【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年7月20日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	新光７資産バランスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

新光７資産バランスファンド

愛称として「七重奏」という名称を用いることがあります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

（イ）追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

（ロ）当初元本は１口当たり１円です。

（ハ）アセットマネジメントOne株式会社（以下「委託者」または「委託会社」といいます。）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付け、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

（イ）発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については１万口当たりの価額を発表します。

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター　0120-104-694

（受付時間は営業日の午前９時から午後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。

（５）【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時から午後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」※1または「償還前乗り換え」※2によりファンドの受益権を取得する場合、申込手数料の優遇を受けることができる場合があります。

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

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

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

（６）【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時から午後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/

（７）【申込期間】

2022年7月21日から2023年1月20日までです。

※申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所（販売会社）については、下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター　0120-104-694

（受付時間は営業日の午前９時から午後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/

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

（イ）申込証拠金

ありません。

（ロ）日本以外の地域における発行

ありません。

（ハ）振替受益権について

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

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

ａ．ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属し、主として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
追加型	海　外	債　　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

■商品分類の定義

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

■属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

■属性区分の定義

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

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

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

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

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

b．ファンドの特色

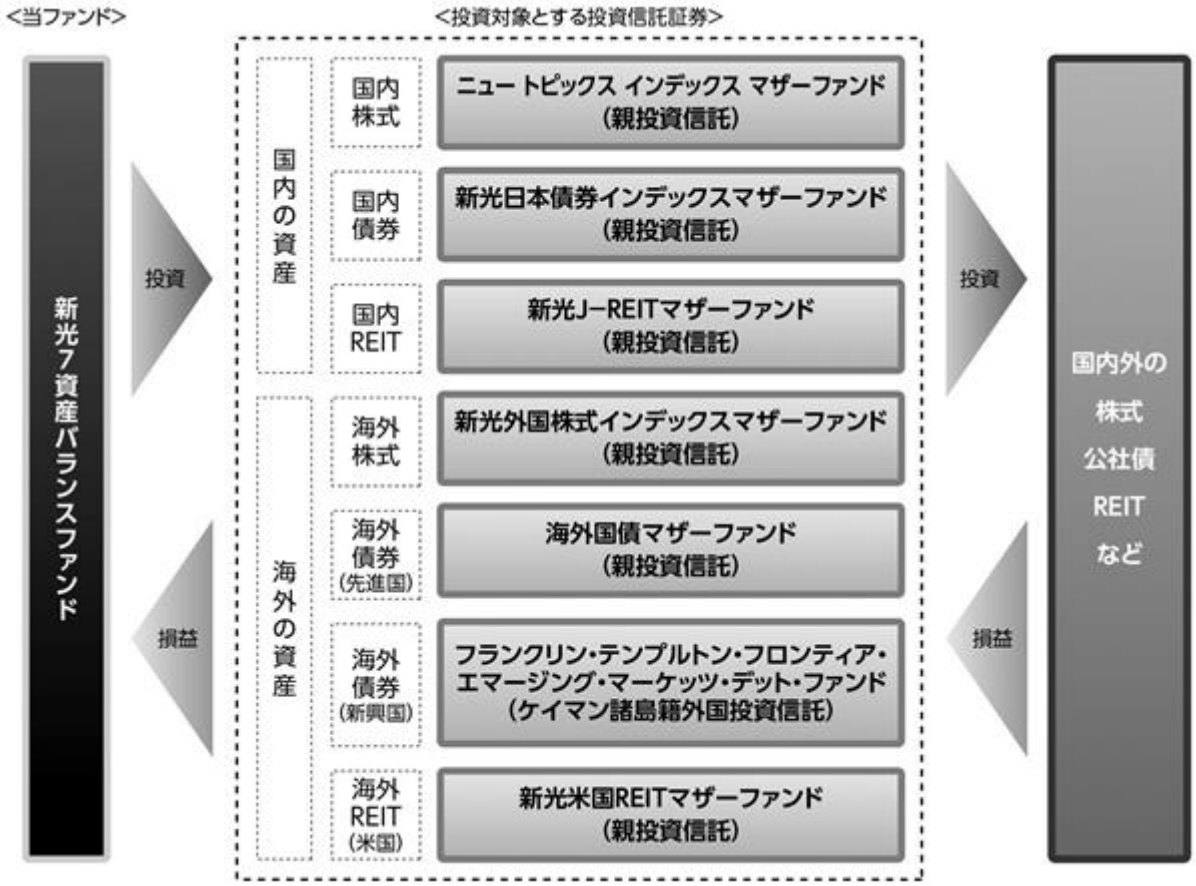
1 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産（株式、公社債、不動産投資信託証券）にバランスよく分散投資します。

●国内外の、株式、公社債および不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）に実質的に投資することにより、リスク分散を図りながら、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指すファンド・オブ・ファンズです。

●投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とします。

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

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



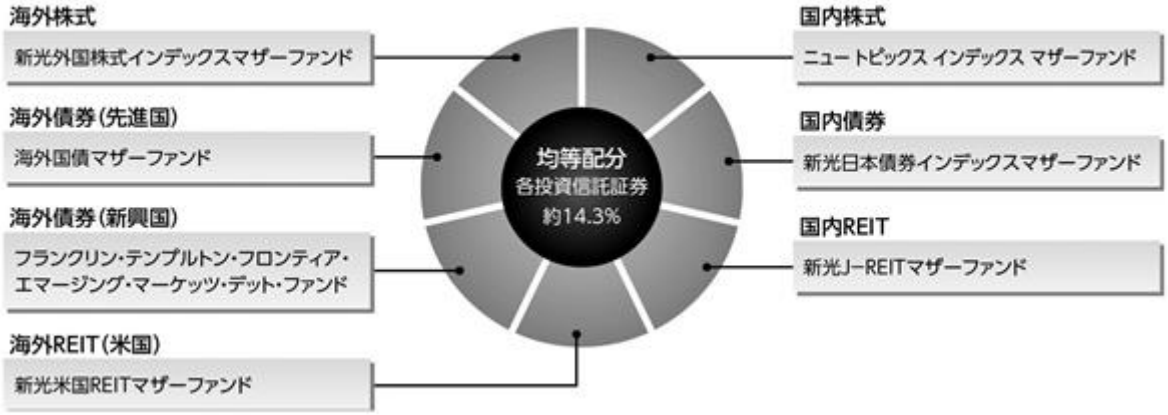
2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

●基本投資配分比率は、各投資信託証券につき純資産総額に対し約14.3%となります。

●各投資信託証券の組入比率については、原則として、6ヵ月ごとにチェックを行い、基本投資配分比率に対し±5%の範囲を超過している場合には調整を行います。

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



■分配方針

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

◆分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。

◆分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

◆上記にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。

◆留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ

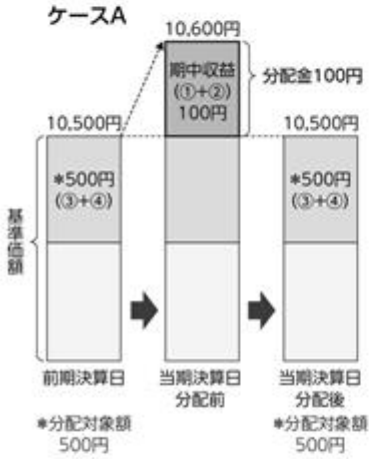
◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係（イメージ）

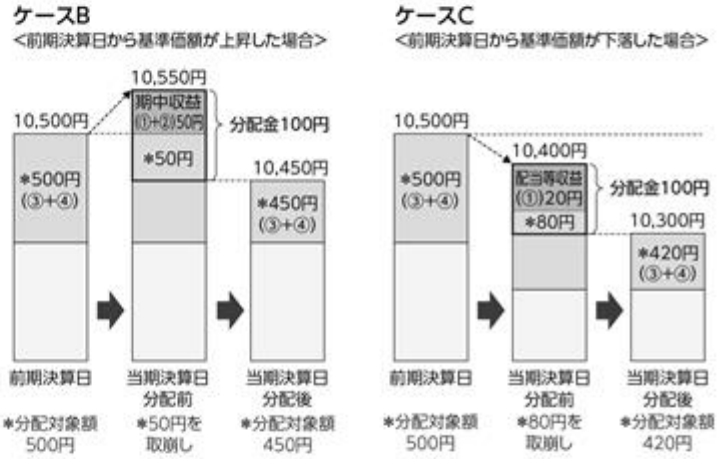
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



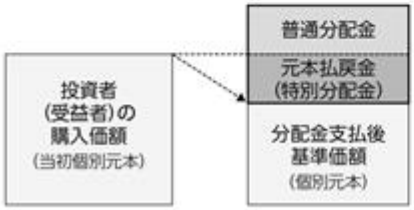
上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

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

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

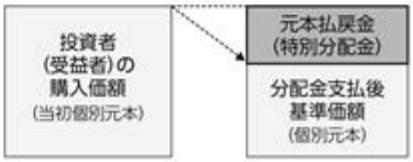
◆投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



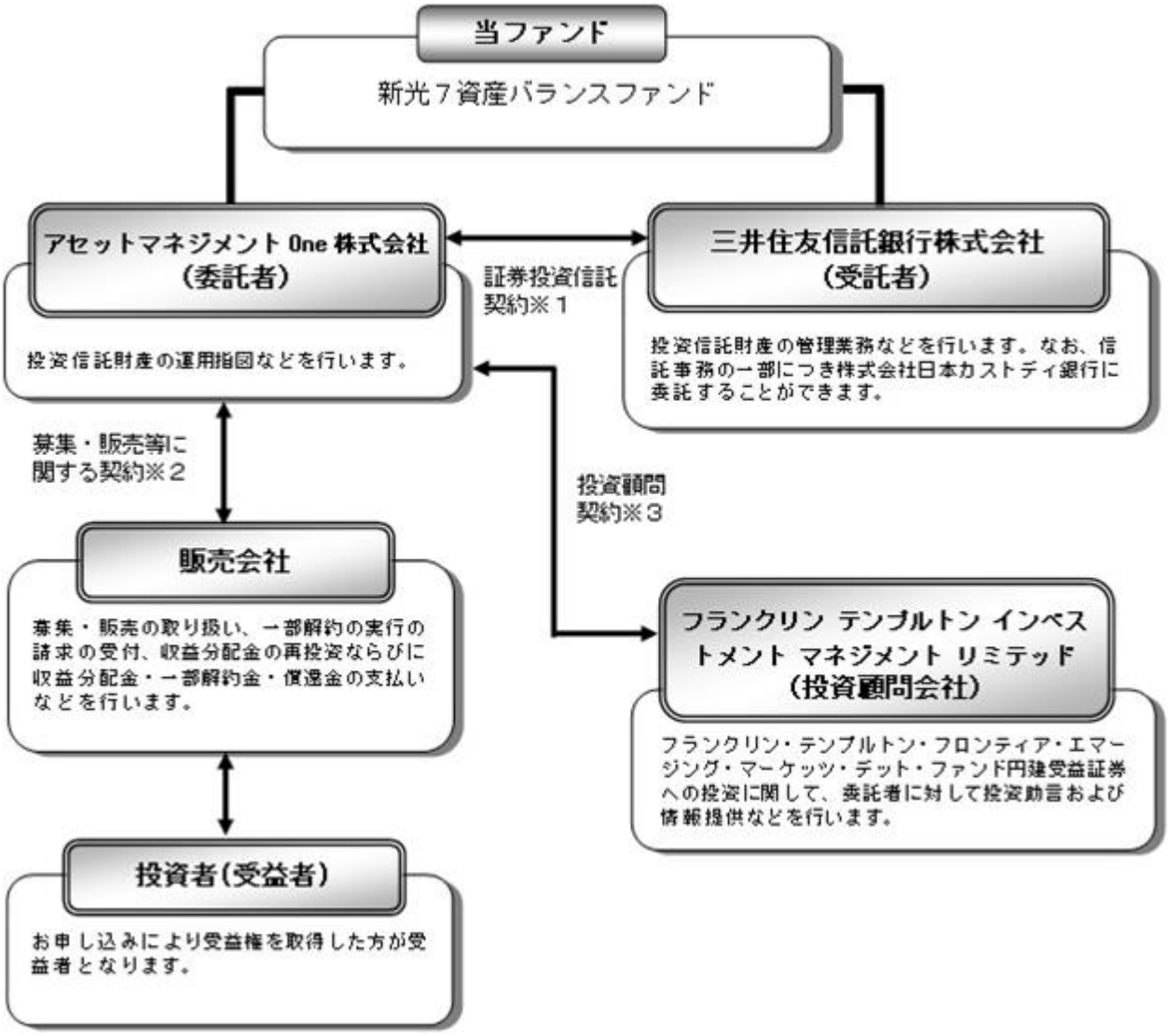
普通分配金　　：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】

ａ．ファンドの仕組み



※１　証券投資信託契約

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

※２　募集・販売等に関する契約

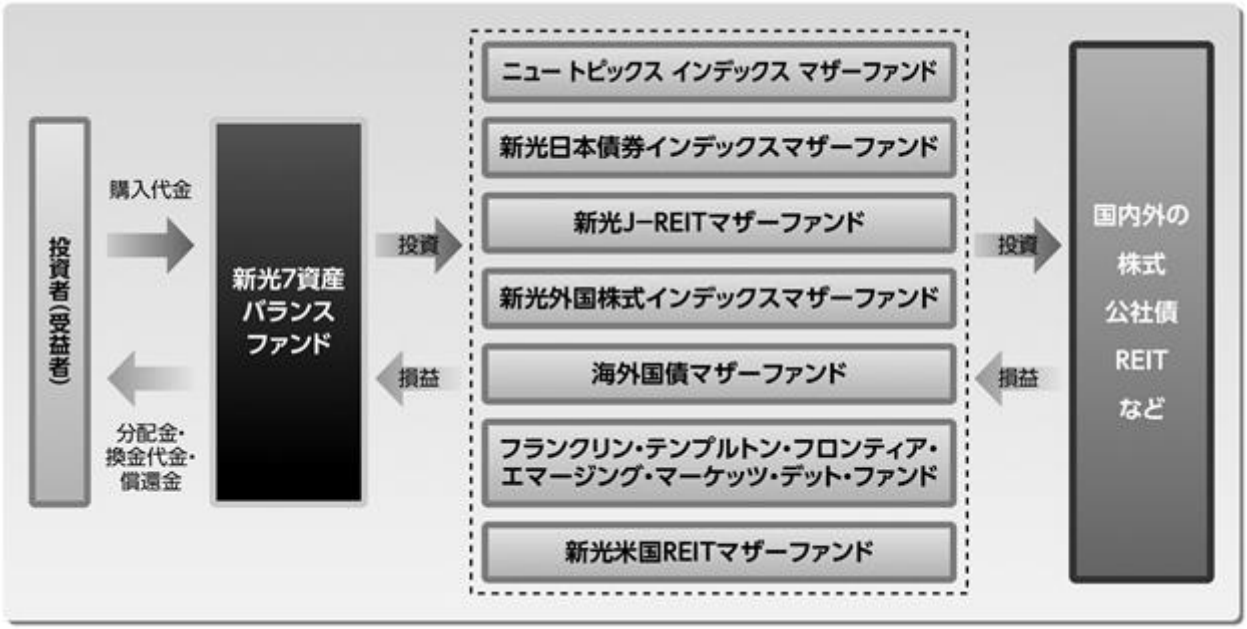
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

※３　投資顧問契約

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

■当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



ｂ．委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額
20億円（2022年4月28日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2022年4月28日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。
※2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

２【投資方針】

（１）【投資方針】

ａ．基本方針

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

ｂ．運用の方法

（イ）主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

（ロ）投資態度

① 以下の投資信託証券を通じて、実質的にわが国および海外の、株式、公社債および不動産投資信託証券に分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

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

② 投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とし、基本投資配分比率に基づき各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は、純資産総額に対する各投資信託証券の構成比率が均等となる率とします。

③ 各投資信託証券の構成比率については、原則として、６ヵ月ごとにチェックを行い、基本投資配分比率に対し一定の範囲を超過している場合には調整を行います。

④ 投資信託証券に含まれる外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。

⑤ フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド円建受益証券への投資にあたっては、フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッドから投資助言および情報提供を受けます。

⑥ 当ファンドの資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

ａ．投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ｂ．運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

８．コマーシャル・ペーパー

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

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

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

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

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・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）銘柄を投資対象とします。 ・投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。 ・株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年１月14日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2002年１月15日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

東証株価指数について

東証株価指数（TOPIX）とは、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・ベンチマークです。

①東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。

②ＪＰＸ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東証株価指数（TOPIX）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③ＪＰＸは、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または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。

④ＪＰＸ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、ＪＰＸは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。

⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

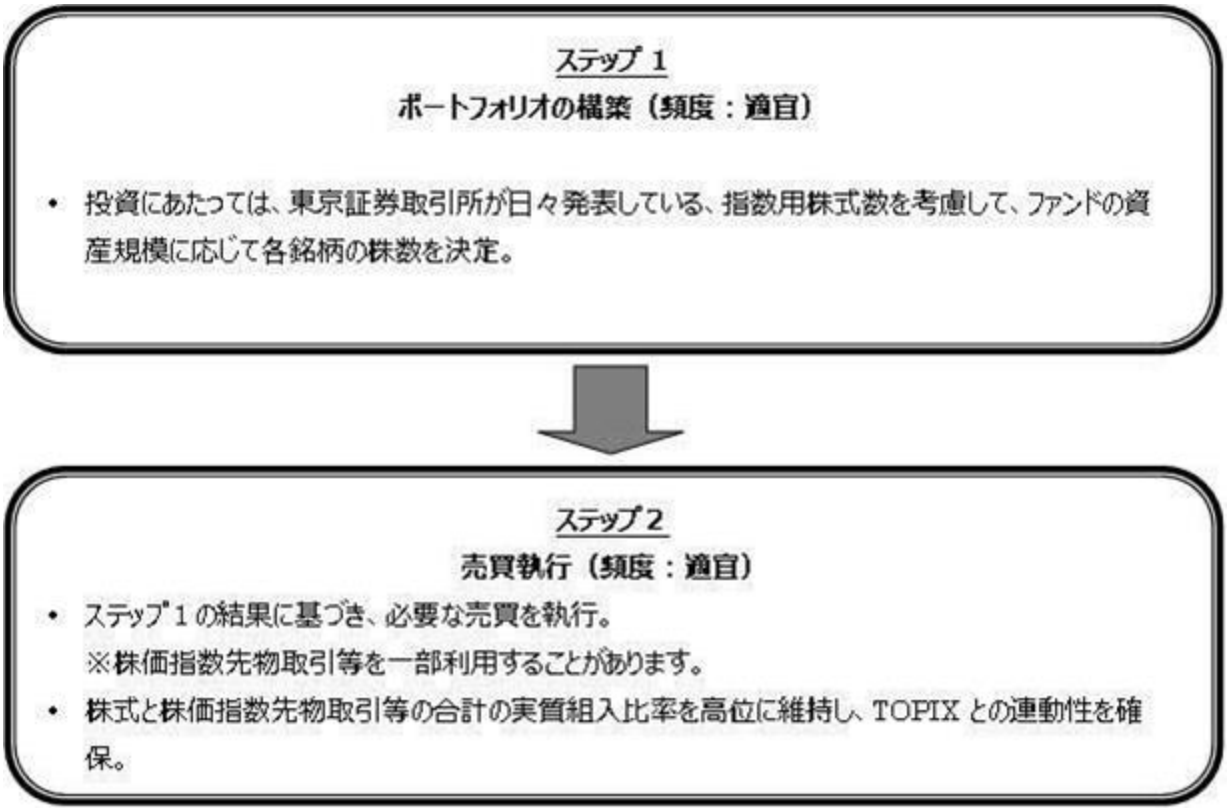
⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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2022年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光日本債券インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・主としてわが国の公社債に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限ります。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年８月17日
委託会社	アセットマネジメント0ne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合について

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

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

運用プロセス

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

ステップ1	
意思決定の範囲	NOMURA-BPI総合に関わる情報収集と対応
内容	NOMURA-BPI総合は月次で構成銘柄の入替えが行われるため、野村総合研究所からの情報等でポートフォリオとベンチマークの乖離をチェックします。

↓

ステップ2	
意思決定の範囲	売買規模の決定（銘柄、額面）
内容	ファンドの設定解約に伴う資金の流出入を元に、ファンドの連動率確保のための売買規模を想定します。銘柄および数量を計量モデル等により決定し、NOMURA-BPI総合と連動性の高いポートフォリオを構築します。

↓

ステップ3	
意思決定の範囲	売買執行指図
内容	売買銘柄決定時に、各銘柄の流動性や売買銘柄数にも留意し、ベンチマークとの連動性を確保します。なお、ベンチマーク構成銘柄の変更時など、リバランスに関わる売買も適宜指示します。

なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

※運用プロセスは2022年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・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。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）、不動産投信指数先物取引以外には投資を行いません。 ・不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができるものとします。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。 ・不動産投信指数先物取引の利用はヘッジ目的に限定します。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

東証REIT指数（配当込み）について

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

①東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。

②ＪＰＸは、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③ＪＰＸは、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または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。

④ＪＰＸは、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。

⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

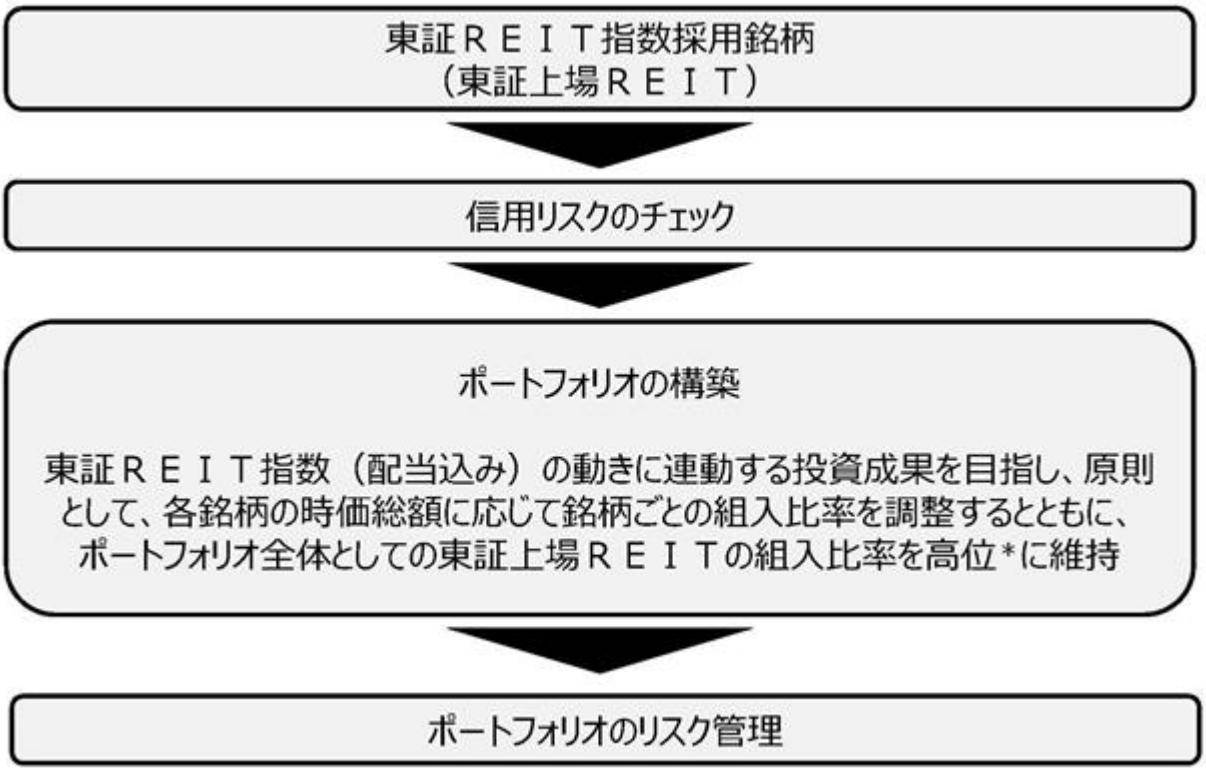
⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンドは、東証REIT指数（配当込み）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（配当込み）の指数値の動向がかい離することがあります。

運用プロセス

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



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

2．東証REIT指数採用銘柄に対して投資を行い、ポートフォリオを構築します。ポートフォリオの構築にあたっては、原則として、各銘柄の時価総額に応じて銘柄ごとの組入比率を調整するとともに、ポートフォリオ全体としての東証上場REIT指数の組入比率（各銘柄の組入比率の合計）を、でき得る限り100%に近づけるよう高位＊に維持し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。

＊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2022年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年８月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

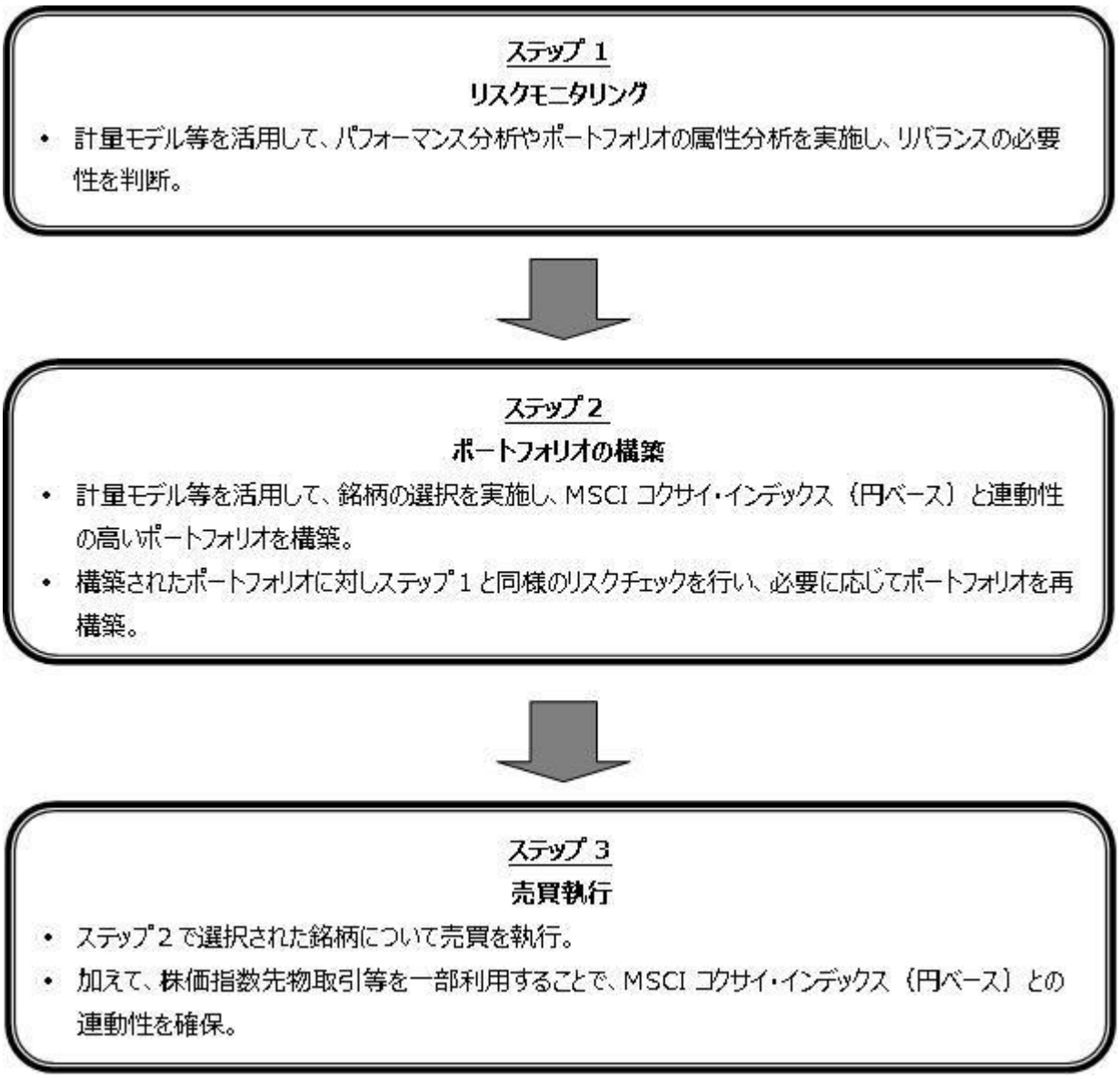
MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、アセットマネジメントOne株式会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会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

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

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

運用プロセス

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



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2022年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。 ・日本を除く、FTSE世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、７～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。 ・債券ポートフォリオは、日本を除くＧ７構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの６ヵ国）が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。 ・運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。 ・通貨アロケーション ・イールドカーブ戦略 ・セクターアロケーション ・デュレーション調整 ・外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。
主な投資制限	・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限ります。 ・外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月４日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2001年11月５日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

FTSE世界国債インデックス（除く日本、７～10年、円ベース）について

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

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

運用プロセス

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

※運用プロセスは2022年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

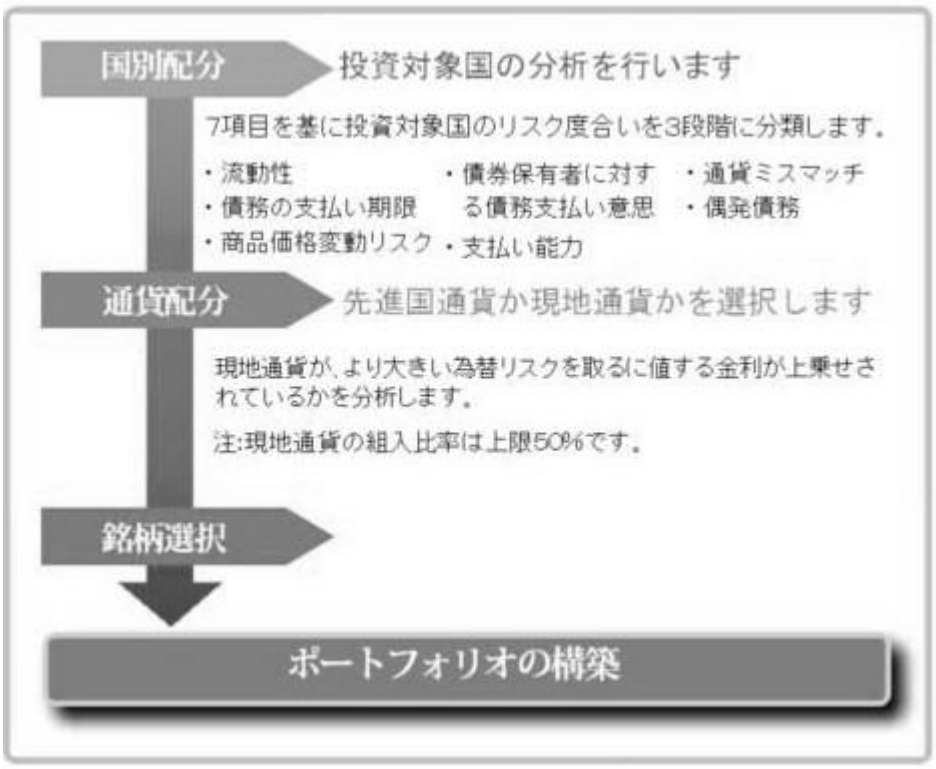
ファンド名	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド （以下、当概要において「ファンド」といいます。）
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託／円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、政府保証債は除きます。 ・クレジットリンク債への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・発行体格付けにおいて、ムーディーズ・インベスターズ・サービスまたはＳ＆Ｐグローバル・レーティングのソブリン信用格付けがＣａａ１またはＣＣＣ＋以下の証券または無格付けの証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。 ・ファンドにおける証券の平均信用格付けは、ムーディーズ・インベスターズ・サービスまたはＳ＆Ｐグローバル・レーティングの格付けにおいてＢ１またはＢ＋以上とします。 ・ファンドにおける証券の平均デュレーションは、８年以下とします。
信託期間	150年
決算日	毎年５月31日
収益分配方針	受託会社は毎月３日（休業日の場合は翌営業日）に受益者に分配金を支払います。当該月次分配にかかわらず、投資顧問会社および管理会社からの通知により受託会社は分配を行う場合があります。 分配はネット・インカム収益とネット実現損益の合計の範囲内で行うことができますが、受益者の利益にかなうと判断される場合には純資産から分配を行うこともできます。
信託報酬等	運用報酬　　：純資産総額に対し0.40% その他報酬※：純資産総額に対し0.15%（上限） ※その他報酬には、受託会社報酬、管理事務代行会社報酬、保管受託銀行報酬、監査報酬、法的費用が含まれます。
信託設定日	2006年３月８日
関係法人	受託会社兼管理事務代行会社：ＢＮＹ メロン ファンド マネジメント（ケイマン）リミテッド 副管理事務代行会社：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店 保管受託銀行：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン 管理会社：フランクリン テンプルトン インターナショナル サービシーズ エスエー アール エル 投資顧問会社：フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（ＦＴＩＭＬ社）は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン・テンプルトン（設立：1947年、運用総資産：約180.8兆円※）の一員です。ＦＴＩＭＬ社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

※2022年3月末現在、1米ドル＝122.39円で換算

運用プロセス



出所：ＦＴＩＭＬ社資料を基にアセットマネジメントOne作成

※運用プロセスは2022年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「ＲＥＩＴ」といいます。）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。 ・ＲＥＩＴの組入比率は原則として高位を保ちます。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・ＲＥＩＴおよび短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 ・ＲＥＩＴへの投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄のＲＥＩＴへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

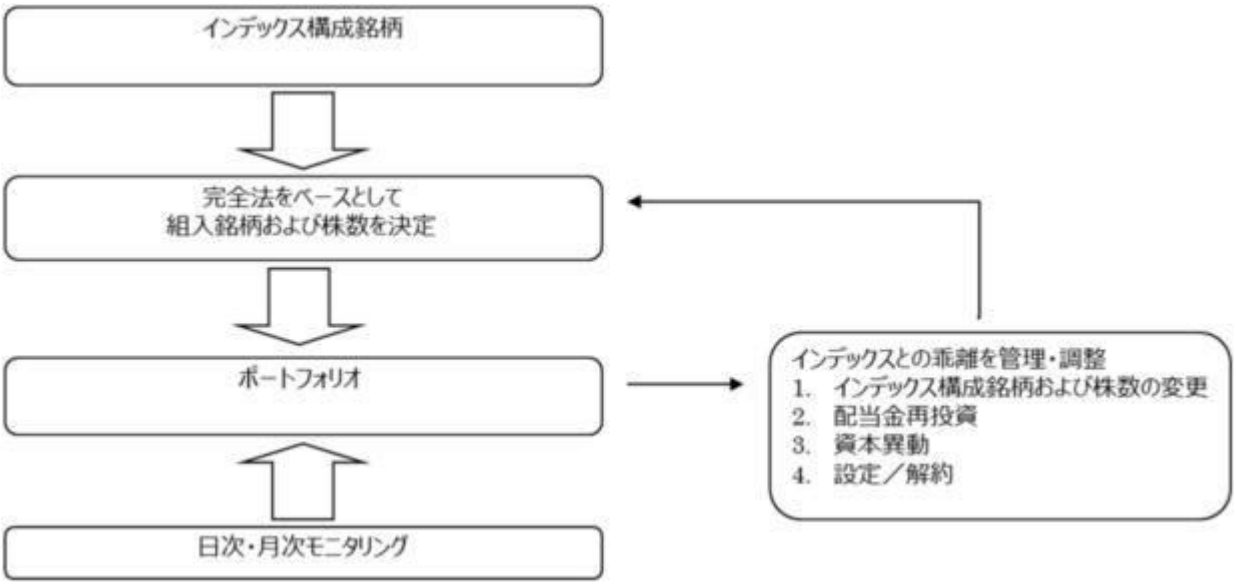
FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスについて

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

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

運用プロセス

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



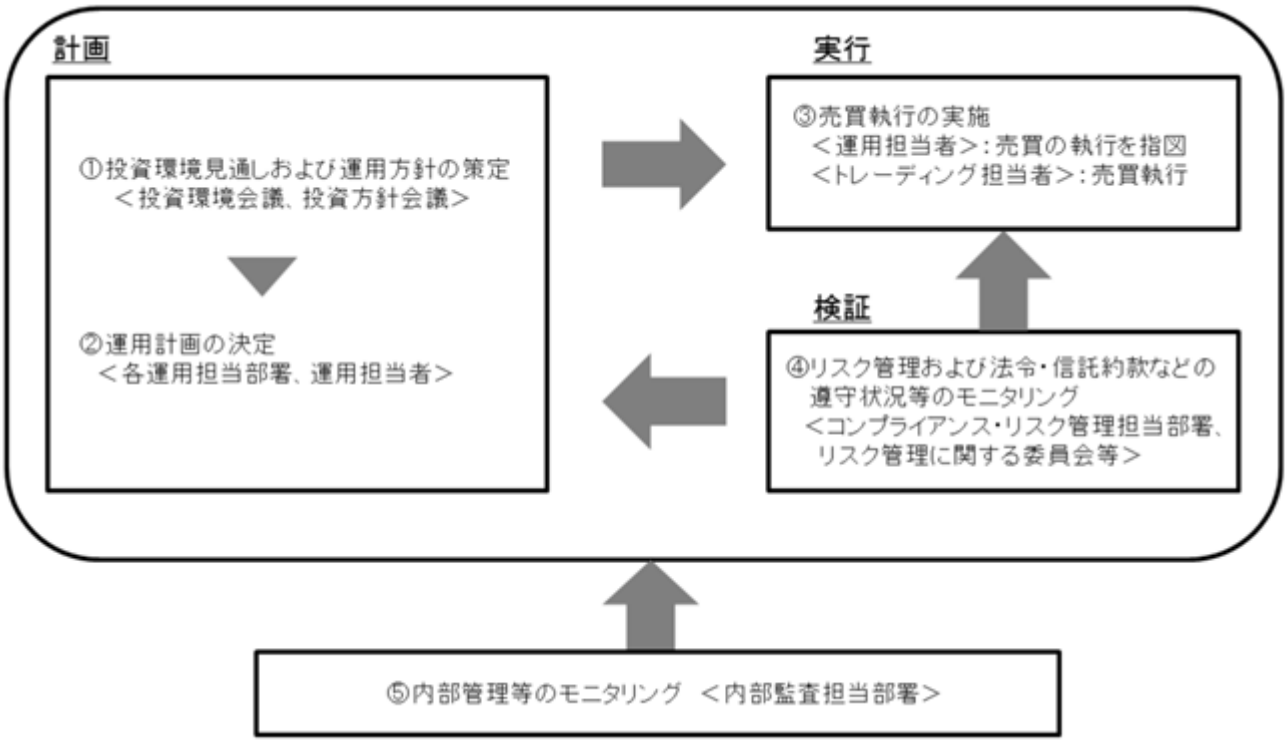
※運用プロセスは2022年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

※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7月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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

③ 売買執行の実施

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

④ モニタリング

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

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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2022年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

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

１．分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

２．分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

３．上記２．にかかわらず、上記２．にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。

４．留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

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

１．分配金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

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

（５）【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

ａ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ｂ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ｃ．公社債の借り入れ

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

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

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

（ニ）借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

ｄ．同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

ｅ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ｆ．外国為替予約の指図

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

ｇ．資金の借り入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

ｈ．受託者の自己または利害関係人等との取引

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

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

ｉ．デリバティブ取引等に係る投資制限

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

ｊ．信用リスク集中回避のための投資制限

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

ｋ．ファンドの投資制限

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

ａ．資産配分リスク

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

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

ｂ．株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

ｃ．ＲＥＩＴの価格変動リスク

ＲＥＩＴの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

ｄ．為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

ｅ．カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

ｆ．金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

ｇ．信用リスク

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

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

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

ｈ．流動性リスク

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

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

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

ｉ．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

（ロ）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生じた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、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。

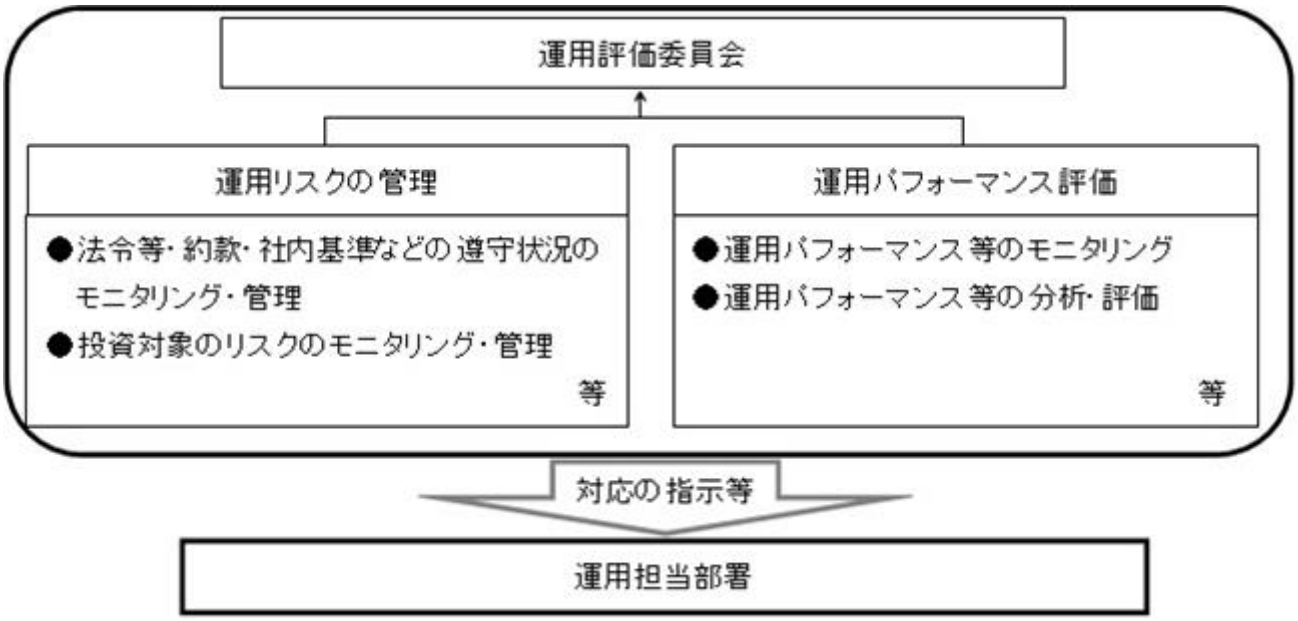
（２）リスク管理体制

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。



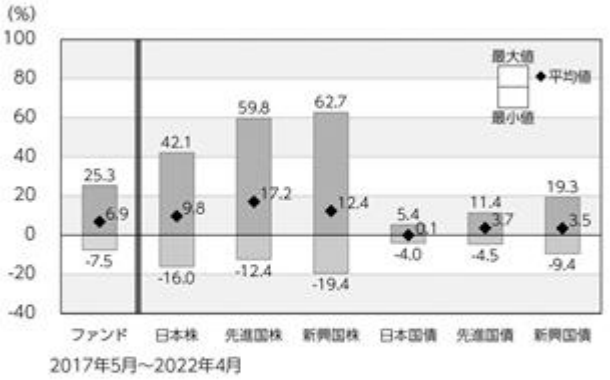
・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は2022年4月28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



2017年5月～2022年4月

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

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時から午後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」※1または「償還前乗り換え」※2によりファンドの受益権を取得する場合、申込手数料の優遇を受けることができる場合があります。

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

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

ａ．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

ｂ．信託財産留保額

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

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

（３）【信託報酬等】

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①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。

②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。

③損益通算について

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

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

ＮＩＳＡおよびジュニアＮＩＳＡは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご留意ください。

○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、2022年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

①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。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③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、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2022年4月28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		618,347,700	13.46
	内　ケイマン諸島	618,347,700	13.46
親投資信託受益証券		3,860,444,538	84.03
	内　日本	3,860,444,538	84.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		115,605,824	2.52
純資産総額		4,594,398,062	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

2022年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		1,703,507,170	95.64
	内　日本	1,703,507,170	95.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		77,598,262	4.36
純資産総額		1,781,105,432	100.00

その他資産の投資状況

2022年4月28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）		76,120,000	4.27
	内　日本	76,120,000	4.27

（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

2022年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		8,643,881,600	81.22
	内　日本	8,643,881,600	81.22
地方債証券		745,367,350	7.00
	内　日本	745,367,350	7.00
特殊債券		718,901,000	6.76
	内　日本	718,901,000	6.76
社債券		503,991,000	4.74
	内　日本	503,991,000	4.74
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		29,887,006	0.28
純資産総額		10,642,027,956	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

2022年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		96,978,302,850	97.15
	内　日本	96,978,302,850	97.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,844,261,819	2.85
純資産総額		99,822,564,669	100.00

その他資産の投資状況

2022年4月28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）		2,723,922,000	2.73
	内　日本	2,723,922,000	2.73

（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

2022年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		1,617,697,844	89.09
	内　アメリカ	1,138,334,609	62.69
	内　イギリス	71,058,457	3.91
	内　カナダ	64,785,390	3.57
	内　スイス	55,775,619	3.07
	内　フランス	50,406,362	2.78
	内　ドイツ	38,354,441	2.11
	内　オーストラリア	36,431,897	2.01
	内　アイルランド	30,401,162	1.67
	内　オランダ	28,425,726	1.57
	内　スウェーデン	15,861,077	0.87
	内　デンマーク	13,319,889	0.73
	内　スペイン	11,702,946	0.64
	内　香港	10,713,832	0.59
	内　イタリア	8,481,403	0.47
	内　ジャージィー	6,471,990	0.36
	内　フィンランド	6,057,044	0.33
	内　シンガポール	5,734,198	0.32
	内　ベルギー	4,212,963	0.23
	内　イスラエル	3,692,861	0.20
	内　ノルウェー	3,619,420	0.20
	内　バミューダ	2,999,077	0.17
	内　ケイマン諸島	2,796,812	0.15
	内　オランダ領キュラソー	1,765,749	0.10
	内　ルクセンブルグ	1,670,144	0.09
	内　ニュージーランド	1,393,329	0.08
	内　オーストリア	1,016,654	0.06
	内　ポルトガル	841,032	0.05
	内　リベリア	553,891	0.03
	内　パナマ	457,664	0.03
	内　マン島	362,206	0.02

新株予約権証券		36,967	0.00
	内　スイス	36,967	0.00
投資信託受益証券		2,985,935	0.16
	内　オーストラリア	2,253,162	0.12
	内　シンガポール	732,773	0.04
投資証券		39,861,608	2.20
	内　アメリカ	37,522,600	2.07
	内　イギリス	1,023,303	0.06
	内　香港	669,778	0.04
	内　フランス	558,672	0.03
	内　カナダ	87,255	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		155,174,239	8.55
純資産総額		1,815,756,593	100.00

その他資産の投資状況

2022年4月28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）		149,511,446	8.23
	内　アメリカ	107,733,403	5.93
	内　ドイツ	29,811,968	1.64
	内　イギリス	11,966,075	0.66

（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

2022年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		14,743,480,779	98.86
	内　アメリカ	6,798,643,491	45.59
	内　フランス	2,982,132,640	20.00
	内　イタリア	2,258,149,860	15.14
	内　ドイツ	1,296,371,963	8.69
	内　カナダ	734,393,278	4.92
	内　イギリス	673,789,547	4.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		169,377,872	1.14
純資産総額		14,912,858,651	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

2022年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		662,058,011	99.27
	内　アメリカ	662,058,011	99.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,865,514	0.73
純資産総額		666,923,525	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2022年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	232,387,351	2.9758 691,538,280	2.8699 666,928,458	－ －	14.52
2	新光外国株式インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	167,683,133	4.1985 704,034,402	3.9238 657,955,077	－ －	14.32
3	海外国債マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	248,248,155	2.6195 650,310,866	2.5887 642,639,998	－ －	13.99
4	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	235,894,003	2.7359 645,405,992	2.7135 640,098,377	－ －	13.93
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	503,038,704	1.2595 633,627,551	1.2623 634,985,756	－ －	13.82
6	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド ケイマン諸島	投資信託受益証券	344,100	1,833.0000 630,735,300	1,797.0000 618,347,700	－ －	13.46
7	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	277,479,957	2.2188 615,700,276	2.2266 617,836,872	－ －	13.45

（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

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	13.46
親投資信託受益証券	84.03
合計	97.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2022年4月28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	33,000	2,386.78 78,763,808	2,235.50 73,771,500	－ －	4.14

2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	4,200	14,058.31 59,044,942	11,220.00 47,124,000	－ －	2.65
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	600	62,160.00 37,296,000	52,850.00 31,710,000	－ －	1.78
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	40,800	707.93 28,883,873	754.30 30,775,440	－ －	1.73
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	7,100	3,292.22 23,374,788	3,847.00 27,313,700	－ －	1.53
6	任天堂 日本	株式 その他製品	400	51,920.00 20,768,000	59,910.00 23,964,000	－ －	1.35
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	4,900	6,026.29 29,528,822	4,818.00 23,608,200	－ －	1.33
8	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	400	65,220.00 26,088,000	55,480.00 22,192,000	－ －	1.25
9	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	4,000	5,478.66 21,914,669	5,269.00 21,076,000	－ －	1.18
10	三菱商事 日本	株式 卸売業	4,800	3,915.55 18,794,650	4,383.00 21,038,400	－ －	1.18
11	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	4,800	3,573.38 17,152,257	4,335.00 20,808,000	－ －	1.17
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	5,300	3,352.55 17,768,560	3,769.00 19,975,700	－ －	1.12
13	信越化学工業 日本	株式 化学	1,100	19,400.00 21,340,000	17,985.00 19,783,500	－ －	1.11
14	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,200	6,861.00 21,955,200	6,072.00 19,430,400	－ －	1.09
15	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	5,200	3,474.10 18,065,355	3,419.00 17,778,800	－ －	1.00
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	4,500	4,297.90 19,340,569	3,915.00 17,617,500	－ －	0.99
17	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	4,400	3,497.00 15,386,800	3,932.00 17,300,800	－ －	0.97
18	第一三共 日本	株式 医薬品	5,200	2,652.96 13,795,426	3,262.00 16,962,400	－ －	0.95
19	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	1,300	15,235.00 19,805,500	12,990.00 16,887,000	－ －	0.95
20	ダイキン工業 日本	株式 機械	800	25,300.00 20,240,000	20,045.00 16,036,000	－ －	0.90
21	三井物産 日本	株式 卸売業	5,000	2,856.50 14,282,500	3,150.00 15,750,000	－ －	0.88

22	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	10,000	1,448.05 14,480,547	1,515.00 15,150,000	－ －	0.85
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,900	9,063.00 17,219,700	7,794.00 14,808,600	－ －	0.83
24	日本電産 日本	株式 電気機器	1,700	12,200.00 20,740,000	8,539.00 14,516,300	－ －	0.82
25	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	2,500	5,161.00 12,902,500	5,718.00 14,295,000	－ －	0.80
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	2,000	6,995.00 13,990,000	7,019.00 14,038,000	－ －	0.79
27	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	700	18,440.00 12,908,000	19,775.00 13,842,500	－ －	0.78
28	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	8,300	1,597.17 13,256,556	1,578.50 13,101,550	－ －	0.74
29	ＳＭＣ 日本	株式 機械	200	68,330.00 13,666,000	63,050.00 12,610,000	－ －	0.71
30	ファナック 日本	株式 電気機器	600	22,424.64 13,454,789	20,165.00 12,099,000	－ －	0.68

（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

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.64
合計	95.64

（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

2022年4月28日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	16.65
情報・通信業		8.25
輸送用機器		8.07
化学		6.33
卸売業		5.73
銀行業		5.21
サービス業		5.20
医薬品		5.13
機械		5.02
小売業		4.09
食料品		3.23
陸運業		2.95
その他製品		2.44
精密機器		2.42
保険業		2.10
建設業		2.08
不動産業		1.87

電気・ガス業	1.17
その他金融業	1.10
鉄鋼	0.77
非鉄金属	0.74
証券、商品先物取引業	0.74
ガラス・土石製品	0.68
ゴム製品	0.64
海運業	0.54
金属製品	0.53
石油・石炭製品	0.45
繊維製品	0.39
空運業	0.39
鉱業	0.31
パルプ・紙	0.20
倉庫・運輸関連業	0.15
水産・農林業	0.08
合計	95.64

（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

2022年4月28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	１４６回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	190,000,000	100.79 191,510,400	100.49 190,932,900	0.1 2025/12/20	1.79
2	３４０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	160,000,000	101.92 163,078,000	101.49 162,385,600	0.4 2025/9/20	1.53
3	１４７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	140,000,000	100.42 140,598,400	100.13 140,190,400	0.005 2026/3/20	1.32
4	１３８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	120,000,000	100.42 120,507,000	100.28 120,343,200	0.1 2023/12/20	1.13
5	３５１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	120,000,000	101.22 121,464,000	100.21 120,255,600	0.1 2028/6/20	1.13
6	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	116.74 116,740,000	114.25 114,252,000	2.1 2029/12/28	1.07
7	１８回　東京都公募公債２０年 日本	地方債証券	100,000,000	115.93 115,938,000	113.78 113,787,000	2.22 2029/3/19	1.07
8	３３２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	110,000,000	101.31 111,451,500	101.10 111,215,500	0.6 2023/12/20	1.05
9	３５３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	110,000,000	101.28 111,414,700	100.06 110,071,500	0.1 2028/12/20	1.03

10	３６回　東日本旅客鉄道社債 日本	社債券	100,000,000	106.31 106,313,000	105.29 105,291,000	2.11 2024/12/20	0.99
11	１２回　兵庫県公募公債　１５年 日本	地方債証券	100,000,000	106.21 106,214,000	104.12 104,122,000	0.781 2030/12/6	0.98
12	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	101.72 101,722,000	101.50 101,503,000	0.484 2025/6/30	0.95
13	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	101.49 101,499,000	101.25 101,251,000	0.645 2024/3/15	0.95
14	４回　第一三共社債 日本	社債券	100,000,000	101.40 101,402,000	101.03 101,037,000	0.846 2023/9/15	0.95
15	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	101.43 101,432,000	101.02 101,022,000	0.882 2023/6/16	0.95
16	１６９回　共同発行市場公募地方債 日本	地方債証券	100,000,000	101.03 101,034,000	100.59 100,592,000	0.205 2027/4/23	0.95
17	２１８回　神奈川県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	100.78 100,780,000	100.53 100,530,000	0.195 2025/12/19	0.94
18	２５０回　住宅金融支援機構 日本	特殊債券	100,000,000	101.50 101,501,000	100.49 100,497,000	0.289 2028/11/20	0.94
19	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	100.95 100,954,000	100.43 100,438,000	0.17 2027/10/29	0.94
20	３４９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	100,000,000	101.16 101,162,000	100.36 100,365,000	0.1 2027/12/20	0.94
21	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	100,000,000	101.24 101,246,000	100.29 100,293,000	0.1 2028/3/20	0.94
22	５０回　西日本高速道路債券 日本	社債券	100,000,000	100.00 100,000,000	99.99 99,991,000	0.04 2024/6/20	0.94
23	１１回　ブリヂストン社債 日本	社債券	100,000,000	100.56 100,560,000	99.98 99,988,000	0.295 2027/4/21	0.94
24	８７回　中日本高速道路債券 日本	特殊債券	100,000,000	99.87 99,879,000	99.93 99,938,000	0.06 2026/3/18	0.94
25	１９０回　大阪府公募公債　５年 日本	地方債証券	100,000,000	99.66 99,668,000	99.70 99,700,000	0.001 2026/12/25	0.94
26	令和３年度１１回　愛知県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	100.34 100,340,000	98.48 98,481,000	0.145 2031/10/29	0.93
27	４９４回　九州電力社債 日本	社債券	100,000,000	99.81 99,815,000	97.68 97,684,000	0.31 2031/5/23	0.92

28	１４７回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	80,000,000	117.14 93,714,400	114.42 91,538,400	1.6 2033/12/20	0.86
29	３３５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	90,000,000	101.77 91,599,300	101.31 91,182,600	0.5 2024/9/20	0.86
30	１４９回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	80,000,000	116.32 93,063,600	113.51 90,814,400	1.5 2034/6/20	0.85

（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

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	81.22
地方債証券	7.00
特殊債券	6.76
社債券	4.74
合計	99.72

（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

2022年4月28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	10,337	736,080.20 7,608,861,130	674,000.00 6,967,138,000	－ －	6.98
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	8,866	706,185.54 6,261,041,022	629,000.00 5,576,714,000	－ －	5.59
3	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	14,506	376,010.63 5,454,410,315	360,500.00 5,229,413,000	－ －	5.24
4	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	28,716	187,089.66 5,372,466,958	175,800.00 5,048,272,800	－ －	5.06
5	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	28,672	170,652.08 4,892,936,713	163,000.00 4,673,536,000	－ －	4.68
6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	44,736	107,887.66 4,826,462,755	103,300.00 4,621,228,800	－ －	4.63
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	13,313	329,374.97 4,384,968,999	315,000.00 4,193,595,000	－ －	4.20
8	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	8,865	372,103.83 3,298,700,468	356,500.00 3,160,372,500	－ －	3.17
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	17,666	189,938.99 3,355,462,319	175,300.00 3,096,849,800	－ －	3.10

10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	19,960	143,218.66 2,858,644,602	142,100.00 2,836,316,000	－ －	2.84
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	6,059	412,215.31 2,497,612,613	394,500.00 2,390,275,500	－ －	2.39
12	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	12,587	206,213.33 2,595,607,297	186,700.00 2,349,992,900	－ －	2.35
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	26,914	92,894.55 2,500,164,117	76,200.00 2,050,846,800	－ －	2.05
14	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	3,062	633,816.75 1,940,746,905	639,000.00 1,956,618,000	－ －	1.96
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	4,725	456,451.99 2,156,735,659	414,000.00 1,956,150,000	－ －	1.96
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	3,493	591,379.15 2,065,687,403	558,000.00 1,949,094,000	－ －	1.95
17	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	10,854	189,913.24 2,061,318,316	175,800.00 1,908,133,200	－ －	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	5,978	336,077.32 2,009,070,274	318,000.00 1,901,004,000	－ －	1.90
19	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	2,743	724,693.40 1,987,834,005	681,000.00 1,867,983,000	－ －	1.87
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	27,163	66,630.19 1,809,876,080	66,100.00 1,795,474,300	－ －	1.80
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	39,025	43,016.61 1,678,723,548	42,450.00 1,656,611,250	－ －	1.66
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	3,108	507,741.80 1,578,061,541	503,000.00 1,563,324,000	－ －	1.57
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	10,427	154,302.37 1,608,910,872	149,500.00 1,558,836,500	－ －	1.56
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	10,426	152,195.68 1,586,792,183	147,700.00 1,539,920,200	－ －	1.54
25	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,874	739,744.50 1,386,281,207	736,000.00 1,379,264,000	－ －	1.38
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	11,981	113,456.39 1,359,321,083	114,700.00 1,374,220,700	－ －	1.38
27	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	4,125	332,907.53 1,373,243,567	324,000.00 1,336,500,000	－ －	1.34
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	8,271	176,203.01 1,457,375,128	161,400.00 1,334,939,400	－ －	1.34

29	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	6,344	215,989.68 1,370,238,570	209,600.00 1,329,702,400	－ －	1.33
30	ＮＴＴ都市開発リート投資法人 日本	投資証券	8,499	154,650.09 1,314,371,144	150,100.00 1,275,699,900	－ －	1.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.15
合計	97.15

（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

2022年4月28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	4,149	19,433.37 80,629,079	20,175.61 83,708,606	－ －	4.61
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,806	43,290.51 78,182,673	36,495.72 65,911,286	－ －	3.63
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	115	460,832.99 52,995,794	356,083.99 40,949,659	－ －	2.26
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	216	131,888.20 28,487,853	113,591.37 24,535,737	－ －	1.35
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	76	383,792.75 29,168,249	294,559.77 22,386,543	－ －	1.23
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	72	384,643.22 27,694,312	296,430.81 21,343,019	－ －	1.18

7	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	237	59,836.13 14,181,165	66,209.55 15,691,664	－ －	0.86
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	668	20,941.03 13,988,613	23,465.40 15,674,891	－ －	0.86
9	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	632	39,504.60 24,966,913	23,729.56 14,997,087	－ －	0.83
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	330	36,899.06 12,176,690	42,469.67 14,014,994	－ －	0.77
11	META PLATFORMS 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	598	43,215.77 25,843,035	22,544.05 13,481,346	－ －	0.74
12	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	617	18,734.95 11,559,467	20,535.12 12,670,174	－ －	0.70
13	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	716	16,341.38 11,700,430	16,639.07 11,913,581	－ －	0.66
14	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	747	21,620.12 16,150,237	15,646.18 11,687,697	－ －	0.64
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,071	8,551.14 9,158,281	10,906.70 11,681,086	－ －	0.64
16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	423	27,497.43 11,631,415	27,590.21 11,670,660	－ －	0.64
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	222	44,411.59 9,859,374	46,591.90 10,343,404	－ －	0.57
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	263	47,761.95 12,561,395	38,864.17 10,221,278	－ －	0.56
19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	488	14,947.75 7,294,506	20,133.08 9,824,946	－ －	0.54

20	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	450	14,897.50 6,703,877	20,310.91 9,139,910	－ －	0.50
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	1,418	6,095.07 8,642,820	6,409.49 9,088,665	－ －	0.50
22	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	1,043	7,279.30 7,592,311	8,448.06 8,811,328	－ －	0.49
23	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,866	6,040.95 11,272,425	4,671.17 8,716,412	－ －	0.48
24	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	179	48,794.23 8,734,168	48,408.82 8,665,179	－ －	0.48
25	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	112	65,552.36 7,341,865	71,398.74 7,996,659	－ －	0.44
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	351	21,069.89 7,395,534	22,531.17 7,908,441	－ －	0.44
27	WALMART INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	387	19,301.93 7,469,850	19,875.36 7,691,766	－ －	0.42
28	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	105	71,878.10 7,547,201	72,102.32 7,570,744	－ －	0.42
29	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	105	99,386.80 10,435,615	71,813.31 7,540,398	－ －	0.42
30	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	205	33,763.89 6,921,598	36,736.69 7,531,022	－ －	0.41

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
株式	89.09
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.16
投資証券	2.20
合計	91.45

（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

2022年4月28日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	6.58
銀行		5.35
医薬品		4.97

コンピュータ・周辺機器	4.85
石油・ガス・消耗燃料	4.12
半導体・半導体製造装置	4.06
情報技術サービス	3.53
インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.41
保険	2.93
資本市場	2.86
インターネット販売・通信販売	2.56
ヘルスケア機器・用品	2.23
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	2.19
化学	1.96
自動車	1.93
電力	1.76
バイオテクノロジー	1.73
飲料	1.70
ホテル・レストラン・レジャー	1.66
金属・鉱業	1.59
食品	1.55
食品・生活必需品小売り	1.52
機械	1.50
専門小売り	1.49
航空宇宙・防衛	1.41
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.27
繊維・アパレル・贅沢品	1.20
各種電気通信サービス	1.15
家庭用品	1.14
陸運・鉄道	1.04
各種金融サービス	1.00
娯楽	0.99
コングロマリット	0.91
総合公益事業	0.87
メディア	0.82
電気設備	0.73
タバコ	0.69
専門サービス	0.64
通信機器	0.62
航空貨物・物流サービス	0.53
電子装置・機器・部品	0.51
複合小売り	0.50
パーソナル用品	0.49
建設関連製品	0.49
商業サービス・用品	0.44
消費者金融	0.43
不動産管理・開発	0.37
商社・流通業	0.32
無線通信サービス	0.28
家庭用耐久財	0.26
容器・包装	0.26
エネルギー設備・サービス	0.22
建設資材	0.22

建設・土木	0.19
自動車部品	0.17
運送インフラ	0.13
ガス	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
紙製品・林産品	0.11
水道	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
販売	0.09
海運業	0.07
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	89.09

（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

2022年4月28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 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	2,577,200,000	96.21 2,479,625,799	91.97 2,370,419,954	1.875 2032/2/15	15.90
2	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,404,574,000	96.35 1,353,310,020	87.96 1,235,476,450	1.375 2031/11/15	8.28
3	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,237,056,000	100.65 1,245,125,844	90.52 1,119,825,607	1.625 2031/5/15	7.51
4	FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス	国債証券	842,146,000	106.20 894,385,810	98.90 832,943,028	0.75 2028/11/25	5.59
5	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証券	747,065,000	121.90 910,739,470	109.56 818,544,926	3.5 2030/3/1	5.49
6	ITALY BTPS 0.6 08/01/31 イタリア	国債証券	679,150,000	96.42 654,880,430	84.43 573,443,241	0.6 2031/8/1	3.85
7	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	657,186,000	97.02 637,621,572	87.22 573,240,753	1.25 2031/8/15	3.84
8	US T N/B 0.125 04/30/23 アメリカ	国債証券	554,098,000	98.20 544,141,552	98.11 543,665,370	0.125 2023/4/30	3.65
9	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	644,300,000	92.61 596,707,369	83.84 540,205,281	0.625 2030/8/15	3.62
10	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	407,490,000	142.19 579,430,812	130.90 533,416,227	5.5 2029/4/25	3.58
11	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証券	451,010,000	101.20 456,453,829	92.19 415,810,076	1.625 2029/8/15	2.79
12	FRANCE OAT 0.0 11/25/29 フランス	国債証券	448,239,000	100.11 448,766,577	92.43 414,309,100	－ 2029/11/25	2.78
13	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	407,490,000	104.29 425,003,512	96.68 393,998,821	0.5 2029/5/25	2.64
14	ITALY BTPS 0.95 08/01/30 イタリア	国債証券	407,490,000	100.66 410,179,434	89.57 364,988,793	0.95 2030/8/1	2.45

15	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 ドイツ	国債証券	366,741,000	101.92 373,797,096	93.74 343,790,348	－ 2031/2/15	2.31
16	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 ドイツ	国債証券	230,911,000	155.02 357,974,395	141.97 327,847,437	6.25 2030/1/4	2.20
17	CANADA 1.5 06/01/31 カナダ	国債証券	361,620,000	97.86 353,913,124	89.68 324,327,937	1.5 2031/6/1	2.17
18	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 ドイツ	国債証券	339,575,000	97.42 330,829,585	92.39 313,735,040	－ 2032/2/15	2.10
19	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 ドイツ	国債証券	334,141,800	102.94 343,972,686	93.07 310,999,138	－ 2031/8/15	2.09
20	FRANCE OAT 0.0 11/25/31 フランス	国債証券	346,366,500	97.90 339,115,351	88.70 307,238,861	－ 2031/11/25	2.06
21	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	271,660,000	121.54 330,187,788	111.24 302,206,700	2.5 2030/5/25	2.03
22	UK TREASURY 4.75 12/07/30 イギリス	国債証券	242,310,000	132.58 321,276,405	124.28 301,152,075	4.75 2030/12/7	2.02
23	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	271,660,000	117.21 318,412,686	105.75 287,299,737	3 2029/8/1	1.93
24	UK TREASURY 0.25 07/31/31 イギリス	国債証券	290,772,000	92.74 269,678,429	86.76 252,302,864	0.25 2031/7/31	1.69
25	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証券	203,745,000	115.02 234,352,660	104.97 213,873,163	2.8 2028/12/1	1.43
26	CANADA 2.25 06/01/29 カナダ	国債証券	140,630,000	104.70 147,245,235	97.13 136,605,872	2.25 2029/6/1	0.92
27	CANADA 0.5 12/01/30 カナダ	国債証券	130,585,000	90.00 117,536,293	82.60 107,872,612	0.5 2030/12/1	0.72
28	FRANCE OAT 0.75 05/25/52 フランス	国債証券	135,830,000	92.93 126,230,893	76.29 103,631,093	0.75 2052/5/25	0.69
29	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	95,081,000	106.08 100,870,482	99.27 94,388,810	0.75 2028/5/25	0.63
30	CANADA 1.5 12/01/31 カナダ	国債証券	105,472,500	94.12 99,281,264	89.11 93,991,080	1.5 2031/12/1	0.63

（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

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.86
合計	98.86

（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

2022年4月28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	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	2,515	18,000.88 45,272,222	21,605.95 54,338,979	－ －	8.15

2	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券	1,540	35,080.63 54,024,177	32,582.25 50,176,666	－ －	7.52
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	1,470	22,323.33 32,815,296	24,321.03 35,751,923	－ －	5.36
4	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	305	100,303.91 30,592,695	92,508.59 28,215,121	－ －	4.23
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	514	41,591.53 21,378,051	50,433.22 25,922,678	－ －	3.89
6	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	957	19,311.53 18,481,142	19,102.20 18,280,811	－ －	2.74
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	1,484	10,850.63 16,102,339	12,014.90 17,830,121	－ －	2.67
8	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	1,928	8,763.98 16,896,955	9,234.10 17,803,359	－ －	2.67
9	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	1,112	18,408.60 20,470,367	15,737.67 17,500,291	－ －	2.62
10	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証券	369	42,836.49 15,806,668	44,955.38 16,588,538	－ －	2.49
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	475	29,521.92 14,022,912	31,026.90 14,737,782	－ －	2.21
12	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	1,256	10,847.47 13,624,434	11,093.55 13,933,508	－ －	2.09
13	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	568	26,095.06 14,821,999	24,145.78 13,714,806	－ －	2.06
14	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証券	2,554	4,747.51 12,125,159	5,265.21 13,447,370	－ －	2.02
15	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	447	23,734.52 10,609,333	26,284.86 11,749,333	－ －	1.76
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	2,034	5,189.80 10,556,059	5,374.75 10,932,242	－ －	1.64
17	MID AMERICA アメリカ	投資証券	393	25,453.32 10,003,155	26,090.28 10,253,481	－ －	1.54
18	VENTAS INC アメリカ	投資証券	1,358	7,202.65 9,781,211	7,377.23 10,018,285	－ －	1.50
19	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	1,296	6,957.02 9,016,305	7,631.08 9,889,891	－ －	1.48
20	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	221	42,593.59 9,413,184	44,064.96 9,738,357	－ －	1.46
21	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	390	25,269.06 9,854,934	23,361.02 9,110,801	－ －	1.37
22	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	532	14,992.15 7,975,829	15,751.84 8,379,982	－ －	1.26
23	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,144	3,852.40 8,259,551	3,810.38 8,169,476	－ －	1.22
24	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	1,837	4,438.53 8,153,588	4,351.60 7,993,893	－ －	1.20
25	UDR INC アメリカ	投資証券	1,079	6,987.40 7,539,414	7,211.00 7,780,675	－ －	1.17

26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	337	20,156.03 6,792,583	20,837.94 7,022,389	－ －	1.05
27	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	644	9,890.41 6,369,429	10,830.68 6,974,959	－ －	1.05
28	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	976	5,805.65 5,666,316	7,012.56 6,844,259	－ －	1.03
29	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	2,409	2,141.18 5,158,112	2,713.79 6,537,523	－ －	0.98
30	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	1,980	2,923.63 5,788,795	3,252.42 6,439,804	－ －	0.97

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	99.27
合計	99.27

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）
ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

新光日本債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド
該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

海外国債マザーファンド
該当事項はありません。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド

2022年4月28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　０４０６月	買建	4	77,781,320	76,120,000	4.27

（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

2022年4月28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　０４０６月	買建	1,382	2,574,956,220	2,723,922,000	2.73

（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

2022年4月28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 Jun22	買建	4	108,052,975	107,733,403	5.93
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun22	買建	6	30,669,734	29,811,968	1.64
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun22	買建	1	11,528,302	11,966,075	0.66

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

海外国債マザーファンド
該当事項はありません。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2022年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第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
第31特定期間末 (2022年4月20日)	4,727	4,736	1.0747	1.0767
2021年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	－
11月末日	4,618	－	1.0457	－
12月末日	4,739	－	1.0748	－
2022年1月末日	4,576	－	1.0274	－
2月末日	4,486	－	1.0109	－
3月末日	4,681	－	1.0601	－

4月末日	4,594	－	1.0529	－

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
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
第31特定期間	0.0120

③【収益率の推移】

	収益率（%）
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
第31特定期間	1.9

（注1）収益率は期間騰落率です。
（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

（４）【設定及び解約の実績】

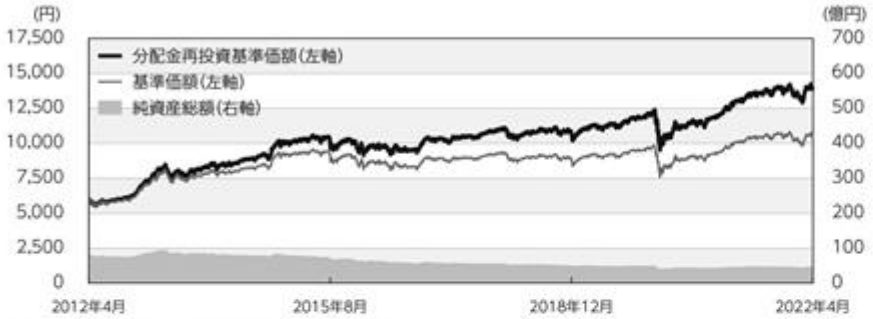
	設定口数	解約口数
第12特定期間	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	22,407,208	820,891,392
第15特定期間	25,208,228	996,341,985
第16特定期間	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	13,815,643	989,033,927
第18特定期間	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	5,348,676	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
第31特定期間	59,835,363	115,612,488

（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:2022年4月28日

基準価額・純資産の推移 〈2012年4月27日～2022年4月28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12月	20円
2022年 1月	20円
2022年 2月	20円
2022年 3月	20円
2022年 4月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	4,760円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	新光米国REITマザーファンド	14.52
2	新光外国株式インデックスマザーファンド	14.32
3	海外国債マザーファンド	13.99
4	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド	13.93
5	新光日本債券インデックスマザーファンド	13.82
6	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド	13.46
7	新光J-REITマザーファンド	13.45

■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	4.14
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.65
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.73
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.53

■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	146回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/12/20	1.79
2	340回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	1.53
3	147回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/3/20	1.32
4	138回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2023/12/20	1.13
5	351回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/6/20	1.13

■新光J-REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.98
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.59
3	日本プロロジスリート投資法人	日本	5.24
4	GLP投資法人	日本	5.06
5	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.68

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2022年4月28日

■新光外国株式インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.61
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.63
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.26
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.35
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	1.23

■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 1.875 02/15/32	国債証券	アメリカ	1.875	2032/2/15	15.90
2	US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	アメリカ	1.375	2031/11/15	8.28
3	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	7.51
4	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	フランス	0.75	2028/11/25	5.59
5	ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	イタリア	3.5	2030/3/1	5.49

■フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド(現地2022年4月14日現在)

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

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

①組入公社債の上位5通貨

順位	通貨	比率(%)
1	米ドル	49.8
2	メキシコペソ	6.3
3	コロンビアペソ	5.9
4	ウルグアイペソ	4.4
5	ユーロ	4.3

②組入公社債の上位5ヵ国

順位	国/地域	比率(%)
1	メキシコ	8.7
2	南アフリカ	7.7
3	その他	6.5
4	コロンビア	5.9
5	カザフスタン	5.3

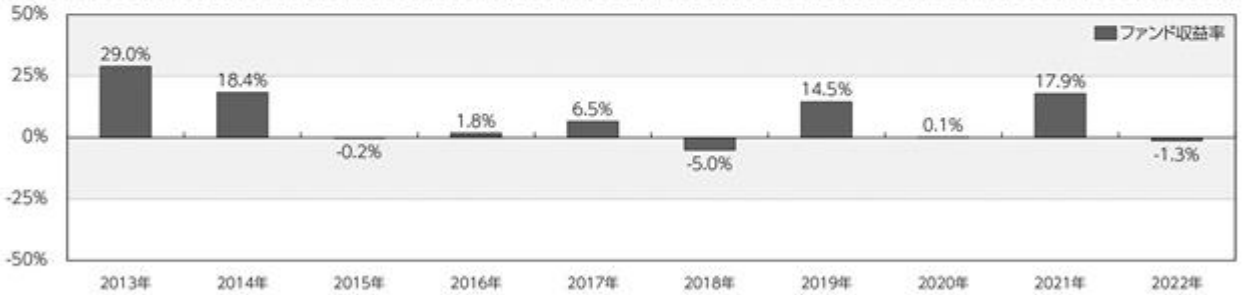
■新光米国REITマザーファンド

※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	PROLOGIS INC	アメリカ	8.15
2	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	7.52
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	アメリカ	5.36
4	EQUINIX INC	アメリカ	4.23
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.89

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。

※2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

２【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時から午後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、受益者の一部解約の実行の請求受付日から起算して、原則として、５営業日目から販売会社において受益者に支払われます。ただし、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

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

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

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

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター　0120-104-694

（受付時間は営業日の午前９時から午後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たときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

（５）【その他】

ａ．信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

（ハ）上記（ロ）の投資信託契約の解約にかかる公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

（ニ）上記（ハ）の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、投資信託契約の解約をしません。

（ホ）委託者は、上記（ニ）の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

（ヘ）上記（ハ）から（ホ）までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記（ホ）の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

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

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

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

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

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

ｂ．投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

ｃ．異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

ｄ．運用報告書

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

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

ｅ．公告

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

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

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

ｆ．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

ｇ．信託事務処理の再信託

（イ）受託者は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について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す。）に委託することができるものとします。

１．投資信託財産の保存にかかる業務

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

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

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

ｉ．関係法人との契約の更改

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

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

４【受益者の権利等】

ａ．収益分配金請求権

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

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

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

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

ｂ．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2021年10月21日から2022年4月20日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【新光７資産バランスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2021年10月20日現在	当期 2022年4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	78,560,474	86,871,213
投資信託受益証券	642,648,600	630,735,300
親投資信託受益証券	4,041,573,431	4,022,533,272
流動資産合計	4,762,782,505	4,740,139,785
資産合計	4,762,782,505	4,740,139,785
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	8,909,668	8,798,114
未払解約金	537,705	－
未払受託者報酬	326,234	325,116
未払委託者報酬	3,547,874	3,535,741
その他未払費用	14,502	14,451
流動負債合計	13,335,983	12,673,422
負債合計	13,335,983	12,673,422
純資産の部		
元本等		
元本	4,454,834,209	4,399,057,084
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	294,612,313	328,409,279
（分配準備積立金）	529,851,600	544,719,180
元本等合計	4,749,446,522	4,727,466,363
純資産合計	4,749,446,522	4,727,466,363
負債純資産合計	4,762,782,505	4,740,139,785

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2021年4月21日 至　2021年10月20日	当期 自　2021年10月21日 至　2022年4月20日
営業収益		
受取配当金	52,038,000	57,438,000
有価証券売買等損益	296,342,939	56,726,541
営業収益合計	348,380,939	114,164,541
営業費用		
支払利息	7,343	5,933
受託者報酬	2,081,569	2,028,652
委託者報酬	22,637,461	22,062,126
その他費用	92,539	90,170
営業費用合計	24,818,912	24,186,881
営業利益又は営業損失（△）	323,562,027	89,977,660
経常利益又は経常損失（△）	323,562,027	89,977,660
当期純利益又は当期純損失（△）	323,562,027	89,977,660
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,557,804	△286,486
期首剰余金又は期首欠損金（△）	31,072,068	294,612,313
剰余金増加額又は欠損金減少額	791,388	1,436,807
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	791,388	1,436,807
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,849,178	4,889,689
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	4,889,689
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	54,406,188	53,014,298
期末剰余金又は期末欠損金（△）	294,612,313	328,409,279

（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10月21日 至　2022年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期 2021年10月20日現在	当期 2022年4月20日現在
１．　期首元本額	4,611,410,297円	4,454,834,209円
期中追加設定元本額	20,473,306円	59,835,363円
期中一部解約元本額	177,049,394円	115,612,488円
２．　受益権の総数	4,454,834,209口	4,399,057,084口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自　2021年4月21日 至　2021年10月20日	当期 自　2021年10月21日 至　2022年4月20日
１．　分配金の計算過程	（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。	（自2021年10月21日　至2021年11月22日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,348,916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（13,556,786円）及び分配準備積立金（525,182,707円）より分配対象収益は548,088,409円（1万口当たり1,241.06円）であり、うち8,832,515円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

		（自2021年5月21日　至2021年6月21日） 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。 （自2021年6月22日　至2021年7月20日） 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。 （自2021年7月21日　至2021年8月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。	（自2021年11月23日　至2021年12月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,836,443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（13,891,009円）及び分配準備積立金（525,041,629円）より分配対象収益は549,769,081円（1万口当たり1,245.63円）であり、うち8,827,133円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自2021年12月21日　至2022年1月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,410,717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（14,336,822円）及び分配準備積立金（525,590,280円）より分配対象収益は551,337,819円（1万口当たり1,251.54円）であり、うち8,810,505円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自2022年1月21日　至2022年2月21日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,458,051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（20,464,481円）及び分配準備積立金（527,394,232円）より分配対象収益は558,316,764円（1万口当たり1,255.12円）であり、うち8,896,577円（1万口当たり20円）を分配金額としております。	

	（自2021年8月21日　至2021年9月21日） 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。 （自2021年9月22日　至2021年10月20日） 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。	（自2022年2月22日　至2022年3月22日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,397,145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（20,571,968円）及び分配準備積立金（525,939,579円）より分配対象収益は563,908,692円（1万口当たり1,274.44円）であり、うち8,849,454円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自2022年3月23日　至2022年4月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（22,231,570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（20,555,123円）及び分配準備積立金（531,285,724円）より分配対象収益は574,072,417円（1万口当たり1,304.98円）であり、うち8,798,114円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自　2021年4月21日 至　2021年10月20日	当期 自　2021年10月21日 至　2022年4月20日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左

３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	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。運用評価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	前期 2021年10月20日現在	当期 2022年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期 2021年10月20日現在	当期 2022年4月20日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	6,596,100	34,708,200
親投資信託受益証券	99,146,679	158,685,966
合計	105,742,779	193,394,166

（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10月20日現在	当期 2022年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0661円 (10,661円)	1.0747円 (10,747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

2022年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド	344,100	630,735,300	
投資信託受益証券　合計		344,100	630,735,300	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	248,248,155	650,310,866	
	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド	235,894,003	645,405,992	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	167,683,133	704,034,402	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	503,038,704	633,627,551	
	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド	277,479,957	615,700,276	
	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド	259,914,707	773,454,185	
親投資信託受益証券　合計		1,692,258,659	4,022,533,272	
合計			4,653,268,572	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	46,030,861
株式	1,718,990,880
未収配当金	20,774,262
前払金	2,040,000
差入委託証拠金	2,295,000
流動資産合計	1,790,131,003
資産合計	1,790,131,003
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,605,990
未払解約金	10,000
流動負債合計	1,615,990
負債合計	1,615,990
純資産の部	
元本等	
元本	653,687,843
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,134,827,170
元本等合計	1,788,515,013
純資産合計	1,788,515,013
負債純資産合計	1,790,131,003

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10月21日 至　2022年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	889,961,797円
同期中追加設定元本額	48,188,911円
同期中一部解約元本額	284,462,865円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	235,894,003円
ニュー　トピックス　インデックス（変額年金）	49,526,567円
世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	310,038,504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）	12,631,076円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	20,241,096円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	8,387,332円
太陽財形株投　太陽一般財形　３０	4,445,785円
太陽財形株投　太陽一般財形　５０	11,714,515円
太陽財形株投　太陽年金・住宅財形　３０	808,965円
計	653,687,843円
２．　受益権の総数	653,687,843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10月21日 至　2022年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年4月20日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△55,656,202
合計	△55,656,202

（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（2022年1月15日から2022年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年4月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	59,025,000	－	57,420,000	△1,605,000
合計	59,025,000	－	57,420,000	△1,605,000

（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）

	2022年4月20日現在
1口当たり純資産額	2.7360円
（1万口当たり純資産額）	(27,360円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年4月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本水産	900	571.00	513,900	
マルハニチロ	200	2,404.00	480,800	
雪国まいたけ	100	1,116.00	111,600	
サカタのタネ	100	4,165.00	416,500	
ホクト	100	1,996.00	199,600	
ショーボンドホールディングス	100	5,400.00	540,000	
ミライト・ホールディングス	300	1,813.00	543,900	
タマホーム	100	2,485.00	248,500	
ＩＮＰＥＸ	3,400	1,651.00	5,613,400	
石油資源開発	100	2,680.00	268,000	
安藤・間	400	890.00	356,000	
東急建設	300	670.00	201,000	
コムシスホールディングス	300	2,667.00	800,100	
高松コンストラクショングループ	100	2,195.00	219,500	
ヤマウラ	100	925.00	92,500	
オリエンタル白石	400	233.00	93,200	
大成建設	600	3,545.00	2,127,000	
大林組	2,000	903.00	1,806,000	
清水建設	1,900	733.00	1,392,700	
飛島建設	100	1,020.00	102,000	
長谷工コーポレーション	600	1,407.00	844,200	

松井建設	100	654.00	65,400	
鹿島建設	1,500	1,475.00	2,212,500	
不動テトラ	100	1,536.00	153,600	
鉄建建設	100	1,818.00	181,800	
西松建設	100	3,875.00	387,500	
三井住友建設	500	423.00	211,500	
奥村組	100	3,035.00	303,500	
東鉄工業	100	2,162.00	216,200	
戸田建設	900	745.00	670,500	
熊谷組	100	2,710.00	271,000	
矢作建設工業	100	791.00	79,100	
日本ハウスホールディングス	200	454.00	90,800	
大東建託	200	12,470.00	2,494,000	
新日本建設	100	720.00	72,000	
東亜建設工業	100	2,919.00	291,900	
日本国土開発	300	538.00	161,400	
東洋建設	200	939.00	187,800	
五洋建設	800	634.00	507,200	
世紀東急工業	100	733.00	73,300	
住友林業	500	2,119.00	1,059,500	
巴コーポレーション	200	460.00	92,000	
大和ハウス工業	1,900	3,113.00	5,914,700	
ライト工業	100	1,941.00	194,100	
積水ハウス	2,200	2,253.50	4,957,700	
ユアテック	200	671.00	134,200	
日本リーテック	100	1,219.00	121,900	
中電工	100	2,068.00	206,800	
関電工	300	816.00	244,800	
きんでん	400	1,548.00	619,200	
東京エネシス	100	997.00	99,700	
住友電設	100	2,200.00	220,000	
日本電設工業	100	1,556.00	155,600	
エクシオグループ	300	2,151.00	645,300	
新日本空調	100	1,812.00	181,200	
九電工	200	2,883.00	576,600	
三機工業	100	1,423.00	142,300	
日揮ホールディングス	600	1,552.00	931,200	
ヤマト	100	771.00	77,100	
太平電業	100	2,687.00	268,700	
高砂熱学工業	200	1,685.00	337,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	200	1,679.00	335,800	
明星工業	200	690.00	138,000	
大氣社	100	3,155.00	315,500	
ダイダン	100	2,072.00	207,200	
日比谷総合設備	100	1,862.00	186,200	
ニップン	200	1,666.00	333,200	
日清製粉グループ本社	700	1,725.00	1,207,500	
昭和産業	100	2,584.00	258,400	
鳥越製粉	100	645.00	64,500	
中部飼料	100	1,009.00	100,900	

フィード・ワン	100	662.00	66,200	
日本甜菜製糖	100	1,636.00	163,600	
DM三井製糖ホールディングス	100	1,905.00	190,500	
ＬＩＦＵＬＬ	300	233.00	69,900	
ミクシィ	100	2,283.00	228,300	
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,859.00	185,900	
日本M&Aセンターホールディングス	1,000	1,692.00	1,692,000	
ＵＴグループ	100	2,957.00	295,700	
アイティメディア	100	1,737.00	173,700	
夢真ビーネックスグループ	200	1,728.00	345,600	
コシダカホールディングス	200	782.00	156,400	
パソナグループ	100	2,165.00	216,500	
リンクアンドモチベーション	200	481.00	96,200	
エス・エム・エス	200	3,345.00	669,000	
パーソルホールディングス	600	2,669.00	1,601,400	
クックパッド	300	277.00	83,100	
森永製菓	200	3,940.00	788,000	
江崎グリコ	200	3,675.00	735,000	
名糖産業	100	1,588.00	158,800	
井村屋グループ	100	2,236.00	223,600	
山崎製パン	500	1,575.00	787,500	
寿スピリッツ	100	6,740.00	674,000	
カルビー	300	2,315.00	694,500	
森永乳業	100	5,050.00	505,000	
六甲バター	100	1,490.00	149,000	
ヤクルト本社	500	6,540.00	3,270,000	
明治ホールディングス	400	6,390.00	2,556,000	
雪印メグミルク	200	1,951.00	390,200	
プリマハム	100	2,136.00	213,600	
日本ハム	200	4,110.00	822,000	
丸大食品	100	1,504.00	150,400	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	100	3,120.00	312,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	300	657.00	197,100	
システナ	900	414.00	372,600	
日鉄ソリューションズ	100	3,790.00	379,000	
綜合警備保障	200	3,580.00	716,000	
いちご	700	296.00	207,200	
日本駐車場開発	800	151.00	120,800	
コア	100	1,564.00	156,400	
カカクコム	500	2,623.00	1,311,500	
ルネサンス	100	936.00	93,600	
ディップ	100	4,055.00	405,500	
ＳＢＳホールディングス	100	3,050.00	305,000	
デジタルホールディングス	100	1,421.00	142,100	
新日本科学	100	1,553.00	155,300	
ベネフィット・ワン	200	2,212.00	442,400	
エムスリー	1,100	4,467.00	4,913,700	
アウトソーシング	400	1,247.00	498,800	
ウェルネット	200	500.00	100,000	
ディー・エヌ・エー	200	1,956.00	391,200	

博報堂ＤＹホールディングス	900	1,544.00	1,389,600	
ぐるなび	100	433.00	43,300	
ファンコミュニケーションズ	200	436.00	87,200	
エスプール	200	1,336.00	267,200	
アドウェイズ	100	804.00	80,400	
バリューコマース	100	3,705.00	370,500	
インフォマート	700	663.00	464,100	
サッポロホールディングス	200	2,374.00	474,800	
アサヒグループホールディングス	1,600	4,516.00	7,225,600	
キリンホールディングス	2,400	1,785.50	4,285,200	
宝ホールディングス	500	1,060.00	530,000	
オエノンホールディングス	300	310.00	93,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	500	1,440.00	720,000	
サントリー食品インターナショナル	400	4,880.00	1,952,000	
伊藤園	200	5,350.00	1,070,000	
キーコーヒー	100	1,986.00	198,600	
日清オイリオグループ	100	2,909.00	290,900	
不二製油グループ本社	100	1,805.00	180,500	
Ｊ－オイルミルズ	100	1,576.00	157,600	
ローソン	100	4,785.00	478,500	
カワチ薬品	100	2,105.00	210,500	
エービーシー・マート	100	5,300.00	530,000	
アスクル	200	1,628.00	325,600	
ゲオホールディングス	100	1,268.00	126,800	
アダストリア	100	2,131.00	213,100	
くら寿司	100	3,405.00	340,500	
エレマテック	100	1,073.00	107,300	
パルグループホールディングス	100	1,398.00	139,800	
エディオン	300	1,090.00	327,000	
あらた	100	3,330.00	333,000	
サーラコーポレーション	100	623.00	62,300	
ＪＰホールディングス	300	217.00	65,100	
フジオフードグループ本社	100	1,318.00	131,800	
ひらまつ	200	193.00	38,600	
双日	700	2,032.00	1,422,400	
アルフレッサ　ホールディングス	700	1,711.00	1,197,700	
ハニーズホールディングス	100	1,057.00	105,700	
キッコーマン	500	8,360.00	4,180,000	
味の素	1,500	3,426.00	5,139,000	
キユーピー	300	2,149.00	644,700	
ハウス食品グループ本社	200	2,945.00	589,000	
カゴメ	300	3,265.00	979,500	
アリアケジャパン	100	4,800.00	480,000	
ニチレイ	300	2,300.00	690,000	
横浜冷凍	200	855.00	171,000	
東洋水産	300	3,880.00	1,164,000	
日清食品ホールディングス	300	8,860.00	2,658,000	
フジッコ	100	2,022.00	202,200	
ロック・フィールド	100	1,473.00	147,300	

日本たばこ産業	3,500	2,202.00	7,707,000	
ケンコーマヨネーズ	100	1,401.00	140,100	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,657.00	165,700	
なとり	100	1,960.00	196,000	
ファーマフーズ	100	1,822.00	182,200	
北の達人コーポレーション	400	194.00	77,600	
ユーグレナ	400	896.00	358,400	
スター・マイカ・ホールディングス	100	1,713.00	171,300	
片倉工業	100	2,243.00	224,300	
ヒューリック	1,500	1,083.00	1,624,500	
アルペン	100	1,953.00	195,300	
ラクーンホールディングス	100	1,310.00	131,000	
クオールホールディングス	100	1,092.00	109,200	
アルコニックス	100	1,444.00	144,400	
神戸物産	500	3,500.00	1,750,000	
ビックカメラ	400	1,095.00	438,000	
ＤＣＭホールディングス	400	1,022.00	408,800	
ペッパーフードサービス	100	360.00	36,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	800	2,473.00	1,978,400	
あい　ホールディングス	100	1,686.00	168,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	800	977.00	781,600	
ドトール・日レスホールディングス	100	1,462.00	146,200	
マツキヨココカラ＆カンパニー	400	4,095.00	1,638,000	
ブロンコビリー	100	2,296.00	229,600	
ＺＯＺＯ	500	3,125.00	1,562,500	
三越伊勢丹ホールディングス	1,100	964.00	1,060,400	
東洋紡	300	1,061.00	318,300	
ユニチカ	300	281.00	84,300	
日清紡ホールディングス	400	995.00	398,000	
倉敷紡績	100	1,731.00	173,100	
ダイワボウホールディングス	300	1,554.00	466,200	
日東紡績	100	2,489.00	248,900	
トヨタ紡織	300	1,943.00	582,900	
マクニカ・富士エレホールディングス	200	2,649.00	529,800	
ウエルシアホールディングス	300	2,616.00	784,800	
クリエイトＳＤホールディングス	100	2,996.00	299,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	100	740.00	74,000	
八洲電機	100	941.00	94,100	
レスターホールディングス	100	2,017.00	201,700	
大光	200	721.00	144,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	300	866.00	259,800	
三洋貿易	100	983.00	98,300	
シュッピン	100	1,244.00	124,400	
オイシックス・ラ・大地	100	2,751.00	275,100	
ウイン・パートナーズ	100	998.00	99,800	
ネクステージ	100	2,062.00	206,200	
ジョイフル本田	200	1,525.00	305,000	
ホットランド	100	1,339.00	133,900	
すかいらーくホールディングス	800	1,534.00	1,227,200	

ＳＦＰホールディングス	100	1,413.00	141,300	
綿半ホールディングス	100	1,306.00	130,600	
日本毛織	200	949.00	189,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	200	1,097.00	219,400	
野村不動産ホールディングス	300	3,020.00	906,000	
三重交通グループホールディングス	200	458.00	91,600	
サムティ	100	2,085.00	208,500	
ディア・ライフ	100	515.00	51,500	
地主	100	1,923.00	192,300	
プレサンスコーポレーション	100	1,672.00	167,200	
フージャースホールディングス	100	658.00	65,800	
オープンハウスグループ	200	5,350.00	1,070,000	
東急不動産ホールディングス	1,900	680.00	1,292,000	
飯田グループホールディングス	500	2,114.00	1,057,000	
帝国繊維	100	1,648.00	164,800	
日本コークス工業	600	144.00	86,400	
あさひ	100	1,355.00	135,500	
コスモス薬品	100	12,100.00	1,210,000	
シップヘルスケアホールディングス	200	2,087.00	417,400	
セブン&アイ・ホールディングス	2,500	5,810.00	14,525,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	400	807.00	322,800	
ツルハホールディングス	100	6,470.00	647,000	
サンマルクホールディングス	100	1,491.00	149,100	
トリドールホールディングス	200	2,485.00	497,000	
帝人	600	1,356.00	813,600	
東レ	4,700	627.00	2,946,900	
クラレ	900	1,042.00	937,800	
旭化成	4,300	1,076.00	4,626,800	
稲葉製作所	100	1,281.00	128,100	
トーカロ	200	1,287.00	257,400	
ＳＵＭＣＯ	1,000	1,907.00	1,907,000	
ＪＭホールディングス	100	1,719.00	171,900	
コメダホールディングス	100	2,213.00	221,300	
アレンザホールディングス	100	976.00	97,600	
クスリのアオキホールディングス	100	5,990.00	599,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	400	3,220.00	1,288,000	
セーレン	100	2,049.00	204,900	
小松マテーレ	100	1,438.00	143,800	
ワコールホールディングス	200	1,853.00	370,600	
ホギメディカル	100	3,185.00	318,500	
ＴＳＩホールディングス	300	312.00	93,600	
ワールド	100	1,320.00	132,000	
ＴＩＳ	600	2,797.00	1,678,200	
グリー	300	1,253.00	375,900	
コーエーテクモホールディングス	200	3,940.00	788,000	
ブレインパッド	100	1,184.00	118,400	
ＫＬａｂ	200	438.00	87,600	

ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	100	1,030.00	103,000	
ネクソン	1,500	2,944.00	4,416,000	
エムアップホールディングス	100	994.00	99,400	
コロプラ	200	648.00	129,600	
オルトプラス	100	312.00	31,200	
ブロードリーフ	400	362.00	144,800	
システム情報	100	946.00	94,600	
じげん	300	306.00	91,800	
ブイキューブ	100	966.00	96,600	
フィックスターズ	100	847.00	84,700	
オプティム	100	944.00	94,400	
ティーガイア	100	1,640.00	164,000	
テクマトリックス	100	2,019.00	201,900	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	2,710.00	542,000	
GMOペイメントゲートウェイ	100	11,130.00	1,113,000	
インターネットイニシアティブ	200	4,085.00	817,000	
ｅＢＡＳＥ	100	456.00	45,600	
アバント	100	1,181.00	118,100	
アドソル日進	100	1,536.00	153,600	
コムチュア	100	2,865.00	286,500	
アイル	100	1,434.00	143,400	
王子ホールディングス	2,700	615.00	1,660,500	
日本製紙	300	1,046.00	313,800	
北越コーポレーション	400	659.00	263,600	
大王製紙	300	1,518.00	455,400	
メディカル・データ・ビジョン	100	1,045.00	104,500	
ｇｕｍｉ	100	552.00	55,200	
ラクス	200	1,612.00	322,400	
カナミックネットワーク	100	509.00	50,900	
レンゴー	600	758.00	454,800	
トーモク	100	1,514.00	151,400	
ザ・パック	100	2,462.00	246,200	
チェンジ	100	1,853.00	185,300	
マクロミル	200	1,230.00	246,000	
マネーフォワード	100	5,050.00	505,000	
昭和電工	600	2,409.00	1,445,400	
住友化学	4,600	560.00	2,576,000	
日産化学	300	7,260.00	2,178,000	
クレハ	100	9,820.00	982,000	
テイカ	100	1,200.00	120,000	
石原産業	100	1,029.00	102,900	
日本曹達	100	3,390.00	339,000	
東ソー	900	1,773.00	1,595,700	
トクヤマ	200	1,677.00	335,400	
セントラル硝子	100	2,351.00	235,100	
東亞合成	400	1,080.00	432,000	
大阪ソーダ	100	3,190.00	319,000	
関東電化工業	200	956.00	191,200	

デンカ	200	3,360.00	672,000	
イビデン	300	5,490.00	1,647,000	
信越化学工業	1,100	17,630.00	19,393,000	
堺化学工業	100	1,864.00	186,400	
第一稀元素化学工業	100	1,006.00	100,600	
エア・ウォーター	600	1,673.00	1,003,800	
日本酸素ホールディングス	600	2,222.00	1,333,200	
日本パーカライジング	300	901.00	270,300	
高圧ガス工業	100	651.00	65,100	
四国化成工業	100	1,322.00	132,200	
日本触媒	100	5,300.00	530,000	
大日精化工業	100	1,953.00	195,300	
カネカ	200	3,465.00	693,000	
協和キリン	800	2,700.00	2,160,000	
三菱瓦斯化学	600	1,865.00	1,119,000	
三井化学	600	2,953.00	1,771,800	
ＪＳＲ	600	3,520.00	2,112,000	
東京応化工業	100	6,740.00	674,000	
大阪有機化学工業	100	2,884.00	288,400	
三菱ケミカルホールディングス	4,300	793.20	3,410,760	
ＫＨネオケム	100	2,519.00	251,900	
ダイセル	900	783.00	704,700	
住友ベークライト	100	4,400.00	440,000	
積水化学工業	1,300	1,675.00	2,177,500	
日本ゼオン	600	1,307.00	784,200	
アイカ工業	200	2,908.00	581,600	
ＵＢＥ	300	2,025.00	607,500	
積水樹脂	100	1,745.00	174,500	
タキロンシーアイ	100	548.00	54,800	
リケンテクノス	200	441.00	88,200	
積水化成品工業	200	423.00	84,600	
ダイキョーニシカワ	200	525.00	105,000	
日本化薬	500	1,123.00	561,500	
カーリットホールディングス	100	633.00	63,300	
プレステージ・インターナショナル	300	642.00	192,600	
プロトコーポレーション	100	1,007.00	100,700	
アミューズ	100	1,944.00	194,400	
野村総合研究所	1,200	4,060.00	4,872,000	
クイック	100	1,550.00	155,000	
電通グループ	600	4,915.00	2,949,000	
インテージホールディングス	100	1,627.00	162,700	
ソースネクスト	400	190.00	76,000	
シーティーエス	100	845.00	84,500	
インフォコム	100	2,138.00	213,800	
日本精化	100	2,102.00	210,200	
扶桑化学工業	100	3,805.00	380,500	
トリケミカル研究所	100	2,626.00	262,600	
シンプレクス・ホールディングス	100	1,779.00	177,900	
ラクスル	100	2,870.00	287,000	
ＡＤＥＫＡ	300	2,639.00	791,700	

日油	200	4,785.00	957,000	
ハリマ化成グループ	100	793.00	79,300	
アルテリア・ネットワークス	100	1,302.00	130,200	
Ｓａｎｓａｎ	200	1,316.00	263,200	
ギフティ	100	1,092.00	109,200	
花王	1,500	5,058.00	7,587,000	
石原ケミカル	100	1,260.00	126,000	
ＪＭＤＣ	100	6,750.00	675,000	
武田薬品工業	5,200	3,760.00	19,552,000	
アステラス製薬	5,700	2,053.00	11,702,100	
住友ファーマ	400	1,089.00	435,600	
塩野義製薬	800	6,880.00	5,504,000	
日本新薬	200	8,910.00	1,782,000	
中外製薬	2,100	4,215.00	8,851,500	
科研製薬	100	3,820.00	382,000	
エーザイ	800	5,731.00	4,584,800	
理研ビタミン	100	1,622.00	162,200	
ロート製薬	300	3,330.00	999,000	
小野薬品工業	1,500	3,220.00	4,830,000	
久光製薬	200	3,420.00	684,000	
持田製薬	100	3,650.00	365,000	
参天製薬	1,200	1,020.00	1,224,000	
ツムラ	200	3,185.00	637,000	
日医工	200	748.00	149,600	
テルモ	1,900	3,923.00	7,453,700	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	200	2,938.00	587,600	
キッセイ薬品工業	100	2,435.00	243,500	
生化学工業	100	845.00	84,500	
栄研化学	100	1,683.00	168,300	
ＪＣＲファーマ	200	2,331.00	466,200	
東和薬品	100	2,645.00	264,500	
ゼリア新薬工業	100	1,922.00	192,200	
第一三共	5,200	2,896.50	15,061,800	
キョーリン製薬ホールディングス	100	1,770.00	177,000	
大幸薬品	100	595.00	59,500	
ダイト	100	2,617.00	261,700	
大塚ホールディングス	1,400	4,175.00	5,845,000	
大正製薬ホールディングス	200	4,690.00	938,000	
ペプチドリーム	400	2,002.00	800,800	
大日本塗料	100	779.00	77,900	
日本ペイントホールディングス	2,400	1,031.00	2,474,400	
関西ペイント	700	1,796.00	1,257,200	
中国塗料	200	919.00	183,800	
太陽ホールディングス	100	3,140.00	314,000	
ＤＩＣ	300	2,439.00	731,700	
サカタインクス	200	928.00	185,600	
東洋インキＳＣホールディングス	100	1,935.00	193,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	100	810.00	81,000	
アルプス技研	100	1,935.00	193,500	
サニックス	100	263.00	26,300	

日本空調サービス	100	802.00	80,200	
オリエンタルランド	700	22,585.00	15,809,500	
フォーカスシステムズ	100	897.00	89,700	
ダスキン	200	2,727.00	545,400	
パーク２４	400	1,917.00	766,800	
明光ネットワークジャパン	100	573.00	57,300	
クレスコ	100	1,857.00	185,700	
フジ・メディア・ホールディングス	600	1,125.00	675,000	
ラウンドワン	200	1,493.00	298,600	
リゾートトラスト	300	2,186.00	655,800	
オービック	200	17,990.00	3,598,000	
ジャストシステム	100	5,240.00	524,000	
ＴＤＣソフト	100	1,139.00	113,900	
Ｚホールディングス	9,300	520.00	4,836,000	
ビー・エム・エル	100	3,255.00	325,500	
トレンドマイクロ	300	7,130.00	2,139,000	
りらいあコミュニケーションズ	100	1,057.00	105,700	
ＩＤホールディングス	100	821.00	82,100	
リソー教育	300	381.00	114,300	
日本オラクル	100	8,470.00	847,000	
早稲田アカデミー	100	1,042.00	104,200	
フューチャー	100	1,550.00	155,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	100	1,346.00	134,600	
ユー・エス・エス	700	2,095.00	1,466,500	
オービックビジネスコンサルタント	100	4,285.00	428,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	300	3,020.00	906,000	
アイティフォー	100	791.00	79,100	
サイバーエージェント	1,600	1,418.00	2,268,800	
楽天グループ	3,300	961.00	3,171,300	
モーニングスター	100	565.00	56,500	
テー・オー・ダブリュー	300	313.00	93,900	
大塚商会	300	4,155.00	1,246,500	
サイボウズ	100	1,281.00	128,100	
山田コンサルティンググループ	100	1,232.00	123,200	
パラカ	100	1,783.00	178,300	
電通国際情報サービス	100	3,675.00	367,500	
ＡＣＣＥＳＳ	100	565.00	56,500	
デジタルガレージ	100	4,350.00	435,000	
イーエムシステムズ	100	862.00	86,200	
ＣＩＪ	100	769.00	76,900	
フルキャストホールディングス	100	2,452.00	245,200	
エン・ジャパン	100	3,110.00	311,000	
あすか製薬ホールディングス	100	1,169.00	116,900	
サワイグループホールディングス	100	4,245.00	424,500	
富士フイルムホールディングス	1,200	7,473.00	8,967,600	
コニカミノルタ	1,500	505.00	757,500	
資生堂	1,200	6,120.00	7,344,000	
ライオン	800	1,281.00	1,024,800	
高砂香料工業	100	2,579.00	257,900	
マンダム	100	1,311.00	131,100	

ミルボン	100	5,250.00	525,000	
ファンケル	300	2,549.00	764,700	
コーセー	100	12,960.00	1,296,000	
コタ	100	1,412.00	141,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	300	1,509.00	452,700	
ノエビアホールディングス	100	4,950.00	495,000	
エステー	100	1,511.00	151,100	
コニシ	100	1,532.00	153,200	
長谷川香料	100	2,600.00	260,000	
小林製薬	200	9,360.00	1,872,000	
荒川化学工業	100	1,025.00	102,500	
メック	100	2,756.00	275,600	
タカラバイオ	200	2,218.00	443,600	
ＪＣＵ	100	3,385.00	338,500	
デクセリアルズ	200	3,040.00	608,000	
アース製薬	100	5,300.00	530,000	
北興化学工業	100	999.00	99,900	
クミアイ化学工業	300	886.00	265,800	
日本農薬	100	621.00	62,100	
ニチレキ	100	1,159.00	115,900	
富士石油	200	297.00	59,400	
出光興産	700	3,525.00	2,467,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	10,000	458.90	4,589,000	
コスモエネルギーホールディングス	200	3,365.00	673,000	
インフロニア・ホールディングス	900	964.00	867,600	
横浜ゴム	400	1,744.00	697,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	400	1,477.00	590,800	
ブリヂストン	1,900	4,739.00	9,004,100	
住友ゴム工業	600	1,139.00	683,400	
アキレス	100	1,315.00	131,500	
ニッタ	100	2,745.00	274,500	
住友理工	200	574.00	114,800	
三ツ星ベルト	100	1,998.00	199,800	
バンドー化学	100	851.00	85,100	
ＡＧＣ	600	4,950.00	2,970,000	
日本板硝子	400	399.00	159,600	
有沢製作所	100	906.00	90,600	
日本電気硝子	300	2,638.00	791,400	
住友大阪セメント	100	4,045.00	404,500	
太平洋セメント	400	2,052.00	820,800	
日本ヒューム	100	673.00	67,300	
アジアパイルホールディングス	200	420.00	84,000	
東海カーボン	600	1,061.00	636,600	
ＴＯＴＯ	500	4,405.00	2,202,500	
日本碍子	700	1,717.00	1,201,900	
日本特殊陶業	500	1,959.00	979,500	
ヨータイ	100	1,333.00	133,300	
フジミインコーポレーテッド	100	5,670.00	567,000	
ニチアス	200	2,347.00	469,400	
日本製鉄	2,900	2,158.00	6,258,200	

神戸製鋼所	1,300	585.00	760,500	
中山製鋼所	200	430.00	86,000	
合同製鐵	100	1,333.00	133,300	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	1,800	1,690.00	3,042,000	
東京製鐵	200	1,213.00	242,600	
共英製鋼	100	1,364.00	136,400	
大和工業	100	3,770.00	377,000	
淀川製鋼所	100	2,689.00	268,900	
丸一鋼管	200	2,835.00	567,000	
大同特殊鋼	100	3,565.00	356,500	
日本冶金工業	100	2,649.00	264,900	
山陽特殊製鋼	100	2,115.00	211,500	
日立金属	700	2,007.00	1,404,900	
新日本電工	500	323.00	161,500	
日本製鋼所	200	3,685.00	737,000	
三菱製鋼	100	1,086.00	108,600	
大紀アルミニウム工業所	100	1,576.00	157,600	
日本軽金属ホールディングス	200	1,700.00	340,000	
三井金属鉱業	200	3,465.00	693,000	
三菱マテリアル	400	2,142.00	856,800	
住友金属鉱山	800	6,568.00	5,254,400	
ＤＯＷＡホールディングス	200	6,130.00	1,226,000	
古河機械金属	100	1,281.00	128,100	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	1,463.00	146,300	
東邦チタニウム	100	1,589.00	158,900	
ＵＡＣＪ	100	2,288.00	228,800	
古河電気工業	200	2,130.00	426,000	
住友電気工業	2,500	1,417.50	3,543,750	
フジクラ	700	567.00	396,900	
昭和電線ホールディングス	100	1,710.00	171,000	
タツタ電線	200	464.00	92,800	
平河ヒューテック	100	1,106.00	110,600	
リョービ	100	1,065.00	106,500	
アサヒホールディングス	300	2,286.00	685,800	
東洋製罐グループホールディングス	400	1,394.00	557,600	
ホッカンホールディングス	100	1,258.00	125,800	
横河ブリッジホールディングス	100	1,858.00	185,800	
三和ホールディングス	600	1,173.00	703,800	
文化シヤッター	200	947.00	189,400	
三協立山	100	592.00	59,200	
アルインコ	100	857.00	85,700	
ＬＩＸＩＬ	1,000	2,151.00	2,151,000	
ノーリツ	100	1,477.00	147,700	
長府製作所	100	1,898.00	189,800	
リンナイ	100	8,000.00	800,000	
ユニプレス	100	758.00	75,800	
岡部	200	664.00	132,800	
ジーテクト	100	1,276.00	127,600	
東プレ	100	1,095.00	109,500	

高周波熱錬	200	578.00	115,600	
パイオラックス	100	1,520.00	152,000	
日本発条	600	845.00	507,000	
三浦工業	300	2,696.00	808,800	
タクマ	200	1,372.00	274,400	
テクノプロ・ホールディングス	400	3,190.00	1,276,000	
ジャパンマテリアル	200	1,841.00	368,200	
ベクトル	100	1,278.00	127,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,211.00	121,100	
ＩＢＪ	100	713.00	71,300	
M&Aキャピタルパートナーズ	100	4,410.00	441,000	
ウィルグループ	100	1,140.00	114,000	
メドピア	100	3,530.00	353,000	
リクルートホールディングス	4,900	5,095.00	24,965,500	
エラン	100	1,023.00	102,300	
ツガミ	200	1,212.00	242,400	
オークマ	100	4,685.00	468,500	
芝浦機械	100	3,110.00	311,000	
アマダ	1,000	1,006.00	1,006,000	
アイダエンジニアリング	200	987.00	197,400	
ＦＵＪＩ	300	2,133.00	639,900	
牧野フライス製作所	100	3,895.00	389,500	
オーエスジー	300	1,638.00	491,400	
旭ダイヤモンド工業	200	580.00	116,000	
DMG森精機	400	1,614.00	645,600	
ソディック	200	726.00	145,200	
ディスコ	100	30,050.00	3,005,000	
日進工具	100	1,432.00	143,200	
日本郵政	8,200	908.90	7,452,980	
ベルシステム２４ホールディングス	100	1,487.00	148,700	
アトラエ	100	1,805.00	180,500	
ソラスト	200	888.00	177,600	
インソース	100	2,105.00	210,500	
豊田自動織機	500	7,900.00	3,950,000	
島精機製作所	100	1,901.00	190,100	
オプトラン	100	1,971.00	197,100	
イワキ	100	1,080.00	108,000	
フリュー	100	1,085.00	108,500	
ヤマシンフィルタ	200	359.00	71,800	
日阪製作所	100	766.00	76,600	
やまびこ	100	1,402.00	140,200	
ナブテスコ	400	3,130.00	1,252,000	
三井海洋開発	100	1,250.00	125,000	
レオン自動機	100	1,051.00	105,100	
ＳＭＣ	200	65,140.00	13,028,000	
ホソカワミクロン	100	2,493.00	249,300	
オイレス工業	100	1,494.00	149,400	
サトーホールディングス	100	1,711.00	171,100	
技研製作所	100	3,530.00	353,000	
日精樹脂工業	100	958.00	95,800	

小松製作所	3,000	3,029.00	9,087,000	
住友重機械工業	400	2,762.00	1,104,800	
日立建機	300	3,250.00	975,000	
日工	100	607.00	60,700	
井関農機	100	1,245.00	124,500	
ＴＯＷＡ	100	2,090.00	209,000	
北川鉄工所	100	1,281.00	128,100	
クボタ	3,200	2,273.00	7,273,600	
東洋エンジニアリング	100	650.00	65,000	
月島機械	100	1,024.00	102,400	
帝国電機製作所	100	1,585.00	158,500	
新東工業	200	677.00	135,400	
澁谷工業	100	2,341.00	234,100	
アイチコーポレーション	100	888.00	88,800	
小森コーポレーション	200	708.00	141,600	
鶴見製作所	100	1,881.00	188,100	
荏原製作所	300	6,040.00	1,812,000	
酉島製作所	100	1,282.00	128,200	
北越工業	100	841.00	84,100	
ダイキン工業	800	20,245.00	16,196,000	
栗田工業	400	4,295.00	1,718,000	
椿本チエイン	100	2,950.00	295,000	
日機装	200	810.00	162,000	
レイズネクスト	100	1,058.00	105,800	
アネスト岩田	100	822.00	82,200	
ダイフク	400	8,050.00	3,220,000	
タダノ	400	927.00	370,800	
フジテック	200	2,930.00	586,000	
ＣＫＤ	200	1,696.00	339,200	
キトー	100	1,691.00	169,100	
平和	200	1,891.00	378,200	
理想科学工業	100	2,330.00	233,000	
ＳＡＮＫＹＯ	100	3,625.00	362,500	
フクシマガリレイ	100	3,755.00	375,500	
竹内製作所	100	2,272.00	227,200	
アマノ	200	2,068.00	413,600	
ＪＵＫＩ	100	903.00	90,300	
サンデン	100	199.00	19,900	
ブラザー工業	800	2,245.00	1,796,000	
マックス	100	1,561.00	156,100	
モリタホールディングス	100	1,214.00	121,400	
グローリー	200	2,039.00	407,800	
新晃工業	100	1,592.00	159,200	
大和冷機工業	100	1,080.00	108,000	
セガサミーホールディングス	600	2,283.00	1,369,800	
ＴＰＲ	100	1,267.00	126,700	
ツバキ・ナカシマ	200	934.00	186,800	
ホシザキ	200	8,110.00	1,622,000	
日本精工	1,200	721.00	865,200	
ＮＴＮ	1,500	207.00	310,500	

ジェイテクト	600	905.00	543,000	
不二越	100	3,775.00	377,500	
ミネベアミツミ	1,100	2,559.00	2,814,900	
日本トムソン	200	516.00	103,200	
ＴＨＫ	400	2,616.00	1,046,400	
前澤給装工業	100	929.00	92,900	
イーグル工業	100	952.00	95,200	
日本ピラー工業	100	2,682.00	268,200	
キッツ	300	656.00	196,800	
日立製作所	3,200	6,009.00	19,228,800	
東芝	1,100	5,129.00	5,641,900	
三菱電機	6,600	1,394.00	9,200,400	
富士電機	400	5,630.00	2,252,000	
安川電機	700	4,555.00	3,188,500	
シンフォニア　テクノロジー	100	1,266.00	126,600	
明電舎	100	2,327.00	232,700	
デンヨー	100	1,596.00	159,600	
ＰＨＣホールディングス	100	1,842.00	184,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	200	1,579.00	315,800	
ウェルビー	100	1,007.00	100,700	
三櫻工業	100	719.00	71,900	
マキタ	800	3,792.00	3,033,600	
東芝テック	100	4,585.00	458,500	
マブチモーター	200	3,600.00	720,000	
日本電産	1,700	8,726.00	14,834,200	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	408.00	40,800	
東光高岳	100	1,490.00	149,000	
ダブル・スコープ	200	960.00	192,000	
ダイヘン	100	3,610.00	361,000	
ヤーマン	100	1,260.00	126,000	
ＪＶＣケンウッド	600	169.00	101,400	
日新電機	200	1,361.00	272,200	
大崎電気工業	100	497.00	49,700	
オムロン	500	7,563.00	3,781,500	
日東工業	100	1,520.00	152,000	
ＩＤＥＣ	100	2,312.00	231,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	200	2,266.00	453,200	
日本電気	800	5,100.00	4,080,000	
富士通	600	18,915.00	11,349,000	
沖電気工業	300	849.00	254,700	
サンケン電気	100	4,835.00	483,500	
ルネサスエレクトロニクス	3,600	1,343.00	4,834,800	
セイコーエプソン	800	1,831.00	1,464,800	
ワコム	500	968.00	484,000	
アルバック	100	5,180.00	518,000	
ＥＩＺＯ	100	3,375.00	337,500	
ジャパンディスプレイ	2,300	72.00	165,600	
日本信号	200	898.00	179,600	
京三製作所	200	423.00	84,600	

能美防災	100	1,884.00	188,400	
ホーチキ	100	1,181.00	118,100	
エレコム	200	1,516.00	303,200	
パナソニック　ホールディングス	7,000	1,140.50	7,983,500	
シャープ	700	1,118.00	782,600	
アンリツ	400	1,608.00	643,200	
富士通ゼネラル	200	2,259.00	451,800	
ソニーグループ	4,100	11,430.00	46,863,000	
ＴＤＫ	1,000	4,070.00	4,070,000	
タムラ製作所	300	564.00	169,200	
アルプスアルパイン	600	1,227.00	736,200	
日本電波工業	100	1,215.00	121,500	
メイコー	100	3,590.00	359,000	
フォスター電機	100	690.00	69,000	
ヨコオ	100	2,440.00	244,000	
ホシデン	200	1,225.00	245,000	
ヒロセ電機	100	16,250.00	1,625,000	
日本航空電子工業	100	1,968.00	196,800	
ＴＯＡ	100	682.00	68,200	
マクセル	100	1,163.00	116,300	
古野電気	100	941.00	94,100	
スミダコーポレーション	100	833.00	83,300	
横河電機	700	2,130.00	1,491,000	
アズビル	400	3,890.00	1,556,000	
日本光電工業	300	3,025.00	907,500	
堀場製作所	100	5,920.00	592,000	
アドバンテスト	500	8,440.00	4,220,000	
エスペック	100	1,717.00	171,700	
キーエンス	600	53,590.00	32,154,000	
シスメックス	600	8,953.00	5,371,800	
日本マイクロニクス	100	1,514.00	151,400	
メガチップス	100	3,445.00	344,500	
デンソー	1,400	7,538.00	10,553,200	
コーセル	100	758.00	75,800	
イリソ電子工業	100	3,005.00	300,500	
オプテックスグループ	100	1,750.00	175,000	
レーザーテック	300	18,090.00	5,427,000	
スタンレー電気	500	2,184.00	1,092,000	
ウシオ電機	300	1,687.00	506,100	
日本セラミック	100	2,363.00	236,300	
古河電池	100	1,228.00	122,800	
山一電機	100	1,666.00	166,600	
日本電子	100	5,680.00	568,000	
カシオ計算機	500	1,350.00	675,000	
ファナック	600	21,000.00	12,600,000	
日本シイエムケイ	100	541.00	54,100	
大真空	100	1,164.00	116,400	
ローム	300	8,920.00	2,676,000	
浜松ホトニクス	500	5,860.00	2,930,000	
三井ハイテック	100	11,740.00	1,174,000	

新光電気工業	200	5,620.00	1,124,000	
京セラ	900	6,835.00	6,151,500	
太陽誘電	300	5,080.00	1,524,000	
村田製作所	1,900	7,787.00	14,795,300	
双葉電子工業	200	656.00	131,200	
日東電工	400	8,770.00	3,508,000	
東海理化電機製作所	200	1,464.00	292,800	
ニチコン	200	1,147.00	229,400	
日本ケミコン	100	1,845.00	184,500	
ＫＯＡ	100	1,356.00	135,600	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	300	370.00	111,000	
日立造船	600	691.00	414,600	
三菱重工業	1,000	4,399.00	4,399,000	
川崎重工業	500	2,391.00	1,195,500	
ＩＨＩ	400	3,090.00	1,236,000	
名村造船所	200	430.00	86,000	
カーブスホールディングス	200	782.00	156,400	
三菱ロジスネクスト	100	777.00	77,700	
フルサト・マルカホールディングス	100	3,375.00	337,500	
ヤマエグループホールディングス	100	1,037.00	103,700	
ＦＰＧ	200	793.00	158,600	
全国保証	200	4,640.00	928,000	
めぶきフィナンシャルグループ	3,300	265.00	874,500	
ジャパンインベストメントアドバイザー	100	1,222.00	122,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	1,811.00	181,100	
九州フィナンシャルグループ	1,400	399.00	558,600	
かんぽ生命保険	600	2,193.00	1,315,800	
ゆうちょ銀行	1,500	984.00	1,476,000	
富山第一銀行	300	318.00	95,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,700	486.00	1,798,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	400	792.00	316,800	
日本モーゲージサービス	100	967.00	96,700	
アルヒ	100	1,020.00	102,000	
日産自動車	7,800	550.80	4,296,240	
いすゞ自動車	2,100	1,581.00	3,320,100	
トヨタ自動車	33,300	2,258.50	75,208,050	
日野自動車	800	693.00	554,400	
三菱自動車工業	2,500	335.00	837,500	
武蔵精密工業	200	1,346.00	269,200	
新明和工業	200	902.00	180,400	
極東開発工業	100	1,285.00	128,500	
トピー工業	100	1,044.00	104,400	
曙ブレーキ工業	400	156.00	62,400	
タチエス	100	1,000.00	100,000	
ＮＯＫ	300	1,099.00	329,700	
フタバ産業	200	337.00	67,400	
ＫＹＢ	100	2,869.00	286,900	

大同メタル工業	200	565.00	113,000	
プレス工業	400	378.00	151,200	
太平洋工業	200	915.00	183,000	
アイシン	500	3,965.00	1,982,500	
マツダ	2,100	954.00	2,003,400	
本田技研工業	5,200	3,433.00	17,851,600	
スズキ	1,500	4,126.00	6,189,000	
ＳＵＢＡＲＵ	1,900	1,936.00	3,678,400	
ヤマハ発動機	900	2,733.00	2,459,700	
小糸製作所	400	4,750.00	1,900,000	
エクセディ	100	1,544.00	154,400	
ミツバ	200	353.00	70,600	
豊田合成	200	1,851.00	370,200	
愛三工業	100	686.00	68,600	
ヨロズ	100	806.00	80,600	
エフ・シー・シー	100	1,297.00	129,700	
シマノ	300	25,495.00	7,648,500	
テイ・エス　テック	300	1,347.00	404,100	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,438.00	143,800	
第四北越フィナンシャルグループ	100	2,570.00	257,000	
ひろぎんホールディングス	1,000	655.00	655,000	
おきなわフィナンシャルグループ	100	2,254.00	225,400	
ダイレクトマーケティングミックス	100	1,643.00	164,300	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	100	2,737.00	273,700	
十六フィナンシャルグループ	100	2,191.00	219,100	
北國フィナンシャルホールディングス	100	3,450.00	345,000	
ネットプロテクションズホールディングス	200	751.00	150,200	
プロクレアホールディングス	100	1,767.00	176,700	
小野建	100	1,536.00	153,600	
ノジマ	100	2,565.00	256,500	
カッパ・クリエイト	100	1,324.00	132,400	
コンドーテック	100	1,083.00	108,300	
ナガイレーベン	100	1,964.00	196,400	
三菱食品	100	3,075.00	307,500	
良品計画	700	1,221.00	854,700	
第一興商	100	3,435.00	343,500	
メディパルホールディングス	700	2,047.00	1,432,900	
アドヴァングループ	100	801.00	80,100	
アルビス	100	2,228.00	222,800	
アズワン	100	6,900.00	690,000	
ドウシシャ	100	1,489.00	148,900	
高速	100	1,494.00	149,400	
Ｇ－７ホールディングス	100	1,612.00	161,200	
イオン北海道	100	995.00	99,500	
コジマ	100	621.00	62,100	
コーナン商事	100	3,690.00	369,000	
ネットワンシステムズ	200	3,065.00	613,000	
ワタミ	100	933.00	93,300	

パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1,300	1,901.00	2,471,300	
丸文	100	681.00	68,100	
西松屋チェーン	100	1,463.00	146,300	
ゼンショーホールディングス	300	2,981.00	894,300	
ハピネット	100	1,484.00	148,400	
幸楽苑ホールディングス	100	1,240.00	124,000	
日本ライフライン	200	1,102.00	220,400	
サイゼリヤ	100	2,376.00	237,600	
ＶＴホールディングス	300	471.00	141,300	
アルゴグラフィックス	100	2,956.00	295,600	
ＩＤＯＭ	200	640.00	128,000	
日本エム・ディ・エム	100	1,643.00	164,300	
フジ・コーポレーション	100	1,190.00	119,000	
ユナイテッドアローズ	100	1,816.00	181,600	
進和	100	2,001.00	200,100	
ハイデイ日高	100	1,835.00	183,500	
シークス	100	1,010.00	101,000	
コロワイド	300	1,681.00	504,300	
スギホールディングス	100	5,500.00	550,000	
島津製作所	800	4,115.00	3,292,000	
長野計器	100	1,122.00	112,200	
スター精密	100	1,448.00	144,800	
東京計器	100	1,193.00	119,300	
東京精密	100	4,395.00	439,500	
マニー	300	1,498.00	449,400	
ニコン	1,000	1,480.00	1,480,000	
トプコン	300	1,699.00	509,700	
オリンパス	3,500	2,393.50	8,377,250	
理研計器	100	4,325.00	432,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	100	10,430.00	1,043,000	
キヤノン電子	100	1,584.00	158,400	
タムロン	100	2,296.00	229,600	
ＨＯＹＡ	1,300	13,025.00	16,932,500	
ノーリツ鋼機	100	2,242.00	224,200	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	100	886.00	88,600	
朝日インテック	700	2,699.00	1,889,300	
キヤノン	3,300	3,114.00	10,276,200	
リコー	1,800	994.00	1,789,200	
シチズン時計	800	499.00	399,200	
メニコン	200	2,804.00	560,800	
スノーピーク	100	2,714.00	271,400	
パラマウントベッドホールディングス	100	2,067.00	206,700	
ニホンフラッシュ	100	966.00	96,600	
前田工繊	100	2,888.00	288,800	
アートネイチャー	100	720.00	72,000	
バンダイナムコホールディングス	600	9,008.00	5,404,800	
ＳＨＯＥＩ	100	4,765.00	476,500	
フランスベッドホールディングス	100	865.00	86,500	
マーベラス	100	748.00	74,800	

パイロットコーポレーション	100	5,140.00	514,000	
萩原工業	100	1,058.00	105,800	
エイベックス	100	1,418.00	141,800	
フジシールインターナショナル	200	1,670.00	334,000	
タカラトミー	300	1,244.00	373,200	
レック	100	865.00	86,500	
凸版印刷	1,000	2,128.00	2,128,000	
大日本印刷	800	2,665.00	2,132,000	
ＮＩＳＳＨＡ	100	1,442.00	144,200	
藤森工業	100	3,525.00	352,500	
前澤化成工業	100	1,278.00	127,800	
アシックス	600	2,175.00	1,305,000	
ニチハ	100	2,339.00	233,900	
エフピコ	100	2,814.00	281,400	
ヤマハ	400	5,120.00	2,048,000	
ピジョン	400	2,083.00	833,200	
天馬	100	2,259.00	225,900	
キングジム	100	933.00	93,300	
象印マホービン	200	1,362.00	272,400	
リンテック	100	2,429.00	242,900	
信越ポリマー	100	1,100.00	110,000	
イトーキ	200	349.00	69,800	
任天堂	400	64,260.00	25,704,000	
三菱鉛筆	100	1,259.00	125,900	
タカラスタンダード	100	1,292.00	129,200	
コクヨ	300	1,667.00	500,100	
ナカバヤシ	200	489.00	97,800	
ニフコ	200	2,661.00	532,200	
グローブライド	100	2,662.00	266,200	
オカムラ	200	1,170.00	234,000	
バルカー	100	2,587.00	258,700	
伊藤忠商事	4,500	4,032.00	18,144,000	
丸紅	6,400	1,480.50	9,475,200	
スクロール	100	797.00	79,700	
ヨンドシーホールディングス	100	1,698.00	169,800	
長瀬産業	400	1,853.00	741,200	
蝶理	100	1,780.00	178,000	
豊田通商	600	4,845.00	2,907,000	
オンワードホールディングス	500	246.00	123,000	
三共生興	100	536.00	53,600	
兼松	200	1,341.00	268,200	
美津濃	100	2,099.00	209,900	
三井物産	5,000	3,294.00	16,470,000	
東京エレクトロン	400	54,730.00	21,892,000	
カメイ	100	1,021.00	102,100	
スターゼン	100	1,973.00	197,300	
セイコーホールディングス	100	2,198.00	219,800	
山善	300	939.00	281,700	
住友商事	4,100	2,114.00	8,667,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	200	3,150.00	630,000	

三菱商事	4,900	4,529.00	22,192,100	
キヤノンマーケティングジャパン	200	2,641.00	528,200	
西華産業	100	1,597.00	159,700	
佐藤商事	100	1,121.00	112,100	
東京産業	100	715.00	71,500	
ユアサ商事	100	2,890.00	289,000	
阪和興業	100	3,190.00	319,000	
カナデン	100	953.00	95,300	
菱電商事	100	1,650.00	165,000	
ニプロ	500	1,023.00	511,500	
岩谷産業	200	5,020.00	1,004,000	
三愛オブリ	200	957.00	191,400	
稲畑産業	100	2,149.00	214,900	
明和産業	100	901.00	90,100	
ゴールドウイン	100	6,250.00	625,000	
ユニ・チャーム	1,300	4,448.00	5,782,400	
デサント	100	2,630.00	263,000	
ワキタ	200	1,044.00	208,800	
東邦ホールディングス	200	2,088.00	417,600	
サンゲツ	200	1,533.00	306,600	
ミツウロコグループホールディングス	100	999.00	99,900	
伊藤忠エネクス	100	1,052.00	105,200	
サンリオ	200	2,799.00	559,800	
サンワ　テクノス	100	1,296.00	129,600	
リョーサン	100	2,255.00	225,500	
新光商事	100	931.00	93,100	
東陽テクニカ	100	1,039.00	103,900	
モスフードサービス	100	2,921.00	292,100	
加賀電子	100	3,060.00	306,000	
三益半導体工業	100	2,303.00	230,300	
立花エレテック	100	1,609.00	160,900	
木曽路	100	2,049.00	204,900	
ＳＲＳホールディングス	100	799.00	79,900	
リテールパートナーズ	100	1,204.00	120,400	
ケーヨー	100	889.00	88,900	
上新電機	100	1,901.00	190,100	
日本瓦斯	300	1,551.00	465,300	
ロイヤルホールディングス	100	2,083.00	208,300	
いなげや	100	1,329.00	132,900	
チヨダ	100	711.00	71,100	
ライフコーポレーション	100	3,030.00	303,000	
リンガーハット	100	2,243.00	224,300	
ＭｒＭａｘＨＤ	100	604.00	60,400	
テンアライド	100	312.00	31,200	
ＡＯＫＩホールディングス	200	593.00	118,600	
オークワ	100	841.00	84,100	
コメリ	100	2,533.00	253,300	
青山商事	200	672.00	134,400	
しまむら	100	11,270.00	1,127,000	
高島屋	500	1,184.00	592,000	

松屋	200	725.00	145,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	300	871.00	261,300	
丸井グループ	500	2,255.00	1,127,500	
クレディセゾン	400	1,622.00	648,800	
アクシアル　リテイリング	100	3,340.00	334,000	
イオン	2,500	2,478.00	6,195,000	
イズミ	100	2,741.00	274,100	
平和堂	100	1,894.00	189,400	
フジ	200	2,115.00	423,000	
ヤオコー	100	6,810.00	681,000	
ゼビオホールディングス	100	915.00	91,500	
ケーズホールディングス	600	1,231.00	738,600	
ＰＡＬＴＡＣ	100	4,410.00	441,000	
新生銀行	400	2,413.00	965,200	
あおぞら銀行	300	2,616.00	784,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	40,600	774.40	31,440,640	
りそなホールディングス	7,400	571.70	4,230,580	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,200	4,010.00	4,812,000	
三井住友フィナンシャルグループ	4,500	3,981.00	17,914,500	
千葉銀行	2,100	786.00	1,650,600	
群馬銀行	1,300	378.00	491,400	
武蔵野銀行	100	1,824.00	182,400	
千葉興業銀行	300	275.00	82,500	
筑波銀行	500	202.00	101,000	
七十七銀行	200	1,619.00	323,800	
秋田銀行	100	1,692.00	169,200	
山形銀行	100	846.00	84,600	
岩手銀行	100	1,943.00	194,300	
東邦銀行	600	207.00	124,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	500	2,468.00	1,234,000	
静岡銀行	1,500	868.00	1,302,000	
スルガ銀行	600	426.00	255,600	
八十二銀行	1,500	426.00	639,000	
山梨中央銀行	100	989.00	98,900	
大垣共立銀行	100	1,943.00	194,300	
福井銀行	100	1,382.00	138,200	
清水銀行	100	1,580.00	158,000	
滋賀銀行	100	2,457.00	245,700	
南都銀行	100	2,042.00	204,200	
百五銀行	600	348.00	208,800	
京都銀行	200	5,400.00	1,080,000	
紀陽銀行	200	1,416.00	283,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	400	885.00	354,000	
山陰合同銀行	400	664.00	265,600	
中国銀行	600	971.00	582,600	
伊予銀行	900	638.00	574,200	
百十四銀行	100	1,678.00	167,800	
四国銀行	100	741.00	74,100	
阿波銀行	100	2,186.00	218,600	
佐賀銀行	100	1,456.00	145,600	

琉球銀行	200	822.00	164,400	
セブン銀行	1,600	245.00	392,000	
みずほフィナンシャルグループ	8,200	1,609.00	13,193,800	
山口フィナンシャルグループ	700	737.00	515,900	
芙蓉総合リース	100	7,100.00	710,000	
みずほリース	100	3,080.00	308,000	
東京センチュリー	100	4,020.00	402,000	
ＳＢＩホールディングス	800	2,904.00	2,323,200	
日本証券金融	300	947.00	284,100	
アイフル	1,100	388.00	426,800	
名古屋銀行	100	2,975.00	297,500	
北洋銀行	1,000	248.00	248,000	
愛媛銀行	100	917.00	91,700	
京葉銀行	300	506.00	151,800	
栃木銀行	400	240.00	96,000	
東和銀行	200	539.00	107,800	
リコーリース	100	3,455.00	345,500	
イオンフィナンシャルサービス	400	1,224.00	489,600	
アコム	1,300	341.00	443,300	
ジャックス	100	3,410.00	341,000	
オリエントコーポレーション	1,700	129.00	219,300	
オリックス	3,900	2,400.00	9,360,000	
三菱ＨＣキャピタル	2,300	588.00	1,352,400	
ジャフコ　グループ	300	1,782.00	534,600	
トモニホールディングス	500	327.00	163,500	
大和証券グループ本社	4,900	656.80	3,218,320	
野村ホールディングス	9,900	513.90	5,087,610	
岡三証券グループ	500	364.00	182,000	
丸三証券	200	491.00	98,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	800	409.00	327,200	
水戸証券	300	270.00	81,000	
いちよし証券	100	606.00	60,600	
松井証券	200	834.00	166,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	1,100	5,148.00	5,662,800	
日本取引所グループ	1,600	2,147.50	3,436,000	
マネックスグループ	500	633.00	316,500	
極東証券	100	708.00	70,800	
岩井コスモホールディングス	100	1,320.00	132,000	
アイザワ証券グループ	100	675.00	67,500	
フィデアホールディングス	100	1,309.00	130,900	
池田泉州ホールディングス	800	177.00	141,600	
アニコム　ホールディングス	200	613.00	122,600	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	1,500	3,861.00	5,791,500	
スパークス・グループ	300	260.00	78,000	
第一生命ホールディングス	3,200	2,695.00	8,624,000	
東京海上ホールディングス	2,100	6,792.00	14,263,200	
イー・ギャランティ	100	2,114.00	211,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	1,700	1,699.00	2,888,300	

三井不動産	2,900	2,717.50	7,880,750	
三菱地所	4,300	1,839.50	7,909,850	
平和不動産	100	4,055.00	405,500	
東京建物	600	1,846.00	1,107,600	
京阪神ビルディング	100	1,383.00	138,300	
住友不動産	1,400	3,464.00	4,849,600	
テーオーシー	200	666.00	133,200	
レオパレス２１	600	203.00	121,800	
スターツコーポレーション	100	2,363.00	236,300	
フジ住宅	100	613.00	61,300	
空港施設	100	538.00	53,800	
ゴールドクレスト	100	1,648.00	164,800	
リログループ	300	1,865.00	559,500	
エスリード	100	1,663.00	166,300	
日神グループホールディングス	200	464.00	92,800	
日本エスコン	200	828.00	165,600	
タカラレーベン	500	299.00	149,500	
ＡＶＡＮＴＩＡ	100	844.00	84,400	
イオンモール	300	1,576.00	472,800	
ランド	3,500	10.00	35,000	
カチタス	200	3,270.00	654,000	
東祥	100	1,696.00	169,600	
トーセイ	100	1,083.00	108,300	
サンフロンティア不動産	100	1,072.00	107,200	
ＦＪネクストホールディングス	100	989.00	98,900	
東武鉄道	600	3,005.00	1,803,000	
相鉄ホールディングス	200	2,297.00	459,400	
東急	1,600	1,633.00	2,612,800	
京浜急行電鉄	900	1,340.00	1,206,000	
小田急電鉄	1,000	2,061.00	2,061,000	
京王電鉄	300	5,020.00	1,506,000	
京成電鉄	500	3,385.00	1,692,500	
富士急行	100	4,160.00	416,000	
東日本旅客鉄道	1,200	7,039.00	8,446,800	
西日本旅客鉄道	800	5,013.00	4,010,400	
東海旅客鉄道	500	16,175.00	8,087,500	
西武ホールディングス	900	1,328.00	1,195,200	
鴻池運輸	100	1,096.00	109,600	
西日本鉄道	200	2,630.00	526,000	
ハマキョウレックス	100	2,828.00	282,800	
近鉄グループホールディングス	600	3,770.00	2,262,000	
阪急阪神ホールディングス	800	3,495.00	2,796,000	
南海電気鉄道	300	2,385.00	715,500	
京阪ホールディングス	300	2,805.00	841,500	
名古屋鉄道	500	2,148.00	1,074,000	
山陽電気鉄道	100	2,040.00	204,000	
ヤマトホールディングス	900	2,382.00	2,143,800	
山九	200	3,790.00	758,000	
日新	100	1,551.00	155,100	
丸全昭和運輸	100	3,090.00	309,000	

センコーグループホールディングス	300	853.00	255,900	
ニッコンホールディングス	200	1,894.00	378,800	
福山通運	100	3,450.00	345,000	
セイノーホールディングス	400	1,015.00	406,000	
日立物流	100	6,730.00	673,000	
丸和運輸機関	100	1,396.00	139,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	100	1,077.00	107,700	
日本郵船	500	9,890.00	4,945,000	
商船三井	1,200	3,235.00	3,882,000	
川崎汽船	200	7,480.00	1,496,000	
明治海運	100	762.00	76,200	
飯野海運	200	782.00	156,400	
九州旅客鉄道	500	2,573.00	1,286,500	
ＳＧホールディングス	1,200	2,148.00	2,577,600	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	200	7,500.00	1,500,000	
日本航空	1,400	2,200.00	3,080,000	
ＡＮＡホールディングス	1,600	2,485.00	3,976,000	
ＴＲＥホールディングス	100	2,147.00	214,700	
ブックオフグループホールディングス	100	1,021.00	102,100	
三菱倉庫	200	2,988.00	597,600	
三井倉庫ホールディングス	100	2,415.00	241,500	
住友倉庫	200	2,169.00	433,800	
日本トランスシティ	200	573.00	114,600	
中央倉庫	100	948.00	94,800	
安田倉庫	100	972.00	97,200	
上組	300	2,162.00	648,600	
近鉄エクスプレス	100	3,125.00	312,500	
エーアイテイー	100	1,508.00	150,800	
ＴＢＳホールディングス	400	1,697.00	678,800	
日本テレビホールディングス	500	1,238.00	619,000	
朝日放送グループホールディングス	100	717.00	71,700	
テレビ朝日ホールディングス	200	1,469.00	293,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	500	416.00	208,000	
テレビ東京ホールディングス	100	1,993.00	199,300	
ビジョン	100	1,240.00	124,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	100	2,226.00	222,600	
コネクシオ	100	1,379.00	137,900	
日本通信	600	187.00	112,200	
日本電信電話	6,800	3,792.00	25,785,600	
ＫＤＤＩ	4,700	4,225.00	19,857,500	
ソフトバンク	9,800	1,493.00	14,631,400	
光通信	100	14,850.00	1,485,000	
ＧＭＯインターネット	200	2,549.00	509,800	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	400	3,270.00	1,308,000	
学研ホールディングス	100	897.00	89,700	
ゼンリン	100	964.00	96,400	
東京電力ホールディングス	4,900	489.00	2,396,100	
中部電力	2,000	1,322.00	2,644,000	

関西電力	2,500	1,219.00	3,047,500	
中国電力	1,000	882.00	882,000	
北陸電力	600	554.00	332,400	
東北電力	1,500	741.00	1,111,500	
四国電力	600	789.00	473,400	
九州電力	1,300	843.00	1,095,900	
北海道電力	600	505.00	303,000	
沖縄電力	100	1,301.00	130,100	
電源開発	600	1,820.00	1,092,000	
イーレックス	100	1,990.00	199,000	
レノバ	100	1,530.00	153,000	
東京瓦斯	1,300	2,320.00	3,016,000	
大阪瓦斯	1,200	2,142.00	2,570,400	
東邦瓦斯	300	2,575.00	772,500	
広島ガス	200	319.00	63,800	
西部ガスホールディングス	100	1,931.00	193,100	
静岡ガス	200	882.00	176,400	
メタウォーター	100	1,971.00	197,100	
アイネット	100	1,227.00	122,700	
東宝	400	4,800.00	1,920,000	
エイチ・アイ・エス	100	2,220.00	222,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,700	2,372.00	4,032,400	
共立メンテナンス	100	4,735.00	473,500	
イチネンホールディングス	100	1,260.00	126,000	
アインホールディングス	100	5,600.00	560,000	
東京テアトル	100	1,224.00	122,400	
東京都競馬	100	4,425.00	442,500	
常磐興産	100	1,291.00	129,100	
カナモト	100	1,968.00	196,800	
ＤＴＳ	100	2,752.00	275,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	300	5,060.00	1,518,000	
シーイーシー	100	1,200.00	120,000	
カプコン	600	2,935.00	1,761,000	
西尾レントオール	100	2,748.00	274,800	
日本空港ビルデング	200	5,560.00	1,112,000	
トランス・コスモス	100	3,075.00	307,500	
乃村工藝社	300	884.00	265,200	
ＳＣＳＫ	400	2,023.00	809,200	
日本管財	100	2,782.00	278,200	
トーカイ	100	1,710.00	171,000	
セコム	600	8,883.00	5,329,800	
アイネス	100	1,471.00	147,100	
丹青社	200	797.00	159,400	
メイテック	100	6,880.00	688,000	
ＴＫＣ	100	3,275.00	327,500	
富士ソフト	100	6,790.00	679,000	
応用地質	100	1,958.00	195,800	
船井総研ホールディングス	100	2,140.00	214,000	
ＮＳＤ	200	2,261.00	452,200	

コナミホールディングス	200	8,070.00	1,614,000	
ベネッセホールディングス	200	2,178.00	435,600	
イオンディライト	100	2,786.00	278,600	
ダイセキ	100	4,285.00	428,500	
トラスコ中山	100	2,078.00	207,800	
ヤマダホールディングス	2,300	380.00	874,000	
オートバックスセブン	200	1,340.00	268,000	
アークランドサカモト	100	1,483.00	148,300	
ニトリホールディングス	300	13,680.00	4,104,000	
グルメ杵屋	100	1,020.00	102,000	
吉野家ホールディングス	200	2,393.00	478,600	
加藤産業	100	3,190.00	319,000	
イノテック	100	1,328.00	132,800	
イエローハット	100	1,568.00	156,800	
ＪＢＣＣホールディングス	100	1,476.00	147,600	
ＪＫホールディングス	100	1,157.00	115,700	
サガミホールディングス	100	1,091.00	109,100	
日伝	100	2,139.00	213,900	
関西フードマーケット	100	1,346.00	134,600	
ミロク情報サービス	100	1,295.00	129,500	
因幡電機産業	200	2,534.00	506,800	
プレナス	100	1,900.00	190,000	
ミニストップ	100	1,386.00	138,600	
アークス	100	2,018.00	201,800	
バローホールディングス	100	2,051.00	205,100	
ミスミグループ本社	800	3,235.00	2,588,000	
ファーストリテイリング	100	64,470.00	6,447,000	
ソフトバンクグループ	3,900	5,627.00	21,945,300	
スズケン	300	3,835.00	1,150,500	
サンドラッグ	200	2,919.00	583,800	
サックスバー　ホールディングス	200	488.00	97,600	
ベルーナ	200	730.00	146,000	
合計	719,600		1,718,990,880	

（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）

	2022年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	53,361,954
国債証券	8,603,953,900
地方債証券	744,021,600
特殊債券	717,986,000
社債券	503,522,000
未収利息	13,435,018
前払費用	374,438
流動資産合計	10,636,654,910
資産合計	10,636,654,910
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,036,000
流動負債合計	3,036,000
負債合計	3,036,000
純資産の部	
元本等	
元本	8,442,176,295
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,191,442,615
元本等合計	10,633,618,910
純資産合計	10,633,618,910
負債純資産合計	10,636,654,910

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10月21日 至　2022年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,273,252,074円
同期中追加設定元本額	1,655,372,570円
同期中一部解約元本額	486,448,349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	2,402,532,998円
新光７資産バランスファンド	503,038,704円
日本債券ファンド	4,879,473,136円
世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	540,796,621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）	27,320,778円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	58,443,882円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	30,570,176円
計	8,442,176,295円
２．　受益権の総数	8,442,176,295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10月21日 至　2022年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年4月20日現在

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

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年4月20日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△237,710,800
地方債証券	△9,144,150
特殊債券	△5,741,000
社債券	△4,568,000
合計	△257,163,950

（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11月11日から2022年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年4月20日現在
1口当たり純資産額	1.2596円
（1万口当たり純資産額）	(12,596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

2022年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考

国債証券	４２７回　利付国庫債券（２年）	40,000,000	40,040,800	
	４２８回　利付国庫債券（２年）	60,000,000	60,065,400	
	４３０回　利付国庫債券（２年）	90,000,000	90,102,600	
	４３３回　利付国庫債券（２年）	50,000,000	50,058,000	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,101,500	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,124,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	120,000,000	120,330,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	60,177,600	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	70,000,000	70,227,500	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	60,210,000	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	70,000,000	70,261,100	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,196,500	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	80,000,000	80,328,800	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	60,256,200	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	190,000,000	190,836,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	140,000,000	140,081,200	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,016,400	
	１４９回　利付国庫債券（５年）	80,000,000	80,000,000	
	１回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	13,405,300	
	２回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	12,985,200	
	３回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	26,120,600	
	４回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	26,205,400	
	５回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	25,244,200	
	６回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	24,836,800	
	７回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	23,848,400	
	８回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	22,256,400	
	９回　利付国庫債券（４０年）	50,000,000	41,457,500	
	１０回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	29,148,000	
	１１回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	28,227,900	
	１２回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	25,407,900	

１３回　利付国庫債券（４０年）	50,000,000	42,142,500	
１４回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	26,987,400	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,713,300	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	40,496,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	110,000,000	111,218,800	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	81,002,400	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	60,844,800	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	90,000,000	91,186,200	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	30,000,000	30,432,300	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	40,000,000	40,362,800	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	81,014,400	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,952,700	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	160,000,000	162,324,800	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,821,100	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	80,344,000	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,305,900	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	80,335,200	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	60,237,600	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,240,100	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,198,100	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,150,500	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	100,000,000	100,141,000	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	100,000,000	100,058,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	120,000,000	119,962,800	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,910,400	

３５３回　利付国庫債券（１０年）	110,000,000	109,744,800	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,759,900	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	79,603,200	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,564,600	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,497,400	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,454,700	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	79,293,600	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,305,600	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	79,116,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	59,266,800	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	50,000,000	49,350,000	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	59,172,000	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,008,800	
１０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,679,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	11,499,900	
１２回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	11,967,000	
１５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,060,800	
１７回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,471,100	
１９回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,407,100	
２０回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,690,100	
２１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,453,800	
２２回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,759,100	
２３回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,780,700	
２６回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,716,100	
２７回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,899,500	

２８回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,876,600	
２９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,628,800	
３０回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	38,064,300	
３１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,085,400	
３２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	25,457,800	
３３回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	36,691,200	
３４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	37,736,100	
３５回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	36,697,500	
３６回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	36,751,500	
３７回　利付国庫債券（３０年）	60,000,000	72,472,800	
３８回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	23,817,600	
３９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	24,223,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	40,000,000	47,706,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	23,475,400	
４２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	23,487,200	
４３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	23,499,200	
４４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	35,265,900	
４５回　利付国庫債券（３０年）	40,000,000	45,372,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	34,033,200	
４７回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	23,104,200	
４８回　利付国庫債券（３０年）	50,000,000	55,696,500	
４９回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	33,415,200	
５０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	19,683,800	
５１回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	26,244,900	
５２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,487,800	

５３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	18,732,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	40,000,000	39,146,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	19,549,400	
５６回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	19,525,600	
５７回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	29,222,100	
５８回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	29,185,500	
５９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	18,972,000	
６０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	19,872,600	
６１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	18,895,800	
６２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	17,917,400	
６３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	17,399,400	
６４回　利付国庫債券（３０年）	40,000,000	34,686,400	
６５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	17,324,400	
６６回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	17,324,600	
６７回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,362,700	
６８回　利付国庫債券（３０年）	40,000,000	36,418,800	
６９回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	28,057,200	
７０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	18,654,200	
７１回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,967,800	
７２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,922,500	
７３回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,876,900	
６４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,120,000	
７０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,061,600	
７２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,037,600	
７８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,222,600	

８１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,692,400	
８４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,741,000	
８８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,960,000	
９０回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,969,100	
９２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,944,200	
９５回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,323,600	
９９回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	33,436,800	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,264,300	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,169,700	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,683,600	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,444,900	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,748,200	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	34,227,900	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,447,400	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,566,800	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,977,600	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,445,900	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,249,200	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,795,200	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,314,900	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,207,200	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,037,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,725,500	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,550,800	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,463,400	

１２８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,997,600	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,409,100	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,883,400	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,349,600	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,384,500	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,958,000	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,020,600	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,413,500	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,633,400	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	34,277,700	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,455,800	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,653,800	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	68,658,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	45,834,800	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	23,124,400	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	34,120,800	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,535,800	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	45,999,600	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	46,079,600	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	80,000,000	91,412,800	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	45,312,000	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	80,000,000	90,733,600	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	44,917,200	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	54,954,000	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	80,000,000	87,965,600	

１５３回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	55,627,500	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	43,990,400	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,678,500	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	39,712,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	38,540,000	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	70,188,300	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	50,752,500	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,832,500	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	40,449,600	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	40,370,000	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	70,504,700	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	39,591,200	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	39,497,600	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	71,152,200	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	39,304,400	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	28,923,300	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	37,808,800	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	28,268,700	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	56,359,200	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	28,590,000	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	38,004,800	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	37,887,600	
１７５回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	48,071,000	
１７６回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	38,343,600	
１７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	37,528,000	

	１７８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	19,071,600	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	28,543,200	
国債証券　合計		8,320,000,000	8,603,953,900	
地方債証券	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	113,430,000	
	２００回　神奈川県公募公債	35,000,000	35,404,600	
	２１８回　神奈川県公募公債	100,000,000	100,493,000	
	４１２回　大阪府公募公債　１０年	50,000,000	49,955,500	
	１９０回　大阪府公募公債　５年	100,000,000	99,584,000	
	１２回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	103,835,000	
	令和３年度１１回　愛知県公募公債	100,000,000	98,198,000	
	２４年度１回　福岡県公募公債　３０年	10,000,000	12,362,200	
	１６９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,438,000	
	４８５回　名古屋市公募公債　１０年	30,000,000	30,321,300	
地方債証券　合計		725,000,000	744,021,600	
特殊債券	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,928,000	
	２４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,462,000	
	３２７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,219,000	
	４９回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,035,000	
	５８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,255,000	
	２５０回　住宅金融支援機構	100,000,000	100,223,000	
	８７回　中日本高速道路債券	100,000,000	99,864,000	
特殊債券　合計		700,000,000	717,986,000	
社債券	５０回　西日本高速道路債券	100,000,000	99,978,000	
	４回　第一三共社債	100,000,000	101,032,000	
	１１回　ブリヂストン社債	100,000,000	99,792,000	
	３６回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,321,000	
	４９４回　九州電力社債	100,000,000	97,399,000	
社債券　合計		500,000,000	503,522,000	
合計			10,569,483,500	

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）

	2022年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,805,973,759
投資証券	97,218,415,500
派生商品評価勘定	139,291,780
未収入金	261,011,899
未収配当金	883,278,959
差入委託証拠金	161,003,000
流動資産合計	100,468,974,897
資産合計	100,468,974,897
負債の部	
流動負債	
前受金	146,353,800
未払解約金	241,285,000
流動負債合計	387,638,800
負債合計	387,638,800
純資産の部	
元本等	
元本	45,103,573,674
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	54,977,762,423
元本等合計	100,081,336,097
純資産合計	100,081,336,097
負債純資産合計	100,468,974,897

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10月21日 至　2022年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　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	2022年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	50,245,671,284円
同期中追加設定元本額	305,759,480円
同期中一部解約元本額	5,447,857,090円
元本の内訳	
ファンド名	
Ｊ－ＲＥＩＴパッケージ	2,474,013,307円
新光Ｊ－ＲＥＩＴオープン	40,633,374,027円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内リートインデックスファンド	1,052,673,564円
新光７資産バランスファンド	277,479,957円
新光Ｊ－ＲＥＩＴオープン（年２回決算型）	666,032,819円
計	45,103,573,674円
２．　受益権の総数	45,103,573,674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10月21日 至　2022年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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。
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。運用評価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	2022年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年4月20日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△5,944,687,147
合計	△5,944,687,147

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2022年4月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	2,574,804,200	－	2,714,248,000	139,443,800
合計	2,574,804,200	－	2,714,248,000	139,443,800

（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）

	2022年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2189円 (22,189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

2022年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	3,448	669,601,600	
	ＧＬＰ投資法人	28,832	4,985,052,800	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	8,533	1,338,827,700	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,545	429,510,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	4,141	636,057,600	
	いちごオフィスリート投資法人	7,294	625,825,200	
	いちごホテルリート投資法人	1,475	130,685,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,745	1,966,802,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	8,901	3,142,053,000	
	イオンリート投資法人	10,469	1,549,412,000	
	インヴィンシブル投資法人	39,182	1,716,171,600	
	エスコンジャパンリート投資法人	1,793	240,262,000	
	オリックス不動産投資法人	17,738	3,011,912,400	

グローバル・ワン不動産投資法人	6,182	698,566,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,754	1,941,570,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,370	1,319,864,000	
ケネディクス商業リート投資法人	3,554	974,862,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,141	1,333,402,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,017	260,193,000	
サンケイリアルエステート投資法人	2,820	286,512,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,437	180,487,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	27,272	1,832,678,400	
ジャパンエクセレント投資法人	8,260	1,075,452,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	8,902	5,510,338,000	
スターアジア不動産投資法人	9,200	553,840,000	
スターツプロシード投資法人	1,386	323,076,600	
タカラレーベン不動産投資法人	3,511	421,320,000	
トーセイ・リート投資法人	1,860	249,612,000	
ヒューリックリート投資法人	8,305	1,340,427,000	
フロンティア不動産投資法人	3,121	1,569,863,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,181	346,124,700	
マリモ地方創生リート投資法人	1,043	137,676,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	20,040	2,829,648,000	
ラサールロジポート投資法人	10,898	1,914,778,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,471	544,252,800	
阪急阪神リート投資法人	4,021	600,737,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,507	1,935,864,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,586	1,190,853,000	
産業ファンド投資法人	12,638	2,291,269,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,089	272,196,700	
森トラスト総合リート投資法人	6,362	897,042,000	
森ヒルズリート投資法人	10,468	1,548,217,200	
星野リゾート・リート投資法人	1,492	995,164,000	
積水ハウス・リート投資法人	27,022	2,123,929,200	
大江戸温泉リート投資法人	1,437	98,721,900	
大和ハウスリート投資法人	13,367	4,270,756,500	
大和証券オフィス投資法人	1,882	1,370,096,000	
大和証券リビング投資法人	12,029	1,352,059,600	
投資法人みらい	10,783	559,637,700	
東海道リート投資法人	682	77,611,600	

	東急リアル・エステート投資法人	5,969	1,098,296,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,074	1,927,398,000	
	日本ビルファンド投資法人	10,379	7,005,825,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	6,083	2,399,743,500	
	日本プロロジスリート投資法人	14,565	5,243,400,000	
	日本リート投資法人	2,747	1,016,390,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,002	1,899,633,000	
	日本都市ファンド投資法人	44,916	4,635,331,200	
	福岡リート投資法人	4,604	758,278,800	
	平和不動産リート投資法人	5,767	862,166,500	
	野村不動産マスターファンド投資法人	28,788	4,701,080,400	
投資証券　合計		520,080	97,218,415,500	
合計			97,218,415,500	

（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）

	2022年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	73,604,812
コール・ローン	5,145,867
株式	1,733,265,395
新株予約権証券	46,464
投資信託受益証券	3,052,691
投資証券	41,351,748
派生商品評価勘定	8,005,822
未収入金	16,738
未収配当金	2,029,732
差入委託証拠金	77,988,863
流動資産合計	1,944,508,132
資産合計	1,944,508,132
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	314,393
未払解約金	15,000
流動負債合計	329,393
負債合計	329,393
純資産の部	
元本等	
元本	463,055,146
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,481,123,593
元本等合計	1,944,178,739
純資産合計	1,944,178,739
負債純資産合計	1,944,508,132

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10月21日 至　2022年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
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	2022年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	538,753,749円
同期中追加設定元本額	8,319,792円
同期中一部解約元本額	84,018,395円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	167,683,133円
新光外国株式インデックスＶＡ	193,130,144円

世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	84,447,188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）	2,845,094円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	9,189,596円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	5,759,991円
計	463,055,146円
２．　受益権の総数	463,055,146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10月21日 至　2022年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年4月20日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△107,996,655
新株予約権証券	△2,478
投資信託受益証券	△142,816
投資証券	1,211,080
合計	△106,930,869

（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11月11日から2022年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年4月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	157,265,090	－	164,956,519	7,691,429
合計	157,265,090	－	164,956,519	7,691,429

（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）

	2022年4月20日現在
1口当たり純資産額	4.1986円
（1万口当たり純資産額）	(41,986円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年4月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	115	3,162.310	363,665.650	
	ABBOTT LABORATORIES	446	119.980	53,511.080	
	AES CORP	157	24.420	3,833.940	
	ABIOMED INC	12	323.420	3,881.040	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	228	129.150	29,446.200	
	ADVANCED MICRO DEVICES	412	96.930	39,935.160	
	ADOBE INC	120	436.400	52,368.000	
	CHUBB LTD	109	209.920	22,881.280	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	55	249.570	13,726.350	
	ALLEGHANY CORP	3	837.280	2,511.840	
	ALLSTATE CORP	72	141.740	10,205.280	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	173	197.200	34,115.600	
	AMGEN INC	143	253.370	36,231.910	
	HESS CORP	67	114.380	7,663.460	
	AMERICAN EXPRESS CO	166	187.170	31,070.220	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	134	102.430	13,725.620	
	AFLAC INC	164	65.490	10,740.360	
	AMERICAN INTL GROUP	207	63.610	13,167.270	
	AMERCO	2	561.390	1,122.780	
	ANALOG DEVICES	136	162.320	22,075.520	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	181	63.530	11,498.930	
	VALERO ENERGY CORP	102	107.740	10,989.480	
	ANSYS INC	23	291.460	6,703.580	
	APPLE INC	4,149	167.400	694,542.600	
	APPLIED MATERIALS INC	228	117.060	26,689.680	
	ALBEMARLE CORP	32	218.150	6,980.800	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	147	95.930	14,101.710	
	AMEREN CORP	72	96.620	6,956.640	
	ARROW ELECTRONICS INC	21	112.030	2,352.630	
	AUTODESK INC	54	203.800	11,005.200	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	108	229.600	24,796.800	
	AUTOZONE INC	5	2,196.790	10,983.950	
	AVERY DENNISON CORP	24	169.030	4,056.720	
	BALL CORP	79	87.630	6,922.770	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	330	348.500	115,005.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	203	46.520	9,443.560	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	128	76.510	9,793.280	
	BECTON DICKINSON & CO	71	263.490	18,707.790	
	AMETEK INC	57	130.130	7,417.410	

VERIZON COMM INC	1,058	53.750	56,867.500	
WR BERKLEY CORP	45	69.200	3,114.000	
BEST BUY CO INC	52	95.570	4,969.640	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	6	556.460	3,338.760	
YUM! BRANDS INC	72	124.640	8,974.080	
FIRSTENERGY CORP	141	47.500	6,697.500	
BOEING CO	138	185.980	25,665.240	
ROBERT HALF INTL INC	25	113.100	2,827.500	
BORGWARNER INC	42	38.430	1,614.060	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	353	45.720	16,139.160	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	30	103.390	3,101.700	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	26	140.370	3,649.620	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	6	1,331.040	7,986.240	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	564	76.400	43,089.600	
ONEOK INC	124	72.170	8,949.080	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	17	146.020	2,482.340	
UNITED RENTALS INC	18	351.480	6,326.640	
SEMPRA ENERGY	80	170.270	13,621.600	
FEDEX CORP	64	208.810	13,363.840	
VERISIGN INC	26	218.280	5,675.280	
AMPHENOL CORP	144	71.110	10,239.840	
BROWN-FORMAN CORP	80	68.030	5,442.400	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	218	6.410	1,397.380	
CSX CORP	569	35.290	20,080.010	
COTERRA ENERGY INC	182	30.470	5,545.540	
CAMPBELL SOUP CO	55	46.200	2,541.000	
CONSTELLATION BRANDS INC	41	253.870	10,408.670	
CARDINAL HEALTH INC	64	62.720	4,014.080	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	204	19.910	4,061.640	
CATERPILLAR INC	136	232.160	31,573.760	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	26	144.280	3,751.280	
CITRIX SYSTEMS INC	27	101.940	2,752.380	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	194	11.530	2,236.820	
CERNER CORP	75	93.460	7,009.500	
JPMORGAN CHASE & CO	747	131.120	97,946.640	
CHURCH & DWIGHT CO INC	62	102.350	6,345.700	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	40	138.840	5,553.600	
CINTAS CORP	23	418.960	9,636.080	
CISCO SYSTEMS INC	1,070	51.830	55,458.100	
CLOROX COMPANY	28	145.310	4,068.680	
COCA-COLA CO/THE	1,043	65.070	67,868.010	

COPART INC	57	120.420	6,863.940	
COGNEX CORP	46	71.980	3,311.080	
COLGATE-PALMOLIVE CO	203	80.610	16,363.830	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	66	188.780	12,459.480	
MOLINA HEALTHCARE INC	15	335.570	5,033.550	
NRG ENERGY, INC.	79	39.710	3,137.090	
COMCAST CORP-CL A	1,153	48.110	55,470.830	
CONAGRA BRANDS INC	103	36.230	3,731.690	
CONSOLIDATED EDISON INC	89	98.010	8,722.890	
CMS ENERGY CORP	79	72.310	5,712.490	
COOPER COS INC	14	410.770	5,750.780	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	39	55.870	2,178.930	
CORNING INC	219	34.710	7,601.490	
SEALED AIR CORP	32	67.700	2,166.400	
HEICO CORP-CL A	14	124.600	1,744.400	
CUMMINS INC	37	201.280	7,447.360	
DR HORTON INC	78	74.120	5,781.360	
DANAHER CORP	162	273.100	44,242.200	
MOODY'S CORP	42	333.540	14,008.680	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	135	85.740	11,574.900	
TARGET CORP	120	246.050	29,526.000	
DEERE & CO	75	437.820	32,836.500	
MORGAN STANLEY	341	88.910	30,318.310	
REPUBLIC SERVICES INC	57	133.720	7,622.040	
COSTAR GROUP INC	93	63.330	5,889.690	
THE WALT DISNEY CO	457	131.900	60,278.300	
DOLLAR TREE INC	58	171.870	9,968.460	
DOVER CORP	35	151.680	5,308.800	
OMNICOM GROUP	49	80.820	3,960.180	
DTE ENERGY CO	52	137.770	7,164.040	
DUKE ENERGY CORP	196	114.470	22,436.120	
DARDEN RESTAURANTS INC	34	135.400	4,603.600	
EBAY INC	151	55.170	8,330.670	
BANK OF AMERICA CORP	1,866	39.570	73,837.620	
CITIGROUP INC	493	52.920	26,089.560	
EASTMAN CHEMICAL CO	38	109.570	4,163.660	
EATON CORP PLC	102	145.770	14,868.540	
CADENCE DESIGN SYS INC	70	155.620	10,893.400	
DISH NETWORK CORP	70	33.500	2,345.000	
ECOLAB INC	61	180.760	11,026.360	
PERKINELMER INC	27	160.800	4,341.600	
ELECTRONIC ARTS INC	76	124.040	9,427.040	
SALESFORCE INC	246	191.390	47,081.940	
ERIE INDEMNITY CO	6	179.000	1,074.000	
EMERSON ELECTRIC CO	152	95.690	14,544.880	
ATMOS ENERGY CORP	31	120.610	3,738.910	
ENTERGY CORP	56	124.550	6,974.800	

EOG RESOURCES INC	146	121.760	17,776.960	
EQUIFAX INC	29	218.430	6,334.470	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	60	274.560	16,473.600	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	43	98.690	4,243.670	
EXXON MOBIL CORP	1,071	87.760	93,990.960	
FMC CORP	28	139.330	3,901.240	
NEXTERA ENERGY INC	494	81.830	40,424.020	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	10	434.490	4,344.900	
FAIR ISAAC CORP	7	409.550	2,866.850	
ASSURANT INC	17	189.520	3,221.840	
FASTENAL CO	141	56.700	7,994.700	
FIFTH THIRD BANCORP	168	40.790	6,852.720	
M&T BANK CORP	35	162.040	5,671.400	
FISERV INC	147	102.450	15,060.150	
FORD MOTOR CO	980	16.150	15,827.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	101	26.760	2,702.760	
FREEPORT-MCMORAN INC	370	50.640	18,736.800	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	3	656.500	1,969.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	54	179.500	9,693.000	
DENTSPLY SIRONA INC	63	42.200	2,658.600	
GENERAL DYNAMICS CORP	62	246.590	15,288.580	
GENERAL MILLS INC	155	71.720	11,116.600	
GENUINE PARTS CO	35	133.820	4,683.700	
GILEAD SCIENCES INC	318	62.780	19,964.040	
GARTNER INC	20	306.350	6,127.000	
MCKESSON CORP	37	324.700	12,013.900	
NVIDIA CORP	632	221.980	140,291.360	
GENERAL ELECTRIC CO	274	91.900	25,180.600	
WW GRAINGER INC	11	507.730	5,585.030	
HALLIBURTON CO	233	41.310	9,625.230	
MONSTER BEVERAGE CORP	94	83.800	7,877.200	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	85	335.950	28,555.750	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	49	257.730	12,628.770	
HASBRO INC	39	87.840	3,425.760	
HENRY SCHEIN INC	38	88.920	3,378.960	
HEICO CORP	13	150.210	1,952.730	
HERSHEY FOODS CORP	40	226.980	9,079.200	
HP INC	287	38.690	11,104.030	
F5 INC	14	202.460	2,834.440	
CROWN HOLDINGS INC NPR	35	120.630	4,222.050	
JUNIPER NETWORKS INC	73	35.770	2,611.210	
HOLOGIC INC	71	76.280	5,415.880	
HOME DEPOT INC	263	307.800	80,951.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	41	80.580	3,303.780	
HORMEL FOODS CORP	67	53.730	3,599.910	

CENTERPOINT ENERGY INC	182	32.170	5,854.940	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6	246.470	1,478.820	
HUMANA INC	31	458.690	14,219.390	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	25	173.880	4,347.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	381	14.070	5,360.670	
BIOGEN INC	40	223.020	8,920.800	
IDEX CORP	18	193.610	3,484.980	
ILLINOIS TOOL WORKS	78	203.390	15,864.420	
INTUIT INC	68	485.070	32,984.760	
IDEXX LABORATORIES INC	20	500.850	10,017.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	59	149.730	8,834.070	
INTEL CORP	1,028	47.930	49,272.040	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	66	124.540	8,219.640	
INTERNATIONAL PAPER CO	105	48.650	5,108.250	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	96	35.550	3,412.800	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	33	147.350	4,862.550	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19	202.180	3,841.420	
INCYTE CORP	42	79.470	3,337.740	
JOHNSON & JOHNSON	668	183.080	122,297.440	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	85	73.470	6,244.950	
KLA CORPORATION	38	337.820	12,837.160	
DEVON ENERGY CORP	174	63.000	10,962.000	
KELLOGG CO	68	68.300	4,644.400	
KEYCORP	263	21.430	5,636.090	
KIMBERLY-CLARK CORP	85	126.870	10,783.950	
BLACKROCK INC/NEW YORK	40	701.570	28,062.800	
KROGER CO	190	57.790	10,980.100	
LAM RESEARCH CORP	35	479.190	16,771.650	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	11	482.460	5,307.060	
PACKAGING CORP OF AMERICA	23	163.940	3,770.620	
AKAMAI TECHNOLOGIES	42	121.340	5,096.280	
PLUG POWER INC	130	28.050	3,646.500	
LENNAR CORP	72	79.550	5,727.600	
ELI LILLY & CO	205	297.010	60,887.050	
BATH & BODY WORKS INC	75	55.570	4,167.750	
LINCOLN NATIONAL CORP	41	67.520	2,768.320	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	185	190.690	35,277.650	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	75	126.530	9,489.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	63	459.900	28,973.700	

LOEWS CORP	55	65.680	3,612.400	
LOWE'S COS INC	169	203.040	34,313.760	
DOMINION ENERGY INC	202	86.970	17,567.940	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	110	42.770	4,704.700	
MCCORMICK & CO INC	61	101.530	6,193.330	
MCDONALD'S CORPORATION	189	255.400	48,270.600	
S&P GLOBAL INC	89	395.350	35,186.150	
EVEREST RE GROUP LTD	9	291.130	2,620.170	
MARKEL CORPORATION	3	1,471.740	4,415.220	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	152	124.520	18,927.040	
MARSH & MCLENNAN COS	128	172.060	22,023.680	
MASCO CORP	62	51.020	3,163.240	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	16	369.700	5,915.200	
METLIFE INC	185	71.840	13,290.400	
MEDTRONIC PLC	338	110.220	37,254.360	
ACTIVISION BLIZZARD INC	196	79.030	15,489.880	
CVS HEALTH CORP	332	103.860	34,481.520	
MERCK & CO.INC.	638	85.790	54,734.020	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	108	56.380	6,089.040	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	25	271.140	6,778.500	
MICROSOFT CORP	1,806	285.300	515,251.800	
MICRON TECH INC	284	72.730	20,655.320	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	147	68.900	10,128.300	
3M CO	144	150.100	21,614.400	
MOHAWK INDUSTRIES INC	17	127.880	2,173.960	
ENTEGRIS INC	35	116.600	4,081.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	12	288.550	3,462.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	42	234.220	9,837.240	
ILLUMINA INC	39	342.270	13,348.530	
XCEL ENERGY INC	135	74.840	10,103.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	29	97.780	2,835.620	
NETAPP INC	60	77.110	4,626.600	
NEWELL BRANDS INC	74	22.870	1,692.380	
NEWMONT CORP	200	82.860	16,572.000	
NOVAVAX INC	22	54.590	1,200.980	
NVR INC	1	4,444.640	4,444.640	
NIKE INC-CL B	321	137.050	43,993.050	
NORDSON CORP	16	223.140	3,570.240	
NORFOLK SOUTHERN CORP	63	264.860	16,686.180	
EVERSOURCE ENERGY	82	92.500	7,585.000	
NISOURCE INC	84	31.770	2,668.680	
NORTHERN TRUST CORP	48	111.690	5,361.120	

NORTHROP GRUMMAN CORP	38	464.410	17,647.580	
WELLS FARGO & CO	1,008	47.830	48,212.640	
NUCOR CORP	71	171.830	12,199.930	
CHENIERE ENERGY INC	62	139.130	8,626.060	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	110	141.590	15,574.900	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	248	60.380	14,974.240	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	28	273.820	7,666.960	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	17	730.290	12,414.930	
ORACLE CORP	414	79.560	32,937.840	
PACCAR INC	87	85.900	7,473.300	
PTC INC	27	99.920	2,697.840	
EXELON CORP	276	49.500	13,662.000	
PARKER HANNIFIN CORP	34	282.950	9,620.300	
PAYCHEX INC	83	137.460	11,409.180	
ALIGN TECHNOLOGY INC	20	424.540	8,490.800	
PPL CORPORATION	171	29.830	5,100.930	
PEPSICO INC	351	172.900	60,687.900	
PENTAIR PLC	48	53.620	2,573.760	
PFIZER INC	1,418	50.180	71,155.240	
ESSENTIAL UTILITIES INC	50	49.230	2,461.500	
CONOCOPHILLIPS	333	101.560	33,819.480	
PG&E CORP	392	12.310	4,825.520	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	58	250.820	14,547.560	
ALTRIA GROUP INC	467	55.220	25,787.740	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	106	178.050	18,873.300	
BROWN & BROWN INC	58	70.160	4,069.280	
GARMIN LTD	39	113.200	4,414.800	
PPG INDUSTRIES INC	63	129.640	8,167.320	
IPG PHOTONICS CORP	12	100.240	1,202.880	
COSTCO WHOLESALE CORP	112	594.300	66,561.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	55	145.120	7,981.600	
QUEST DIAGNOSTICS	28	135.880	3,804.640	
PROCTER & GAMBLE CO	617	159.410	98,355.970	
PROGRESSIVE CORP	151	111.150	16,783.650	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	131	73.080	9,573.480	
PULTE GROUP INC	65	43.690	2,839.850	
GLOBAL PAYMENTS INC	75	144.600	10,845.000	
QUALCOMM INC	284	141.050	40,058.200	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	48	113.050	5,426.400	
EXACT SCIENCES CORP	37	68.980	2,552.260	
REGENERON PHARMACEUTICALS	28	716.220	20,054.160	

RESMED INC	36	239.420	8,619.120	
US BANCORP	356	52.880	18,825.280	
SEAGEN INC	33	144.290	4,761.570	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	100	48.920	4,892.000	
ROSS STORES INC	95	107.360	10,199.200	
ROLLINS INC	68	34.590	2,352.120	
ROPER TECHNOLOGIES INC	27	462.750	12,494.250	
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	270.910	7,585.480	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	54	84.480	4,561.920	
RPM INTERNATIONAL INC	29	87.340	2,532.860	
ACCENTURE PLC-CL A	161	320.570	51,611.770	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	358	65.210	23,345.180	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	31	235.200	7,291.200	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	62	176.160	10,921.920	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	149	104.890	15,628.610	
BOOKING HOLDINGS INC	10	2,239.380	22,393.800	
SCHLUMBERGER LTD	343	43.430	14,896.490	
SCHWAB (CHARLES) CORP	368	76.900	28,299.200	
POOL CORP	10	429.790	4,297.900	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	48	130.600	6,268.800	
BUNGE LTD	34	123.240	4,190.160	
SEI INVESTMENTS CO	33	59.120	1,950.960	
ANTHEM INC	61	517.040	31,539.440	
AMERISOURCEBERGEN CORP	42	162.850	6,839.700	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	66	75.170	4,961.220	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	61	252.250	15,387.250	
CENTENE CORP	155	85.990	13,328.450	
SVB FINANCIAL GROUP	16	537.080	8,593.280	
SMITH (A.O.) CORP	26	65.370	1,699.620	
SNAP-ON INC	15	226.870	3,403.050	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	95	119.420	11,344.900	
ADVANCE AUTO PARTS	14	222.900	3,120.600	
EDISON INTERNATIONAL	100	71.810	7,181.000	
SOUTHERN CO	268	76.270	20,440.360	
TRUIST FINANCIAL CORP	326	52.010	16,955.260	
SOUTHWEST AIRLINES	52	47.350	2,462.200	
AT&T INC	1,805	19.490	35,179.450	
CHEVRON CORP	488	171.830	83,853.040	
STANLEY BLACK & DECKER INC	39	144.560	5,637.840	
STATE STREET CORP	99	74.910	7,416.090	
STARBUCKS CORP	292	81.220	23,716.240	
STEEL DYNAMICS INC	42	91.980	3,863.160	

STRYKER CORP	88	271.670	23,906.960	
NETFLIX INC	111	348.610	38,695.710	
NORTONLIFELOCK INC	130	26.870	3,493.100	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30	47.310	1,419.300	
SYNOPSYS INC	39	306.330	11,946.870	
SYSCO CORP	138	88.100	12,157.800	
INTUITIVE SURGICAL INC	88	294.860	25,947.680	
TELEFLEX INC	12	338.730	4,064.760	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	357	10.180	3,634.260	
TERADYNE INC	43	112.610	4,842.230	
TEXAS INSTRUMENTS INC	235	179.060	42,079.100	
TEXTRON INC	55	70.090	3,854.950	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	99	574.150	56,840.850	
GLOBE LIFE INC	31	102.690	3,183.390	
DAVITA INC	16	120.760	1,932.160	
TRACTOR SUPPLY CO	30	221.650	6,649.500	
BIO-TECHNE CORP	10	413.250	4,132.500	
TRIMBLE INC	66	69.310	4,574.460	
TYLER TECHNOLOGIES INC	11	410.790	4,518.690	
TYSON FOODS INC	78	97.480	7,603.440	
UGI CORP	40	36.720	1,468.800	
UNION PACIFIC CORP	165	245.620	40,527.300	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	380	104.550	39,729.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	237	537.700	127,434.900	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	18	151.460	2,726.280	
VF CORP	73	57.370	4,188.010	
PARAMOUNT GLOBAL	149	36.280	5,405.720	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	66	282.520	18,646.320	
VULCAN MATERIALS CO	32	177.210	5,670.720	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	198	45.600	9,028.800	
WALMART INC	387	157.650	61,010.550	
WASTE MANAGEMENT INC	107	159.080	17,021.560	
WATERS CORP	14	300.800	4,211.200	
WEBSTER FINANCIAL CORP	36	52.260	1,881.360	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	20	371.000	7,420.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	26	142.320	3,700.320	
VAIL RESORTS INC	12	265.230	3,182.760	
WESTERN DIGITAL CORP	78	48.950	3,818.100	
WABTEC CORP	43	90.950	3,910.850	
WHIRLPOOL CORP	14	176.550	2,471.700	

SKYWORKS SOLUTIONS INC	40	122.000	4,880.000	
WYNN RESORTS LTD	18	77.800	1,400.400	
NASDAQ INC	29	181.040	5,250.160	
CME GROUP INC	92	234.100	21,537.200	
WILLIAMS COS INC	312	35.410	11,047.920	
LKQ CORP	68	49.760	3,383.680	
ALLIANT ENERGY CORP	57	63.880	3,641.160	
WEC ENERGY GROUP INC	77	104.520	8,048.040	
CARMAX INC	48	96.290	4,621.920	
TJX COMPANIES INC	297	65.430	19,432.710	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	15	406.620	6,099.300	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	343	4.820	1,653.260	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	100	56.030	5,603.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	30	161.200	4,836.000	
SIGNATURE BANK	16	288.200	4,611.200	
CBRE GROUP INC	82	86.460	7,089.720	
LIBERTY GLOBAL PLC	59	25.490	1,503.910	
REGIONS FINANCIAL CORP	254	21.680	5,506.720	
DOMINO'S PIZZA INC	10	394.080	3,940.800	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	11	437.450	4,811.950	
T-MOBILE US INC	157	132.840	20,855.880	
LAS VEGAS SANDS CORP	88	38.240	3,365.120	
MOSAIC CO/THE	88	77.980	6,862.240	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	9	263.710	2,373.390	
CELANESE CORP	30	147.390	4,421.700	
DEXCOM INC	24	491.790	11,802.960	
EXPEDIA GROUP INC	36	186.340	6,708.240	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	53	107.000	5,671.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	29	297.630	8,631.270	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	90	26.290	2,366.100	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	143	122.930	17,578.990	
LIVE NATION	45	113.740	5,118.300	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	1,632.030	11,424.210	
TRANSDIGM GROUP INC	13	643.740	8,368.620	
MASTERCARD INC	222	363.870	80,779.140	
WESTERN UNION CO	133	19.240	2,558.920	
OWENS CORNING	19	87.650	1,665.350	
LEIDOS HOLDINGS INC	31	109.610	3,397.910	
AERCAP HOLDINGS NV	25	52.760	1,319.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	80	6.840	547.200	

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	28	154.640	4,329.920	
DELTA AIR LINES INC	27	43.040	1,162.080	
INSULET CORP	20	270.830	5,416.600	
DISCOVER FINANCIAL	71	118.750	8,431.250	
TE CONNECTIVITY LTD	80	124.380	9,950.400	
MASIMO CORP	15	136.330	2,044.950	
LULULEMON ATHLETICA INC	29	404.660	11,735.140	
VMWARE INC	51	111.670	5,695.170	
MERCADOLIBRE INC	12	1,130.350	13,564.200	
ULTA BEAUTY INC	14	428.370	5,997.180	
INVESCO LTD	75	21.740	1,630.500	
MSCI INC	21	490.520	10,300.920	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	394	102.580	40,416.520	
VISA INC	423	215.700	91,241.100	
KEURIG DR PEPPER INC	195	37.560	7,324.200	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	42	164.380	6,903.960	
MARATHON PETROLEUM CORP	156	90.440	14,108.640	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	42	71.730	3,012.660	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	552	19.600	10,819.200	
XYLEM INC	46	85.340	3,925.640	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	70	110.610	7,742.700	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	8	224.110	1,792.880	
SPLUNK INC	39	136.440	5,321.160	
EPAM SYSTEMS INC	16	297.980	4,767.680	
ZILLOW GROUP INC	26	46.610	1,211.860	
HCA HEALTHCARE INC	64	261.960	16,765.440	
VERISK ANALYTICS INC	38	215.330	8,182.540	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	166.540	2,664.640	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	18	261.110	4,699.980	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	41	163.210	6,691.610	
NXP SEMICONDUCTOR NV	71	178.650	12,684.150	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	28	87.380	2,446.640	
LEAR CORP	13	132.180	1,718.340	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	23	117.780	2,708.940	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	57	71.800	4,092.600	
DOLLAR GENERAL CORP	56	255.360	14,300.160	
FORTINET INC	35	335.190	11,731.650	
HORIZON PHARMA PLC	54	114.750	6,196.500	

TESLA INC	216	1,028.150	222,080.400	
GENERAC HOLDINGS INC	15	267.200	4,008.000	
ENPHASE ENERGY INC	31	195.600	6,063.600	
GENERAL MOTORS CO	322	42.080	13,549.760	
ALLY FINANCIAL INC	84	44.810	3,764.040	
APTIV PLC	73	110.470	8,064.310	
PHILLIPS 66	121	89.550	10,835.550	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	17	93.010	1,581.170	
META PLATFORMS INC	598	217.310	129,951.380	
IQVIA HOLDINGS INC	47	237.870	11,179.890	
DIAMONDBACK ENERGY INC	44	137.920	6,068.480	
SERVICENOW INC	50	514.400	25,720.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	25	628.560	15,714.000	
WORKDAY INC	49	224.620	11,006.380	
ABBVIE INC	450	156.350	70,357.500	
ZOETIS INC	118	185.940	21,940.920	
NEWS CORP/NEW-CL A	90	21.730	1,955.700	
CDW CORP	36	173.940	6,261.840	
HOWMET AEROSPACE INC	90	36.640	3,297.600	
TWILIO INC	45	145.170	6,532.650	
COUPA SOFTWARE INC	20	99.270	1,985.400	
SNAP INC	283	33.630	9,517.290	
TRADE DESK INC A	115	66.890	7,692.350	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	59	68.420	4,036.780	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	9	45.380	408.420	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	55	45.310	2,492.050	
OKTA INC	35	149.050	5,216.750	
BLACK KNIGHT INC	50	68.090	3,404.500	
BAKER HUGHES CO	215	36.740	7,899.100	
BROADCOM INC	105	597.620	62,750.100	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	23	105.440	2,425.120	
MONGODB INC	16	416.000	6,656.000	
BURLINGTON STORES INC	20	227.540	4,550.800	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	107	26.120	2,794.840	
VEEVA SYSTEMS INC	36	199.260	7,173.360	
TWITTER INC	197	46.160	9,093.520	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	49	48.240	2,363.760	
EVERGY INC	52	71.110	3,697.720	
ALLEGION PLC	20	109.290	2,185.800	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	30	61.320	1,839.600	
STERIS PLC	28	247.350	6,925.800	
DOCUSIGN INC	51	102.030	5,203.530	
WIX.COM LTD	14	94.150	1,318.100	
DROPBOX INC	57	23.180	1,321.260	
KKR & CO INC	127	56.430	7,166.610	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	16	34.390	550.240	

ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	51	111.180	5,670.180	
MODERNA INC	86	152.720	13,133.920	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	73	163.140	11,909.220	
ARAMARK	70	37.290	2,610.300	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	150	18.680	2,802.000	
CIGNA CORP	86	261.030	22,448.580	
DELL TECHNOLOGIES INC	79	47.990	3,791.210	
DOW INC	185	67.050	12,404.250	
AMCOR PLC	431	11.760	5,068.560	
PINTEREST INC	158	22.720	3,589.760	
PELOTON INTERACTIVE INC	73	24.530	1,790.690	
FOX CORP-A	100	39.180	3,918.000	
FOX CORP-B	24	36.200	868.800	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	105	17.070	1,792.350	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	52	228.660	11,890.320	
CHEWY INC	26	42.390	1,102.140	
AVANTOR INC	134	31.670	4,243.780	
LYFT INC	78	36.310	2,832.180	
DYNATRACE INC	38	42.870	1,629.060	
CLOUDFLARE INC	65	111.150	7,224.750	
TRADEWEB MARKETS INC	24	84.530	2,028.720	
CARRIER GLOBAL CORP	223	42.500	9,477.500	
OTIS WORLDWIDE CORP	100	75.370	7,537.000	
INMODE LTD	11	30.880	339.680	
UBER TECHNOLOGIES INC	370	33.800	12,506.000	
CORTEVA INC	182	61.140	11,127.480	
MATCH GROUP INC	66	93.910	6,198.060	
BILL.COM HOLDINGS INC	19	206.820	3,929.580	
BLACKSTONE INC	173	117.480	20,324.040	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	5	63.800	319.000	
CARLYLE GROUP INC	43	43.950	1,889.850	
10X GENOMICS INC	22	63.710	1,401.620	
DATADOG INC	57	137.280	7,824.960	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	50	84.130	4,206.500	
UPSTART HOLDINGS INC	6	87.500	525.000	
INGERSOLL RAND INC	105	47.950	5,034.750	
PAYCOM SOFTWARE INC	12	318.970	3,827.640	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	54	39.150	2,114.100	
ASANA INC	16	32.860	525.760	
UNITY SOFTWARE INC	15	91.640	1,374.600	
AON PLC	55	330.790	18,193.450	
SOFI TECHNOLOGIES INC	108	7.410	800.280	
WARNER BROS DISCOVERY INC	550	24.490	13,469.500	
BENTLEY SYSTEMS INC	54	44.380	2,396.520	

COINBASE GLOBAL INC	9	151.270	1,361.430	
AFFIRM HOLDINGS INC	29	37.030	1,073.870	
IAC/INTERACTIVECORP	17	97.170	1,651.890	
AIRBNB INC	75	170.120	12,759.000	
ZENDESK INC	30	129.120	3,873.600	
CONSTELLATION ENERGY CORP	94	66.710	6,270.740	
ROYALTY PHARMA PLC	75	44.200	3,315.000	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	69	56.680	3,910.920	
VIATRIS INC	354	10.920	3,865.680	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	48	71.750	3,444.000	
DRAFTKINGS INC	88	16.880	1,485.440	
SNOWFLAKE INC	57	197.430	11,253.510	
DOORDASH INC	27	106.510	2,875.770	
ARISTA NETWORKS INC	64	128.840	8,245.760	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	96	58.590	5,624.640	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	385	12.910	4,970.350	
FNF GROUP	57	42.570	2,426.490	
MARVELL TECHNOLOGY INC	206	63.770	13,136.620	
ROBINHOOD MARKETS INC	31	11.560	358.360	
LUCID GROUP INC	101	21.410	2,162.410	
GRAB HOLDINGS LTD	153	3.290	503.370	
CATALENT INC	39	95.330	3,717.870	
SYNCHRONY FINANCIAL	147	40.700	5,982.900	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	111	44.040	4,888.440	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	175.810	1,406.480	
WAYFAIR INC	21	106.600	2,238.600	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	50	148.360	7,418.000	
HUBSPOT INC	11	454.950	5,004.450	
QORVO INC	25	117.340	2,933.500	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	4	134.540	538.160	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	40	139.480	5,579.200	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	13	304.820	3,962.660	
GODADDY INC	39	86.800	3,385.200	
KORNIT DIGITAL LTD	11	72.830	801.130	
ETSY INC	37	115.290	4,265.730	
TRANSUNION	54	95.070	5,133.780	
BLOCK INC	125	125.620	15,702.500	
DUPONT DE NEMOURS INC	137	69.270	9,489.990	
CARVANA CO	21	101.770	2,137.170	

	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	65	49.520	3,218.800	
	TELADOC HEALTH INC	42	64.620	2,714.040	
	WESTROCK CO	54	51.320	2,771.280	
	KRAFT HEINZ CO	166	42.610	7,073.260	
	NOVOCURE LTD	28	82.440	2,308.320	
	FORTIVE CORP	85	59.080	5,021.800	
	WASTE CONNECTIONS INC	64	138.370	8,855.680	
	ALPHABET INC-CL A	76	2,600.180	197,613.680	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	337	16.110	5,429.070	
	PAYPAL HOLDINGS INC	279	103.660	28,921.140	
	SEA LTD ADR	80	107.530	8,602.400	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	94	31.840	2,992.960	
	SUNRUN INC	55	24.500	1,347.500	
	ZILLOW GROUP INC-C	52	48.340	2,513.680	
	ALPHABET INC-CL C	72	2,610.620	187,964.640	
	ZSCALER INC	22	228.790	5,033.380	
	CABLE ONE INC	1	1,415.070	1,415.070	
	LINDE PLC	129	318.150	41,041.350	
	ROKU INC	35	116.780	4,087.300	
	AVALARA INC	27	91.020	2,457.540	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	31	557.750	17,290.250	
	VISTRA CORP	95	24.820	2,357.900	
アメリカ・ドル　小計		80,834		9,842,635.490 (1,273,932,307)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	69	16.870	1,164.030	
	ASHTEAD GROUP	110	45.920	5,051.200	
	SEVERN TRENT PLC	53	30.290	1,605.370	
	BARCLAYS PLC	3,904	1.457	5,688.120	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	208	5.152	1,071.610	
	BT GROUP PLC	2,169	1.858	4,030.000	
	BHP GROUP LTD	558	29.760	16,606.080	
	BUNZL PLC	94	30.670	2,882.980	
	AVIVA PLC	1,035	4.358	4,510.530	
	CRODA INTERNATIONAL	30	74.180	2,225.400	
	DIAGEO PLC	587	38.675	22,702.220	
	SCHRODERS PLC	39	31.120	1,213.680	
	DCC PLC	34	59.000	2,006.000	
	NATIONAL GRID PLC	933	11.680	10,897.440	
	KINGFISHER PLC	697	2.598	1,810.800	
	BAE SYSTEMS PLC	863	7.600	6,558.800	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	549	32.770	17,990.730	
	HALMA PLC	74	24.960	1,847.040	
	NEXT PLC	39	62.380	2,432.820	
	IMPERIAL BRANDS PLC	255	16.755	4,272.520	

JOHNSON MATTHEY PLC	52	19.140	995.280	
ANGLO AMERICAN PLC	334	41.550	13,877.700	
COMPASS GROUP PLC	452	16.695	7,546.140	
HSBC HOLDINGS PLC	5,101	5.256	26,810.850	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,632	2.717	4,434.140	
UNILEVER PLC	644	34.215	22,034.460	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	165	11.125	1,835.620	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	76	16.305	1,239.180	
PEARSON PLC	156	7.670	1,196.520	
PERSIMMON PLC	64	21.850	1,398.400	
PRUDENTIAL PLC	649	10.560	6,853.440	
RIO TINTO PLC	293	61.420	17,996.060	
VODAFONE GROUP PLC	7,132	1.303	9,292.990	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	176	59.500	10,472.000	
RELX PLC	486	23.990	11,659.140	
RENTOKIL INITIAL PLC	440	5.140	2,261.600	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	2,163	0.955	2,065.660	
NATWEST GROUP PLC	1,586	2.204	3,495.540	
ST JAMES'S PLACE PLC	100	13.575	1,357.500	
SSE PLC	294	17.850	5,247.900	
BP PLC	4,853	4.010	19,460.530	
SAGE GROUP PLC(THE)	255	7.202	1,836.510	
SMITHS GROUP PLC	111	14.535	1,613.380	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14	124.650	1,745.100	
STANDARD CHARTERED PLC	631	5.084	3,208.000	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	18,296	0.453	8,288.080	
TAYLOR WIMPLEY PLC	1,208	1.321	1,595.760	
TESCO PLC	1,834	2.703	4,957.300	
3I GROUP PLC	267	13.345	3,563.110	
SMITH & NEPHEW PLC	195	12.340	2,406.300	
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,274	17.596	22,417.300	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	81	79.600	6,447.600	
WPP PLC	274	9.778	2,679.170	
ASTRAZENECA PLC	391	105.000	41,055.000	
WHITBREAD PLC	63	29.100	1,833.300	
INTERTEK GROUP PLC	49	49.430	2,422.070	
BURBERRY GROUP PLC	83	16.110	1,337.130	
INTERCONTINENTAL HOTELS	44	51.840	2,280.960	
SAINSBURY (J) PLC	302	2.449	739.590	
ADMIRAL GROUP PLC	59	24.440	1,441.960	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	34	39.870	1,355.580	

	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	43	20.810	894.830	
	AVEVA GROUP PLC	29	24.210	702.090	
	ABRDN PLC	765	1.932	1,477.980	
	EXPERIAN PLC	235	27.110	6,370.850	
	MONDI PLC	125	14.430	1,803.750	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	117	9.592	1,122.260	
	OCADO GROUP PLC	126	11.430	1,440.180	
	INFORMA PLC	294	5.974	1,756.350	
	GLENCORE PLC	2,486	5.356	13,315.010	
	ENTAIN PLC	153	15.740	2,408.220	
	COCA-COLA HBC AG	72	15.715	1,131.480	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	130	6.164	801.320	
	FERGUSON PLC	57	102.500	5,842.500	
	M&G PLC	858	2.096	1,798.360	
	JD SPORTS FASHION PLC	595	1.430	850.850	
	SHELL PLC	1,942	22.280	43,267.760	
	AUTO TRADER GROUP PLC	284	6.420	1,823.280	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	1,427	1.214	1,732.370	
イギリス・ポンド　小計		74,351		489,860.660 (82,536,623)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	318	31.410	9,988.380	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	429	35.110	15,062.190	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5	716.000	3,580.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	247	19.860	4,905.420	
	ICL GROUP LTD	193	40.900	7,893.700	
	NICE LTD	16	678.400	10,854.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48	123.900	5,947.200	
	AZRIELI GROUP	17	288.300	4,901.100	
イスラエル・シュケル　小計		1,273		63,132.390 (2,522,120)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	50	64.390	3,219.500	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	720	27.750	19,980.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	925	24.400	22,570.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	426	21.730	9,256.980	
	TELSTRA CORP LTD	956	4.030	3,852.680	
	ASX LTD	48	82.370	3,953.760	
	BHP GROUP LTD	736	53.170	39,133.120	
	AMPOL LTD	49	32.120	1,573.880	
	COMPUTERSHARE LT	150	25.750	3,862.500	
	CSL LIMITED	121	262.350	31,744.350	
	REA GROUP LTD	17	127.360	2,165.120	
	TRANSURBAN GROUP	756	13.750	10,395.000	

COCHLEAR LTD	14	224.450	3,142.300	
ORIGIN ENERGY LTD	315	6.590	2,075.850	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	438	107.010	46,870.380	
RIO TINTO LIMITED	98	121.660	11,922.680	
APA GROUP	357	11.100	3,962.700	
ARISTOCRAT LEISU	148	32.850	4,861.800	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	522	4.380	2,286.360	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	119	40.890	4,865.910	
ORICA LTD	100	16.290	1,629.000	
LEND LEASE CORP LTD	207	11.350	2,349.450	
BLUESCOPE STEEL LTD	133	22.000	2,926.000	
MACQUARIE GROUP LTD	88	205.550	18,088.400	
SUNCORP GROUP LTD	321	11.180	3,588.780	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	836	33.250	27,797.000	
NEWCREST MINING LTD	195	28.840	5,623.800	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	136	5.390	733.040	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	428	12.260	5,247.280	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	333	11.480	3,822.840	
REECE LTD	101	17.220	1,739.220	
SANTOS LTD	759	8.320	6,314.880	
SONIC HEALTHCARE	137	35.500	4,863.500	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	40	28.800	1,152.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	433	5.410	2,342.530	
WESFARMERS LTD	285	48.510	13,825.350	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	227	32.910	7,470.570	
WOOLWORTHS GROUP LTD	324	38.610	12,509.640	
SEEK LTD	81	28.230	2,286.630	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	16	80.750	1,292.000	
MINERAL RESOURCES LTD	45	61.660	2,774.700	
BRAMBLES LTD	288	9.920	2,856.960	
CROWN RESORTS LTD	93	12.840	1,194.120	
EVOLUTION MINING LTD	356	4.680	1,666.080	
AURIZON HOLDINGS LTD	267	3.870	1,033.290	
TREASURY WINE ESTATES LTD	186	11.100	2,064.600	
XERO LTD	41	100.950	4,138.950	
IDP EDUCATION LTD	49	27.500	1,347.500	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	402	7.810	3,139.620	
MEDIBANK PVT LTD	807	3.170	2,558.190	
SOUTH32 LTD(AUD)	1,072	5.240	5,617.280	

	COLES GROUP LTD	354	18.340	6,492.360	
	WISETECH GLOBAL LTD	39	46.350	1,807.650	
オーストラリア・ドル　小計		16,144		393,988.080 (37,716,479)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	127	80.920	10,276.840	
	BARRICK GOLD CORP	421	31.550	13,282.550	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	79	13.090	1,034.110	
	BANK OF MONTREAL	167	144.540	24,138.180	
	BANK OF NOVA SCOTIA	316	85.830	27,122.280	
	NATIONAL BANK OF CANADA	84	94.610	7,947.240	
	BCE INC	8	73.280	586.240	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	350	69.190	24,216.500	
	BAUSCH HEALTH COS INC	71	27.950	1,984.450	
	SAPUTO INC	38	30.890	1,173.820	
	BLACKBERRY LTD	197	8.350	1,644.950	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	130	19.650	2,554.500	
	CGI INC	57	102.570	5,846.490	
	CCL INDUSTRIES INC	23	56.930	1,309.390	
	CAE INC	67	34.420	2,306.140	
	CAMECO CORP	90	38.140	3,432.600	
	ROGERS COMM-CL B	96	73.790	7,083.840	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	116	145.990	16,934.840	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	294	84.500	24,843.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	18	190.640	3,431.520	
	CANADIAN UTILITIES LTD	12	39.270	471.240	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	180	160.700	28,926.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	53	46.090	2,442.770	
	OPEN TEXT CORP	77	53.110	4,089.470	
	EMPIRE CO LTD	48	44.000	2,112.000	
	KINROSS GOLD CORP	311	7.620	2,369.820	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	33	70.550	2,328.150	
	FORTIS INC	106	63.620	6,743.720	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	146	42.150	6,153.900	
	TELUS CORP	88	33.580	2,955.040	
	GREAT WEST LIFECO INC	70	37.010	2,590.700	
	IMPERIAL OIL LTD	76	63.790	4,848.040	
	ENBRIDGE INC	518	58.570	30,339.260	
	IGM FINANCIAL INC	35	43.370	1,517.950	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	501	26.880	13,466.880	
	LOBLAW CO LTD	45	118.420	5,328.900	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	204	58.180	11,868.720	

MAGNA INTERNATIONAL INC	73	80.200	5,854.600	
SUN LIFE FINANCIAL INC	143	68.460	9,789.780	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	711.490	4,268.940	
METRO INC	56	72.830	4,078.480	
EMERA INC	58	64.490	3,740.420	
ONEX CORP	13	81.360	1,057.680	
PAN AMERICAN SILVER CORP	73	36.170	2,640.410	
POWER CORP OF CANADA	164	39.010	6,397.640	
QUEBECOR INC-B	38	32.490	1,234.620	
ROYAL BANK OF CANADA	367	138.720	50,910.240	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	235	98.000	23,030.000	
SHAW COMM INC-B	132	38.920	5,137.440	
SUNCOR ENERGY INC	355	42.970	15,254.350	
LUNDIN MINING CORP	208	13.920	2,895.360	
TECK RESOURCES LTD-CL B	114	54.490	6,211.860	
THOMSON REUTERS CORP	48	134.270	6,444.960	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	19	123.290	2,342.510	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	470	94.450	44,391.500	
TC ENERGY CORP	243	72.390	17,590.770	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	27	101.200	2,732.400	
WESTON (GEORGE) LTD	16	159.620	2,553.920	
INTACT FINANCIAL CORP	49	179.990	8,819.510	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	99	64.020	6,337.980	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	2,272.620	11,363.100	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	49	208.310	10,207.190	
TOURMALINE OIL CORP	84	63.190	5,307.960	
KEYERA CORP	42	34.000	1,428.000	
PARKLAND CORP	41	36.500	1,496.500	
ALTAGAS LTD	79	30.980	2,447.420	
PEMBINA PIPELINE CORP	142	50.230	7,132.660	
DOLLARAMA INC	67	75.140	5,034.380	
CENOVUS ENERGY INC W/I	358	22.650	8,108.700	
NORTHLAND POWER INC	57	39.950	2,277.150	
TMX GROUP LTD	17	129.270	2,197.590	
IVANHOE MINES LTD	210	11.950	2,509.500	
NUTRIEN LTD	143	143.040	20,454.720	
TFI INTERNATIONAL INC	19	105.060	1,996.140	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	29	32.050	929.450	
WSP GLOBAL INC	32	164.920	5,277.440	
IA FINANCIAL CORP INC	34	74.290	2,525.860	
GFL ENVIRONMENTAL INC	58	42.250	2,450.500	
NUVEI CORP	14	86.800	1,215.200	

	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	48	49.210	2,362.080	
	AIR CANADA	21	23.940	502.740	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	80	75.980	6,078.400	
	SHOPIFY INC	28	764.630	21,409.640	
	FIRSTSERVICE CORP	9	172.540	1,552.860	
	CANOPY GROWTH CORP	81	7.500	607.500	
	HYDRO ONE LTD	74	34.690	2,567.060	
カナダ・ドル　小計		10,079		672,857.150 (69,068,786)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	600	4.050	2,430.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	500	33.000	16,500.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	200	8.330	1,666.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	300	9.920	2,976.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	2,300	0.790	1,817.000	
	KEPPEL CORP LTD	300	6.600	1,980.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	900	11.900	10,710.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,100	2.580	5,418.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	400	5.440	2,176.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	300	30.430	9,129.000	
	UOL GROUP LIMITED	100	7.050	705.000	
	VENTURE CORP LTD	100	16.960	1,696.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	500	4.530	2,265.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	400	3.970	1,588.000	
シンガポール・ドル　小計		9,000		61,056.000 (5,774,676)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	688	7.278	5,007.260	
	LOGITECH INTL-REG	39	66.980	2,612.220	
	NESTLE SA-REGISTERED	716	121.640	87,094.240	
	CIE FINANC RICHEMONT	130	119.600	15,548.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	179	377.250	67,527.750	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	13	191.600	2,490.800	
	SIKA INHABER	35	311.200	10,892.000	
	SGS SA-REG	1	2,513.000	2,513.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	558	87.090	48,596.220	
	BALOISE HOLDING AG -R	8	173.200	1,385.600	
	BARRY CALLEBAUT AG	1	2,232.000	2,232.000	
	CLARIANT AG-REG	69	15.930	1,099.170	
	SWISSCOM AG-REG	8	568.600	4,548.800	
	ABB LTD	430	29.800	12,814.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	44	38.260	1,683.440	
	GEBERIT AG	10	546.000	5,460.000	

	LONZA GROUP AG-REG	18	634.600	11,422.800	
	GIVAUDAN-REG	2	3,806.000	7,612.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	39	449.000	17,511.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	7	409.400	2,865.800	
	HOLCIM LTD	133	43.930	5,842.690	
	TEMENOS GROUP	21	94.940	1,993.740	
	BACHEM HOLDING AG	1	484.600	484.600	
	SONOVA HOLDING AG	13	382.200	4,968.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	14	265.800	3,721.200	
	STRAUMANN HOLDING AG	3	1,273.000	3,819.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6	256.100	1,536.600	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	49.060	490.600	
	SCHINDLER NAMEN	6	189.800	1,138.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	8	617.800	4,942.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING	2	860.500	1,721.000	
	SWISS PRIME SITE AG	22	93.800	2,063.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	6	1,130.500	6,783.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	62	48.720	3,020.640	
	SWISS RE LTD	78	82.420	6,428.760	
	ALCON INC	129	74.260	9,579.540	
	VIFOR PHARMA AG	16	168.800	2,700.800	
	UBS GROUP AG	875	16.820	14,717.500	
	VAT GROUP AG	7	316.800	2,217.600	
スイス・フラン　小計		4,407		389,086.770 (52,861,329)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	156	470.300	73,366.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	111	414.000	45,954.000	
	ERICSSON LM-B SHS	714	81.980	58,533.720	
	GETINGE AB-B SHS	49	350.500	17,174.500	
	INVESTOR AB-A SHS	102	224.600	22,909.200	
	LUNDBERGS B	9	480.700	4,326.300	
	SKF AB-B SHS	126	157.900	19,895.400	
	SANDVIK AB	292	196.400	57,348.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	379	106.600	40,401.400	
	SKANSKA AB-B SHS	112	199.450	22,338.400	
	SWEDBANK AB	230	155.150	35,684.500	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	143	198.650	28,406.950	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	365	93.160	34,003.400	
	VOLVO AB-A SHS	47	162.000	7,614.000	
	VOLVO AB-B SHS	362	157.800	57,123.600	
	SWEDISH MATCH AB	413	78.500	32,420.500	
	TELE2 AB-B SHS	145	147.150	21,336.750	
	INDUSTRIVARDEN A	19	267.000	5,073.000	

	INDUSTRIVARDEN C	40	261.300	10,452.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	58	154.020	8,933.160	
	SECURITAS AB-B SHS	101	116.600	11,776.600	
	INVESTOR AB-B SHS	493	208.250	102,667.250	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	211	131.160	27,674.760	
	ASSA ABLOY AB-B	244	247.900	60,487.600	
	TELIA CO AB	640	39.410	25,222.400	
	LUNDIN ENERGY AB	48	431.100	20,692.800	
	BOLIDEN AB	76	502.800	38,212.800	
	ALFA LAVAL AB	73	311.000	22,703.000	
	KINNEVIK AB-B	83	231.400	19,206.200	
	FASTIGHETS AB BALDER	24	538.200	12,916.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	141	92.520	13,045.320	
	NIBE INDUSTRIER AB	342	102.800	35,157.600	
	HEXAGON AB-B SHS	473	131.250	62,081.250	
	SAGAX AB	24	246.300	5,911.200	
	EPIROC AB-A	166	198.450	32,942.700	
	EPIROC AB-B	117	167.150	19,556.550	
	ESSITY AB-B	157	229.000	35,953.000	
	EQT AB	78	356.700	27,822.600	
	EMBRACER GROUP AB	154	71.800	11,057.200	
	LIFCO AB	43	220.100	9,464.300	
	EVOLUTION AB	46	964.600	44,371.600	
	NORDEA BANK ABP	810	99.520	80,611.200	
	INVESTMENT AB LATOUR	23	286.200	6,582.600	
	SINCH AB	140	56.980	7,977.200	
スウェーデン・クローナ　小計		8,579		1,337,390.910 (18,148,395)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	30	853.600	25,608.000	
	A P MOLLER A/S	1	19,195.000	19,195.000	
	AP MOLLER MAERSK A	1	18,660.000	18,660.000	
	DANSKE BANK A/S	164	112.700	18,482.800	
	GENMAB A/S	16	2,630.000	42,080.000	
	NOVOZYMES-B SHS	48	461.100	22,132.800	
	ROCKWOOL AS	2	1,957.000	3,914.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	430	790.700	340,001.000	
	GN STORE NORD A/S	38	279.500	10,621.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	249	203.300	50,621.700	
	COLOPLAST-B	31	1,082.500	33,557.500	
	DSV A/S	52	1,145.000	59,540.000	
	DEMANT A/S	33	297.200	9,807.600	
	TRYG A/S	84	166.450	13,981.800	
	PANDORA A/S	24	643.400	15,441.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	35	534.600	18,711.000	
	AMBU A/S B	18	106.850	1,923.300	
	ORSTED A/S	46	813.300	37,411.800	
デンマーク・クローネ　小計		1,302		741,690.900	

				(13,928,955)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	345	7.690	2,653.050	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	101	9.020	911.020	
	FISHER & PAYKEL	148	22.260	3,294.480	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	595	4.850	2,885.750	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	87	5.900	513.300	
	MERIDIAN ENERGY LTD	456	4.850	2,211.600	
ニュージーランド・ドル　小計		1,732		12,469.200 (1,089,434)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	113	254.700	28,781.100	
	NORSK HYDRO ASA	358	90.480	32,391.840	
	TELENOR ASA	162	131.000	21,222.000	
	SCHIBSTED ASA	9	197.700	1,779.300	
	ORKLA ASA	236	78.060	18,422.160	
	EQUINOR ASA	257	340.000	87,380.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33	489.400	16,150.200	
	AKER BP ASA	16	361.200	5,779.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24	210.400	5,049.600	
	ADEVINTA ASA	72	70.550	5,079.600	
	DNB BANK ASA	229	194.150	44,460.350	
	SCHIBSTED ASA	29	180.100	5,222.900	
ノルウェー・クローネ　小計		1,538		271,718.250 (3,980,672)	
ユーロ	CRH PLC	198	36.495	7,226.010	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	46	102.150	4,698.900	
	KERRY GROUP PLC-A	44	100.050	4,402.200	
	KINGSPAN GROUP PLC	39	85.640	3,339.960	
	UMICORE	47	38.460	1,807.620	
	AIR LIQUIDE	119	160.900	19,147.100	
	AIRBUS SE	155	104.220	16,154.100	
	AXA SA	472	26.590	12,550.480	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	170	27.340	4,647.800	
	ADIDAS AG	50	203.700	10,185.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	277	18.750	5,193.750	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.000	0.000	
	DASSAULT AVIATION SA	10	159.300	1,593.000	
	DANONE	153	52.630	8,052.390	
	SAFRAN SA	88	102.800	9,046.400	
	INTESA SANPAOLO	3,864	1.973	7,623.670	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	89	78.020	6,943.780	
	ACCOR SA	56	29.670	1,661.520	
	BOUYGUES	48	31.480	1,511.040	
	BNP PARIBAS	272	49.745	13,530.640	
	THALES SA	26	129.000	3,354.000	

CAPGEMINI SA	42	187.800	7,887.600	
UNICREDIT SPA	576	9.288	5,349.880	
KONINKLIJKE DSM NV	44	155.100	6,824.400	
COMMERZBANK AG	231	6.520	1,506.120	
EIFFAGE	26	92.920	2,415.920	
FRESENIUS SE & CO KGAA	117	34.360	4,020.120	
UNITED INTERNET	42	30.990	1,301.580	
FUCHS PETROLUB SE PREF	21	30.060	631.260	
PUBLICIS GROUPE	63	55.880	3,520.440	
FAURECIA	23	22.530	518.190	
IBERDROLA SA	1,528	10.465	15,990.520	
ENI SPA	623	14.150	8,815.450	
JERONIMO MARTINS	86	20.860	1,793.960	
KESKO OYJ-B	72	23.880	1,719.360	
KBC GROUPE	68	64.000	4,352.000	
HANNOVER RUECK SE	14	144.400	2,021.600	
WARTSILA OYJ	111	8.492	942.610	
L'OREAL	63	350.950	22,109.850	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	69	634.100	43,752.900	
GEA GROUP AG	52	37.680	1,959.360	
BOLLORE	224	4.482	1,003.960	
MEDIOBANCA SPA	225	9.236	2,078.100	
MICHELIN(CGDE)-B	41	121.400	4,977.400	
CONTINENTAL AG	25	65.980	1,649.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	262	41.405	10,848.110	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	79	15.400	1,216.600	
OMV AG	35	45.200	1,582.000	
VERBUND AG	22	95.400	2,098.800	
PERNOD-RICARD	51	191.150	9,748.650	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	46	82.120	3,777.520	
RENAULT SA	68	22.745	1,546.660	
REPSOL SA	386	13.645	5,266.970	
REMY COINTREAU	8	186.900	1,495.200	
MERCK KGAA	31	179.950	5,578.450	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	130	51.580	6,705.400	
RWE AG	149	40.200	5,989.800	
SEB SA	9	125.200	1,126.800	
SOCIETE GENERALE-A	211	23.170	4,888.870	
VINCI S.A.	131	89.240	11,690.440	
SODEXO	26	70.760	1,839.760	
SOFINA	3	314.400	943.200	
SOLVAY SA	18	88.060	1,585.080	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	133	140.740	18,718.420	
VIVENDI SE	221	11.890	2,627.690	
SAP SE	263	97.170	25,555.710	

TELEFONICA S.A	1,318	4.943	6,514.870	
TOTALENERGIES SE	623	47.345	29,495.930	
VALEO	78	17.040	1,329.120	
E.ON SE	625	10.100	6,312.500	
VOEST-ALPINE AG	26	25.040	651.040	
HENKEL AG & CO KGAA	31	58.300	1,807.300	
SIEMENS AG-REG	191	117.120	22,369.920	
UPM-KYMMENE OYJ	138	30.650	4,229.700	
ING GROEP NV-CVA	937	9.550	8,948.350	
PUMA AG	29	75.440	2,187.760	
BAYER AG	243	66.420	16,140.060	
STORA ENSO OYJ-R SHS	169	19.680	3,325.920	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	45	58.600	2,637.000	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	211	64.280	13,563.080	
BASF SE	241	52.190	12,577.790	
BEIERSDORF AG	20	93.360	1,867.200	
HEIDELBERGCEMENT AG	37	51.700	1,912.900	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	58	62.460	3,622.680	
ASM INTERNATIONAL NV	12	298.350	3,580.200	
ORANGE	527	11.170	5,886.590	
SAMPO OYJ-A SHS	140	47.330	6,626.200	
RANDSTAD NV	32	51.840	1,658.880	
ALLIANZ SE	101	218.050	22,023.050	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	767	4.695	3,601.060	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	265	28.465	7,543.220	
HERMES INTL	8	1,237.000	9,896.000	
ENDESA S.A.	51	19.440	991.440	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	188	7.202	1,353.970	
ERSTE GROUP BANK AG	95	31.890	3,029.550	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	36	238.500	8,586.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	178	30.415	5,413.870	
DASSAULT SYSTEMES SA	169	40.245	6,801.400	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	46	24.740	1,138.040	
HEINEKEN NV	72	89.340	6,432.480	
AKZO NOBEL	41	76.800	3,148.800	
ASML HOLDING NV	105	561.600	58,968.000	
AEGON NV	404	5.240	2,116.960	
VOLKSWAGEN AG	5	214.600	1,073.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	50	153.000	7,650.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,617	5.082	8,217.590	
KERING	20	529.900	10,598.000	
CNP ASSURANCES	20	21.820	436.400	
FORTUM OYJ	90	15.820	1,423.800	

AGEAS	50	47.110	2,355.500	
UCB SA	35	115.300	4,035.500	
NEMETSCHEK SE	12	83.280	999.360	
CARREFOUR SA	136	20.600	2,801.600	
NATURGY ENERGY GROUP SA	35	29.110	1,018.850	
NOKIA OYJ	1,466	4.861	7,126.220	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	244	27.395	6,684.380	
WOLTERS KLUWER-CVA	67	96.580	6,470.860	
SANOFI	287	102.540	29,428.980	
STMICROELECTRONICS NV	169	34.595	5,846.550	
ELISA OYJ	33	55.500	1,831.500	
BANCO SANTANDER SA	4,178	3.162	13,210.830	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	134	19.155	2,566.770	
QIAGEN N.V.	53	43.290	2,294.370	
DEUTSCHE BANK AG-REG	482	11.002	5,302.960	
BMW VORZUG	19	69.250	1,315.750	
ENEL SPA	2,088	6.181	12,905.920	
COLRUYT NV	6	34.940	209.640	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	810	17.136	13,880.160	
SARTORIUS AG	8	374.800	2,998.400	
UBISOFT ENTERTAINMENT	27	36.630	989.010	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	315	27.680	8,719.200	
RATIONAL AG	1	621.000	621.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	12	131.250	1,575.000	
BECHTLE AG	21	44.650	937.650	
KONINKLIJKE KPN NV	888	3.346	2,971.240	
EUROFINS SCIENTIFIC	38	94.880	3,605.440	
TELEPERFORMANCE	14	325.300	4,554.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	47	163.800	7,698.600	
EURAZEO	11	77.500	852.500	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	27	93.820	2,533.140	
HEINEKEN HOLDING NV-A	31	72.050	2,233.550	
INDITEX	245	20.770	5,088.650	
ESSILORLUXOTTICA	76	165.250	12,559.000	
SNAM SPA	513	5.358	2,748.650	
CREDIT AGRICOLE SA	292	10.050	2,934.600	
ORPEA	19	35.210	668.990	
ENAGAS	61	20.950	1,277.950	
WENDEL	13	95.000	1,235.000	
TENARIS SA	163	15.025	2,449.070	
TELECOM ITALIA SPA	1,698	0.306	519.580	
ATLANTIA SPA	119	22.780	2,710.820	
PROXIMUS	39	17.245	672.550	
TERNA SPA	397	8.088	3,210.930	
BIOMERIEUX	17	95.700	1,626.900	
GRIFOLS SA	92	16.040	1,475.680	
FERROVIAL SA	135	25.340	3,420.900	

LANXESS AG	26	35.710	928.460	
NESTE OYJ	100	43.630	4,363.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	13	11.320	147.160	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	33	48.140	1,588.620	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	89	10.455	930.490	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	11	190.200	2,092.200	
KONE OYJ	98	46.420	4,549.160	
ELIA GROUP	4	154.000	616.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	8	337.400	2,699.200	
ENGIE	468	11.686	5,469.040	
ALSTOM	87	21.530	1,873.110	
ELECTRICITE DE FRANCE	75	8.650	648.750	
IPSEN SA	5	115.200	576.000	
ARKEMA SA	14	109.150	1,528.100	
LEGRAND SA	66	82.160	5,422.560	
AMPLIFON SPA	27	40.820	1,102.140	
ADP	10	143.850	1,438.500	
ORION OYJ	14	42.270	591.780	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	92	11.775	1,083.300	
SYMRISE AG	30	107.800	3,234.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	60	38.550	2,313.000	
PRYSMIAN SPA	62	29.880	1,852.560	
DIASORIN SPA	3	134.150	402.450	
CAIXABANK	1,237	3.035	3,754.290	
BUREAU VERITAS SA	95	25.220	2,395.900	
GETLINK	123	17.175	2,112.520	
EDP RENOVAVEIS SA	78	22.800	1,778.400	
AMADEUS IT GROUP SA	122	56.840	6,934.480	
BRENNTAG SE	39	73.720	2,875.080	
EVONIK INDUSTRIES AG	66	24.620	1,624.920	
EDENRED	76	49.280	3,745.280	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	239	2.767	661.310	
LEG IMMOBILIEN SE	12	99.140	1,189.680	
KION GROUP AG	14	55.000	770.000	
VONOVIA SE	189	39.130	7,395.570	
KNORR-BREMSE AG	22	69.660	1,532.520	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65	55.820	3,628.300	
FERRARI NV	34	205.600	6,990.400	
CNH INDUSTRIAL NV	269	14.505	3,901.840	
AROUNDTOWN SA	287	4.933	1,415.770	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	25	35.690	892.250	
MONCLER SPA	60	49.650	2,979.000	

	NEXI SPA	160	9.040	1,446.400	
	PROSUS NV	223	44.880	10,008.240	
	JDE PEET'S BV	9	27.240	245.160	
	SIEMENS ENERGY AG	92	19.560	1,799.520	
	INPOST SA	49	5.428	265.970	
	EURONEXT NV	16	80.700	1,291.200	
	IMCD NV	12	148.700	1,784.400	
	WORLDLINE SA	70	35.020	2,451.400	
	NN GROUP NV	69	47.810	3,298.890	
	FINECOBANK SPA	147	13.785	2,026.390	
	ARGENX SE	10	297.800	2,978.000	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	169	24.460	4,133.740	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	117	24.520	2,868.840	
	ZALANDO SE	43	43.440	1,867.920	
	STELLANTIS NV	490	13.348	6,540.520	
	AENA SME SA	17	150.150	2,552.550	
	CELLNEX TELECOM SAU	134	45.280	6,067.520	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	60	26.100	1,566.000	
	ABN AMRO BANK NV	70	11.855	829.850	
	EXOR NV	29	68.940	1,999.260	
	SCOUT24 SE	9	59.540	535.860	
	COVESTRO AG	43	44.760	1,924.680	
	HELLOFRESH SE	52	39.220	2,039.440	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	227	54.580	12,389.660	
	POSTE ITALIANE SPA	150	9.654	1,448.100	
	AMUNDI SA	10	60.500	605.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	59	10.435	615.660	
	ADYEN NV	5	1,665.800	8,329.000	
	UNIPER SE	15	23.200	348.000	
	DELIVERY HERO SE	49	35.500	1,739.500	
ユーロ　小計		62,257		1,133,526.850 (158,387,707)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	864	16.600	14,342.400	
	CLP HOLDINGS LTD	235	76.450	17,965.750	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	53.500	26,750.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	266	331.000	88,046.000	
	MTR CORP	403	42.200	17,006.600	
	HANG SENG BANK LTD	200	152.000	30,400.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	86	33.150	2,850.900	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	567	52.350	29,682.450	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,515	8.980	22,584.700	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	45.500	24,433.500	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,184	29.450	34,868.800	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	890	31.800	28,302.000	
	SINO LAND CO	576	10.720	6,174.720	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	95.300	47,650.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	273	111.800	30,521.400	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	600	12.900	7,740.000	
	AIA GROUP LTD	3,151	78.350	246,880.850	
	HKT TRUST / HKT LTD	1,080	10.860	11,728.800	
	SANDS CHINA LTD	574	18.300	10,504.200	
	SWIRE PROPERTIES LTD	432	20.050	8,661.600	
	ESR CAYMAN LTD	600	24.300	14,580.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	1,000	7.680	7,680.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	500	19.920	9,960.000	
	WH GROUP LTD	1,500	5.260	7,890.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	534	57.100	30,491.400	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	534	55.150	29,450.100	
香港・ドル　小計		20,101		807,146.170 (13,317,912)	
合計		291,597		1,733,265,395 (1,733,265,395)	

（２）株式以外の有価証券

2022年4月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	スイス・フラン	CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23	456.000	342.000	
	スイス・フラン　小計		456.000	342.000 (46,464)	
新株予約権証券　合計			456	46,464 (46,464)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	286.000	3,091.660	
		GOODMAN GROUP	410.000	9,249.600	
		GPT GROUP	525.000	2,693.250	
		MIRVAC GROUP	1,078.000	2,630.320	
		SCENTRE GROUP	1,109.000	3,304.820	
		STOCKLAND	473.000	1,948.760	
		VICINITY CENTRES	700.000	1,312.500	
	オーストラリア・ドル　小計		4,581.000	24,230.910 (2,319,625)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,100.000	3,146.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,479.000	3,327.750	

		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	200.000	372.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	500.000	905.000	
	シンガポール・ドル　小計		3,279.000	7,750.750 (733,066)	
投資信託受益証券　合計			7,860	3,052,691 (3,052,691)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	80.000	948.800	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	37.000	7,309.350	
		AMERICAN TOWER CORP	113.000	29,241.010	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	322.000	2,109.100	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	35.000	8,642.200	
		BOSTON PROPERTIES INC	41.000	5,174.610	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	24.000	3,977.760	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	112.000	21,713.440	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	76.000	11,426.600	
		DUKE REALTY TRUST	102.000	6,141.420	
		EQUINIX INC	22.000	16,592.840	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	45.000	3,652.650	
		EQUITY RESIDENTIAL	95.000	8,641.200	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	18.000	6,258.240	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	36.000	7,859.520	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	139.000	4,846.930	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	154.000	3,146.220	
		INVITATION HOMES INC	160.000	6,886.400	
		IRON MOUNTAIN INC	83.000	4,686.180	
		KIMCO REALTY	151.000	3,895.800	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	125.000	2,476.250	
		MID AMERICA	29.000	6,017.790	
		PROLOGIS INC	186.000	31,538.160	
		PUBLIC STORAGE	40.000	16,526.800	
		REALTY INCOME CORP	148.000	10,969.760	
		REGENCY CENTERS CORP	38.000	2,721.940	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	29.000	10,466.390	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	81.000	10,636.920	
		SUN COMMUNITIES INC	31.000	5,833.890	
		UDR INC	90.000	5,220.000	
		VENTAS INC	95.000	5,753.200	
		VICI PROPERTIES INC	151.000	4,517.920	
		VORNADO REALTY TRUST	26.000	1,083.940	
		WELLTOWER INC	111.000	10,742.580	

		WEYERHAEUSER CO	207.000	8,576.010	
		WP CAREY INC	53.000	4,517.190	
	アメリカ・ドル　小計		3,285.000	300,749.010 (38,925,944)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	255.000	1,306.620	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	134.000	1,014.640	
		SEGRO PLC	297.000	4,024.350	
	イギリス・ポンド　小計		686.000	6,345.610 (1,069,172)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	10.000	524.100	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15.000	375.450	
	カナダ・ドル　小計		25.000	899.550 (92,339)	
	ユーロ	COVIVIO	4.000	289.400	
		GECINA SA	7.000	767.900	
		KLEPIERRE	31.000	716.720	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	33.000	2,317.590	
	ユーロ　小計		75.000	4,091.610 (571,721)	
	香港・ドル	LINK REIT	607.000	41,974.050	
	香港・ドル　小計		607.000	41,974.050 (692,572)	
投資証券　合計			4,678	41,351,748 (41,351,748)	
合計				44,450,903 (44,450,903)	

（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　605銘柄	65.53	－	－	－	73.85
	投資証券　36銘柄	－	－	－	2.00	
イギリス・ポンド	株式　79銘柄	4.25	－	－	－	4.70
	投資証券　3銘柄	－	－	－	0.05	
イスラエル・シュケル	株式　8銘柄	0.13	－	－	－	0.14
オーストラリア・ドル	株式　53銘柄	1.94	－	－	－	2.25
	投資信託受益証券　7銘柄	－	－	0.12	－	

カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.55	－	－	－	3.89
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.00	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.30	－	－	－	0.37
	投資信託受益証券	4銘柄	－	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式	39銘柄	2.72	－	－	－	2.98
	新株予約権証券	1銘柄	－	0.00	－	－	
スウェーデン・クローナ	株式	44銘柄	0.93	－	－	－	1.02
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.72	－	－	－	0.78
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.06	－	－	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.20	－	－	－	0.22
ユーロ	株式	229銘柄	8.15	－	－	－	8.94
	投資証券	4銘柄	－	－	－	0.03	
香港・ドル	株式	26銘柄	0.69	－	－	－	0.79
	投資証券	1銘柄	－	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

海外国債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,875,836
コール・ローン	87,902,215
国債証券	14,924,601,790
未収入金	1,812,585,244
未収利息	83,113,390
前払費用	7,494,946
流動資産合計	16,918,573,421
資産合計	16,918,573,421
負債の部	
流動負債	
未払金	1,788,649,797
未払解約金	16,400,000
流動負債合計	1,805,049,797
負債合計	1,805,049,797
純資産の部	
元本等	
元本	5,769,509,411
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	9,344,014,213
元本等合計	15,113,523,624
純資産合計	15,113,523,624
負債純資産合計	16,918,573,421

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10月21日 至　2022年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　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	2022年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,148,518,226円
同期中追加設定元本額	3,295,662円
同期中一部解約元本額	382,304,477円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	4,161,502,450円
海外国債ファンド（３ヵ月決算型）	756,314,440円
新光７資産バランスファンド	248,248,155円
海外国債ファンド（１年決算型）	19,605,912円
海外国債ファンド（変額年金）	583,838,454円
計	5,769,509,411円
２．　受益権の総数	5,769,509,411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10月21日 至　2022年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年4月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△1,365,098,551
合計	△1,365,098,551

（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11月5日から2022年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6196円 (26,196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

2022年4月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 04/30/23	4,300,000.000	4,219,710.910	
		US T N/B 0.625 08/15/30	5,000,000.000	4,158,593.750	
		US T N/B 1.25 08/15/31	5,100,000.000	4,411,101.530	

		US T N/B 1.375 11/15/31	10,900,000.000	9,512,804.630	
		US T N/B 1.625 05/15/31	9,600,000.000	8,627,249.940	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,500,000.000	3,206,875.000	
		US T N/B 1.875 02/15/32	20,000,000.000	18,239,062.390	
	アメリカ・ドル　小計		58,400,000.000 (7,558,712,000)	52,375,398.150 (6,778,947,785)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,800,000.000	1,539,270.000	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	300,000.000	280,088.880	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	500,000.000	455,502.670	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	1,844,897.100	
	イギリス・ポンド　小計		4,100,000.000 (690,809,000)	4,119,758.650 (694,138,135)	
	カナダ・ドル	CANADA 0.5 12/01/30	1,300,000.000	1,072,854.900	
		CANADA 1.25 06/01/30	800,000.000	712,276.800	
		CANADA 1.5 06/01/31	3,600,000.000	3,226,143.600	
		CANADA 1.5 12/01/31	1,050,000.000	934,971.450	
		CANADA 2.25 06/01/29	1,400,000.000	1,358,393.400	
	カナダ・ドル　小計		8,150,000.000 (836,597,500)	7,304,640.150 (749,821,311)	
	ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,700,000.000	2,507,139.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,500,000.000	2,286,122.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,460,000.000	2,266,914.600	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,700,000.000	2,401,709.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,300,000.000	3,034,874.700	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	2,550,000.000	2,244,102.000	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,000,000.000	2,887,257.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	700,000.000	692,323.800	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,000,000.000	748,709.000	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	6,200,000.000	6,106,094.800	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,000,000.000	2,214,660.000	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	3,916,626.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	5,000,000.000	4,228,583.100	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	3,000,000.000	2,690,700.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,500,000.000	1,576,995.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,000,000.000	2,120,352.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,500,000.000	6,038,582.000	
	ユーロ　小計		48,110,000.000 (6,722,410,300)	47,961,744.500 (6,701,694,559)	
国債証券　合計			15,808,528,800 (15,808,528,800)	14,924,601,790 (14,924,601,790)	
合計				14,924,601,790 (14,924,601,790)	

（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	7銘柄	44.85	45.42
イギリス・ポンド	国債証券	4銘柄	4.59	4.65
カナダ・ドル	国債証券	5銘柄	4.96	5.02
ユーロ	国債証券	17銘柄	44.34	44.90

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,298,077
コール・ローン	1,936,801
投資証券	768,646,601
未収配当金	574,236
流動資産合計	773,455,715
資産合計	773,455,715
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	－
負債合計	－
純資産の部	
元本等	
元本	259,914,707
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	513,541,008
元本等合計	773,455,715
純資産合計	773,455,715
負債純資産合計	773,455,715

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10月21日 至　2022年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	288,344,583円
同期中追加設定元本額	－円
同期中一部解約元本額	28,429,876円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	259,914,707円
計	259,914,707円
２．　受益権の総数	259,914,707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10月21日 至　2022年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年4月20日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	42,442,125
合計	42,442,125

（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）

	2022年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.9758円 (29,758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

2022年4月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	330.000	7,098.300	
		AGREE REALTY CORP	267.000	19,037.100	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	275.000	6,259.000	
		ALEXANDER'S INC.	8.000	2,113.840	

		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	636.000	125,641.800	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	39.000	733.200	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	190.000	6,912.200	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	521.000	33,760.800	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	1,120.000	48,160.000	
		AMERICAN TOWER CORP	1,726.000	446,637.020	
		AMERICOLD REALTY TRUST	1,014.000	28,858.440	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	594.000	31,416.660	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	566.000	3,854.460	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	814.000	14,676.420	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	253.000	3,660.910	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	64.000	555.520	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	533.000	131,608.360	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	99.000	2,628.450	
		BOSTON PROPERTIES INC	594.000	74,968.740	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	217.000	1,332.380	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	644.000	8,268.960	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,126.000	29,816.480	
		BROADSTONE NET LEASE INC	589.000	13,228.940	
		BRT APARTMENTS CORP	43.000	1,027.700	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	378.000	62,649.720	
		CARETRUST REIT INC	366.000	6,211.020	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	203.000	1,755.950	
		CEDAR REALTY TRUST INC	48.000	1,359.360	
		CENTERSPACE	53.000	5,286.750	
		CHATHAM LODGING TRUST	179.000	2,468.410	
		CITY OFFICE REIT INC	162.000	2,634.120	
		CLIPPER REALTY INC	46.000	439.300	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	738.000	10,058.940	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	90.000	3,636.000	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	429.000	12,140.700	
		COUSINS PROPERTIES INC	564.000	22,052.400	

CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	58.000	421.080	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	1,647.000	319,303.890	
CUBESMART	829.000	44,641.650	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	794.000	8,138.500	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,072.000	161,175.200	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	1,840.000	13,855.200	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	901.000	2,495.770	
DOUGLAS EMMETT INC	635.000	19,824.700	
DUKE REALTY TRUST	1,452.000	87,424.920	
EAST GROUP	153.000	31,950.990	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	332.000	6,716.360	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	543.000	4,865.280	
EPR PROPERTIES	283.000	15,570.660	
EQUINIX INC	342.000	257,943.240	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	673.000	54,627.410	
EQUITY RESIDENTIAL	1,408.000	128,071.680	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	457.000	12,028.240	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	248.000	86,224.640	
EXTRA SPACE STORAGE INC	501.000	109,378.320	
FARMLAND PARTNERS INC	109.000	1,775.610	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	297.000	37,068.570	
FIRST INDUSTRIAL RT	489.000	31,090.620	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	289.000	8,528.390	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	383.000	2,125.650	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	886.000	41,482.520	
GETTY REALTY CORP	151.000	4,329.170	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	149.000	3,432.960	
GLADSTONE LAND CORP	120.000	5,005.200	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	234.000	3,718.260	
GLOBAL NET LEASE INC	383.000	5,813.940	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	552.000	15,108.240	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	831.000	25,835.790	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,059.000	71,797.330	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	134.000	1,291.760	

		HIGHWOODS PROPERTIES INC	387.000	17,117.010	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	2,689.000	54,936.270	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	566.000	14,529.220	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	838.000	22,877.400	
		INDUS REALTY TRUST INC	22.000	1,627.560	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	247.000	5,125.250	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	257.000	7,938.730	
		INVITATION HOMES INC	2,280.000	98,131.200	
		IRON MOUNTAIN INC	1,090.000	61,541.400	
		JBG SMITH PROPERTIES	460.000	12,705.200	
		KILROY REALTY CORP	441.000	33,035.310	
		KIMCO REALTY	2,219.000	57,250.200	
		KITE REALTY GROUP TRUST	823.000	18,468.120	
		LAMAR ADVERTISING CO	328.000	37,680.640	
		LIFE STORAGE INC	310.000	45,796.300	
		LTC PROPERTIES INC	148.000	5,351.680	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	1,046.000	13,828.120	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,247.000	44,513.070	
		MID AMERICA	441.000	91,511.910	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	166.000	9,116.720	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	664.000	31,666.160	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	308.000	20,232.520	
		NETSTREIT CORP	151.000	3,504.710	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	84.000	7,437.360	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	182.000	4,559.100	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	907.000	24,371.090	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	67.000	2,081.020	
		ORION OFFICE REIT INC	211.000	2,958.220	
		OUTFRONT MEDIA INC	553.000	15,356.810	
		PARAMOUNT GROUP INC	709.000	7,472.860	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	897.000	17,751.630	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	494.000	12,374.700	
		PHILLIPS EDISON & CO INC	423.000	15,168.780	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	836.000	14,546.400	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	471.000	7,856.280	

PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	111.000	2,856.030	
POSTAL REALTY TRUST INC	64.000	1,125.760	
POTLATCH CORP	251.000	13,609.220	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	195.000	4,855.500	
PROLOGIS INC	2,818.000	477,820.080	
PS BUSINESS PARKS	76.000	12,781.680	
PUBLIC STORAGE	576.000	237,985.920	
RAYONIER INC	543.000	24,440.430	
REALTY INCOME CORP	2,161.000	160,173.320	
REGENCY CENTERS CORP	642.000	45,986.460	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	451.000	8,803.520	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	611.000	48,641.710	
RLJ LODGING TRUST	628.000	8,867.360	
RPT REALTY	306.000	4,274.820	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	204.000	20,030.760	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	862.000	10,706.040	
SAFEHOLD INC	79.000	3,754.870	
SAUL CENTERS INC	49.000	2,680.790	
SBA COMMUNICATIONS CORP	414.000	149,416.740	
SERVICE PROPERTIES TRUST	623.000	5,594.540	
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,246.000	163,624.720	
SITE CENTERS CORP	658.000	10,968.860	
SL GREEN	255.000	19,066.350	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	486.000	22,958.640	
STAG INDUSTRIAL INC	677.000	27,905.940	
STORE CAPITAL CORP	929.000	28,306.630	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	394.000	3,849.380	
SUN COMMUNITIES INC	438.000	82,427.220	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	827.000	9,990.160	
TANGER FACTORY OUTLET	388.000	6,867.600	
TERRENO REALTY CORP	280.000	21,649.600	
THE MACERICH COMPANY	812.000	11,700.920	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	450.000	3,568.500	
UDR INC	1,209.000	70,122.000	
UMH PROPERTIES INC	167.000	4,139.930	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	48.000	2,778.720	
URBAN EDGE PROPERTIES	440.000	8,531.600	

		URSTADT BIDDLE PROPERTIES	113.000	2,073.550	
		VENTAS INC	1,522.000	92,172.320	
		VERIS RESIDENTIAL INC	333.000	5,544.450	
		VICI PROPERTIES INC	2,402.000	71,867.840	
		VORNADO REALTY TRUST	667.000	27,807.230	
		WASHINGTON REIT	324.000	8,190.720	
		WELLTOWER INC	1,664.000	161,041.920	
		WEYERHAEUSER CO	2,862.000	118,572.660	
		WHITESTONE REIT	166.000	2,211.120	
		WP CAREY INC	722.000	61,536.060	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	433.000	8,395.870	
	アメリカ・ドル　小計		93,290.000	5,938,705.100 (768,646,601)	
投資証券　合計			93,290	768,646,601 (768,646,601)	
合計				768,646,601 (768,646,601)	

（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　153銘柄	99.38	100.00

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

「フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド」は、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）
資産		
流動資産		
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	**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**
資産合計	**20,132,206,603**	**24,246,092,169**
負債		
流動負債		
未払解約金	**—**	**303,520,000**
ブローカーに対する債務	**117,069,215**	**341,308,763**
未払費用	**25,152,333**	**27,096,268**
負債合計	**142,221,548**	**671,925,031**
受益証券保有者に帰属する純資産	**19,989,985,055**	**23,574,167,138**

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）
債券		
アンゴラ		
Angolan Government International Bond 8.00% due 26/11/2029 REGS	—	485,754,341
アンゴラ合計	—	485,754,341
アルゼンチン		
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
アルメニア		
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
アゼルバイジャン		
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
ベラルーシ		
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	227,784,666	—
ベラルーシ合計	740,974,163	614,069,501
ベナン		
Benin, Republik 4.875% due 19/01/2032	216,767,944	—
ベナン合計	216,767,944	—
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
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
ブラジル		
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
カメルーン		
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）
債券（続き）		
中国		
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.875% due 14/03/2025 REGS	—	632,529,013
中国合計	—	632,529,013
コロンビア		
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
コスタリカ		
Costa Rica Government International Bond 7.158% due 12/03/2045	129,447,393	—
コスタリカ合計	129,447,393	—
ドミニカ共和国		
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
エジプト		
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
エルサルバドル		
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
エチオピア		
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
ジョージア		
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
ガーナ		
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）
債券（続き）		
ホンジュラス		
Honduras Government International Bond 5.625% due 24/06/2030	198,720,395	—
ホンジュラス合計	198,720,395	—
インドネシア		
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
ジャマイカ		
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
ヨルダン		
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
カザフスタン		
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
ケニア		
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
メキシコ		
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】

2022年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	4,596,253,738円
Ⅱ　負債総額	1,855,676円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,594,398,062円
Ⅳ　発行済数量	4,363,601,813口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0529円

（参考）

ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド

2022年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	1,829,453,979円
Ⅱ　負債総額	48,348,547円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,781,105,432円
Ⅳ　発行済数量	656,393,501口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7135円

新光日本債券インデックスマザーファンド

2022年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	10,686,096,156円
Ⅱ　負債総額	44,068,200円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,642,027,956円
Ⅳ　発行済数量	8,430,665,207口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2623円

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

2022年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	100,072,913,819円
Ⅱ　負債総額	250,349,150円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	99,822,564,669円
Ⅳ　発行済数量	44,832,619,311口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2266円

新光外国株式インデックスマザーファンド

2022年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	1,816,933,932円
Ⅱ　負債総額	1,177,339円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,815,756,593円
Ⅳ　発行済数量	462,751,246口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9238円

海外国債マザーファンド

2022年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	14,912,858,651円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,912,858,651円
Ⅳ　発行済数量	5,760,766,060口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5887円

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

2022年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	**746,923,525円**
Ⅱ　負債総額	**80,000,000円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**666,923,525円**
Ⅳ　発行済数量	**232,387,351口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.8699円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2022年4月28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（2022年4月28日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書

を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年4月28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	1,471,714,623,702
追加型株式投資信託	810	14,822,397,858,988
単位型公社債投資信託	27	53,750,145,946
単位型株式投資信託	220	1,232,854,578,168
合計	1,083	17,580,717,206,804

３【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

2. 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期事業年度の財務諸表及び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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第37期事業年度（自2021年4月1日至2022年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）		第37期 （2022年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		36,734		31,421
金銭の信託		25,670		30,332
未収委託者報酬		16,804		17,567
未収運用受託報酬		5,814		4,348
未収投資助言報酬		317		309
未収収益		7		5
前払費用		724		1,167
その他		2,419		2,673
流動資産計		88,493		87,826
固定資産				
有形固定資産		1,119		1,268
建物	※1	915	※1	1,109
器具備品	※1	202	※1	158
建設仮勘定		0		-
無形固定資産		3,991		4,561
ソフトウエア		2,878		3,107
ソフトウエア仮勘定		1,109		1,449
電話加入権		3		3
投資その他の資産		11,153		10,153
投資有価証券		261		241
関係会社株式		5,299		5,349
長期差入保証金		1,324		1,102
繰延税金資産		3,676		3,092
その他		591		367
固定資産計		16,264		15,983
資産合計		104,757		103,810

（単位：百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	3,730	1,445
未払金	7,337	7,616
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	9
未払手数料	6,889	7,430
その他未払金	437	175
未払費用	9,713	8,501
未払法人税等	4,199	2,683
未払消費税等	2,106	1,330
賞与引当金	1,789	1,933
役員賞与引当金	76	69
流動負債計	28,954	23,581
固定負債		
退職給付引当金	2,292	2,507
時効後支払損引当金	157	147
固定負債計	2,450	2,655
負債合計	31,404	26,236
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	51,800	56,020
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	51,676	55,896
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	19,996	24,216
株主資本計	73,353	77,573
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	73,353	77,573
負債・純資産合計	104,757	103,810

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第36期 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）		第37期 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	89,905		108,563	
運用受託報酬	17,640		16,716	
投資助言報酬	1,103		1,587	
その他営業収益	781		12	
営業収益計		109,430		126,879
営業費用				
支払手数料	37,003		45,172	
広告宣伝費	424		391	
公告費	0		0	
調査費	30,794		36,488	
調査費	11,302		10,963	
委託調査費	19,491		25,525	
委託計算費	543		557	
営業雑経費	938		842	
通信費	46		35	
印刷費	680		606	
協会費	71		66	
諸会費	23		26	
支払販売手数料	116		106	
営業費用計		69,704		83,453
一般管理費				
給料	10,586		10,377	
役員報酬	163		168	
給料・手当	9,030		8,995	
賞与	1,392		1,213	
交際費	8		6	
寄付金	7		15	
旅費交通費	50		40	
租税公課	912		367	
不動産賃借料	1,499		1,674	
退職給付費用	524		495	
固定資産減価償却費	1,078		1,389	
福利厚生費	44		42	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	1,789		1,933	
役員賞与引当金繰入額	76		69	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,793		3,901	
事務用消耗品費	68		45	
器具備品費	0		0	
諸経費	152		217	
一般管理費計		20,594		20,578
営業利益		19,132		22,848

（単位：百万円）

	第36期 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）		第37期 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	27		13	
受取配当金	2		※1　559	
時効成立分配金・償還金	0		0	
為替差益	7		7	
金銭の信託運用益	1,229		―	
雑収入	13		19	
時効後支払損引当金戻入額	13		10	
営業外収益計		1,293		610
営業外費用				
投資信託償還損	0		―	
金銭の信託運用損	―		743	
早期割増退職金	48		20	
雑損失	0		―	
営業外費用計		48		764
経常利益		20,376		22,694
特別利益				
固定資産売却益	―		0	
特別利益計		―		0
特別損失				
固定資産除却損	1		5	
投資有価証券売却損	―		6	
ゴルフ会員権売却損	―		3	
オフィス再編費用	―		※2　509	
特別損失計		1		525
税引前当期純利益		20,375		22,169
法人税、住民税及び事業税		7,418		6,085
法人税等調整額		△1,168		584
法人税等合計		6,249		6,669
当期純利益		14,125		15,499

（３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

	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	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,871	49,674	71,227
当期変動額									
剰余金の配当							△12,000	△12,000	△12,000
当期純利益							14,125	14,125	14,125
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	2,125	2,125
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353

	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	△0	△0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			△12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	△0	△0	73,353

第37期（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

	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	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							△11,280	△11,280	△11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	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	△0	△0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			△11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	4,219
当期末残高	△0	△0	77,573

重要な会計方針

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

6. 収益及び費用の計上基準	**当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。** **(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回又は２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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。** **(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回又は２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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。** **(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回又は４回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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。** **(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。**
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 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
当社は、当事業年度において、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、当事業年度において、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万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。

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。

（未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（会計基準適用指針第31号　2021年6月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分法相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業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

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
建物	407	415
器具備品	978	966

（損益計算書関係）

※1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（百万円）

	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）
受取配当金	-	543

※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

（株主資本等変動計算書関係）

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（百万円）	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	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

決議	株式の種類	配当の原資	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	利益剰余金	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類株式					

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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（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

2022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（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2022年6月16日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022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おります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期（2021年3月31日現在）

	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	25,670	25,670	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	－
資産計	25,672	25,672	－

第37期（2022年3月31日現在）

	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	30,332	30,332	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	－
資産計	30,334	30,334	－

（注1）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。

（注2）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36期（2021年3月31日現在）

	1年以内（百万円）	1年超5年以内（百万円）	5年超10年以内（百万円）	10年超（百万円）
（1）現金・預金	36,734	－	－	－
（2）金銭の信託	25,670	－	－	－
（3）未収委託者報酬	16,804	－	－	－
（4）未収運用受託報酬	5,814	－	－	－
（5）投資有価証券				
その他有価証券(投資信託)	－	1	－	－
合計	85,024	1	－	－

第37期（2022年3月31日現在）

	1年以内（百万円）	1年超5年以内（百万円）	5年超10年以内（百万円）	10年超（百万円）
（1）現金・預金	31,421	－	－	－
（2）金銭の信託	30,332	－	－	－
（3）未収委託者報酬	17,567	－	－	－
（4）未収運用受託報酬	4,348	－	－	－
（5）投資有価証券				
その他有価証券(投資信託)	－	1	－	－
合計	83,670	1	－	－

3. 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
（1）金銭の信託	－	6,932	－	6,932
（2）投資有価証券	－	－	－	－
その他有価証券	－	－	－	－
資産計	－	6,932	－	6,932

「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）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。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、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、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の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。

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	259	239
関係会社株式		
非上場株式	5,299	5,349

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（第36期の貸借対照表計上額5,299百万円、第37期の貸借対照表計上額5,349百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2．その他有価証券

第36期（2021年3月31日現在）

（百万円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計	―	―	―
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

（注）非上場株式（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。

第37期（2022年3月31日現在）

（百万円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計	―	―	―
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

（注）非上場株式（貸借対照表計上額239百万円）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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
投資信託	0	－	0

（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。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
株式	13	－	6

（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

（百万円）

	第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△4	△14
退職給付の支払額	△245	△185
過去勤務費用の発生額	△1	－
その他	1	－
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

（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

（百万円）

	第36期（2021年3月31日現在）	第37期（2022年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,479	2,576
未積立退職給付債務	2,479	2,576
未認識数理計算上の差異	△84	△35
未認識過去勤務費用	△102	△33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507
退職給付引当金	2,292	2,507
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	41	34
過去勤務費用の費用処理額	69	69
その他	△7	△3
確定給付制度に係る退職給付費用	409	398

（注）上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において48百万円、当事業年度において20百万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36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～3.76%	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100百万円、当事業年度97百万円であります。

（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36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
未払事業税	260	156
未払事業所税	10	10
賞与引当金	547	592
未払法定福利費	92	92
運用受託報酬	1,410	845
資産除去債務	18	13
減価償却超過額（一括償却資産）	25	12
減価償却超過額	51	58
繰延資産償却超過額（税法上）	301	292
退職給付引当金	701	767
時効後支払損引当金	48	45
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	166
投資有価証券評価損	28	28
その他	3	2
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産小計	3,676	3,092
評価性引当額	－	－
繰延税金資産合計	3,676	3,092
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	3,676	3,092

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号　平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号　平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a.発生したのれんの金額	76,224百万円
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

（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。

（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

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	84,609百万円	76,763百万円
資産合計	84,609百万円	76,763百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	5,570百万円	4,740百万円
負債合計	5,570百万円	4,740百万円
純資産	79,038百万円	72,022百万円

（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	59,074百万円	55,263百万円
顧客関連資産	29,793百万円	25,175百万円

（2）損益計算書項目

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,823百万円	△8,429百万円
経常利益	△8,823百万円	△8,429百万円
税引前当期純利益	△8,823百万円	△8,429百万円
当期純利益	△7,288百万円	△7,015百万円
1株当たり当期純利益	△182,220円85銭	△175,380円68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	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

（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。

（収益認識関係）

1．収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円
運用受託報酬	14,425百万円
投資助言報酬	1,587百万円
成功報酬（注）	2,594百万円
その他営業収益	12百万円
合計	126,879百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬及び運用受託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.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）

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36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）及び第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						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	未払手数料	1,457
	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	未払手数料	2,524

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						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	7,789	未払手数料	1,592
	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	16,373	未払手数料	2,651

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36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36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36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
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当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
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	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

(3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 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。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「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（2021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【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

②請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨

・目論見書の使用開始日

・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第１「ファンドの状況」５「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。

独立監査人の監査報告書

２０２２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

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　長谷川　敬

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２０２２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。

その他の記載内容
その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２２年6月２４日

アセットマネジメントOne株式会社
取 締 役 会　御 中

EY新日本有限責任監査法人
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　長 谷 川　敬

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１０月２１日から２０２２年４月２０日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光７資産バランスファンドの２０２２年４月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメント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）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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。