00	33,500	
イオン北海道	100	1,200.00	120,000	
コジマ	200	580.00	116,000	
コーナン商事	100	3,655.00	365,500	
ネットワンシステムズ	400	3,875.00	1,550,000	
ワタミ	100	1,018.00	101,800	
システムソフト	200	147.00	29,400	
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	1,700	2,501.00	4,251,700	
丸文	100	784.00	78,400	
西松屋チェーン	200	1,448.00	289,600	
ゼンショーホールディングス	500	2,663.00	1,331,500	
ハビネット	100	1,499.00	149,900	
幸楽苑ホールディングス	100	1,496.00	149,600	
日本ライフライン	300	1,315.00	394,500	
サイゼリヤ	100	3,115.00	311,500	
タカショー	100	823.00	82,300	
V Tホールディングス	300	518.00	155,400	
アルゴグラフィックス	100	3,215.00	321,500	
I D O M	300	806.00	241,800	
日本エム・ディ・エム	100	2,185.00	218,500	
ユナイテッドアローズ	100	2,157.00	215,700	
進和	100	2,227.00	222,700	
ハイデイ日高	100	1,639.00	163,900	
シークス	100	1,266.00	126,600	
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	100	245.00	24,500	
コロワイド	300	1,691.00	507,300	
ピーシーデポコーポレーション	100	453.00	45,300	
壱番屋	100	4,595.00	459,500	
スギホールディングス	200	8,340.00	1,668,000	
島津製作所	1,200	4,700.00	5,640,000	
J M S	100	773.00	77,300	
長野計器	100	1,353.00	135,300	
スター精密	100	1,516.00	151,600	
東京計器	100	1,018.00	101,800	
オーバル	100	254.00	25,400	
東京精密	200	4,570.00	914,000	
マニー	400	2,007.00	802,800	
ニコン	1,400	1,288.00	1,803,200	
トプコン	500	1,979.00	989,500	
オリンパス	4,500	2,525.00	11,362,500	
理研計器	100	3,125.00	312,500	
S C R E E Nホールディングス	200	9,300.00	1,860,000	
キヤノン電子	100	1,643.00	164,300	
タムロン	100	2,606.00	260,600	
H O Y A	1,700	17,445.00	29,656,500	
ノーリツ鋼機	100	2,449.00	244,900	

エー・アンド・デイ	100	1,037.00	103,700
朝日インテック	1,000	2,993.00	2,993,000
キヤノン	4,200	2,904.00	12,196,800
リコー	2,100	1,163.00	2,442,300
シチズン時計	1,200	520.00	624,000
大研医器	100	588.00	58,800
メニコン	200	4,095.00	819,000
スノーピーク	100	5,420.00	542,000
パラマウントベッドホールディングス	200	2,154.00	430,800
ニホンフラッシュ	100	1,101.00	110,100
前田工織	100	3,320.00	332,000
永大産業	100	297.00	29,700
アートネイチャー	100	740.00	74,000
バンダイナムコホールディングス	800	8,788.00	7,030,400
共立印刷	200	178.00	35,600
SHOEI	100	5,010.00	501,000
フランスベッドホールディングス	100	908.00	90,800
マーベラス	100	730.00	73,000
パイロットコーポレーション	200	4,270.00	854,000
萩原工業	100	1,576.00	157,600
エイベックス	200	1,596.00	319,200
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	2,507.00	501,400
タカラトミー	400	1,112.00	444,800
広済堂ホールディングス	100	1,019.00	101,900
レック	100	1,089.00	108,900
三光合成	100	418.00	41,800
プロネクサス	100	1,093.00	109,300
ホクシン	100	177.00	17,700
大建工業	100	2,399.00	239,900
きもと	100	242.00	24,200
凸版印刷	1,400	1,861.00	2,605,400
大日本印刷	1,100	2,821.00	3,103,100
NISSHA	200	1,815.00	363,000
藤森工業	100	4,660.00	466,000
前澤化成工業	100	1,278.00	127,800
アシックス	800	2,865.00	2,292,000
JSP	100	1,605.00	160,500
ニチハ	100	3,225.00	322,500
ローランド	100	5,210.00	521,000
エフピコ	200	3,875.00	775,000
ヤマハ	500	7,230.00	3,615,000
クリナップ	100	550.00	55,000
ピジョン	500	2,630.00	1,315,000
天馬	100	2,779.00	277,900
キングジム	100	877.00	87,700
象印マホービン	200	1,571.00	314,200
リンテック	200	2,503.00	500,600
信越ポリマー	100	1,015.00	101,500
東リ	200	237.00	47,400

イトーキ	200	374.00	74,800
任天堂	500	50,300.00	25,150,000
三菱鉛筆	100	1,391.00	139,100
タカラスタンド	200	1,540.00	308,000
コクヨ	400	1,802.00	720,800
ナカバヤシ	100	575.00	57,500
ニフコ	300	3,650.00	1,095,000
オカムラ	300	1,530.00	459,000
バルカー	100	2,130.00	213,000
伊藤忠商事	5,900	3,330.00	19,647,000
丸紅	8,300	959.30	7,962,190
スクロール	100	875.00	87,500
ヨンドシーホールディングス	100	1,737.00	173,700
長瀬産業	500	1,922.00	961,000
蝶理	100	1,862.00	186,200
豊田通商	900	5,050.00	4,545,000
オンワードホールディングス	500	339.00	169,500
三共生興	100	581.00	58,100
兼松	400	1,342.00	536,800
美津濃	100	2,618.00	261,800
三井物産	6,700	2,591.00	17,359,700
東京エレクトロン	500	50,960.00	25,480,000
カメイ	100	1,170.00	117,000
スターゼン	100	2,189.00	218,900
セイコーホールディングス	100	2,398.00	239,800
山善	300	1,066.00	319,800
住友商事	5,400	1,612.00	8,704,800
日本ユニシス	300	3,180.00	954,000
三菱商事	5,200	3,609.00	18,766,800
キヤノンマーケティングジャパン	200	2,535.00	507,000
佐藤商事	100	1,194.00	119,400
菱洋エレクトロ	100	2,371.00	237,100
東京産業	100	699.00	69,900
ユアサ商事	100	3,030.00	303,000
阪和興業	200	3,275.00	655,000
正栄食品工業	100	4,140.00	414,000
カナデン	100	1,035.00	103,500
菱電商事	100	1,743.00	174,300
ニプロ	700	1,153.00	807,100
岩谷産業	200	6,780.00	1,356,000
アステナホールディングス	100	564.00	56,400
三愛石油	200	1,487.00	297,400
稲畑産業	200	1,710.00	342,000
明和産業	100	849.00	84,900
ゴールドウイン	100	6,860.00	686,000
ユニ・チャーム	1,700	4,546.00	7,728,200
デザート	200	3,975.00	795,000
ワキタ	200	1,042.00	208,400
ヤマトインターナショナル	100	321.00	32,100
東邦ホールディングス	300	1,849.00	554,700

サンゲツ	200	1,592.00	318,400
ミツウロコグループホールディングス	100	1,414.00	141,400
伊藤忠エネクス	200	1,027.00	205,400
サンリオ	300	2,712.00	813,600
サンワテクノス	100	1,492.00	149,200
リョーサン	100	2,303.00	230,300
新光商事	100	898.00	89,800
東陽テクニカ	100	1,126.00	112,600
モスフードサービス	100	3,150.00	315,000
加賀電子	100	3,035.00	303,500
三益半導体工業	100	2,486.00	248,600
ソーダニッカ	100	630.00	63,000
立花エレテック	100	1,551.00	155,100
木曽路	100	2,171.00	217,100
SRSホールディングス	100	756.00	75,600
千趣会	200	395.00	79,000
リテールパートナーズ	100	1,182.00	118,200
ケーヨー	200	821.00	164,200
上新電機	100	2,443.00	244,300
日本瓦斯	400	1,440.00	576,000
ロイヤルホールディングス	200	2,163.00	432,600
いなげや	100	1,365.00	136,500
チヨダ	100	773.00	77,300
ライフコーポレーション	100	3,860.00	386,000
リンガーハット	100	2,214.00	221,400
MrMaxHD	100	634.00	63,400
テンアライド	100	318.00	31,800
AOKIホールディングス	200	698.00	139,600
オークワ	100	1,117.00	111,700
コメリ	100	2,731.00	273,100
青山商事	200	819.00	163,800
しまむら	100	9,670.00	967,000
高島屋	700	1,128.00	789,600
松屋	200	1,083.00	216,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	400	919.00	367,600
丸井グループ	800	2,260.00	1,808,000
クレディセゾン	500	1,470.00	735,000
アクシアル リテイリング	100	3,600.00	360,000
イオン	3,200	2,629.50	8,414,400
イズミ	200	3,665.00	733,000
平和堂	200	1,985.00	397,000
フジ	100	2,062.00	206,200
ヤオコー	100	6,650.00	665,000
ゼビオホールディングス	100	1,104.00	110,400
ケーズホールディングス	800	1,200.00	960,000
PALTAC	100	5,140.00	514,000
三谷産業	100	371.00	37,100
日産東京販売ホールディングス	100	247.00	24,700
新生銀行	700	1,896.00	1,327,200
あおぞら銀行	500	2,718.00	1,359,000



三菱UFJフィナンシャル・グループ	56,900	664.00	37,781,600
りそなホールディングス	9,600	442.80	4,250,880
三井住友トラスト・ホールディングス	1,600	3,915.00	6,264,000
三井住友フィナンシャルグループ	5,800	3,915.00	22,707,000
千葉銀行	2,800	741.00	2,074,800
群馬銀行	1,700	365.00	620,500
武蔵野銀行	100	1,782.00	178,200
千葉興業銀行	200	273.00	54,600
筑波銀行	400	174.00	69,600
七十七銀行	300	1,242.00	372,600
青森銀行	100	2,075.00	207,500
秋田銀行	100	1,448.00	144,800
山形銀行	100	840.00	84,000
岩手銀行	100	1,657.00	165,700
東邦銀行	800	208.00	166,400
みちのく銀行	100	879.00	87,900
ふくおかフィナンシャルグループ	800	2,133.00	1,706,400
静岡銀行	2,000	950.00	1,900,000
スルガ銀行	800	413.00	330,400
八十二銀行	1,900	395.00	750,500
山梨中央銀行	100	840.00	84,000
大垣共立銀行	200	1,943.00	388,600
福井銀行	100	1,455.00	145,500
滋賀銀行	200	1,895.00	379,000
南都銀行	100	1,975.00	197,500
百五銀行	800	327.00	261,600
京都銀行	300	5,270.00	1,581,000
紀陽銀行	300	1,541.00	462,300
ほくほくフィナンシャルグループ	600	850.00	510,000
山陰合同銀行	600	558.00	334,800
中国銀行	800	848.00	678,400
伊予銀行	1,200	576.00	691,200
百十四銀行	100	1,500.00	150,000
四国銀行	100	753.00	75,300
阿波銀行	100	2,170.00	217,000
大分銀行	100	1,870.00	187,000
宮崎銀行	100	2,075.00	207,500
佐賀銀行	100	1,463.00	146,300
琉球銀行	200	787.00	157,400
セブン銀行	2,800	247.00	691,600
みずほフィナンシャルグループ	11,500	1,565.00	17,997,500
山口フィナンシャルグループ	1,100	667.00	733,700
芙蓉総合リース	100	7,610.00	761,000
みずほリース	100	3,545.00	354,500
東京センチュリー	200	6,530.00	1,306,000
SBIホールディングス	1,100	3,035.00	3,338,500
日本証券金融	400	871.00	348,400
アイフル	1,400	386.00	540,400
名古屋銀行	100	2,534.00	253,400
北洋銀行	1,400	246.00	344,400

愛媛銀行	100	781.00	78,100
京葉銀行	400	441.00	176,400
栃木銀行	400	180.00	72,000
東和銀行	200	518.00	103,600
福島銀行	100	245.00	24,500
リコーリース	100	3,600.00	360,000
イオンフィナンシャルサービス	500	1,483.00	741,500
アコム	1,700	390.00	663,000
ジャックス	100	3,010.00	301,000
オリエントコーポレーション	2,200	161.00	354,200
オリックス	5,100	2,191.50	11,176,650
三菱HCキャピタル	2,900	586.00	1,699,400
ジャフコグループ	100	7,500.00	750,000
トモニホールディングス	700	318.00	222,600
大和証券グループ本社	6,300	677.60	4,268,880
野村ホールディングス	12,900	570.30	7,356,870
岡三証券グループ	800	397.00	317,600
丸三証券	300	618.00	185,400
東洋証券	300	171.00	51,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,000	402.00	402,000
水戸証券	200	299.00	59,800
いちよし証券	200	684.00	136,800
松井証券	400	834.00	333,600
SOMPOホールディングス	1,500	4,970.00	7,455,000
日本取引所グループ	2,200	2,861.50	6,295,300
マネックスグループ	800	780.00	624,000
極東証券	100	797.00	79,700
岩井コスモホールディングス	100	1,408.00	140,800
アイザワ証券グループ	200	1,093.00	218,600
池田泉州ホールディングス	1,000	165.00	165,000
アニコムホールディングス	300	939.00	281,700
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,000	3,725.00	7,450,000
マネーパートナーズグループ	100	248.00	24,800
スパークス・グループ	400	293.00	117,200
第一生命ホールディングス	4,100	2,459.50	10,083,950
東京海上ホールディングス	2,800	6,111.00	17,110,800
イー・ギャランティ	100	2,560.00	256,000
T&Dホールディングス	2,500	1,537.00	3,842,500
三井不動産	3,900	2,635.00	10,276,500
三菱地所	5,600	1,771.50	9,920,400
平和不動産	200	3,615.00	723,000
東京建物	900	1,708.00	1,537,200
ダイビル	200	1,554.00	310,800
京阪神ビルディング	200	1,414.00	282,800
住友不動産	1,900	4,154.00	7,892,600
テーオーシー	200	650.00	130,000
レオパレス21	800	236.00	188,800
スターツコーポレーション	100	2,810.00	281,000

フジ住宅	100	684.00	68,400	
空港施設	100	559.00	55,900	
ゴールドクレスト	100	1,682.00	168,200	
リログループ	500	2,367.00	1,183,500	
日神グループホールディングス	100	509.00	50,900	
日本エスコン	200	809.00	161,800	
タカラレーベン	400	313.00	125,200	
イオンモール	400	1,732.00	692,800	
ランド	4,500	12.00	54,000	
カチタス	200	4,170.00	834,000	
東祥	100	1,839.00	183,900	
トーセイ	100	1,169.00	116,900	
サンフロンティア不動産	100	1,091.00	109,100	
FJネクストホールディングス	100	1,016.00	101,600	
グランディハウス	100	493.00	49,300	
東武鉄道	900	2,880.00	2,592,000	
相鉄ホールディングス	300	2,185.00	655,500	
東急	2,100	1,616.00	3,393,600	
京浜急行電鉄	1,200	1,308.00	1,569,600	
小田急電鉄	1,400	2,522.00	3,530,800	
京王電鉄	500	5,880.00	2,940,000	
京成電鉄	700	3,710.00	2,597,000	
富士急行	100	4,680.00	468,000	
東日本旅客鉄道	1,500	7,414.00	11,121,000	
西日本旅客鉄道	1,000	5,369.00	5,369,000	
東海旅客鉄道	800	17,215.00	13,772,000	
西武ホールディングス	1,100	1,279.00	1,406,900	
鴻池運輸	100	1,257.00	125,700	
西日本鉄道	300	2,742.00	822,600	
ハマキョウレックス	100	3,310.00	331,000	
近鉄グループホールディングス	900	3,625.00	3,262,500	
阪急阪神ホールディングス	1,100	3,475.00	3,822,500	
南海電気鉄道	400	2,284.00	913,600	
京阪ホールディングス	400	3,060.00	1,224,000	
名古屋鉄道	700	1,971.00	1,379,700	
山陽電気鉄道	100	1,983.00	198,300	
アルプス物流	100	1,045.00	104,500	
日本通運	300	7,480.00	2,244,000	
ヤマトホールディングス	1,200	2,806.00	3,367,200	
山九	200	5,370.00	1,074,000	
日新	100	1,648.00	164,800	
丸全昭和運輸	100	3,355.00	335,500	
センコーグループホールディングス	500	1,026.00	513,000	
ニッコンホールディングス	300	2,280.00	684,000	
福山通運	100	4,765.00	476,500	
セイノーホールディングス	600	1,379.00	827,400	
日立物流	200	4,775.00	955,000	
丸和運輸機関	200	1,573.00	314,600	
C&Fロジホールディングス	100	1,655.00	165,500	
日本郵船	700	7,800.00	5,460,000	

商船三井	500	6,690.00	3,345,000	
川崎汽船	300	5,220.00	1,566,000	
明治海運	100	823.00	82,300	
飯野海運	400	553.00	221,200	
九州旅客鉄道	700	2,624.00	1,836,800	
S Gホールディングス	1,500	2,901.00	4,351,500	
日本航空	1,900	2,517.00	4,782,300	
A N Aホールディングス	2,100	2,753.00	5,781,300	
T R Eホールディングス	100	1,794.00	179,400	
コア商事ホールディングス	100	697.00	69,700	
国際紙パルプ商事	200	368.00	73,600	
ブックオフグループホールディングス	100	980.00	98,000	
三菱倉庫	300	3,225.00	967,500	
三井倉庫ホールディングス	100	2,315.00	231,500	
住友倉庫	300	1,848.00	554,400	
東陽倉庫	100	329.00	32,900	
乾汽船	100	2,324.00	232,400	
日本トランスシティ	200	604.00	120,800	
中央倉庫	100	982.00	98,200	
安田倉庫	100	975.00	97,500	
宇徳	100	537.00	53,700	
上組	500	2,364.00	1,182,000	
近鉄エクスプレス	200	2,712.00	542,400	
エーアイテイー	100	1,125.00	112,500	
T B Sホールディングス	600	1,828.00	1,096,800	
日本テレビホールディングス	700	1,271.00	889,700	
朝日放送グループホールディングス	100	731.00	73,100	
テレビ朝日ホールディングス	300	1,793.00	537,900	
スカパーJ S A Tホールディングス	600	442.00	265,200	
テレビ東京ホールディングス	100	2,219.00	221,900	
ビジョン	200	1,497.00	299,400	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	100	2,920.00	292,000	
コネクシオ	100	1,581.00	158,100	
日本通信	800	206.00	164,800	
日本電信電話	9,700	3,138.00	30,438,600	
K D D I	6,700	3,668.00	24,575,600	
ソフトバンク	7,600	1,533.50	11,654,600	
光通信	100	17,930.00	1,793,000	
エムティーアイ	100	720.00	72,000	
G M Oインターネット	300	3,105.00	931,500	
K A D O K A W A	200	6,010.00	1,202,000	
学研ホールディングス	100	1,166.00	116,600	
ゼンリン	200	1,052.00	210,400	
インプレスホールディングス	100	269.00	26,900	
東京電力ホールディングス	7,200	342.00	2,462,400	
中部電力	2,600	1,303.00	3,387,800	
関西電力	3,200	1,079.00	3,452,800	
中国電力	1,300	996.00	1,294,800	
北陸電力	800	580.00	464,000	

東北電力	1,900	780.00	1,482,000
四国電力	800	756.00	604,800
九州電力	1,900	839.00	1,594,100
北海道電力	900	517.00	465,300
沖縄電力	200	1,423.00	284,600
電源開発	700	1,595.00	1,116,500
エフオン	100	876.00	87,600
イーレックス	100	2,682.00	268,200
レノバ	200	5,030.00	1,006,000
東京瓦斯	1,600	1,926.50	3,082,400
大阪瓦斯	1,500	1,915.00	2,872,500
東邦瓦斯	400	3,690.00	1,476,000
広島ガス	200	370.00	74,000
西部ガスホールディングス	100	2,339.00	233,900
静岡ガス	200	1,248.00	249,600
メタウォーター	100	1,875.00	187,500
松竹	100	13,000.00	1,300,000
東宝	500	5,480.00	2,740,000
エイチ・アイ・エス	200	2,641.00	528,200
エヌ・ティ・ティ・データ	2,200	2,239.00	4,925,800
共立メンテナンス	100	4,165.00	416,500
イチネンホールディングス	100	1,288.00	128,800
建設技術研究所	100	2,727.00	272,700
スペース	100	947.00	94,700
アインホールディングス	100	6,890.00	689,000
東京都競馬	100	4,455.00	445,500
カナモト	200	2,533.00	506,600
D T S	200	2,560.00	512,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	5,930.00	2,372,000
シーイーシー	100	1,365.00	136,500
カブコン	800	3,250.00	2,600,000
西尾レントオール	100	2,842.00	284,200
日本空港ビルデング	300	5,570.00	1,671,000
トランス・コスモス	100	3,525.00	352,500
乃村工藝社	400	1,115.00	446,000
ジャステック	100	1,297.00	129,700
S C S K	600	2,349.00	1,409,400
日本管財	100	2,760.00	276,000
トーカイ	100	2,245.00	224,500
セコム	900	8,080.00	7,272,000
アイネス	100	1,628.00	162,800
丹青社	200	947.00	189,400
メイテック	100	6,550.00	655,000
T K C	200	3,440.00	688,000
富士ソフト	100	5,850.00	585,000
応用地質	100	1,689.00	168,900
船井総研ホールディングス	200	3,100.00	620,000
N S D	300	2,001.00	600,300
オオバ	100	802.00	80,200

コナミホールディングス	300	6,650.00	1,995,000
ベネッセホールディングス	300	2,636.00	790,800
イオンディライト	100	3,405.00	340,500
ダイセキ	100	5,380.00	538,000
日鉄物産	100	5,090.00	509,000
トラスコ中山	200	2,784.00	556,800
ヤマダホールディングス	2,800	462.00	1,293,600
オートバックスセブン	300	1,535.00	460,500
モリト	100	695.00	69,500
アークランドサカモト	100	1,719.00	171,900
ニトリホールディングス	400	20,655.00	8,262,000
グルメ杵屋	100	1,000.00	100,000
愛眼	100	219.00	21,900
吉野家ホールディングス	300	2,219.00	665,700
加藤産業	100	3,245.00	324,500
イノテック	100	1,403.00	140,300
イエローハット	200	1,928.00	385,600
JBCホールディングス	100	1,620.00	162,000
JKホールディングス	100	836.00	83,600
サガミホールディングス	100	1,010.00	101,000
日伝	100	2,300.00	230,000
関西スーパーマーケット	100	1,983.00	198,300
ミロク情報サービス	100	1,749.00	174,900
北沢産業	100	252.00	25,200
因幡電機産業	200	2,721.00	544,200
王将フードサービス	100	5,970.00	597,000
プレナス	100	1,990.00	199,000
ミニストップ	100	1,391.00	139,100
アークス	200	2,216.00	443,200
バローホールディングス	200	2,432.00	486,400
ミスミグループ本社	1,100	4,840.00	5,324,000
アルテック	100	316.00	31,600
ファーストリテイリング	100	75,500.00	7,550,000
ソフトバンクグループ	6,700	6,712.00	44,970,400
スズケン	400	3,290.00	1,316,000
サンドラッグ	300	3,510.00	1,053,000
サックスパー ホールディングス	100	561.00	56,100
ジェコス	100	878.00	87,800
グローセル	100	408.00	40,800
ベルーナ	200	819.00	163,800
合計	945,500		2,420,358,100

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



新光日本債券インデックスマザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2021年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	40,215,853
国債証券	7,377,350,200
地方債証券	754,204,050
特殊債証券	622,847,000
社債証券	507,540,000
未収入金	20,501,800
未収利息	12,609,066
前払費用	220,877
流動資産合計	9,335,488,846
資産合計	9,335,488,846
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,050,000
流動負債合計	3,050,000
負債合計	3,050,000
純資産の部	
元本等	
元本	7,273,252,074
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	2,059,186,772
元本等合計	9,332,438,846
純資産合計	9,332,438,846
負債純資産合計	9,335,488,846



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2021年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,127,677,414円
同期中追加設定元本額	481,000,662円
同期中一部解約元本額	335,426,002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	882,481,079円
新光7資産バランスファンド	510,950,097円
日本債券ファンド	5,162,368,355円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	568,877,154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）	28,029,245円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	60,085,181円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	35,161,252円
グローバル・ナビ	25,299,711円
計	7,273,252,074円
2. 受益権の総数	7,273,252,074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 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月20日現在
----	---------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月20日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	59,920,400	
地方債証券	3,506,500	
特殊債券	4,586,000	
社債券	2,847,000	
合計	70,859,900	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2020年11月11日から2021年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

		2021年10月20日現在
1口当たり純資産額		1.2831円
(1万口当たり純資産額)		(12,831円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考

国債証券	4 1 8 回 利付国庫債券(2年)	50,000,000	50,113,000	
	4 2 2 回 利付国庫債券(2年)	30,000,000	30,089,700	
	4 2 7 回 利付国庫債券(2年)	40,000,000	40,088,800	
	4 2 8 回 利付国庫債券(2年)	10,000,000	10,023,300	
	1 3 4 回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,146,400	
	1 3 5 回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,090,900	
	1 3 6 回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,179,000	
	1 3 7 回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,206,000	
	1 3 8 回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,186,400	
	1 3 9 回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,311,400	
	1 4 0 回 利付国庫債券(5年)	70,000,000	70,392,000	
	1 4 1 回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,368,400	
	1 4 2 回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,325,000	
	1 4 3 回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,342,000	
	1 4 4 回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	80,588,000	
	1 4 5 回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,471,600	
	1 4 6 回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,326,000	
	1 4 7 回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,168,000	
	1 4 8 回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,158,800	
	1 回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,315,800	
	2 回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	13,880,600	
	3 回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	27,902,800	
	4 回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	28,069,800	
	5 回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	27,061,800	
	6 回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	26,660,200	
	7 回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	25,656,200	
	8 回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	24,018,400	
	9 回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	27,017,100	
	1 0 回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	31,568,100	
	1 1 回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	30,603,900	

12回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	27,647,400	
13回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	27,558,000	
14回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	9,818,000	
326回 利付国庫債券(10年)	10,000,000	10,094,400	
327回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,424,000	
328回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,702,100	
329回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,061,200	
330回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,698,400	
332回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,924,000	
333回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,372,800	
334回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,137,600	
335回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,604,700	
336回 利付国庫債券(10年)	30,000,000	30,576,000	
337回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,514,000	
338回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,368,800	
339回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,654,200	
340回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,179,000	
341回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,170,400	
342回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,672,800	
343回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	90,779,400	
344回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,710,400	
345回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,725,600	
346回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,760,000	
347回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,676,200	
348回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,783,200	

349回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,791,200	
350回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	100,964,000	
351回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,775,200	
352回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,654,500	
353回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,559,800	
354回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,534,000	
355回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,505,800	
356回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,553,700	
357回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,440,400	
358回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,499,800	
359回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,518,400	
360回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,426,400	
361回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,364,800	
362回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,196,200	
363回 利付国庫債券(10年)	20,000,000	20,038,200	
10回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,131,400	
11回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,769,900	
12回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,261,100	
15回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,728,600	
17回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,813,600	
19回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,758,900	
20回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,069,500	
21回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,830,700	
22回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,147,900	
23回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,191,800	

26回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,141,600	
27回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,362,000	
28回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,840,000	
29回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,632,600	
30回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,632,700	
31回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,171,200	
32回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,607,400	
33回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	38,440,500	
34回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,619,500	
35回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	38,640,000	
36回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	38,765,100	
37回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	38,278,800	
38回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,199,000	
39回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,648,200	
40回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,259,800	
41回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,888,000	
42回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,911,800	
43回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,936,200	
44回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,959,800	
45回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,126,800	
46回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	36,211,200	
47回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,603,000	
48回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	23,718,200	
49回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	35,590,800	
50回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,008,200	

5 1 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	28,066,200	
5 2 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,381,400	
5 3 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,021,800	
5 4 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,928,000	
5 5 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,912,800	
5 6 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,897,000	
5 7 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,321,200	
5 8 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,260,900	
5 9 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	30,514,200	
6 0 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,291,600	
6 1 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,277,600	
6 2 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,234,800	
6 3 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,696,000	
6 4 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,664,200	
6 5 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,632,200	
6 6 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,600,000	
6 7 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,388,900	
6 8 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,589,600	
6 9 回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	30,145,800	
7 0 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,073,400	
7 1 回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,049,200	
5 9 回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,211,000	
6 4 回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,385,700	
7 0 回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,340,600	
7 2 回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,289,400	

78回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,466,600	
81回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,823,200	
84回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,875,900	
88回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,113,900	
90回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,125,000	
92回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	33,382,800	
95回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,688,400	
99回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,332,900	
105回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,479,900	
108回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,385,700	
110回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	34,720,200	
111回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,694,800	
112回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,236,200	
113回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	34,986,300	
114回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,704,900	
116回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,835,400	
117回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,502,800	
118回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,707,200	
120回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,722,800	
121回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,304,600	
122回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,126,800	
123回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,740,200	
124回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,557,800	
125回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,005,200	
126回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,815,400	



127回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,721,800	
128回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,501,600	
129回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,654,800	
130回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,372,400	
131回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,587,900	
132回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,615,700	
133回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,432,800	
134回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,491,000	
135回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,642,500	
136回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,539,600	
137回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,669,600	
138回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,917,800	
139回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,564,200	
140回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,087,700	
141回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,884,800	
142回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,662,400	
143回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	34,899,600	
144回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,042,000	
145回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,079,600	
146回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,174,400	
147回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,788,800	
148回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,381,600	
149回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,450,800	
150回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,014,000	
151回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	56,305,000	

152回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,076,800	
153回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	57,087,000	
154回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,170,400	
155回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	55,129,500	
156回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,721,200	
157回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,549,200	
158回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,230,000	
159回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,213,500	
160回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,325,600	
161回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,701,600	
162回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,664,400	
163回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,218,900	
164回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,930,800	
165回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,880,000	
166回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,601,100	
167回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,773,200	
168回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,048,900	
169回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,307,600	
170回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,424,600	
171回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,367,600	
172回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,846,400	
173回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,724,000	
174回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,651,200	
175回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,237,900	
176回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,249,200	

	177回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,568,600	
国債証券 合計		6,930,000,000	7,377,350,200	
地方債証券	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	115,760,000	
	200回 神奈川県公募公債	35,000,000	35,547,050	
	218回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,791,000	
	412回 大阪府公募公債 10年	50,000,000	50,123,000	
	12回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	105,874,000	
	24年度7回 広島県公募公債	100,000,000	100,946,000	
	24年度1回 福岡県公募公債 30年	10,000,000	13,054,600	
	169回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,878,000	
	485回 名古屋市公募公債 10年	30,000,000	30,422,400	
	24年度2回 広島市公募公債	100,000,000	100,808,000	
地方債証券 合計		725,000,000	754,204,050	
特殊債券	104回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,989,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,342,000	
	249回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,749,000	
	327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,781,000	
	49回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,475,000	
	58回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,511,000	
特殊債券 合計		600,000,000	622,847,000	
社債券	50回 西日本高速道路債券	100,000,000	99,986,000	
	4回 第一三共社債	100,000,000	101,431,000	
	11回 プリヂストン社債	100,000,000	100,380,000	
	36回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,346,000	
	494回 九州電力社債	100,000,000	99,397,000	
社債券 合計		500,000,000	507,540,000	
合計			9,261,941,250	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 新光J-REITマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2021年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,131,258,630
投資証券	114,105,077,250
派生商品評価勘定	317,180
未収入金	197,090,382
未収配当金	951,003,419
前払金	4,225,290
差入委託証拠金	95,844,000
流動資産合計	116,484,816,151
資産合計	116,484,816,151
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,963,050
未払解約金	163,409,000
流動負債合計	176,372,050
負債合計	176,372,050
純資産の部	
元本等	
元本	50,245,671,284
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,062,772,817
元本等合計	116,308,444,101
純資産合計	116,308,444,101
負債純資産合計	116,484,816,151

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 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10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	58,049,127,563円
同期中追加設定元本額	550,712,940円
同期中一部解約元本額	8,354,169,219円
元本の内訳	
ファンド名	
J-REITパッケージ	2,686,293,729円
新光J-REITオープン	45,590,092,289円
One DC 国内リートインデックスファンド	999,032,376円
新光7資産バランスファンド	282,017,780円
グローバル・ナビ	4,611,090円
新光J-REITオープン(年2回決算型)	683,624,020円
計	50,245,671,284円
2. 受益権の総数	50,245,671,284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 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信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、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年10月20日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	13,378,358,673
合計	13,378,358,673

（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2021年10月20日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 不動産投信関連

種類	2021年10月20日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	2,054,602,290	-	2,042,064,000	12,538,290
合計	2,054,602,290	-	2,042,064,000	12,538,290

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年10月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3148円 (23,148円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	3,861	827,026,200	
	GLP投資法人	32,287	6,044,126,400	
	NTT都市開発リート投資法人	9,004	1,394,719,600	
	Oneリート投資法人	1,730	515,886,000	
	SOSILA物流リート投資法人	4,182	705,503,400	
	いちごオフィスリート投資法人	8,168	737,570,400	
	いちごホテルリート投資法人	1,651	155,524,200	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	5,313	2,428,041,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,967	3,712,707,500	
	イオンリート投資法人	11,724	1,810,185,600	
	インヴィンシブル投資法人	43,877	1,888,904,850	
	エスコンジャパンリート投資法人	2,007	280,980,000	
	オリックス不動産投資法人	19,863	3,777,942,600	

グローバル・ワン不動産投資法人	6,922	806,413,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,084	2,235,900,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,809	1,480,276,600	
ケネディクス商業リート投資法人	3,980	1,150,220,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,489	1,499,326,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,258	270,960,000	
サンケイリアルエステート投資法人	3,158	381,802,200	
ザイマックス・リート投資法人	1,447	169,154,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,540	2,037,018,000	
ジャパンエクセレント投資法人	9,250	1,270,950,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,969	7,048,083,000	
スターアジア不動産投資法人	10,302	598,546,200	
スターツプロシード投資法人	1,552	385,206,400	
タカラレーベン不動産投資法人	3,931	430,051,400	
トーセイ・リート投資法人	2,083	287,870,600	
ヒューリックリート投資法人	8,763	1,547,545,800	
フロンティア不動産投資法人	3,495	1,775,460,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,126	329,742,600	
マリモ地方創生リート投資法人	934	123,288,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	22,442	3,215,938,600	
ラサルロジポート投資法人	12,204	2,319,980,400	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,887	627,361,800	
阪急阪神リート投資法人	4,503	752,451,300	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,706	2,197,658,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,533	1,246,236,000	
産業ファンド投資法人	14,152	2,922,388,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,339	327,226,100	
森トラスト総合リート投資法人	7,125	1,054,500,000	
森ヒルズリート投資法人	11,723	1,785,412,900	
星野リゾート・リート投資法人	1,538	1,131,968,000	
積水ハウス・リート投資法人	29,321	2,735,649,300	
大江戸温泉リート投資法人	1,609	131,455,300	
大和ハウスリート投資法人	14,968	4,931,956,000	
大和証券オフィス投資法人	2,108	1,559,920,000	
大和証券リビング投資法人	13,470	1,528,845,000	
投資法人みらい	11,365	622,802,000	
東海道リート投資法人	763	81,259,500	



東急リアル・エステート投資法人	6,684	1,254,586,800	
日本アコモデーションファンド投資法人	3,442	2,182,228,000	
日本ビルファンド投資法人	11,298	8,349,222,000	
日本プライムリアルティ投資法人	6,551	2,712,114,000	
日本プロロジスリート投資法人	15,794	5,938,544,000	
日本リート投資法人	3,076	1,339,598,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,514	2,198,475,000	
日本都市ファンド投資法人	50,299	5,432,292,000	
福岡リート投資法人	5,156	875,488,800	
平和不動産リート投資法人	6,458	1,036,509,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	32,237	5,506,079,600	
投資証券 合計	575,991	114,105,077,250	
合計		114,105,077,250	

(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

「(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）

2021年10月20日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	38,552,430
コール・ローン	20,363,628
株式	1,822,238,596
新株予約権証券	33,956
投資信託受益証券	3,146,836
投資証券	38,790,611
派生商品評価勘定	1,502,453
未収入金	86,413,563
未収配当金	1,185,476
差入委託証拠金	84,219,586
流動資産合計	2,096,447,135
資産合計	2,096,447,135
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	131,093
未払解約金	20,483,000
流動負債合計	20,614,093
負債合計	20,614,093
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	538,753,749
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,537,079,293
元本等合計	2,075,833,042
純資産合計	2,075,833,042
負債純資産合計	2,096,447,135

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	620,393,119円
同期中追加設定元本額	4,885,037円
同期中一部解約元本額	86,524,407円

元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	177,969,300円
新光外国株式インデックスVA	230,980,600円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	99,673,596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)	3,390,283円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	10,432,652円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	7,408,444円
グローバル・ナビ	8,898,874円
計	538,753,749円
2. 受益権の総数	538,753,749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 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年10月20日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	373,027,963	
新株予約権証券	21,538	
投資信託受益証券	344,620	
投資証券	8,098,924	
合計	381,493,045	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2020年11月11日から2021年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2021年10月20日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(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	38,566,160	-	38,597,593	31,433
イギリス・ポンド	19,484,500	-	19,495,312	10,812
カナダ・ドル	4,733,300	-	4,745,625	12,325
スイス・フラン	1,855,780	-	1,856,152	372
デンマーク・クローネ	2,482,020	-	2,482,272	252
ユーロ	537,840	-	537,918	78
香港・ドル	8,004,420	-	8,005,344	924
合計	1,468,300	-	1,474,970	6,670
合計	38,566,160	-	38,597,593	31,433

(注)時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	2021年10月20日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	172,614,840	-	174,017,633	1,402,793
合計	172,614,840	-	174,017,633	1,402,793

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年10月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.8530円 (38,530円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	130	3,444.150	447,739.500	
	ABBOTT LABORATORIES	509	119.340	60,744.060	
	AES CORP	200	24.150	4,830.000	
	ABIOMED INC	12	349.410	4,192.920	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	256	141.980	36,346.880	
	ADVANCED MICRO DEVICES	345	116.330	40,133.850	
	ADOBE INC	136	636.070	86,505.520	
	CHUBB LTD	132	182.190	24,049.080	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	66	294.490	19,436.340	
	ALLEGHANY CORP	5	664.300	3,321.500	
	ALLSTATE CORP	89	126.500	11,258.500	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	199	221.780	44,134.220	
	AMGEN INC	161	206.780	33,291.580	
	HESS CORP	85	90.100	7,658.500	

AMERICAN EXPRESS CO	193	177.310	34,220.830	
AMERICAN ELECTRIC POWER	144	83.800	12,067.200	
AFLAC INC	191	55.790	10,655.890	
AMERICAN INTL GROUP	258	58.640	15,129.120	
AMERCO	2	720.510	1,441.020	
ANALOG DEVICES	158	176.630	27,907.540	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	211	72.480	15,293.280	
VALERO ENERGY CORP	115	80.150	9,217.250	
ANSYS INC	23	366.030	8,418.690	
APPLE INC	4,802	148.760	714,345.520	
APPLIED MATERIALS INC	259	134.600	34,861.400	
ALBEMARLE CORP	36	235.950	8,494.200	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	164	64.540	10,584.560	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	34	67.230	2,285.820	
AMEREN CORP	72	83.510	6,012.720	
ARROW ELECTRONICS INC	21	118.680	2,492.280	
AUTOLIV INC	26	94.440	2,455.440	
AUTODESK INC	65	296.690	19,284.850	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	121	213.980	25,891.580	
AUTOZONE INC	6	1,764.210	10,585.260	
AVERY DENNISON CORP	24	211.280	5,070.720	
BALL CORP	98	90.640	8,882.720	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	384	284.830	109,374.720	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	241	57.650	13,893.650	
BAXTER INTERNATIONAL INC	149	79.680	11,872.320	
BECTON DICKINSON & CO	85	242.730	20,632.050	
AMETEK INC	68	130.140	8,849.520	
VERIZON COMM INC	1,205	52.350	63,081.750	
WR BERKLEY CORP	47	77.470	3,641.090	
BEST BUY CO INC	65	113.940	7,406.100	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	6	732.760	4,396.560	
YUM! BRANDS INC	91	125.710	11,439.610	
FIRSTENERGY CORP	176	36.870	6,489.120	
BOEING CO	156	215.970	33,691.320	
ROBERT HALF INTL INC	25	109.220	2,730.500	
BORGWARNER INC	76	45.820	3,482.320	
BOSTON BEER COMPANY INC- CL A	3	510.270	1,530.810	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	391	44.130	17,254.830	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	30	97.560	2,926.800	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	36	172.040	6,193.440	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	7	1,430.450	10,013.150	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	639	57.590	36,800.010	
ONEOK INC	136	65.140	8,859.040	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24	133.980	3,215.520	
UNITED RENTALS INC	21	353.440	7,422.240	
SEMPRA ENERGY	88	129.440	11,390.720	
FEDEX CORP	75	229.320	17,199.000	
VERISIGN INC	26	215.590	5,605.340	
AMPHENOL CORP	174	77.830	13,542.420	
BROWN-FORMAN CORP	80	70.020	5,601.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	218	6.020	1,312.360	
CSX CORP	638	34.110	21,762.180	
COTERRA ENERGY INC	230	20.860	4,797.800	
CAMPBELL SOUP CO	55	40.820	2,245.100	
CONSTELLATION BRANDS INC	51	216.240	11,028.240	
CARDINAL HEALTH INC	96	48.630	4,668.480	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	204	22.340	4,557.360	
CATERPILLAR INC	155	201.140	31,176.700	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	33	121.780	4,018.740	
CITRIX SYSTEMS INC	42	100.320	4,213.440	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	303	12.280	3,720.840	
CERNER CORP	91	71.410	6,498.310	
JPMORGAN CHASE & CO	871	168.570	146,824.470	
CHURCH & DWIGHT CO INC	74	83.330	6,166.420	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	40	117.820	4,712.800	
CINTAS CORP	26	423.900	11,021.400	
CISCO SYSTEMS INC	1,214	55.740	67,668.360	
CLOROX COMPANY	37	158.990	5,882.630	
COCA-COLA CO/THE	1,185	54.150	64,167.750	
COPART INC	57	148.130	8,443.410	
COGNEX CORP	46	86.240	3,967.040	
COLGATE-PALMOLIVE CO	232	74.780	17,348.960	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	76	155.020	11,781.520	
MOLINA HEALTHCARE INC	15	281.920	4,228.800	
NRG ENERGY, INC.	79	40.630	3,209.770	
COMCAST CORP-CL A	1,315	54.240	71,325.600	
CONAGRA BRANDS INC	149	33.220	4,949.780	
CONSOLIDATED EDISON INC	103	73.730	7,594.190	
CMS ENERGY CORP	79	60.240	4,758.960	
COOPER COS INC	14	402.200	5,630.800	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	66	44.960	2,967.360	



CORNING INC	219	37.910	8,302.290	
SEALED AIR CORP	49	58.000	2,842.000	
HEICO CORP-CL A	14	121.950	1,707.300	
CUMMINS INC	43	240.120	10,325.160	
DR HORTON INC	100	88.290	8,829.000	
DANAHER CORP	185	308.480	57,068.800	
MOODY'S CORP	50	378.960	18,948.000	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	146	79.790	11,649.340	
TARGET CORP	141	252.190	35,558.790	
DEERE & CO	89	343.090	30,535.010	
MORGAN STANLEY	404	101.750	41,107.000	
REPUBLIC SERVICES INC	65	128.400	8,346.000	
COSTAR GROUP INC	116	96.520	11,196.320	
THE WALT DISNEY CO	526	171.180	90,040.680	
DOLLAR TREE INC	72	100.280	7,220.160	
DOVER CORP	43	167.910	7,220.130	
OMNICOM GROUP	67	76.470	5,123.490	
DTE ENERGY CO	52	114.470	5,952.440	
DUKE ENERGY CORP	221	101.130	22,349.730	
DARDEN RESTAURANTS INC	34	146.500	4,981.000	
EBAY INC	204	74.720	15,242.880	
BANK OF AMERICA CORP	2,212	46.480	102,813.760	
CITIGROUP INC	594	71.760	42,625.440	
EASTMAN CHEMICAL CO	38	107.240	4,075.120	
EATON CORP PLC	118	161.480	19,054.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	82	158.830	13,024.060	
DISH NETWORK CORP	70	44.190	3,093.300	
ECOLAB INC	72	219.530	15,806.160	
PERKINELMER INC	35	171.620	6,006.700	
ELECTRONIC ARTS INC	83	136.750	11,350.250	
SALESFORCE.COM INC	277	292.340	80,978.180	
ERIE INDEMNITY CO	6	196.810	1,180.860	
EMERSON ELECTRIC CO	178	96.420	17,162.760	
ATMOS ENERGY CORP	44	92.880	4,086.720	
ENTERGY CORP	56	102.060	5,715.360	
EOG RESOURCES INC	174	90.160	15,687.840	
EQUIFAX INC	34	273.180	9,288.120	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	66	312.430	20,620.380	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	55	118.740	6,530.700	
EXXON MOBIL CORP	1,210	63.500	76,835.000	
FMC CORP	28	92.180	2,581.040	
NEXTERA ENERGY INC	565	82.030	46,346.950	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12	422.350	5,068.200	
FAIR ISAAC CORP	7	415.450	2,908.150	
ASSURANT INC	17	163.410	2,777.970	
FASTENAL CO	168	56.260	9,451.680	
FIFTH THIRD BANCORP	198	43.930	8,698.140	

M&T BANK CORP	35	151.640	5,307.400	
FISERV INC	175	111.290	19,475.750	
FORD MOTOR CO	1,145	15.420	17,655.900	
FRANKLIN RESOURCES INC	101	29.930	3,022.930	
FREEMPORT-MCMORAN INC	401	38.850	15,578.850	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	58	161.970	9,394.260	
DENTSPLY SIRONA INC	63	57.550	3,625.650	
GENERAL DYNAMICS CORP	70	208.620	14,603.400	
GENERAL MILLS INC	178	61.690	10,980.820	
GENUINE PARTS CO	35	127.790	4,472.650	
GILEAD SCIENCES INC	370	66.900	24,753.000	
GARTNER INC	27	319.960	8,638.920	
MCKESSON CORP	44	202.590	8,913.960	
NVIDIA CORP	714	222.900	159,150.600	
GENERAL ELECTRIC CO	311	104.730	32,571.030	
VW GRAINGER INC	14	436.320	6,108.480	
HALLIBURTON CO	270	26.100	7,047.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	115	85.000	9,775.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	98	412.160	40,391.680	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	57	241.930	13,790.010	
HASBRO INC	39	93.290	3,638.310	
HENRY SCHEIN INC	38	76.960	2,924.480	
HEICO CORP	13	140.290	1,823.770	
HERSHEY FOODS CORP	45	179.700	8,086.500	
HP INC	382	28.860	11,024.520	
F5 NETWORKS INC	19	202.600	3,849.400	
CROWN HOLDINGS INC NPR	35	103.490	3,622.150	
JUNIPER NETWORKS INC	114	28.280	3,223.920	
HOLOGIC INC	71	70.930	5,036.030	
HOME DEPOT INC	305	357.990	109,186.950	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58	74.140	4,300.120	
HORMEL FOODS CORP	67	41.650	2,790.550	
CENTERPOINT ENERGY INC	182	26.160	4,761.120	
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	309.210	3,401.310	
HUMANA INC	36	441.500	15,894.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	25	191.270	4,781.750	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	381	16.340	6,225.540	
BIOGEN INC	40	268.130	10,725.200	
IDEX CORP	18	216.250	3,892.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	93	223.240	20,761.320	
INTUIT INC	78	572.800	44,678.400	
IDEXX LABORATORIES INC	25	640.990	16,024.750	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	66	175.570	11,587.620	
INTEL CORP	1,156	55.210	63,822.760	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	66	147.010	9,702.660	
INTERNATIONAL PAPER CO	105	52.060	5,466.300	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	96	38.260	3,672.960	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	33	133.820	4,416.060	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19	170.950	3,248.050	
INCYTE CORP	58	65.470	3,797.260	
JOHNSON & JOHNSON	758	163.870	124,213.460	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	99	72.340	7,161.660	
KLA CORPORATION	46	332.140	15,278.440	
DEVON ENERGY CORP	174	40.300	7,012.200	
KELLOGG CO	68	61.500	4,182.000	
KEYCORP	263	23.200	6,101.600	
KIMBERLY-CLARK CORP	93	129.770	12,068.610	
BLACKROCK INC/NEW YORK	44	901.650	39,672.600	
KROGER CO	222	39.070	8,673.540	
LAM RESEARCH CORP	40	570.830	22,833.200	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	14	436.730	6,114.220	
PACKAGING CORP OF AMERICA	23	132.860	3,055.780	
AKAMAI TECHNOLOGIES	42	107.920	4,532.640	
PLUG POWER INC	170	33.440	5,684.800	
LENNAR CORP	84	99.860	8,388.240	
ELI LILLY & CO	233	242.310	56,458.230	
BATH & BODY WORKS INC	75	66.100	4,957.500	
LINCOLN NATIONAL CORP	41	73.940	3,031.540	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	207	193.790	40,114.530	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	91	155.620	14,161.420	
LOCKHEED MARTIN CORP	71	371.070	26,345.970	
LOEWS CORP	55	57.470	3,160.850	
LOWE'S COS INC	201	222.910	44,804.910	
DOMINION ENERGY INC	235	75.220	17,676.700	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	110	47.470	5,221.700	
MCCORMICK & CO INC	61	79.880	4,872.680	
MCDONALD'S CORPORATION	217	242.770	52,681.090	
S&P GLOBAL INC	69	451.090	31,125.210	
EVEREST RE GROUP LTD	14	276.640	3,872.960	
MARKEL CORPORATION	3	1,310.560	3,931.680	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	183	115.000	21,045.000	
MARSH & MCLENNAN COS	147	164.660	24,205.020	
MASCO CORP	62	59.850	3,710.700	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	16	370.560	5,928.960	
METLIFE INC	213	65.690	13,991.970	
MEDTRONIC PLC	387	122.200	47,291.400	
ACTIVISION BLIZZARD INC	213	77.180	16,439.340	
CVS HEALTH CORP	380	84.890	32,258.200	
MERCK & CO. INC.	722	79.490	57,391.780	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	131	44.950	5,888.450	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	30	276.050	8,281.500	
MICROSOFT CORP	2,055	308.230	633,412.650	
MICRON TECH INC	330	67.570	22,298.100	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	164	74.850	12,275.400	
3M CO	164	182.310	29,898.840	
MOHAWK INDUSTRIES INC	17	185.770	3,158.090	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	16	412.520	6,600.320	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	50	245.130	12,256.500	
KANSAS CITY SOUTHERN	27	297.500	8,032.500	
ILLUMINA INC	43	414.080	17,805.440	
XCEL ENERGY INC	155	64.930	10,064.150	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	29	103.130	2,990.770	
NETAPP INC	60	90.810	5,448.600	
NEWELL BRANDS INC	133	22.830	3,036.390	
NEWMONT CORP	216	56.990	12,309.840	
NOVAVAX INC	22	160.550	3,532.100	
NVR INC	1	5,034.700	5,034.700	
NIKE INC-CL B	362	157.820	57,130.840	
NORDSON CORP	16	247.890	3,966.240	
NORFOLK SOUTHERN CORP	70	274.980	19,248.600	
EVERSOURCE ENERGY	99	86.160	8,529.840	
NISOURCE INC	84	24.640	2,069.760	
NORTHERN TRUST CORP	56	121.410	6,798.960	
NORTHROP GRUMMAN CORP	43	399.300	17,169.900	
WELLS FARGO & CO	1,182	50.340	59,501.880	
NUCOR CORP	89	103.300	9,193.700	
CHENIERE ENERGY INC	73	108.290	7,905.170	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	127	169.790	21,563.330	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	248	32.940	8,169.120	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	29	308.030	8,932.870	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	20	638.240	12,764.800	
ORACLE CORP	537	97.060	52,121.220	
PACCAR INC	97	86.500	8,390.500	
PTC INC	27	129.010	3,483.270	

EXELON CORP	295	50.320	14,844.400	
PARKER HANNIFIN CORP	38	296.240	11,257.120	
PAYCHEX INC	97	121.810	11,815.570	
ALIGN TECHNOLOGY INC	22	594.270	13,073.940	
PPL CORPORATION	227	28.890	6,558.030	
PEPSICO INC	401	160.100	64,200.100	
PENTAIR PLC	48	72.660	3,487.680	
PFIZER INC	1,609	42.090	67,722.810	
ESSENTIAL UTILITIES INC	50	47.070	2,353.500	
CONOCOPHILLIPS	391	75.320	29,450.120	
PG&E CORP	392	11.180	4,382.560	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	64	190.890	12,216.960	
ALTRIA GROUP INC	533	47.900	25,530.700	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	124	206.830	25,646.920	
BROWN & BROWN INC	73	64.090	4,678.570	
GARMIN LTD	49	159.530	7,816.970	
PPG INDUSTRIES INC	71	158.940	11,284.740	
IPG PHOTONICS CORP	12	164.140	1,969.680	
COSTCO WHOLESALE CORP	128	467.080	59,786.240	
T ROWE PRICE GROUP INC	62	202.700	12,567.400	
QUEST DIAGNOSTICS	36	145.710	5,245.560	
PROCTER & GAMBLE CO	708	140.660	99,587.280	
PROGRESSIVE CORP	165	92.620	15,282.300	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	151	62.450	9,429.950	
PULTE GROUP INC	65	49.230	3,199.950	
GLOBAL PAYMENTS INC	87	160.990	14,006.130	
QUALCOMM INC	322	132.500	42,665.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	61	100.370	6,122.570	
EXACT SCIENCES CORP	54	96.520	5,212.080	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	9	146.510	1,318.590	
REGENERON PHARMACEUTICALS	31	552.110	17,115.410	
RESMED INC	43	260.160	11,186.880	
US BANCORP	401	61.350	24,601.350	
SEAGEN INC	42	174.190	7,315.980	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	100	42.070	4,207.000	
ROSS STORES INC	95	108.660	10,322.700	
ROLLINS INC	68	38.320	2,605.760	
ROPER TECHNOLOGIES INC	30	474.130	14,223.900	
ROCKWELL AUTOMATION INC	34	316.140	10,748.760	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	71	84.470	5,997.370	
RPM INTERNATIONAL INC	29	83.940	2,434.260	
ACCENTURE PLC-CL A	184	349.740	64,352.160	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	407	59.790	24,334.530	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	35	248.100	8,683.500	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	72	155.390	11,188.080	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	182	124.050	22,577.100	
BOOKING HOLDINGS INC	12	2,463.100	29,557.200	
SCHLUMBERGER LTD	391	34.540	13,505.140	
SCHWAB (CHARLES) CORP	410	81.540	33,431.400	
POOL CORP	13	464.510	6,038.630	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	60	148.920	8,935.200	
BUNGE LTD	45	86.470	3,891.150	
SEI INVESTMENTS CO	33	62.470	2,061.510	
ANTHEM INC	70	393.750	27,562.500	
AMERISOURCEBERGEN CORP	42	119.840	5,033.280	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	66	69.030	4,555.980	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	72	298.280	21,476.160	
CENTENE CORP	172	64.710	11,130.120	
SVB FINANCIAL GROUP	16	699.920	11,198.720	
SMITH (A.O.) CORP	26	65.510	1,703.260	
SNAP-ON INC	15	225.290	3,379.350	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	113	111.920	12,646.960	
ADVANCE AUTO PARTS	22	224.140	4,931.080	
EDISON INTERNATIONAL	100	57.520	5,752.000	
SOUTHERN CO	314	62.970	19,772.580	
TRUIST FINANCIAL CORP	390	62.570	24,402.300	
SOUTHWEST AIRLINES	52	49.380	2,567.760	
AT&T INC	2,058	25.590	52,664.220	
CHEVRON CORP	556	111.700	62,105.200	
STANLEY BLACK & DECKER INC	48	184.320	8,847.360	
STATE STREET CORP	99	97.060	9,608.940	
STARBUCKS CORP	339	113.490	38,473.110	
STEEL DYNAMICS INC	67	63.500	4,254.500	
STRYKER CORP	96	270.860	26,002.560	
NETFLIX INC	127	639.000	81,153.000	
NORTONLIFELOCK INC	184	25.820	4,750.880	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	58	50.750	2,943.500	
SYNOPSIS INC	41	311.000	12,751.000	
SYSCO CORP	155	81.340	12,607.700	
INTUITIVE SURGICAL INC	100	336.300	33,630.000	
TELEFLEX INC	12	367.820	4,413.840	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	357	10.070	3,594.990	

TERADYNE INC	43	116.720	5,018.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	266	198.230	52,729.180	
TEXTRON INC	67	73.340	4,913.780	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	113	592.100	66,907.300	
GLOBE LIFE INC	31	97.480	3,021.880	
DAVITA INC	16	112.900	1,806.400	
TRACTOR SUPPLY CO	30	203.530	6,105.900	
BIO-TECHNE CORP	10	499.620	4,996.200	
TRIMBLE INC	66	87.040	5,744.640	
TYLER TECHNOLOGIES INC	11	506.070	5,566.770	
TYSON FOODS INC	91	80.100	7,289.100	
UGI CORP	76	44.660	3,394.160	
UNION PACIFIC CORP	189	225.760	42,668.640	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	433	91.230	39,502.590	
UNITEDHEALTH GROUP INC	272	424.380	115,431.360	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	18	132.240	2,380.320	
VF CORP	96	73.510	7,056.960	
VIACOMCBS INC	179	39.070	6,993.530	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	74	185.410	13,720.340	
VULCAN MATERIALS CO	39	179.870	7,014.930	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	219	48.010	10,514.190	
WALMART INC	446	144.690	64,531.740	
WASTE MANAGEMENT INC	123	158.840	19,537.320	
WATERS CORP	19	349.540	6,641.260	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	20	417.570	8,351.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	26	120.940	3,144.440	
VAIL RESORTS INC	12	350.120	4,201.440	
WESTERN DIGITAL CORP	78	55.650	4,340.700	
WABTEC CORP	43	91.910	3,952.130	
WHIRLPOOL CORP	21	205.640	4,318.440	
SKYWORX SOLUTIONS INC	49	164.750	8,072.750	
WYNN RESORTS LTD	34	91.620	3,115.080	
NASDAQ INC	35	208.860	7,310.100	
CME GROUP INC	105	217.560	22,843.800	
WILLIAMS COS INC	371	29.000	10,759.000	
LKQ CORP	92	55.110	5,070.120	
ALLIANT ENERGY CORP	57	55.670	3,173.190	
WEC ENERGY GROUP INC	88	89.860	7,907.680	
CARMAX INC	48	138.500	6,648.000	
XILINX INC	70	170.240	11,916.800	
TJX COMPANIES INC	357	63.900	22,812.300	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	15	528.630	7,929.450	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	343	5.070	1,739.010	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	100	57.000	5,700.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	30	206.590	6,197.700	
CBRE GROUP INC	100	101.940	10,194.000	
LIBERTY GLOBAL PLC	59	29.700	1,752.300	
REGIONS FINANCIAL CORP	254	22.820	5,796.280	
DOMINO'S PIZZA INC	10	465.370	4,653.700	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	11	496.070	5,456.770	
T-MOBILE US INC	176	118.560	20,866.560	
LAS VEGAS SANDS CORP	88	40.300	3,546.400	
MOSAIC CO/THE	82	41.820	3,429.240	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	9	411.190	3,700.710	
CELANESE CORP	30	164.610	4,938.300	
DEXCOM INC	27	550.050	14,851.350	
DISCOVERY INC-A	43	24.900	1,070.700	
EXPEDIA GROUP INC	43	166.200	7,146.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	69	60.560	4,178.640	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	32	293.180	9,381.760	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	90	29.800	2,682.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	167	130.910	21,861.970	
LIVE NATION	45	100.010	4,500.450	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	8	1,841.140	14,729.120	
TRANSDIGM GROUP INC	16	647.040	10,352.640	
MASTERCARD INC	252	362.100	91,249.200	
WESTERN UNION CO	133	20.170	2,682.610	
OWENS CORNING	36	90.060	3,242.160	
LEIDOS HOLDINGS INC	43	99.690	4,286.670	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	80	11.640	931.200	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	36	180.930	6,513.480	
DELTA AIR LINES INC	27	40.450	1,092.150	
INSULET CORP	20	299.930	5,998.600	
DISCOVER FINANCIAL	84	131.170	11,018.280	
TE CONNECTIVITY LTD	99	147.010	14,553.990	
MASIMO CORP	15	280.990	4,214.850	
LULULEMON ATHLETICA INC	34	416.640	14,165.760	
VMWARE INC	29	161.810	4,692.490	
MERCADOLIBRE INC	13	1,591.260	20,686.380	
ULTA BEAUTY INC	16	363.350	5,813.600	
INVESCO LTD	75	25.000	1,875.000	



MSCI INC	23	630.960	14,512.080	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	451	95.790	43,201.290	
VISA INC	484	233.520	113,023.680	
KEURIG DR PEPPER INC	195	34.750	6,776.250	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	53	172.650	9,150.450	
DISCOVERY INC-C	71	24.200	1,718.200	
MARATHON PETROLEUM CORP	197	66.830	13,165.510	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	42	96.590	4,056.780	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	552	18.450	10,184.400	
XYLEM INC	58	125.510	7,279.580	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	70	98.610	6,902.700	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	14	209.420	2,931.880	
SPLUNK INC	47	165.590	7,782.730	
EPAM SYSTEMS INC	17	634.160	10,780.720	
ZILLOW GROUP INC	26	88.860	2,310.360	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	60	73.180	4,390.800	
HCA HEALTHCARE INC	77	248.680	19,148.360	
VERISK ANALYTICS INC	44	212.050	9,330.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	144.000	2,304.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	23	275.410	6,334.430	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	53	211.120	11,189.360	
NXP SEMICONDUCTOR NV	82	196.950	16,149.900	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	46	80.970	3,724.620	
LEAR CORP	13	172.640	2,244.320	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	37	125.880	4,657.560	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	74	73.410	5,432.340	
DOLLAR GENERAL CORP	65	213.790	13,896.350	
FORTINET INC	42	332.120	13,949.040	
HORIZON PHARMA PLC	65	112.880	7,337.200	
TESLA INC	235	864.270	203,103.450	
GENERAC HOLDINGS INC	19	462.840	8,793.960	
ENPHASE ENERGY INC	38	187.060	7,108.280	
GENERAL MOTORS CO	386	56.850	21,944.100	
ALLY FINANCIAL INC	119	54.660	6,504.540	
VOYA FINANCIAL INC	35	69.490	2,432.150	
APTIV PLC	80	166.580	13,326.400	
PHILLIPS 66	121	82.780	10,016.380	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	17	121.440	2,064.480	

FACEBOOK INC	688	339.990	233,913.120	
IQVIA HOLDINGS INC	54	249.020	13,447.080	
SERVICENOW INC	56	680.250	38,094.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	29	512.490	14,862.210	
WORKDAY INC	55	277.270	15,249.850	
ABBVIE INC	505	107.450	54,262.250	
ZOETIS INC	135	204.440	27,599.400	
NEWS CORP/NEW-CL A	90	23.700	2,133.000	
CDW CORP	44	187.630	8,255.720	
HOWMET AEROSPACE INC	117	30.880	3,612.960	
TWILIO INC	45	365.030	16,426.350	
COUPA SOFTWARE INC	20	255.940	5,118.800	
SNAP INC	283	76.430	21,629.690	
TRADE DESK INC A	115	81.410	9,362.150	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	59	54.390	3,209.010	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	9	48.380	435.420	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	55	48.370	2,660.350	
OKTA INC	33	257.710	8,504.430	
BLACK KNIGHT INC	50	71.900	3,595.000	
BAKER HUGHES CO	189	26.870	5,078.430	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	44	55.950	2,461.800	
ALTICE USA INC-A	36	17.260	621.360	
BROADCOM INC	118	510.390	60,226.020	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	23	243.610	5,603.030	
MONGODB INC	16	508.010	8,128.160	
BURLINGTON STORES INC	20	272.710	5,454.200	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	107	32.640	3,492.480	
VEEVA SYSTEMS INC	41	319.240	13,088.840	
TWITTER INC	223	66.110	14,742.530	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	49	57.000	2,793.000	
EVERGY INC	74	63.640	4,709.360	
ALLEGION PLC	20	134.720	2,694.400	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	45	124.710	5,611.950	
STERIS PLC	28	227.030	6,356.840	
DOCUSIGN INC	58	272.890	15,827.620	
WIX.COM LTD	14	196.270	2,747.780	
DROPBOX INC	115	30.220	3,475.300	
KKR & CO INC	149	68.510	10,207.990	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	16	66.500	1,064.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	63	276.400	17,413.200	
MODERNA INC	97	333.610	32,360.170	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	80	140.950	11,276.000	
ARAMARK	70	36.490	2,554.300	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	150	40.800	6,120.000	

CIGNA CORP	96	206.630	19,836.480	
DELL TECHNOLOGIES INC	79	110.810	8,753.990	
DOW INC	225	59.190	13,317.750	
AMCOR PLC	431	12.020	5,180.620	
PINTEREST INC	158	55.580	8,781.640	
PELTON INTERACTIVE INC	73	88.190	6,437.870	
FOX CORP-A	100	43.030	4,303.000	
FOX CORP-B	64	39.930	2,555.520	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	105	21.870	2,296.350	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	52	282.350	14,682.200	
CHEWY INC	26	66.340	1,724.840	
AVANTOR INC	166	38.230	6,346.180	
LYFT INC	78	50.040	3,903.120	
DYNATRACE INC	62	76.980	4,772.760	
CLOUDFLARE INC	65	172.890	11,237.850	
TRADEWEB MARKETS INC	39	84.130	3,281.070	
CARRIER GLOBAL CORP	248	53.970	13,384.560	
OTIS WORLDWIDE CORP	113	84.420	9,539.460	
UBER TECHNOLOGIES INC	360	47.050	16,938.000	
CORTEVA INC	213	43.630	9,293.190	
MATCH GROUP INC	75	160.690	12,051.750	
BLACKSTONE INC	196	126.790	24,850.840	
CARLYLE GROUP INC	43	53.010	2,279.430	
10X GENOMICS INC	22	160.740	3,536.280	
DATADOG INC	50	157.940	7,897.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	61	81.120	4,948.320	
INGERSOLL RAND INC	105	53.570	5,624.850	
PAYCOM SOFTWARE INC	15	518.690	7,780.350	
PPD INC	35	47.030	1,646.050	
UNITY SOFTWARE INC	15	147.710	2,215.650	
AON PLC	67	309.520	20,737.840	
BENTLEY SYSTEMS INC	54	57.890	3,126.060	
IAC/INTERACTIVECORP	17	148.380	2,522.460	
AIRBNB INC	35	170.740	5,975.900	
ZENDESK INC	38	128.010	4,864.380	
ROYALTY PHARMA PLC	57	37.700	2,148.900	
VIATRIS INC	354	13.570	4,803.780	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	65	113.930	7,405.450	
DRAFTKINGS INC	88	48.840	4,297.920	
SNOWFLAKE INC	54	339.740	18,345.960	
DOORDASH INC	21	213.330	4,479.930	
OAK STREET HEALTH INC	30	42.210	1,266.300	
ARISTA NETWORKS INC	16	389.640	6,234.240	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	467	24.690	11,530.230	
IHS MARKIT LTD	108	125.860	13,592.880	
FNF GROUP	89	49.340	4,391.260	

MARVELL TECHNOLOGY INC	228	67.850	15,469.800	
CATALENT INC	50	133.220	6,661.000	
SYNCHRONY FINANCIAL	176	52.360	9,215.360	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	111	49.100	5,450.100	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	181.970	1,455.760	
WAYFAIR INC	21	249.030	5,229.630	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	50	174.720	8,736.000	
HUBSPOT INC	13	790.950	10,282.350	
QORVO INC	35	168.760	5,906.600	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	4	170.010	680.040	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	48	172.510	8,280.480	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	17	317.220	5,392.740	
GODADDY INC	39	69.670	2,717.130	
ETSY INC	37	226.410	8,377.170	
TRANSUNION	54	117.290	6,333.660	
SQUARE INC	110	254.410	27,985.100	
DUPONT DE NEMOURS INC	154	72.240	11,124.960	
CARVANA CO	21	290.850	6,107.850	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	65	53.450	3,474.250	
TELADOC HEALTH INC	42	139.760	5,869.920	
WESTROCK CO	83	48.200	4,000.600	
KRAFT HEINZ CO	194	36.810	7,141.140	
NOVOCURE LTD	28	117.360	3,286.080	
FORTIVE CORP	85	73.850	6,277.250	
WASTE CONNECTIONS INC	77	130.290	10,032.330	
ALPHABET INC-CL A	86	2,864.740	246,367.640	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	337	15.370	5,179.690	
PAYPAL HOLDINGS INC	318	271.700	86,400.600	
SEA LTD ADR	20	366.990	7,339.800	
EQUITABLE HOLDINGS INC	94	32.960	3,098.240	
SUNRUN INC	55	51.620	2,839.100	
ZILLOW GROUP INC-C	52	87.590	4,554.680	
ALPHABET INC-CL C	84	2,876.440	241,620.960	
ZSCALER INC	26	298.030	7,748.780	
CABLE ONE INC	1	1,771.990	1,771.990	
LINDE PLC	150	310.680	46,602.000	
ATHENE HOLDING LTD	44	82.170	3,615.480	
ROKU INC	35	344.450	12,055.750	
AVALARA INC	27	177.720	4,798.440	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	38	717.910	27,280.580	
VISTRA CORP	161	19.210	3,092.810	

アメリカ・ドル	小計	90,501		11,556,929.490 (1,325,348,674)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	144	14.760	2,125.440	
	ASHTED GROUP	124	59.300	7,353.200	
	SEVERN TRENT PLC	53	26.260	1,391.780	
	BHP GROUP PLC	612	20.085	12,292.020	
	BARCLAYS PLC	4,637	1.995	9,250.810	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	208	6.800	1,414.400	
	BT GROUP PLC	2,716	1.370	3,720.920	
	BUNZL PLC	94	25.140	2,363.160	
	AVIVA PLC	1,035	3.974	4,113.090	
	CRODA INTERNATIONAL	44	88.320	3,886.080	
	DIAGEO PLC	677	36.065	24,416.000	
	SCHRODERS PLC	39	35.560	1,386.840	
	DCC PLC	34	60.140	2,044.760	
	NATIONAL GRID PLC	1,071	9.038	9,679.690	
	KINGFISHER PLC	697	3.304	2,302.880	
	BAE SYSTEMS PLC	863	5.926	5,114.130	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	641	25.800	16,537.800	
	HALMA PLC	115	28.640	3,293.600	
	NEXT PLC	39	80.680	3,146.520	
	IMPERIAL BRANDS PLC	255	15.580	3,972.900	
	JOHNSON MATTHEY PLC	52	26.600	1,383.200	
	ANGLO AMERICAN PLC	379	28.395	10,761.700	
	COMPASS GROUP PLC	528	14.645	7,732.560	
	HSBC HOLDINGS PLC	5,996	4.321	25,908.710	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,632	2.762	4,507.580	
	UNILEVER PLC	752	37.870	28,478.240	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	706	2.851	2,012.800	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	165	9.862	1,627.230	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	76	17.900	1,360.400	
	PEARSON PLC	275	6.308	1,734.700	
PERSIMMON PLC	107	26.700	2,856.900		
PRUDENTIAL PLC	748	14.460	10,816.080		
RIO TINTO PLC	314	50.500	15,857.000		
VODAFONE GROUP PLC	8,478	1.094	9,274.930		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	194	53.910	10,458.540		
RELX PLC	554	22.020	12,199.080		
RENTOKIL INITIAL PLC	440	5.988	2,634.720		
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	2,163	1.394	3,015.220		
NATWEST GROUP PLC	1,586	2.336	3,704.890		
ST JAMES'S PLACE PLC	173	15.185	2,627.000		

SSE PLC	294	15.880	4,668.720	
BP PLC	5,893	3.619	21,326.760	
SAGE GROUP PLC(THE)	255	7.174	1,829.370	
SMITHS GROUP PLC	111	14.255	1,582.300	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	23	151.450	3,483.350	
STANDARD CHARTERED PLC	873	4.943	4,315.230	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	21,476	0.494	10,609.140	
TAYLOR WIMPLEY PLC	1,208	1.566	1,891.720	
TESCO PLC	2,147	2.742	5,887.070	
3I GROUP PLC	267	13.140	3,508.380	
SMITH & NEPHEW PLC	281	12.850	3,610.850	
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,423	14.072	20,024.450	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	91	80.620	7,336.420	
WPP PLC	398	9.918	3,947.360	
ASTRAZENECA PLC	443	87.390	38,713.770	
WHITBREAD PLC	63	32.900	2,072.700	
INTERTEK GROUP PLC	49	50.240	2,461.760	
BURBERRY GROUP PLC	139	18.300	2,543.700	
INTERCONTINENTAL HOTELS	44	50.580	2,225.520	
SAINSBURY (J) PLC	302	2.968	896.330	
ADMIRAL GROUP PLC	59	30.090	1,775.310	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	34	42.610	1,448.740	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,198	17.784	21,305.230	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,044	17.988	18,779.470	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	43	24.130	1,037.590	
AVEVA GROUP PLC	29	36.820	1,067.780	
ABRDN PLC	765	2.591	1,982.110	
EXPERIAN PLC	275	32.650	8,978.750	
MONDI PLC	125	17.745	2,218.120	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	117	15.460	1,808.820	
OCADO GROUP PLC	126	18.025	2,271.150	
INFORMA PLC	485	5.370	2,604.450	
GLENCORE PLC	2,777	3.807	10,572.030	
ENTAIN PLC	153	21.710	3,321.630	
EVRAZ PLC	114	6.326	721.160	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	372	2.856	1,062.430	
COCA-COLA HBC AG	72	24.930	1,794.960	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	130	6.770	880.100	
FERGUSON PLC	68	105.750	7,191.000	
M&G PLC	858	1.973	1,692.830	
JD SPORTS FASHION PLC	119	10.540	1,254.260	

	AUTO TRADER GROUP PLC	284	5.950	1,689.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	1,427	1.643	2,344.560	
イギリス・ポンド 小計		85,870		519,494.680 (82,178,863)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	407	30.230	12,303.610	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	429	29.050	12,462.450	
	ELBIT SYSTEMS LTD	8	472.100	3,776.800	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	204	18.670	3,808.680	
	ICL GROUP LTD	193	26.530	5,120.290	
	NICE LTD	21	881.100	18,503.100	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48	111.200	5,337.600	
	AZRIELI GROUP	17	300.000	5,100.000	
イスラエル・シュケル 小計		1,327		66,412.530 (2,368,497)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	65	66.750	4,338.750	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	895	28.150	25,194.250	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,061	25.480	27,034.280	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	483	14.560	7,032.480	
	TELSTRA CORP LTD	956	3.830	3,661.480	
	ASX LTD	70	80.370	5,625.900	
	BHP GROUP LTD	898	38.390	34,474.220	
	AMPOL LTD	49	30.820	1,510.180	
	COMPUTERSHARE LT	212	18.170	3,852.040	
	CSL LIMITED	138	296.180	40,872.840	
	REA GROUP LTD	17	154.510	2,626.670	
	TRANSURBAN GROUP	888	13.610	12,085.680	
	COCHLEAR LTD	22	219.290	4,824.380	
	ORIGIN ENERGY LTD	776	5.090	3,949.840	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	526	103.890	54,646.140	
	RIO TINTO LIMITED	115	98.150	11,287.250	
	APA GROUP	357	8.430	3,009.510	
	ARISTOCRAT LEISU	148	45.790	6,776.920	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	925	4.880	4,514.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	147	50.390	7,407.330	
	ORICA LTD	100	14.380	1,438.000	
	LEND LEASE CORP LTD	207	10.790	2,233.530	
	BLUESCOPE STEEL LTD	133	20.030	2,663.990	
SYDNEY AIRPORT	525	8.340	4,378.500		
MACQUARIE GROUP LTD	97	192.200	18,643.400		
SUNCORP GROUP LTD	321	12.330	3,957.930		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,029	28.650	29,480.850	
	NEWCREST MINING LTD	266	24.620	6,548.920	
	OIL SEARCH LTD	865	4.530	3,918.450	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	136	5.720	777.920	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	428	11.570	4,951.960	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	333	9.400	3,130.200	
	REECE LTD	101	18.120	1,830.120	
	SANTOS LTD	714	7.380	5,269.320	
	SONIC HEALTHCARE	137	39.080	5,353.960	
	TABCORP HOLDINGS LTD	433	5.090	2,203.970	
	WESFARMERS LTD	346	55.520	19,209.920	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	318	24.960	7,937.280	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	402	40.280	16,192.560	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	35	35.200	1,232.000	
	SEEK LTD	81	32.440	2,627.640	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	16	133.920	2,142.720	
	AUSNET SERVICES	648	2.480	1,607.040	
	AGL ENERGY LTD	269	6.110	1,643.590	
	BRAMBLES LTD	489	10.170	4,973.130	
	CROWN RESORTS LTD	93	9.460	879.780	
	EVOLUTION MINING LTD	688	3.720	2,559.360	
	AURIZON HOLDINGS LTD	267	3.890	1,038.630	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	186	11.730	2,181.780	
	XERO LTD	41	144.140	5,909.740	
	AFTERPAY LTD	71	124.300	8,825.300	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	402	6.710	2,697.420	
	MEDIBANK PVT LTD	807	3.470	2,800.290	
	SOUTH32 LTD(AUD)	1,072	3.880	4,159.360	
	COLES GROUP LTD	454	17.810	8,085.740	
	WISETECH GLOBAL LTD	39	53.310	2,079.090	
	オーストラリア・ドル 小計	21,297		460,287.530 (39,455,847)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	60	70.160	4,209.600	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	242	48.260	11,678.920	
	BARRICK GOLD CORP	494	23.860	11,786.840	
	ATCO LTD	31	40.530	1,256.430	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	79	20.600	1,627.400	
	BANK OF MONTREAL	192	133.370	25,607.040	
	BANK OF NOVA SCOTIA	361	80.980	29,233.780	
	NATIONAL BANK OF CANADA	96	102.230	9,814.080	



BCE INC	8	63.380	507.040	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	370	72.530	26,836.100	
BAUSCH HEALTH COS INC	71	35.210	2,499.910	
SAPUTO INC	99	31.250	3,093.750	
BLACKBERRY LTD	197	14.230	2,803.310	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	130	18.690	2,429.700	
CGI INC	57	113.650	6,478.050	
CCL INDUSTRIES INC	53	65.900	3,492.700	
CAE INC	67	37.470	2,510.490	
CAMECO CORP	126	32.940	4,150.440	
ROGERS COMM-CL B	96	60.390	5,797.440	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	132	147.970	19,532.040	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	343	52.840	18,124.120	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	18	185.650	3,341.700	
CANADIAN UTILITIES LTD	12	34.750	417.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	202	153.520	31,011.040	
YAMANA GOLD INC	384	5.320	2,042.880	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	53	45.930	2,434.290	
OPEN TEXT CORP	77	62.100	4,781.700	
EMPIRE CO LTD	48	37.690	1,809.120	
KINROSS GOLD CORP	311	7.550	2,348.050	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	33	84.100	2,775.300	
FORTIS INC	147	55.490	8,157.030	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	198	30.310	6,001.380	
TELUS CORP	88	27.840	2,449.920	
GREAT WEST LIFECO INC	70	37.320	2,612.400	
IMPERIAL OIL LTD	76	42.500	3,230.000	
ENBRIDGE INC	594	53.090	31,535.460	
IGM FINANCIAL INC	35	47.480	1,661.800	
MANULIFE FINANCIAL CORP	577	25.010	14,430.770	
LOBLAW CO LTD	45	92.040	4,141.800	
MAGNA INTERNATIONAL INC	73	102.590	7,489.070	
SUN LIFE FINANCIAL INC	168	69.190	11,623.920	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	520.760	4,686.840	
METRO INC	85	61.660	5,241.100	
EMERA INC	58	58.500	3,393.000	
ONEX CORP	13	94.680	1,230.840	
PAN AMERICAN SILVER CORP	73	31.300	2,284.900	
POWER CORP OF CANADA	164	42.420	6,956.880	
QUEBECOR INC-B	38	30.910	1,174.580	
ROYAL BANK OF CANADA	417	131.560	54,860.520	

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	195	90.820	17,709.900	
SHAW COMM INC-B	132	36.140	4,770.480	
SUNCOR ENERGY INC	408	28.680	11,701.440	
LUNDIN MINING CORP	208	10.830	2,252.640	
TECK RESOURCES LTD-CL B	114	35.990	4,102.860	
THOMSON REUTERS CORP	48	145.600	6,988.800	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	19	110.510	2,099.690	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	534	88.680	47,355.120	
TC ENERGY CORP	289	67.350	19,464.150	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	27	107.980	2,915.460	
WESTON (GEORGE) LTD	16	136.920	2,190.720	
INTACT FINANCIAL CORP	49	166.660	8,166.340	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	132	50.990	6,730.680	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	2,201.720	13,210.320	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	49	174.320	8,541.680	
B2GOLD CORP	413	5.110	2,110.430	
KEYERA CORP	42	32.200	1,352.400	
PARKLAND CORP	41	37.580	1,540.780	
ALTAGAS LTD	79	26.110	2,062.690	
PEMBINA PIPELINE CORP	180	42.070	7,572.600	
DOLLARAMA INC	101	57.600	5,817.600	
CENOVUS ENERGY INC W/I	418	14.330	5,989.940	
NORTHLAND POWER INC	57	40.350	2,299.950	
TMX GROUP LTD	17	133.300	2,266.100	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	85	56.340	4,788.900	
IVANHOE MINES LTD	210	10.100	2,121.000	
INTER PIPELINE LTD	67	19.970	1,337.990	
NUTRIEN LTD	161	88.780	14,293.580	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	29	120.190	3,485.510	
WSP GLOBAL INC	38	167.720	6,373.360	
IA FINANCIAL CORP INC	34	72.910	2,478.940	
GFL ENVIRONMENTAL INC	58	49.500	2,871.000	
NUVEI CORP	14	156.020	2,184.280	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	48	49.860	2,393.280	
AIR CANADA	21	23.150	486.150	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	80	75.540	6,043.200	
SHOPIFY INC	32	1,836.820	58,778.240	
FIRSTSERVICE CORP	9	243.930	2,195.370	
CANOPY GROWTH CORP	81	17.730	1,436.130	
HYDRO ONE LTD	74	30.080	2,225.920	
カナダ・ドル 小計	11,985		720,298.090 (66,850,866)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	600	3.890	2,334.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	500	31.220	15,610.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	200	7.390	1,478.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	300	9.650	2,895.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	2,300	0.800	1,840.000	
	KEPPEL CORP LTD	300	5.530	1,659.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,100	11.980	13,178.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,100	2.550	5,355.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	600	5.480	3,288.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	300	26.770	8,031.000	
	UOL GROUP LIMITED	300	7.310	2,193.000	
	VENTURE CORP LTD	100	19.330	1,933.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	500	4.420	2,210.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	1,000	3.430	3,430.000	
シンガポール・ドル 小計	10,200		65,434.000 (5,577,594)		
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	688	9.786	6,732.760	
	LOGITECH INTL-REG	55	83.220	4,577.100	
	NESTLE SA-REGISTERED	821	112.960	92,740.160	
	CIE FINANC RICHEMONT	152	109.000	16,568.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	200	357.950	71,590.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	13	255.800	3,325.400	
	SIKA INHABER	39	315.300	12,296.700	
	SGS SA-REG	2	2,788.000	5,576.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	628	76.690	48,161.320	
	BALOISE HOLDING AG -R	17	143.500	2,439.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	1	2,124.000	2,124.000	
	CLARIANT AG-REG	69	17.960	1,239.240	
	SWISSCOM AG-REG	8	539.400	4,315.200	
	ABB LTD	507	31.880	16,163.160	
	ADECCO GROUP AG-REG	44	47.350	2,083.400	
	GEBERIT AG	10	713.200	7,132.000	
	LONZA GROUP AG-REG	20	722.800	14,456.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	1	11,000.000	11,000.000	
	GIVAUDAN-REG	3	4,279.000	12,837.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	44	392.300	17,261.200	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	10	391.800	3,918.000	
	HOLCIM LTD	153	45.210	6,917.130	
	TEMENOS GROUP	21	121.550	2,552.550	
SONOVA HOLDING AG	16	364.200	5,827.200		
KUEHNE & NAGEL INTL AG	18	297.700	5,358.600		
STRAUMANN HOLDING AG	3	1,862.500	5,587.500		

	THE SWATCH GROUP AG-B	6	246.000	1,476.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	48.220	482.200	
	SCHINDLER NAMEN	6	249.000	1,494.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	10	486.400	4,864.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	7	70.500	493.500	
	VIFOR PHARMA AG	16	122.700	1,963.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING	2	913.500	1,827.000	
	SWISS PRIME SITE AG	22	94.400	2,076.800	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	6	1,542.500	9,255.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	62	65.000	4,030.000	
	SWISS RE LTD	78	82.080	6,402.240	
	ALCON INC	129	74.680	9,633.720	
	UBS GROUP AG	1,041	15.935	16,588.330	
スイス・フラン	小計	4,938		443,365.110 (55,026,044)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	192	558.000	107,136.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	120	474.000	56,880.000	
	ERICSSON LM-B SHS	858	102.240	87,721.920	
	LUNDBERGS B	9	493.400	4,440.600	
	SKF AB-B SHS	126	218.900	27,581.400	
	SANDVIK AB	292	218.200	63,714.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	491	130.600	64,124.600	
	SKANSKA AB-B SHS	112	224.400	25,132.800	
	SWEDBANK AB	230	185.840	42,743.200	
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	204	137.150	27,978.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	365	107.350	39,182.750	
	VOLVO AB-A SHS	47	204.400	9,606.800	
	VOLVO AB-B SHS	416	201.100	83,657.600	
	SWEDISH MATCH AB	413	78.700	32,503.100	
	TELE2 AB-B SHS	145	123.700	17,936.500	
	INDUSTRIVARDEN A	14	282.800	3,959.200	
	INDUSTRIVARDEN C	40	276.700	11,068.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	58	193.850	11,243.300	
	SECURITAS AB-B SHS	101	145.600	14,705.600	
	INVESTOR AB-B SHS	559	197.640	110,480.760	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	211	171.520	36,190.720	
	ASSA ABLOY AB-B	299	252.000	75,348.000	
	TELIA CO AB	640	36.275	23,216.000	
	LUNDIN ENERGY AB	48	349.300	16,766.400	
	BOLIDEN AB	92	327.700	30,148.400	
	ALFA LAVAL AB	107	336.900	36,048.300	
	KINNEVIK AB-B	83	315.750	26,207.250	
	FASTIGHETS AB BALDER	24	594.600	14,270.400	
	ICA GRUPPEN AB	38	404.100	15,355.800	

	HUSQVARNA AB-B SHS	141	107.650	15,178.650	
	NIBE INDUSTRIER AB	444	115.750	51,393.000	
	HEXAGON AB-B SHS	550	135.750	74,662.500	
	EPIROC AB-A	166	199.300	33,083.800	
	EPIROC AB-B	117	170.350	19,930.950	
	ESSITY AB-B	157	262.800	41,259.600	
	EQT AB	78	399.700	31,176.600	
	EMBRACER GROUP AB	154	82.500	12,705.000	
	ELECTROLUX AB	58	17.000	986.000	
	EVOLUTION AB	46	1,488.600	68,475.600	
	NORDEA BANK ABP	950	109.420	103,949.000	
	INVESTMENT AB LATOUR	23	295.000	6,785.000	
	SINCH AB	140	169.700	23,758.000	
スウェーデン・クローナ 小計		9,358		1,598,692.100 (21,246,618)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	30	1,056.500	31,695.000	
	A P MOLLER A/S	2	17,475.000	34,950.000	
	AP MOLLER MAERSK A	1	16,530.000	16,530.000	
	DANSKE BANK A/S	238	114.950	27,358.100	
	GENMAB A/S	19	2,910.000	55,290.000	
	NOVOZYMES-B SHS	67	447.200	29,962.400	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	2	2,894.000	5,788.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	484	670.000	324,280.000	
	GN STORE NORD A/S	38	416.200	15,815.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	291	252.100	73,361.100	
	COLOPLAST-B	31	1,050.500	32,565.500	
	DSV A/S	59	1,524.500	89,945.500	
	DEMANT A/S	33	291.000	9,603.000	
	TRYG A/S	84	152.300	12,793.200	
	PANDORA A/S	24	865.200	20,764.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	35	494.700	17,314.500	
	AMBU A/S B	75	184.750	13,856.250	
ORSTED A/S	54	890.000	48,060.000		
デンマーク・クローネ 小計		1,567		859,932.950 (15,418,598)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	512	7.790	3,988.480	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	101	14.700	1,484.700	
	A2 MILK CO LTD	80	7.230	578.400	
	FISHER & PAYKEL	206	30.570	6,297.420	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	789	4.600	3,629.400	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	87	6.150	535.050	
	MERIDIAN ENERGY LTD	456	4.870	2,220.720	
ニュージーランド・ドル 小計		2,231		18,734.170 (1,537,513)	

ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	140	233.600	32,704.000	
	NORSK HYDRO ASA	358	71.100	25,453.800	
	TELENOR ASA	162	138.100	22,372.200	
	SCHIBSTED ASA	9	448.600	4,037.400	
	ORKLA ASA	236	77.480	18,285.280	
	EQUINOR ASA	303	231.800	70,235.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	60	427.100	25,626.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	84	202.600	17,018.400	
	ADEVINTA ASA	72	150.100	10,807.200	
	DNB BANK ASA	291	210.600	61,284.600	
	SCHIBSTED ASA	29	395.000	11,455.000	
ノルウェー・クローネ 小計	1,744		299,279.280 (4,106,112)		
ユーロ	CRH PLC	234	41.080	9,612.720	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	46	170.450	7,840.700	
	KERRY GROUP PLC-A	44	114.000	5,016.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	39	92.460	3,605.940	
	UMICORE	47	50.600	2,378.200	
	AIR LIQUIDE	139	143.060	19,885.340	
	AIRBUS SE	175	112.320	19,656.000	
	AXA SA	554	23.935	13,259.990	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	170	27.760	4,719.200	
	ADIDAS AG	56	268.350	15,027.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	325	18.485	6,007.620	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.000	0.000	
	DASSAULT AVIATION SA	10	91.500	915.000	
	DANONE	185	55.610	10,287.850	
	SAFRAN SA	100	111.000	11,100.000	
	INTESA SANPAOLO	4,968	2.451	12,176.560	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	89	85.460	7,605.940	
	ACCOR SA	56	30.760	1,722.560	
	BOUYGUES	81	34.120	2,763.720	
	BNP PARIBAS	311	58.100	18,069.100	
	THALES SA	36	81.260	2,925.360	
	CAPGEMINI SA	49	189.500	9,285.500	
	UNICREDIT SPA	576	11.620	6,693.120	
	KONINKLIJKE DSM NV	51	182.250	9,294.750	
	COMMERZBANK AG	351	6.367	2,234.810	
	EIFFAGE	26	87.540	2,276.040	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	117	40.650	4,756.050	
	UNITED INTERNET	42	31.900	1,339.800	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	21	42.680	896.280	
PUBLICIS GROUPE	72	58.840	4,236.480		
FAURECIA	23	42.300	972.900		
IBERDROLA SA	1,750	9.646	16,880.500		

ENI SPA	727	12.172	8,849.040	
JERONIMO MARTINS	86	19.025	1,636.150	
KESKO OYJ-B	72	29.970	2,157.840	
KBC GROUPE	68	79.120	5,380.160	
HANNOVER RUECK SE	14	154.350	2,160.900	
WARTSILA OYJ	111	10.670	1,184.370	
L'OREAL	73	362.550	26,466.150	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	79	646.000	51,034.000	
GEA GROUP AG	52	40.560	2,109.120	
BOLLORE	224	5.210	1,167.040	
MEDIOBANCA SPA	225	10.190	2,292.750	
MICHELIN(CGDE) -B	51	132.450	6,754.950	
CONTINENTAL AG	25	97.460	2,436.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	293	53.740	15,745.820	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	79	20.590	1,626.610	
OMV AG	35	54.300	1,900.500	
VERBUND AG	22	92.400	2,032.800	
PERNOD-RICARD	59	195.500	11,534.500	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	46	86.400	3,974.400	
RENAULT SA	68	32.250	2,193.000	
REPSOL SA	386	11.522	4,447.490	
REMY COINTREAU	8	171.700	1,373.600	
MERCK KGAA	38	195.050	7,411.900	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	148	60.930	9,017.640	
RWE AG	183	32.280	5,907.240	
SEB SA	9	121.000	1,089.000	
SOCIETE GENERALE-A	211	28.700	6,055.700	
VINCI S.A.	145	90.690	13,150.050	
SODEXO	26	74.400	1,934.400	
SOFINA	6	374.200	2,245.200	
SOLVAY SA	18	106.050	1,908.900	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	159	142.900	22,721.100	
VIVENDI SE	221	11.255	2,487.350	
SAP SE	299	124.740	37,297.260	
TELEFONICA S.A	1,631	3.738	6,096.670	
TOTALENERGIES SE	704	44.830	31,560.320	
VALEO	78	24.560	1,915.680	
E.ON SE	625	10.688	6,680.000	
VOEST-ALPINE AG	26	32.520	845.520	
HENKEL AG & CO KGAA	31	71.350	2,211.850	
SIEMENS AG-REG	219	140.640	30,800.160	
UPM-KYMMENE OYJ	138	31.030	4,282.140	
ING GROEP NV-CVA	1,100	12.994	14,293.400	
PUMA AG	29	100.700	2,920.300	
BAYER AG	268	47.280	12,671.040	

STORA ENSO OYJ-R SHS	169	14.610	2,469.090	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	45	76.720	3,452.400	
DAIMLER AG	250	82.370	20,592.500	
BASF SE	266	63.740	16,954.840	
BEIERSDORF AG	34	93.200	3,168.800	
HEIDELBERGCEMENT AG	37	64.380	2,382.060	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	58	60.900	3,532.200	
ASM INTERNATIONAL NV	15	336.700	5,050.500	
ORANGE	527	9.435	4,972.240	
SAMPO OYJ-A SHS	140	45.660	6,392.400	
RANDSTAD NV	32	59.340	1,898.880	
ALLIANZ SE	115	199.080	22,894.200	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	767	4.773	3,660.890	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	308	27.605	8,502.340	
HERMES INTL	9	1,281.500	11,533.500	
ENDESA S.A.	123	19.000	2,337.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	188	5.759	1,082.690	
ERSTE GROUP BANK AG	95	38.720	3,678.400	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	42	249.400	10,474.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	226	27.770	6,276.020	
DASSAULT SYSTEMES SA	200	46.565	9,313.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	46	22.600	1,039.600	
HEINEKEN NV	72	90.740	6,533.280	
AKZO NOBEL	57	95.700	5,454.900	
ASML HOLDING NV	121	683.000	82,643.000	
AEGON NV	607	4.469	2,712.680	
VOLKSWAGEN AG	11	266.200	2,928.200	
VOLKSWAGEN AG PFD	50	190.000	9,500.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,847	5.776	10,668.270	
KERING	22	650.400	14,308.800	
CNP ASSURANCES	20	14.495	289.900	
FORTUM OYJ	149	26.410	3,935.090	
AGEAS	50	41.170	2,058.500	
UCB SA	35	99.240	3,473.400	
NEMETSCHEK SE	9	93.020	837.180	
CARREFOUR SA	136	15.000	2,040.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	107	22.440	2,401.080	
ATOS SE	29	44.650	1,294.850	
NOKIA OYJ	1,466	5.100	7,476.600	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	244	38.455	9,383.020	
WOLTERS KLUWER-CVA	74	91.980	6,806.520	
SANOFI	318	82.630	26,276.340	
STMICROELECTRONICS NV	198	37.050	7,335.900	



ELISA OYJ	49	53.840	2,638.160	
BANCO SANTANDER SA	4,805	3.361	16,149.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	134	17.615	2,360.410	
QIAGEN N.V.	53	45.100	2,390.300	
DEUTSCHE BANK AG-REG	590	11.400	6,726.000	
BMW VORZUG	19	71.600	1,360.400	
ENEL SPA	2,309	7.081	16,350.020	
COLRUYT NV	6	41.830	250.980	
VOPAK (KON.)	1	36.030	36.030	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	949	16.394	15,557.900	
SARTORIUS AG	8	536.000	4,288.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	27	46.170	1,246.590	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	356	37.860	13,478.160	
RATIONAL AG	1	835.400	835.400	
CARL ZEISS MEDITEC AG	12	168.700	2,024.400	
BECHTLE AG	21	59.500	1,249.500	
KONINKLIJKE KPN NV	888	2.710	2,406.480	
EUROFINS SCIENTIFIC	38	111.260	4,227.880	
TELEPERFORMANCE	18	354.600	6,382.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	58	149.750	8,685.500	
EURAZEO	11	82.000	902.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	27	99.020	2,673.540	
HEINEKEN HOLDING NV-A	31	76.100	2,359.100	
INDITEX	310	31.740	9,839.400	
ESSILORLUXOTTICA	82	167.960	13,772.720	
SNAM SPA	513	4.778	2,451.110	
CREDIT AGRICOLE SA	292	12.822	3,744.020	
ORPEA	19	89.120	1,693.280	
ENAGAS	61	19.430	1,185.230	
WENDEL	13	118.900	1,545.700	
TENARIS SA	163	9.942	1,620.540	
TELECOM ITALIA SPA	1,698	0.329	558.640	
TELECOM ITALIA-RNC	3,436	0.340	1,168.240	
ATLANTIA SPA	119	16.010	1,905.190	
PROXIMUS	39	17.080	666.120	
TERNA SPA	397	6.282	2,493.950	
BIOMERIEUX	17	102.850	1,748.450	
GRIFOLS SA	92	19.895	1,830.340	
FERROVIAL SA	135	26.580	3,588.300	
LANXESS AG	26	58.400	1,518.400	
NESTE OYJ	134	49.710	6,661.140	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	13	24.560	319.280	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	33	51.400	1,696.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	202	12.795	2,584.590	

MTU AERO ENGINES HOLDING AG	18	185.600	3,340.800	
KONE OYJ	98	59.400	5,821.200	
ELIA GROUP	4	106.000	424.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	8	471.300	3,770.400	
ENGIE	468	11.818	5,530.820	
ALSTOM	87	31.670	2,755.290	
ELECTRICITE DE FRANCE	75	12.825	961.870	
IPSEN SA	3	86.240	258.720	
DEUTSCHE WOHNEN	92	52.960	4,872.320	
ARKEMA SA	14	114.750	1,606.500	
LEGRAND SA	81	93.880	7,604.280	
AMPLIFON SPA	27	42.000	1,134.000	
ADP	10	116.700	1,167.000	
ORION OYJ	46	36.480	1,678.080	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	66	9.914	654.320	
SYMRISE AG	41	114.450	4,692.450	
SCOR SE	17	24.380	414.460	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	85	43.030	3,657.550	
PRYSMIAN SPA	62	31.760	1,969.120	
DIASORIN SPA	11	181.500	1,996.500	
CAIXABANK	1,237	2.643	3,269.390	
BUREAU VERITAS SA	95	27.200	2,584.000	
GETLINK	123	13.540	1,665.420	
EDP RENOVAVEIS SA	78	22.280	1,737.840	
SUEZ SA	102	19.735	2,012.970	
AMADEUS IT GROUP SA	122	59.820	7,298.040	
BRENTAG SE	39	82.280	3,208.920	
EVONIK INDUSTRIES AG	66	28.260	1,865.160	
EDENRED	76	49.200	3,739.200	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	239	2.314	553.040	
LEG IMMOBILIEN SE	24	132.500	3,180.000	
KION GROUP AG	28	87.000	2,436.000	
VONOVIA SE	153	54.360	8,317.080	
KNORR-BREMSE AG	22	93.500	2,057.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	85	57.900	4,921.500	
FERRARI NV	34	193.400	6,575.600	
CNH INDUSTRIAL NV	269	14.455	3,888.390	
AROUNDTOWN SA	287	6.100	1,750.700	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	25	43.460	1,086.500	
MONCLER SPA	60	58.560	3,513.600	
NEXI SPA	160	17.110	2,737.600	
TEAMVIEWER AG	62	13.390	830.180	
PROSUS NV	259	76.200	19,735.800	
JDE PEET'S BV	9	24.960	224.640	
SIEMENS ENERGY AG	92	23.990	2,207.080	

	INPOST SA	49	12.900	632.100	
	WORLDLINE SA	70	68.620	4,803.400	
	NN GROUP NV	69	45.820	3,161.580	
	FINECOBANK SPA	147	16.390	2,409.330	
	ARGENX SE	15	256.100	3,841.500	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	221	24.820	5,485.220	
	ZALANDO SE	68	79.720	5,420.960	
	STELLANTIS NV	617	16.778	10,352.020	
	AENA SME SA	25	144.150	3,603.750	
	CELLNEX TELECOM SAU	134	53.540	7,174.360	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	60	71.350	4,281.000	
	ABN AMRO BANK NV	70	12.604	882.280	
	EXOR NV	29	74.280	2,154.120	
	SCOUT24 AG	32	61.720	1,975.040	
	COVESTRO AG	66	56.140	3,705.240	
	HELLOFRESH SE	52	80.860	4,204.720	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	220	47.715	10,497.300	
	POSTE ITALIANE SPA	150	12.250	1,837.500	
	AMUNDI SA	10	76.650	766.500	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	59	9.734	574.300	
	ADYEN NV	6	2,691.500	16,149.000	
	UNIPER SE	15	37.380	560.700	
	DELIVERY HERO SE	49	115.650	5,666.850	
ユーロ	小計	71,301		1,400,432.090 (186,845,649)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	864	18.020	15,569.280	
	CLP HOLDINGS LTD	235	75.000	17,625.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	43.750	21,875.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	366	482.800	176,704.800	
	MTR CORP	903	42.350	38,242.050	
	HANG SENG BANK LTD	200	145.800	29,160.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	86	32.000	2,752.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	567	45.600	25,855.200	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,515	11.660	29,324.900	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	41.200	22,124.400	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,184	25.150	29,777.600	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	890	33.300	29,637.000	
	SINO LAND CO	576	10.860	6,255.360	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	102.000	51,000.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	273	161.200	44,007.600	
	SJM HOLDINGS LTD	1,000	5.660	5,660.000	

WYNN MACAU LTD	699	7.020	4,906.980	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	600	17.940	10,764.000	
AIA GROUP LTD	3,751	89.450	335,526.950	
HKT TRUST / HKT LTD	1,080	10.660	11,512.800	
SANDS CHINA LTD	974	17.120	16,674.880	
SWIRE PROPERTIES LTD	432	21.100	9,115.200	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,000	41.950	41,950.000	
ESR CAYMAN LTD	600	23.800	14,280.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	1,000	7.660	7,660.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	500	19.620	9,810.000	
WH GROUP LTD	3,000	5.260	15,780.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,034	53.300	55,112.200	
CK ASSET HOLDINGS LTD	534	46.650	24,911.100	
香港・ドル 小計	26,400		1,103,574.300 (16,277,721)	
合計	338,719		1,822,238,596 (1,822,238,596)	

## (2) 株式以外の有価証券

2021年10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	スイス・フラン	CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23	456.000	273.600	
	スイス・フラン	小計	456.000	273.600 (33,956)	
新株予約権証券 合計			456	33,956 (33,956)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	393.000	4,212.960	
		GOODMAN GROUP	479.000	10,365.560	
		GPT GROUP	525.000	2,688.000	
		MIRVAC GROUP	1,078.000	3,104.640	
		SCENTRE GROUP	1,683.000	5,065.830	
		STOCKLAND	473.000	2,180.530	
		VICINITY CENTRES	700.000	1,253.000	
	オーストラリア・ドル	小計	5,331.000	28,870.520 (2,474,781)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,100.000	3,311.000		
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,479.000	3,150.270		
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	200.000	428.000		

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	500.000	995.000	
		シンガポール・ドル 小計	3,279.000	7,884.270 (672,055)	
投資信託受益証券 合計			8,610	3,146,836 (3,146,836)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	191.000	3,151.500	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	37.000	7,516.920	
		AMERICAN TOWER CORP	129.000	35,204.100	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	322.000	2,788.520	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	42.000	9,597.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	46.000	5,341.980	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	23.000	3,588.000	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	122.000	21,091.360	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	86.000	12,892.260	
		DUKE REALTY TRUST	122.000	6,564.820	
		EQUINIX INC	26.000	20,271.420	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	45.000	3,798.900	
		EQUITY RESIDENTIAL	108.000	9,072.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	18.000	5,941.440	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	36.000	6,604.560	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	139.000	4,787.160	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	223.000	3,697.340	
		INVITATION HOMES INC	160.000	6,430.400	
		IRON MOUNTAIN INC	83.000	3,730.850	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	198.000	4,068.900	
		MID AMERICA	36.000	7,099.560	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	68.000	2,138.600	
		PROLOGIS INC	211.000	29,354.320	
		PUBLIC STORAGE	47.000	15,087.000	
		REALTY INCOME CORP	112.000	7,844.480	
		REGENCY CENTERS CORP	38.000	2,641.380	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	29.000	9,633.220	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	100.000	14,284.000	
		SUN COMMUNITIES INC	31.000	6,091.500	
		UDR INC	90.000	4,854.600	
		VENTAS INC	113.000	6,316.700	
		VEREIT INC	52.000	2,558.920	
VICI PROPERTIES INC	141.000	4,246.920			
VORNADO REALTY TRUST	57.000	2,540.490			
WELLTOWER INC	126.000	10,592.820			

	WEYERHAEUSER CO	207.000	7,611.390	
	WP CAREY INC	53.000	4,059.800	
アメリカ・ドル	小計	3,667.000	313,095.130 (35,905,750)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	255.000	1,279.590	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	134.000	936.120	
	SEGRO PLC	384.000	4,947.840	
イギリス・ポンド	小計	773.000	7,163.550 (1,133,202)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	10.000	603.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1.000	22.630	
カナダ・ドル	小計	11.000	626.230 (58,120)	
ユーロ	COVIVIO	21.000	1,543.080	
	GECINA SA	18.000	2,166.300	
	KLEPIERRE	82.000	1,599.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	44.000	2,794.880	
ユーロ	小計	165.000	8,103.260 (1,081,137)	
香港・ドル	LINK REIT	607.000	41,518.800	
香港・ドル	小計	607.000	41,518.800 (612,402)	
投資証券	合計	5,223	38,790,611 (38,790,611)	
合計			41,971,403 (41,971,403)	

(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 598銘柄	63.85	-	-	-	73.02
	投資証券 37銘柄	-	-	-	1.73	
イギリス・ポンド	株式 83銘柄	3.96	-	-	-	4.47
	投資証券 3銘柄	-	-	-	0.05	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11	-	-	-	0.13
オーストラリア・ドル	株式 56銘柄	1.90	-	-	-	2.25
	投資信託受益証 券 7銘柄	-	-	0.12	-	

カナダ・ドル	株式	89銘柄	3.22	-	-	-	3.59
	投資証券	2銘柄	-	-	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.27	-	-	-	0.34
	投資信託受益証券	4銘柄	-	-	0.03	-	
スイス・フラン	株式	39銘柄	2.65	-	-	-	2.95
	新株予約権証券	1銘柄	-	0.00	-	-	
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	1.02	-	-	-	1.14
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.74	-	-	-	0.83
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.07	-	-	-	0.08
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.20	-	-	-	0.22
ユーロ	株式	233銘柄	9.00	-	-	-	10.08
	投資証券	4銘柄	-	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	29銘柄	0.78	-	-	-	0.91
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 海外国債マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2021年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,856,437
コール・ローン	59,916,787
国債証券	16,052,233,669
未収入金	221,579,180
未収利息	87,867,167
前払費用	14,675,360
流動資産合計	16,441,128,600
資産合計	16,441,128,600
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	295,837
未払金	154,151,852
未払解約金	25,000,000
流動負債合計	179,447,689
負債合計	179,447,689
純資産の部	
元本等	
元本	6,148,518,226
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,113,162,685
元本等合計	16,261,680,911
純資産合計	16,261,680,911
負債純資産合計	16,441,128,600



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2021年4月21日 至 2021年10月20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	2021年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,481,302,084円
同期中追加設定元本額	18,924,290円
同期中一部解約元本額	351,708,148円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	4,456,014,821円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	778,575,603円
新光7資産バランスファンド	252,129,390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）	628,213,184円
グローバル・ナビ	12,521,406円
計	6,148,518,226円
2. 受益権の総数	6,148,518,226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 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年10月20日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	578,248,076
合計	578,248,076

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2020年11月5日から2021年10月20日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2021年10月20日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	66,606,680	-	66,902,517	295,837
アメリカ・ドル	66,606,680	-	66,902,517	295,837
合計	66,606,680	-	66,902,517	295,837

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年10月20日現在
1口当たり純資産額	2.6448円
(1万口当たり純資産額)	(26,448円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.625 08/15/30	5,000,000.000	4,608,398.400	
		US T N/B 1.25 08/15/31	12,050,000.000	11,631,544.830	
		US T N/B 1.625 05/15/31	9,600,000.000	9,612,000.000	
		US T N/B 1.625 08/15/29	6,500,000.000	6,559,414.030	
		US T N/B 2.625 02/15/29	8,700,000.000	9,397,359.370	
		US T N/B 2.875 05/15/28	2,250,000.000	2,459,882.810	
		US T N/B 2.875 08/15/28	5,000,000.000	5,473,828.090	
		US T N/B 3.125 11/15/28	5,000,000.000	5,564,648.400	
	アメリカ・ドル	小計	54,100,000.000 (6,204,188,000)	55,307,075.930 (6,342,615,468)	

イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,530,000.000	1,520,514.000	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,000,000.000	916,446.000	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,800,000.000	1,782,559.440	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,000,000.000	1,048,426.800	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	340,000.000	408,637.050	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	1,979,456.700	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,200,000.000	1,619,335.200	
イギリス・ポンド 小計		8,370,000.000 (1,324,050,300)	9,275,375.190 (1,467,271,601)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 11/01/22	2,750,000.000	2,742,674.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,300,000.000	1,180,884.900	
	CANADA 1.25 06/01/30	2,200,000.000	2,149,184.400	
	CANADA 1.5 06/01/31	3,000,000.000	2,966,646.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	2,400,000.000	2,536,965.600	
カナダ・ドル 小計		11,650,000.000 (1,081,236,500)	11,576,354.900 (1,074,401,498)	
ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,700,000.000	2,739,636.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,900,000.000	2,938,559.000	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,300,000.000	3,291,337.500	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/31	1,600,000.000	1,563,564.800	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,000,000.000	3,119,577.000	
	FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,000,000.000	3,176,550.000	
	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	6,500,000.000	6,887,166.000	
	FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,000,000.000	2,421,580.000	
	FRANCE OAT 2.75 10/25/27	1,100,000.000	1,298,585.200	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	4,259,109.000	
	ITALY BTPS 0.6 08/01/31	5,000,000.000	4,848,373.740	
	ITALY BTPS 0.95 08/01/30	3,000,000.000	3,038,400.000	
	ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,500,000.000	1,644,651.000	
	ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,000,000.000	2,312,026.000	
	ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,000,000.000	2,356,274.000	
	ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,500,000.000	6,739,678.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	800,000.000	1,089,600.000		
ユーロ 小計		47,900,000.000 (6,390,818,000)	53,724,667.240 (7,167,945,102)	
国債証券 合計		15,000,292,800 (15,000,292,800)	16,052,233,669 (16,052,233,669)	
合計			16,052,233,669 (16,052,233,669)	

(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 8銘柄	39.00	39.51
イギリス・ポンド	国債証券 7銘柄	9.02	9.14
カナダ・ドル	国債証券 5銘柄	6.61	6.69
ユーロ	国債証券 17銘柄	44.08	44.65

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 新光米国REITマザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,505,850
コール・ローン	3,706,111
投資証券	691,324,139
未収入金	7,109,994
未収配当金	396,951
流動資産合計	708,043,045
資産合計	708,043,045
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	738
未払金	36,368
流動負債合計	37,106
負債合計	37,106
純資産の部	
元本等	
元本	288,344,583
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	419,661,356
元本等合計	708,005,939
純資産合計	708,005,939
負債純資産合計	708,043,045

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	331,716,865円
同期中追加設定元本額	-円
同期中一部解約元本額	43,372,282円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	283,745,767円
グローバル・ナビ	4,598,816円
計	288,344,583円
2. 受益権の総数	288,344,583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 2021年4月21日 至 2021年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年10月20日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	164,065,206
合計	164,065,206

（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2021年10月20日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連



種類	2021年10月20日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	10,320,300	-	10,321,038	738
	10,320,300	-	10,321,038	738
合計	10,320,300	-	10,321,038	738

(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)

2021年10月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,4554円 (24,554円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	359,000	8,084,680	
		AGREE REALTY CORP	279,000	19,334,700	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	294,000	7,097,160	
		ALEXANDER'S INC.	9,000	2,493,180	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	635,000	129,006,600	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	203,000	7,868,280	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	563,000	28,454,020	

AMERICAN FINANCE TRUST INC	489.000	4,132.050	
AMERICAN HOMES 4 RENT	1,163.000	45,938.500	
AMERICAN TOWER CORP	1,859.000	507,321.100	
AMERICOLD REALTY TRUST	1,073.000	32,007.590	
APARTMENT INCOME REIT CORP	643.000	32,400.770	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	615.000	4,507.950	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	873.000	13,784.670	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	247.000	3,314.740	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	574.000	131,159.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	109.000	1,645.900	
BOSTON PROPERTIES INC	642.000	74,555.460	
BRANDYWINE REALTY TRUST	688.000	9,535.680	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,217.000	28,514.310	
BROADSTONE NET LEASE INC	639.000	16,524.540	
BRT APARTMENTS CORP	60.000	1,192.200	
CAMDEN PROPERTY TRUST	400.000	62,400.000	
CARETRUST REIT INC	391.000	8,324.390	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	203.000	1,776.250	
CENTERSPACE	58.000	5,776.800	
CHATHAM LODGING TRUST	199.000	2,475.560	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	58.000	491.260	
CITY OFFICE REIT INC	177.000	3,324.060	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	465.000	8,900.100	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	789.000	9,554.790	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	96.000	4,454.400	
COREPOINT LODGING INC	163.000	2,534.650	
CORESITE REALTY CORP	180.000	25,333.200	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	469.000	13,099.170	
COUSINS PROPERTIES INC	610.000	24,265.800	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	1,774.000	306,689.120	
CUBESMART	826.000	43,067.640	
CYRUSONE INC	510.000	39,382.200	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	848.000	8,081.440	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,155.000	173,146.050	

DIGITALBRIDGE GROUP INC	1,987.000	12,756.540	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	981.000	3,619.890	
DOUGLAS EMMETT INC	684.000	22,831.920	
DUKE REALTY TRUST	1,540.000	82,867.400	
EAST GROUP	162.000	29,843.640	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	342.000	7,363.260	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	580.000	6,246.600	
EPR PROPERTIES	309.000	15,910.410	
EQUINIX INC	368.000	286,918.560	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	715.000	60,360.300	
EQUITY RESIDENTIAL	1,516.000	127,344.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	486.000	14,084.280	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	267.000	88,131.360	
EXTRA SPACE STORAGE INC	539.000	98,884.940	
FARMLAND PARTNERS INC	111.000	1,316.460	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	317.000	38,287.260	
FIRST INDUSTRIAL RT	529.000	30,174.160	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	309.000	8,809.590	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	429.000	2,187.900	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	907.000	44,352.300	
GEO GROUP INC	487.000	4,076.190	
GETTY REALTY CORP	165.000	5,161.200	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	149.000	3,252.670	
GLADSTONE LAND CORP	111.000	2,540.790	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	234.000	3,744.000	
GLOBAL NET LEASE INC	417.000	6,759.570	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	601.000	19,688.760	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	895.000	29,857.200	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,218.000	76,387.920	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	134.000	1,201.980	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	423.000	19,352.250	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2,908.000	48,214.640	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	614.000	16,749.920	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	434.000	9,296.280	

INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	263.000	7,379.780	
INVITATION HOMES INC	2,372.000	95,330.680	
IRON MOUNTAIN INC	1,178.000	52,951.100	
JBG SMITH PROPERTIES	509.000	14,959.510	
KILROY REALTY CORP	477.000	32,693.580	
KIMCO REALTY	2,389.000	54,086.960	
KITE REALTY GROUP TRUST	338.000	7,223.060	
LAMAR ADVERTISING CO	354.000	41,821.560	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,121.000	16,422.650	
LIFE STORAGE INC	320.000	39,958.400	
LTC PROPERTIES INC	158.000	5,444.680	
MACK CALI	356.000	6,461.400	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,431.000	49,957.050	
MID AMERICA	475.000	93,674.750	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	386.000	7,376.460	
NATIONAL HEALTH INVS INC	182.000	10,357.620	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	718.000	32,747.980	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	336.000	19,736.640	
NETSTREIT CORP	164.000	3,972.080	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	92.000	6,114.320	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	194.000	5,420.360	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	981.000	30,852.450	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	67.000	2,125.240	
OUTFRONT MEDIA INC	595.000	15,511.650	
PARAMOUNT GROUP INC	757.000	6,956.830	
PARK HOTELS & RESORTS INC	965.000	18,325.350	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	527.000	12,041.950	
PHILLIPS EDISON & CO INC	79.000	2,464.800	
PHYSICIANS REALTY TRUST	881.000	16,421.840	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	503.000	9,245.140	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	127.000	3,110.230	
POTLATCH CORP	274.000	14,774.080	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	208.000	2,562.560	
PROLOGIS INC	3,035.000	422,229.200	
PS BUSINESS PARKS	83.000	14,216.240	
PUBLIC STORAGE	620.000	199,020.000	
RAYONIER INC	577.000	21,135.510	

REALTY INCOME CORP	1,603.000	112,274.120	
REGENCY CENTERS CORP	695.000	48,309.450	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	491.000	8,887.100	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	870.000	11,562.300	
RETAIL VALUE INC	72.000	1,954.800	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	567.000	35,341.110	
RLJ LODGING TRUST	684.000	10,047.960	
RPT REALTY	333.000	4,488.840	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	223.000	18,917.090	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	896.000	13,646.080	
SAFEHOLD INC	73.000	5,497.630	
SAUL CENTERS INC	49.000	2,278.500	
SBA COMMUNICATIONS CORP	446.000	148,152.280	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	152.000	2,185.760	
SERVICE PROPERTIES TRUST	666.000	7,452.540	
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,342.000	191,691.280	
SITE CENTERS CORP	703.000	11,487.020	
SL GREEN	278.000	20,274.540	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	488.000	23,272.720	
STAG INDUSTRIAL INC	667.000	28,734.360	
STORE CAPITAL CORP	1,005.000	34,089.600	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	429.000	4,358.640	
SUN COMMUNITIES INC	471.000	92,551.500	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	900.000	11,178.000	
TANGER FACTORY OUTLET	423.000	7,347.510	
TERRENO REALTY CORP	285.000	19,995.600	
THE MACERICH COMPANY	884.000	15,965.040	
UDR INC	1,215.000	65,537.100	
UMH PROPERTIES INC	167.000	3,937.860	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	53.000	3,030.540	
URBAN EDGE PROPERTIES	470.000	8,577.500	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	124.000	2,453.960	
VENTAS INC	1,616.000	90,334.400	
VEREIT INC	941.000	46,306.610	
VICI PROPERTIES INC	2,415.000	72,739.800	
VORNADO REALTY TRUST	722.000	32,179.540	
WASHINGTON REIT	343.000	8,653.890	
WELLTOWER INC	1,739.000	146,197.730	

	WEYERHAEUSER CO	3,083.000	113,361.910	
	WHITESTONE REIT	166.000	1,643.400	
	WP CAREY INC	752.000	57,603.200	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	462.000	8,182.020	
	アメリカ・ドル 小計	100,527.000	6,028,288.620 (691,324,139)	
投資証券 合計		100,527	691,324,139 (691,324,139)	
合計			691,324,139 (691,324,139)	

(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 154銘柄	97.64	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

「(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。

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

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

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

## 財政状態計算書

2021年5月31日現在

	2021年 (日本円)	2020年 (日本円)
<b>資産</b>		
<b>流動資産</b>		
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	18,753,592,218	23,312,508,302
ブローカーに対する債権	117,814,864	302,000,000
現金および現金同等物	1,259,624,258	631,504,565
その他の債権	1,175,263	79,302
<b>資産合計</b>	<b>20,132,206,603</b>	<b>24,246,092,169</b>
<b>負債</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	-	303,520,000
ブローカーに対する債務	117,069,215	341,308,763
未払費用	25,152,333	27,096,268
<b>負債合計</b>	<b>142,221,548</b>	<b>671,925,031</b>
<b>受益証券保有者に帰属する純資産</b>	<b>19,989,985,055</b>	<b>23,574,167,138</b>

## 投資ポートフォリオ(無監査)

2021年5月31日終了会計年度

	公正価値 2021年 (日本円)	公正価値 2020年 (日本円)
<b>債券</b>		
<b>アンゴラ</b>		
Angolan Government International Bond 8.00% due 26/11/2029 REGS	-	485,754,341
アンゴラ合計	-	485,754,341
<b>アルゼンチン</b>		
Provincia De Tierra Del Fuego Argentina 8.95% due 17/04/2027 REGS	324,696,635	259,937,602
Provincia Del Chubut Argentina 7.75% due 26/07/2026 REGS	119,052,823	69,966,794
アルゼンチン合計	443,749,458	329,904,396
<b>アルメニア</b>		
Republic of Armenia International Bond 7.15% due 26/03/2025 REGS	-	622,962,259
アルメニア合計	-	622,962,259
<b>アゼルバイジャン</b>		
International Bank of Azerbaijan Ojsc 5.625% due 11/06/2019 REGS	-	542,151,550
Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026 REGS	226,135,734	402,534,028
アゼルバイジャン合計	226,135,734	944,685,578
<b>ベラルーシ</b>		
Development Bank of the Republic of Belarus JSC 12.00% due 15/05/2022 REGS	270,989,742	288,837,645
Republic of Belarus International Bond 6.20% due 28/02/2030 REGS	242,199,755	325,231,856
Republic of Belarus Ministry of Finance 6.378% due 24/02/2031 REGS	227,784,666	-
ベラルーシ合計	740,974,163	614,069,501
<b>ベナン</b>		
Benin, Republik 4.875% due 19/01/2032 REGS	216,767,944	-
ベナン合計	216,767,944	-
<b>ボスニア・ヘルツェゴビナ</b>		
Bosnia and Herzegovina due 20/12/2021 REGS	137,290,090	242,154,573
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	137,290,090	242,154,573
<b>ブラジル</b>		
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 8.20% due 06/04/2028 REGS	416,445,758	374,919,491
ブラジル合計	416,445,758	374,919,491
<b>カメルーン</b>		
Republic of Cameroon International Bond 9.50% due 19/11/2025 REGS	428,139,883	494,795,841
カメルーン合計	428,139,883	494,795,841



	公正価値 2021年 (日本円)	公正価値 2020年 (日本円)
<b>債券(続き)</b>		
<b>中国</b>		
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.875% due 14/03/2025 REGS	-	632,529,013
中国合計	-	632,529,013
<b>コロンビア</b>		
Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS	447,483,246	446,615,163
Ecopetrol SA 4.125% due 16/01/2025	-	317,674,883
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	375,305,415	361,617,331
Republic of Colombia 4.375% due 12/07/2021	-	284,013,947
コロンビア合計	822,788,661	1,409,921,324
<b>コスタリカ</b>		
Costa Rica Government International Bond 7.158% due 12/03/2045	129,447,393	-
コスタリカ合計	129,447,393	-
<b>ドミニカ共和国</b>		
Dominican Republic 6.40% due 05/06/2049 REGS	84,614,071	-
Dominican Republic 8.90% due 15/02/2023 REGS	135,200,388	249,397,178
Dominican Republic International Bond 9.75% due 05/06/2026 REGS	413,745,120	295,130,796
ドミニカ共和国合計	633,559,579	544,527,974
<b>エジプト</b>		
Egypt Government Bond 16.40% due 05/09/2020	-	64,671,809
Egypt Government Bond 18.15% due 13/06/2020	-	196,721,094
Egypt Government International Bond 7.50% due 16/02/2061 REGS	139,981,457	-
Egypt Government International Bond 7.625% due 29/05/2032 REGS	65,287,221	185,510,495
Egypt Treasury Bills 0% due 03/08/2021 TBLM	85,525,478	-
Egypt Treasury Bills 0% due 15/09/2020 TBLM	-	478,981,784
Egypt Treasury Bills 0% due 17/08/2021 TBLM	231,460,798	-
Egypt Treasury Bills 0% due 31/08/2021 TBLM	214,041,385	-
エジプト合計	736,296,339	925,885,182
<b>エルサルバドル</b>		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035 REGS	545,761,541	436,469,319
エルサルバドル合計	545,761,541	436,469,319
<b>エチオピア</b>		
Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	394,357,040	580,035,583
エチオピア合計	394,357,040	580,035,583
<b>ジョージア</b>		
Georgian Oil & Gas Corp 6.75% due 26/04/2021 REGS	-	290,167,017
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022 REGS	-	134,925,770
ジョージア合計	-	425,092,787
<b>ガーナ</b>		
Ghana Government International Bond 8.125% due 18/01/2026 REGS	-	216,847,700
Ghana Govt 18.25% due 25/07/2022	509,197,795	500,039,599
Ghana Govt 24.75% due 19/07/2021	-	69,122,267
Saderea DAC 12.50% due 30/11/2026 REGS	97,058,452	81,567,131
ガーナ合計	606,256,247	867,576,697

	公正価値 2021年 (日本円)	公正価値 2020年 (日本円)
<b>債券(続き)</b>		
<b>ホンジュラス</b>		
Honduras Government International Bond 5.625% due 24/06/2030	198,720,395	-
ホンジュラス合計	198,720,395	-
<b>インドネシア</b>		
Indonesia Republic of 3.375% due 15/04/2023 REGS	462,911,060	448,853,600
Indonesia, 4.35% due 08/01/2027	63,084,409	-
インドネシア合計	525,995,469	448,853,600
<b>ジャマイカ</b>		
Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045	236,241,591	258,602,840
ジャマイカ合計	236,241,591	258,602,840
<b>ヨルダン</b>		
Jordan Kingdom 6.125% due 29/01/2026 REGS	483,707,229	441,160,766
ヨルダン合計	483,707,229	441,160,766
<b>カザフスタン</b>		
Astana Finance JSC 0% due 22/12/2024 REGS	3,312,777	3,265,620
Development Bank of Kazakhstan JSC 9.50% due 14/12/2020 REGS	-	138,100,748
Kazakhstan Government International Bond 4.875% due 14/10/2044 REGS	108,907,524	571,183,053
Kazakhstan Government Bond-MEKKAM 5.00% due 15/05/2023	82,469,905	-
Kazakhstan Temir Zholy Finance Bv 6.95% due 10/07/2042 REGS	271,876,764	254,054,643
Kazakhstan Treasury bill-MEKKAM 0% due 20/01/2022	220,968,865	-
カザフスタン合計	687,535,835	966,604,064
<b>ケニア</b>		
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	320,246,776	321,307,925
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 10/01/2033	-	81,006,407
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 12/05/2025	227,840,744	274,710,911
ケニア合計	548,087,520	677,025,243
<b>メキシコ</b>		
Mexican Bonos 8.00% due 11/07/2047	1,229,538,462	-
Mexican Bonos 8.50% due 31/05/2029	-	993,848,490
Mexico City Airport Trust 4.25% due 31/10/2026 REGS	-	98,909,026
Mexico City Airport Trust 5.50% due 31/07/2047 REGS	-	175,559,483
Mexico Government International Bond 2.659% due 24/05/2031	174,771,330	-
Mexico Government International Bond 4.60% due 23/01/2046	165,424,766	-
Mexican Udibonos 4.50% due 04/12/2025 Index Linked To Mxudi	-	90,420,623
メキシコ合計	1,569,734,558	1,358,737,622

	公正価値 2021年 (日本円)	公正価値 2020年 (日本円)
債券(続き)		
パキスタン		
Pakistan, 7.375% due on 08/04/2031	108,859,182	-
パキスタン合計	108,859,182	-
パラグアイ		
Rutas 2 and 7 Finance Ltd 0% due 30/09/2036 REGS	321,819,276	280,891,783
パラグアイ合計	321,819,276	280,891,783
ペルー		
Iirsa Norte Finance Ltd 8.75% due 30/05/2024 REGS	156,108,197	207,322,503
Lima Metro Line 2 Finance Ltd 5.875% due 05/07/2034 REGS	-	336,902,878
Peruvian Government International Bond 6.35% due 12/08/2028 REGS	-	441,325,969
ペルー合計	156,108,197	985,551,350
ロシア		
Russian Federation Bond 7.65% due 10/04/2030	57,165,071	-
Russian Federal Inflation Linked Bond 2.50% due 17/07/2030	330,058,282	-
Rzd Capital PLC (Russian Railways) 5.70% due 05/04/2022 REGS	195,182,291	428,466,890
ロシア合計	582,405,644	428,466,890
南アフリカ		
Government of South Africa 4.30% due 12/10/2028	409,964,336	567,209,588
Government of South Africa 7.00% due 28/02/2031	779,924,376	1,135,602,453
南アフリカ合計	1,189,888,712	1,702,812,041
国際機関		
Asian Infrastructure Investment Bank 16.00% due 14/09/2021	536,285,823	-
Banque Ouest Africaine De Developpement 5.00% due 27/07/2027 REGS	-	330,709,228
European Bank for Reconstruction & Development 6.85% due 21/06/2021	335,224,500	318,256,025
European Bank for Reconstruction & Development 8.30% due 02/10/2020	-	166,323,419
European Bank for Reconstruction & Development 27.50% due 11/09/2020	-	569,640,669
International Bank for Reconstruction and Development 9.00% due 26/02/21 REGS	-	288,045,406
Inter-American Development Bank 7.875% due 14/03/2023 REGS	175,558,404	-
Inter-American Development Bank 8.01% due 11/12/2021 REGS	133,049,543	127,398,191
International Finance Corp 7.50% 29/10/2021	301,626,776	-
国際機関合計	1,481,745,046	1,800,372,938
スリナム		
Government of Suriname 9.25% due 26/10/2026 REGS	223,080,079	105,724,168
Suriname Government International Bond 9.875% due 30/12/2023 REGS	148,260,584	82,887,763
スリナム合計	371,340,663	188,611,931

	公正価値 2021年 (日本円)	公正価値 2020年 (日本円)
債券(続き)		
トリニダード・トバゴ		
Trinidad Petroleum Holdings Ltd 9.75% due 15/06/2026 REGS	790,910,549	615,733,670
トリニダード・トバゴ合計	790,910,549	615,733,670
チュニジア		
Banque Centrale De Tunisie International Bond 5.75% due 30/01/2025 REGS	-	689,988,228
Banque Centrale De Tunisie International Bond 6.375% due 15/07/2026 REGS	808,350,998	-
チュニジア合計	808,350,998	689,988,228
トルコ		
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS 6.125% due 03/05/2024	175,504,543	325,402,681
Government of Turkey 4.875% due 16/04/2043	215,527,227	558,493,072
Ziraat Bank, 5.375% due 02/03/2026	177,665,785	-
トルコ合計	568,697,555	883,895,753
ウクライナ		
KYIV Finance PLC (CITY OF KIEV) 7.50% due 15/12/2022 REGS	463,251,022	539,609,503
ウクライナ合計	463,251,022	539,609,503
ウルグアイ		
Uruguay Republic of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked	791,766,489	901,681,330
ウルグアイ合計	791,766,489	901,681,330
ウズベキスタン		
IPOTEKA Bank, ATIB 16.00% due 16/04/2024	190,050,369	-
Reupblic of Uzbekistan, 14.5% due 25/11/2023, REGS	127,964,450	-
ウズベキスタン合計	318,014,819	-
債券合計	18,681,150,579	23,099,883,411
原油ワラント		
ナイジェリア		
Nigeria Central Bank of WRD Exp 15/11/2020 REGS	-	165,561,307
ナイジェリア合計	-	165,561,307
ベネズエラ		
Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020	72,441,639	47,063,584
ベネズエラ合計	72,441,639	47,063,584
原油ワラント合計	72,441,639	212,624,891
投資ポートフォリオ	18,753,592,218	23,312,508,302

(FRN)変動利付債です。

(Index Linked)インフレ連動債です。

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

はアセットマネジメントOneにて追記

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年10月29日現在

資産総額	4,736,900,768円
負債総額	2,392,852円
純資産総額( - )	4,734,507,916円
発行済数量	4,438,246,258口
1口当たり純資産額( / )	1.0668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10月29日現在

資産総額	2,531,663,772円
負債総額	68,312,503円
純資産総額( - )	2,463,351,269円
発行済数量	873,951,957口
1口当たり純資産額( / )	2.8186円

新光日本債券インデックスマザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	9,379,327,287円
負債総額	52,246,100円
純資産総額( - )	9,327,081,187円
発行済数量	7,263,265,395口
1口当たり純資産額( / )	1.2841円

新光J-REITマザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	115,838,981,491円
負債総額	203,591,050円
純資産総額( - )	115,635,390,441円
発行済数量	49,956,172,908口
1口当たり純資産額( / )	2.3147円

新光外国株式インデックスマザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	2,001,172,192円
負債総額	6,639円
純資産総額( - )	2,001,165,553円
発行済数量	515,905,952口
1口当たり純資産額( / )	3.8789円

海外国債マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	16,126,651,138円
負債総額	43,735,057円
純資産総額( - )	16,082,916,081円
発行済数量	6,114,148,944口
1口当たり純資産額( / )	2.6304円

## 新光米国REITマザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	663,226,524円
負債総額	0円
純資産総額( - )	663,226,524円
発行済数量	263,704,883口
1口当たり純資産額( / )	2.5150円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2)受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5)受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6)受益権の再分割

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

### (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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



## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額(2021年10月29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10月29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10月29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	1,389,726,868,805
追加型株式投資信託	831	15,977,901,845,268
単位型公社債投資信託	28	60,426,385,134
単位型株式投資信託	220	1,327,861,039,257
合計	1,105	18,755,916,138,464

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

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



第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

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

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

## 重要な会計方針

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

(未適用の会計基準等)

## 1. 収益認識に関する会計基準等

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

### (1) 概要

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

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

### (2) 適用予定日

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

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

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

### (1) 概要

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

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

### (2) 適用予定日

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

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っているデリバティブ取引は後述するリスクを低減する目的で行っております。当該デリバティブ取引は、実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引(為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引)を利用して一部リスクを低減しております。

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されてあります。

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券(投資信託)、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されてあります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	5,299,196

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第35期(2020年3月31日現在)

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

## 第36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-



## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

## 2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

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

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

## 第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

## (2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 3.76%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳  
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円
(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

## (2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,149,555千円	5,016,672千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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



## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

## (1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,648
金銭の信託		25,866
未収委託者報酬		18,882
未収運用受託報酬		2,911
未収投資助言報酬		319
未収収益		15
前払費用		996
その他		2,470
	流動資産計	80,112
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	792
器具備品	1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		4,193
ソフトウェア仮勘定		3,475
電話加入権		714
電話加入権		3
投資その他の資産		
投資有価証券		10,724
関係会社株式		261
長期差入保証金		5,299
繰延税金資産		1,273
繰延税金資産		3,311
その他		578
	固定資産計	15,895
資産合計		96,007

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,845
未払金	7,922
未払収益分配金	0
未払償還金	9
未払手数料	7,759
その他未払金	153
未払費用	7,337
未払法人税等	3,423
未払消費税等	1,234
契約負債	20
賞与引当金	836
役員賞与引当金	33
	流動負債計
	22,653
固定負債	
退職給付引当金	2,391
時効後支払損引当金	147
	固定負債計
	2,538
負債合計	25,192
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	49,261
利益準備金	123
その他利益剰余金	49,138
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	17,458
	株主資本計
	70,814
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	70,814
負債・純資産合計	96,007

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	54,995	
運用受託報酬	7,193	
投資助言報酬	569	
その他営業収益	6	
		営業収益計 62,765
営業費用		
支払手数料	22,800	
広告宣伝費	126	
公告費	0	
調査費	17,656	
調査費	4,722	
委託調査費	12,934	
委託計算費	281	
営業雑経費	437	
通信費	17	
印刷費	315	
協会費	33	
諸会費	17	
支払販売手数料	52	
		営業費用計 41,301
一般管理費		
給料	4,865	
役員報酬	82	
給料・手当	4,565	
賞与	217	
交際費	1	
寄付金	4	
旅費交通費	13	
租税公課	292	
不動産賃借料	892	
退職給付費用	248	
固定資産減価償却費	1 670	
福利厚生費	16	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	836	
役員賞与引当金繰入額	33	
機器リース料	0	
事務委託費	1,971	
事務用消耗品費	26	
器具備品費	0	
諸経費	99	
		一般管理費計 9,973
営業利益		11,490

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	7	
受取配当金	548	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	10	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	288	
雑収入	2	
営業外収益計		884
経常利益		12,374
特別損失		
固定資産除却損	5	
ゴルフ会員権売却損	3	
オフィス再編費用	5	
特別損失計		13
税引前中間純利益		12,360
法人税、住民税及び事業税		3,254
法人税等調整額		364
法人税等合計		3,619
中間純利益		8,741

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280
中間純利益							8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	2,538
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,458

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

## 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：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</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、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</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）に基づく定額法によっております。</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、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<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中間会計期間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中間会計期間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当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日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. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 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。

## 会計上の見積りの変更

## 第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

当社は、当中間会計期間において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当中間会計期間において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ124百万円減少しております。

## (会計方針の変更)

## 1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識基準に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計方針の変更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の適用

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	520百万円
	器具備品	1,004百万円

## (中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自2021年4月1日至2021年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (百万円)	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	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

（金融商品関係）

第37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

### 1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	25,866	25,866	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

（注）現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

### 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「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。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「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)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

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

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

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

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



## (収益認識関係)

## 1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間  
(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬(注)	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬に含めて表示しております。

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6. 重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

## (セグメント情報等)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

## 1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 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。

## (1株当たり情報)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,741百万円
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
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

名称	三井住友信託銀行株式会社
資本金の額	342,037百万円(2021年3月末日現在)
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
いちよし証券株式会社(1)	14,577	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
永和証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡安証券株式会社	650	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
あかつき証券株式会社	3,067	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
大山日ノ丸証券株式会社	215	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	(2)7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
西村証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三にいがた証券株式会社	852	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
三豊証券株式会社	300	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

(1) 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) 2020年12月31日現在

### (3) 投資顧問会社

名称	フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド
資本金の額	300万ポンド（2020年12月末日現在）
事業の内容	英国籍の法人であり、内外の有価証券等にかかる投資顧問業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は以下の業務を行います。

- (1) 委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理
- (2) 投資信託財産の計算
- (3) その他上記業務に付随する一切の業務

「販売会社」は以下の業務を行います。

- (1) 募集・販売の取り扱い
- (2) 受益者に対する一部解約事務
- (3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い
- (4) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付
- (6) 受益者に対する運用報告書の交付
- (7) 所得税および地方税の源泉徴収
- (8) その他上記業務に付随する一切の業務

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2021年5月10日	臨時報告書
2021年7月20日	有価証券報告書
2021年7月20日	有価証券届出書
2021年8月5日	臨時報告書

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の監査報告書

2021年11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 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

### 監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの2021年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2021年11月25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

#### 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、「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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

#### 中間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。

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。

#### 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、企業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、監査等委員会に対して、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。

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) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。