

【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】 | 2023年1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があります。
- 2 「償還前乗り換え」とは、償還することが決定している証券投資信託の償還日前の一定期間内において、当該証券投資信託の一部解約金をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合があります。

(6) 【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後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】

2023年1月21日から2023年7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 |
| | | 債券 |
| | 海外 | 不動産投信 |
| 追加型 | 内外 | 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 | 年1回 年2回 | グローバル (含む日本) 日本 | ファミリーファンド |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () | 年4回 年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他() | 北米 欧州 アジア オセアニア | ファンド・オブ・ファンズ 為替ヘッジ |
| 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)) | | 中南米 アフリカ 中近東(中東) エマージング | あり() なし |
| 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | | | |

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

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

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

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

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

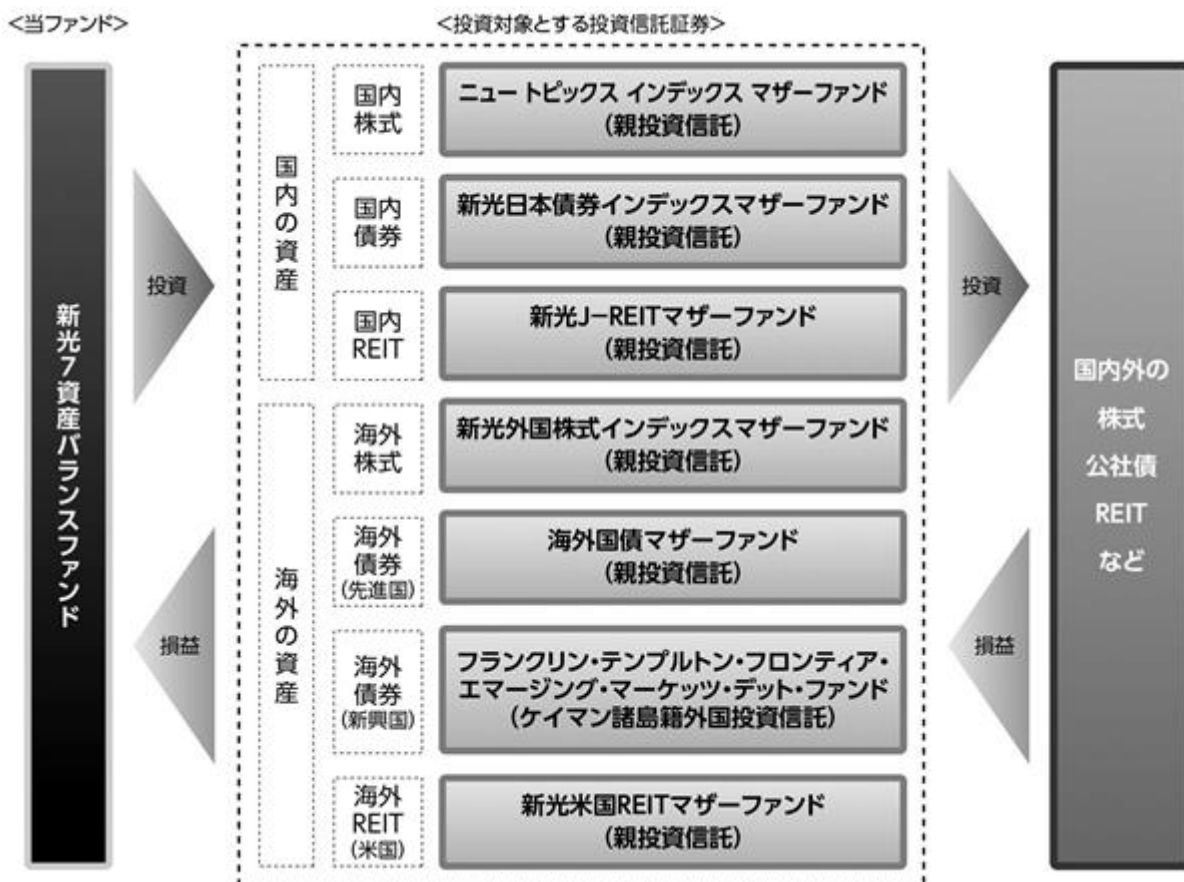
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



b. ファンドの特色

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

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

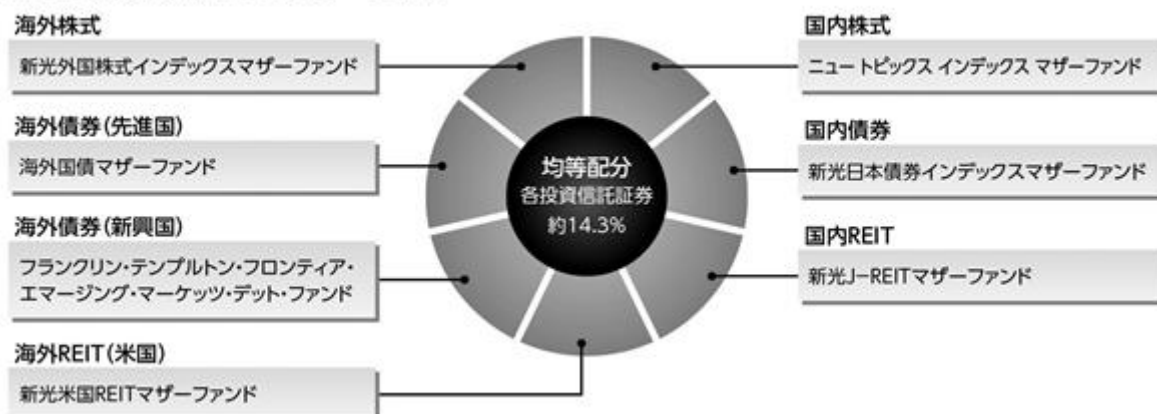


2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。 基本投資配分比率は均等とします。

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

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



■ 分配方針

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



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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

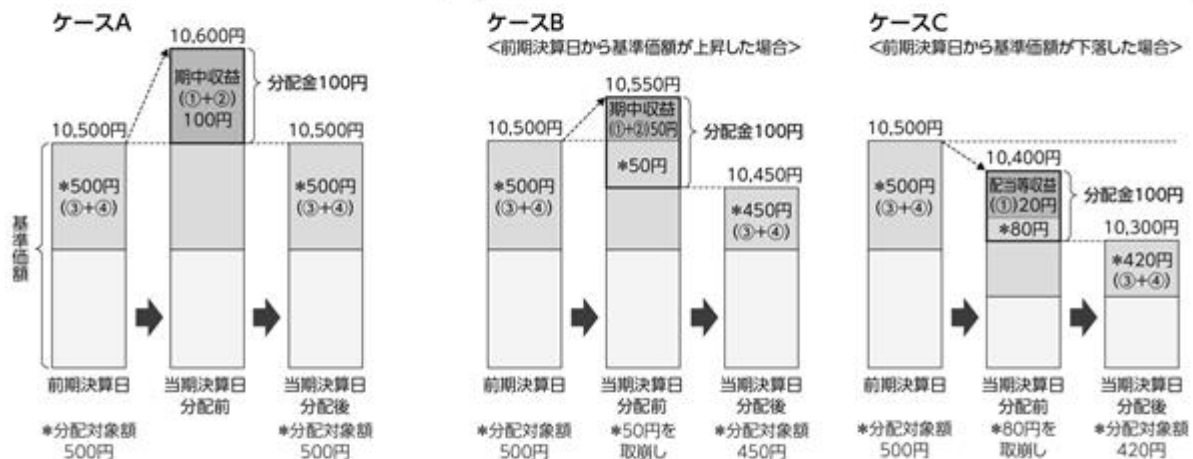
分配金額と基準価額の関係(イメージ)

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

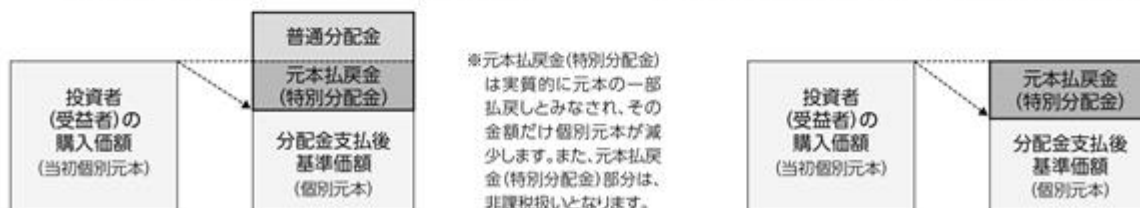
ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
 ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
 ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

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

◆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率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

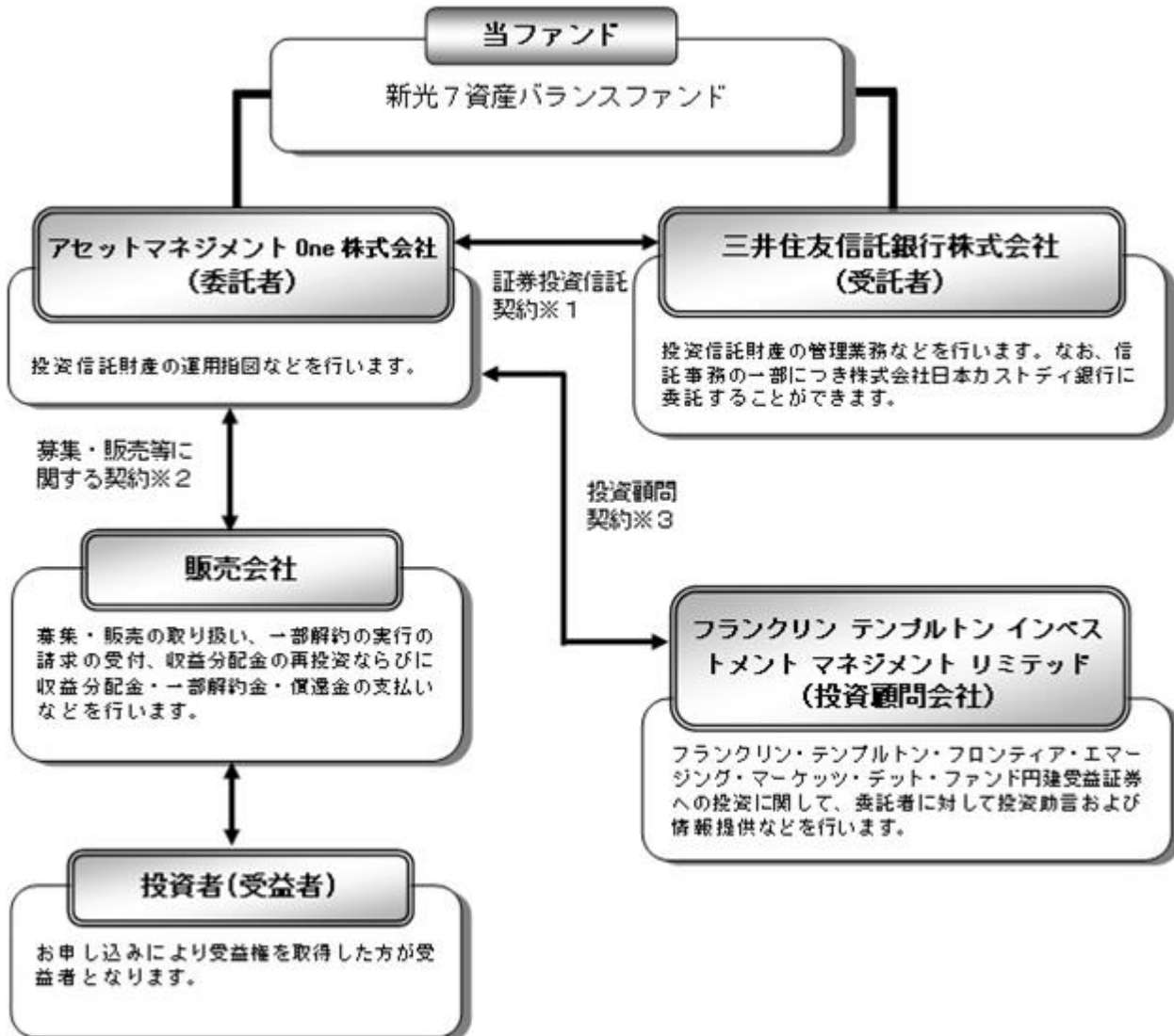
元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み



1 証券投資信託契約

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

2 募集・販売等に関する契約

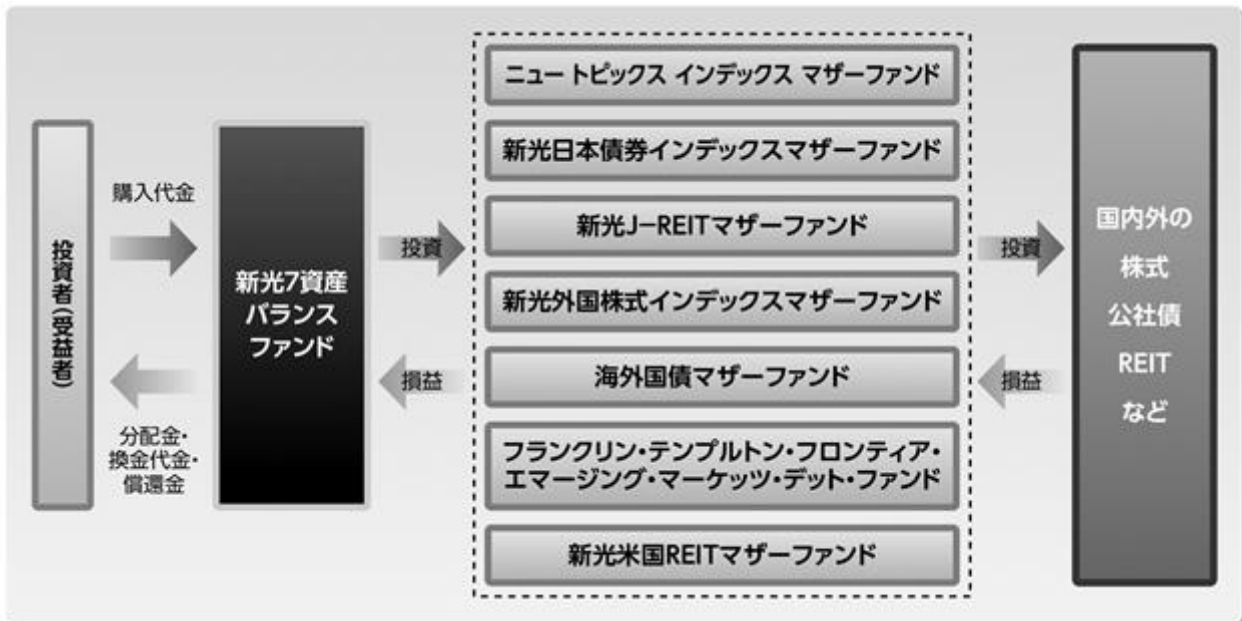
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2022年10月31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10月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

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

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

(2) 【投資対象】

a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

b. 運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

8. コマーシャル・ペーパー

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

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

11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

| | |
|--------|--|
| ファンド名 | ニュー トピックス インデックス マザーファンド |
| 形態 | 親投資信託 |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none">・ 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 | <ul style="list-style-type: none">・ 株式への投資割合には制限を設けません。・ 同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。・ 外貨建資産への投資は行いません。 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 決算日 | 毎年1月14日 |
| 収益分配方針 | 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。

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J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」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J P Xが有しています。

J P X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。

J P X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。

J P X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、J P X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。

本件商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。

J P X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。

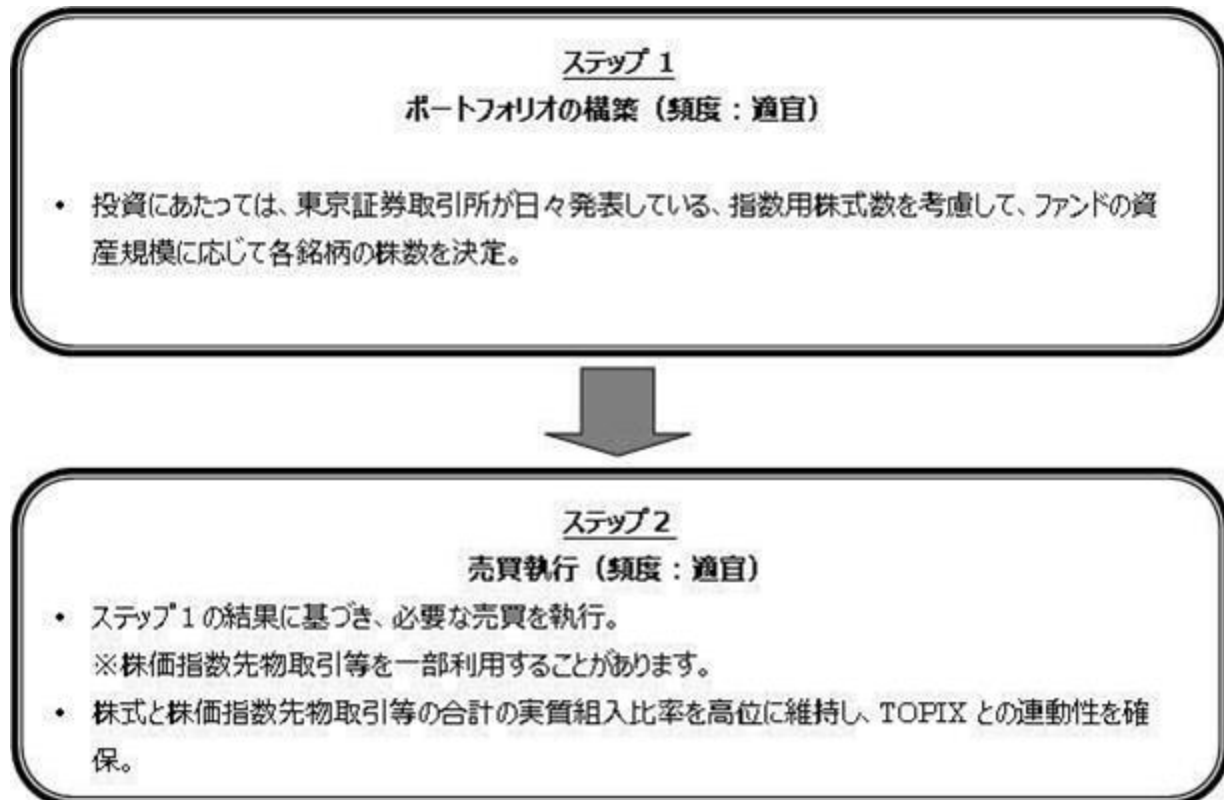
J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、J P X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、T O P I X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T O P I X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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

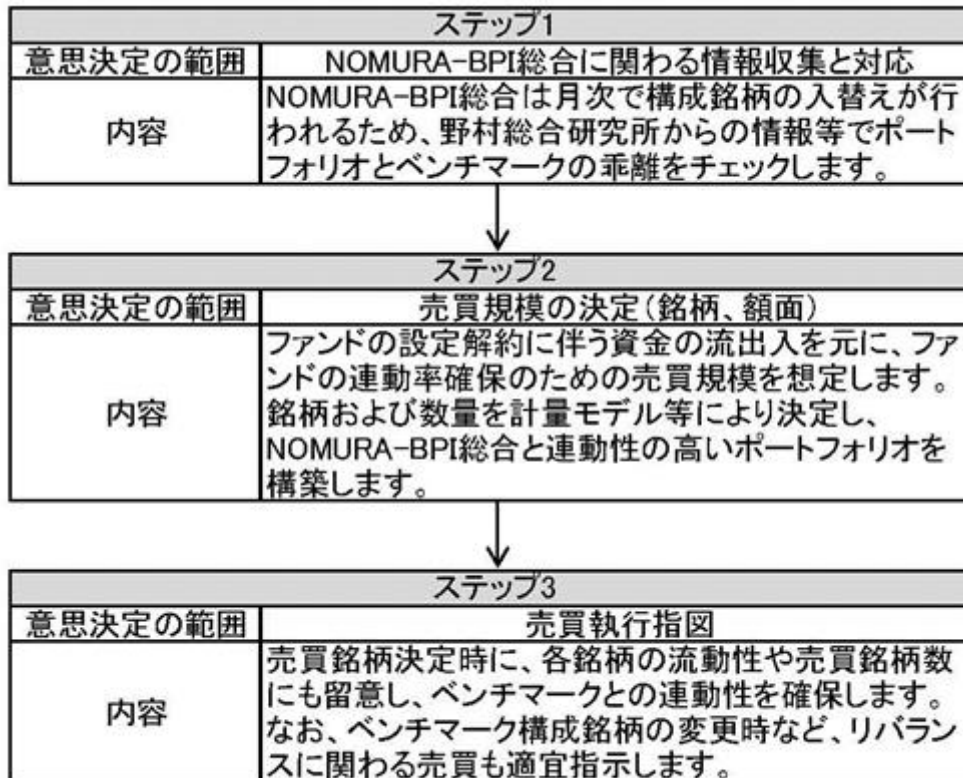
NOMURA - B P I 総合について

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

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

運用プロセス

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



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2022年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

| | |
|--------|---|
| ファンド名 | 新光J-REITマザーファンド |
| 形態 | 親投資信託 |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none">・主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。・不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。・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 | <ul style="list-style-type: none">・不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）、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「株東京証券取引所」といいます。）に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均の指数で、東京証券取引所上場のREIT全体の値動きを、配当金を反映させたうえで表す指数です。なお、2017年1月31日より、浮動株比率が考慮された指数となっています。

東証REIT指数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J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社（以下「J P X」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J P X が有しています。

J P X 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。

J P X 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。

J P X 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、J P X 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。

本件商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではありません。

J P X 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。

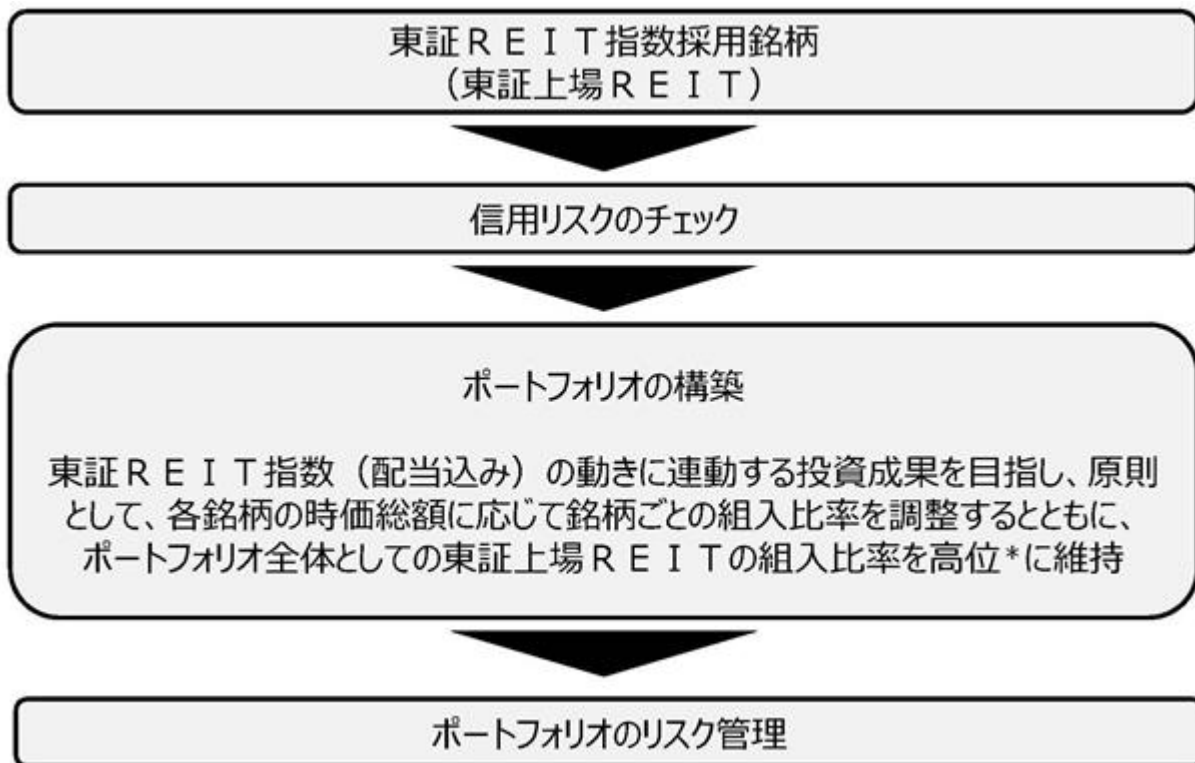
J P X は、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、J P X 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 - R E I T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 - R E I T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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

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

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

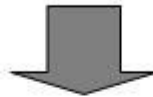
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

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

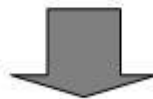
ステップ 1 リスクモニタリング

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



ステップ 2 ポートフォリオの構築

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



ステップ 3 売買執行

- ステップ 2 で選択された銘柄について売買を執行。
- 加えて、株価指数先物取引等の一部利用することで、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）との連動性を確保。

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2022年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

| | |
|--------|--|
| ファンド名 | 海外国債マザーファンド |
| 形態 | 親投資信託 |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。 ・ 日本を除く、FTSE世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。 ・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。 ・ 債券ポートフォリオは、日本を除くG7構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国）が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。 ・ 運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 通貨アロケーション ・ イールドカーブ戦略 ・ セクターアロケーション ・ デュレーション調整 ・ 外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限りません。 ・ 外貨建資産への投資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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

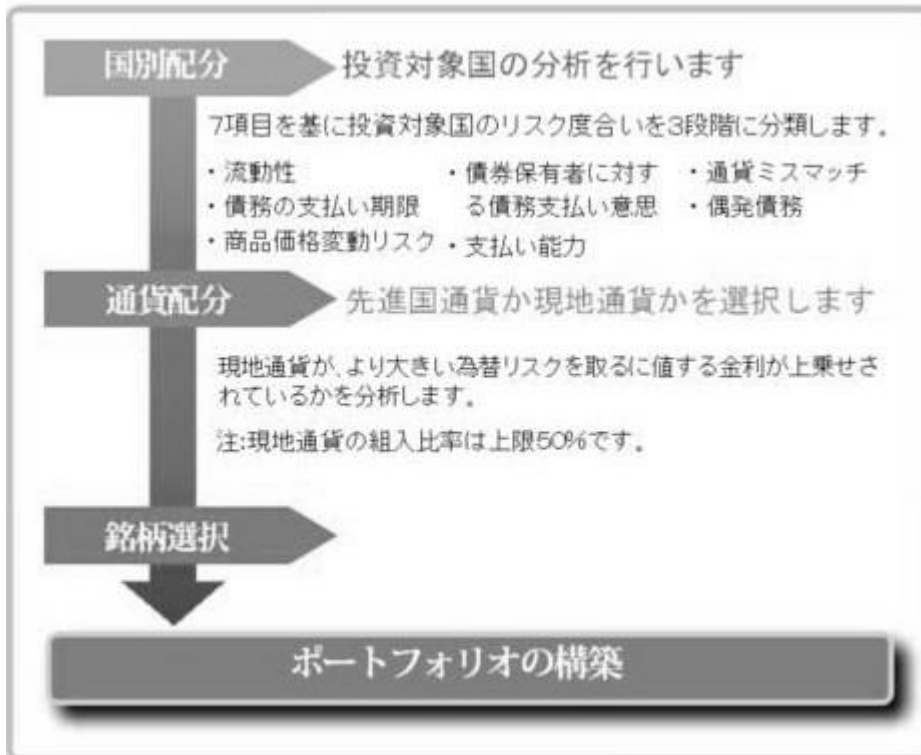
| | |
|--------|---|
| ファンド名 | フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。) |
| 形態 | ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券 |
| 運用方針 | ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。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

フランクリン テンプレトン 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 テンプレトン 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・テンプレトン（設立：1947年、運用総資産：約187.9兆円）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9月末現在、1米ドル = 144.81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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

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

FTSE NAREIT All Equity REITs インデックス（以下「本指数」といいます。）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。

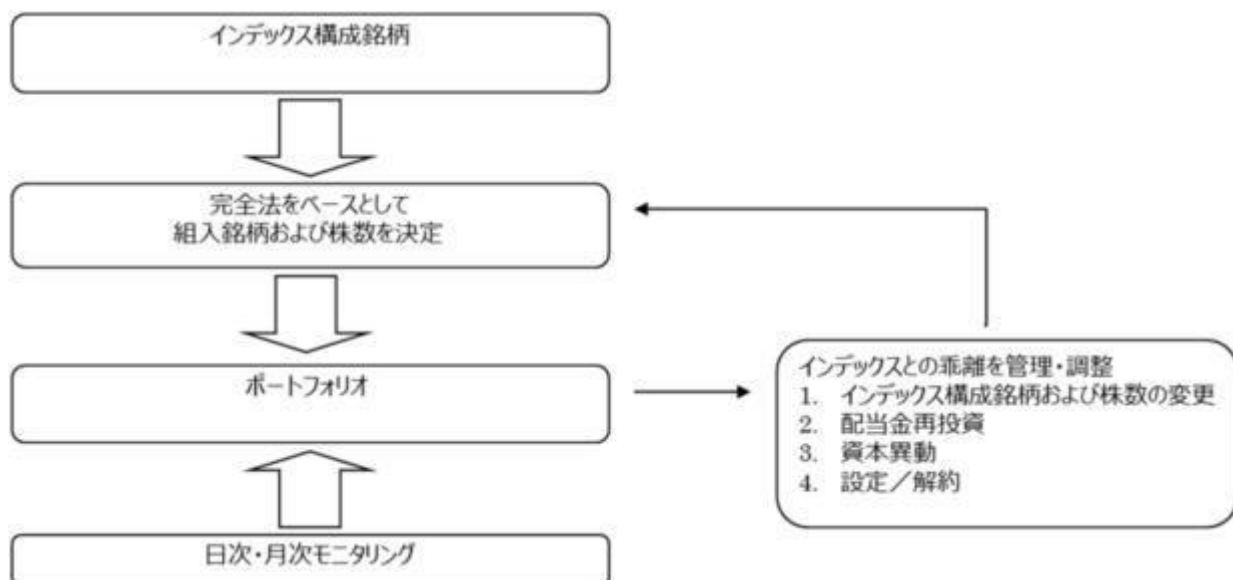
新光米国REITマザーファンド（以下「当マザーファンド」といいます。）は、アセットマネジメントOne株式会社によって単独で開発されたものです。当マザーファンドは、いかなる方法においても、FTSE、London Stock Exchange Group plcおよび、そのグループ企業（以下、総称して「LSE Group」といいます。）またはNareitによって出資、保証、販売または販売促進されることはありません。

本指数のすべての権利はFTSEおよびNareitに帰属します。「FTSE^(R)」はLSE Groupの商標であり、ライセンス契約に基づきFTSEによって使用されています。「NAREIT^(R)」はNareitの商標です。

本指数はFTSEによって計算されます。FTSE、LSE Group、Nareitはいずれも、如何なる者に対しても（a）本指数の使用、信頼、または誤謬、（b）当マザーファンドへの投資または運営に起因する如何なる義務も負いません。FTSE、LSE Group、およびNareitは、当マザーファンドから得られる結果、またはアセットマネジメントOne株式会社によって提示される目的に対する本指数の適合性に関して、いかなる請求、予測、保証、または表明も行いません。

運用プロセス

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



運用プロセスは2022年10月31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2023年1月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2022年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

1. 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
2. 分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
3. 上記2.にかかわらず、上記2.にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。
4. 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

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

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

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

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

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

(5) 【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c. 公社債の借り入れ

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

(ロ) 借り入れの指図は、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て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。
- (二) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。
- h. 受託者の自己または利害関係人等との取引
- (イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に定める範囲内での資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。
- (ロ) 上記(イ)の取り扱いは、約款に定める範囲内での委託者の指図による取引についても同様とします。
- i. デリバティブ取引等に係る投資制限
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- j. 信用リスク集中回避のための投資制限
- 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- k. ファンドの投資制限
- 投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

a. 資産配分リスク

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

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

b. 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

c. REITの価格変動リスク

REITの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

d. 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

e. カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

f. 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

g. 信用リスク

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

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

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

h. 流動性リスク

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

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

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

i. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

（ロ）当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

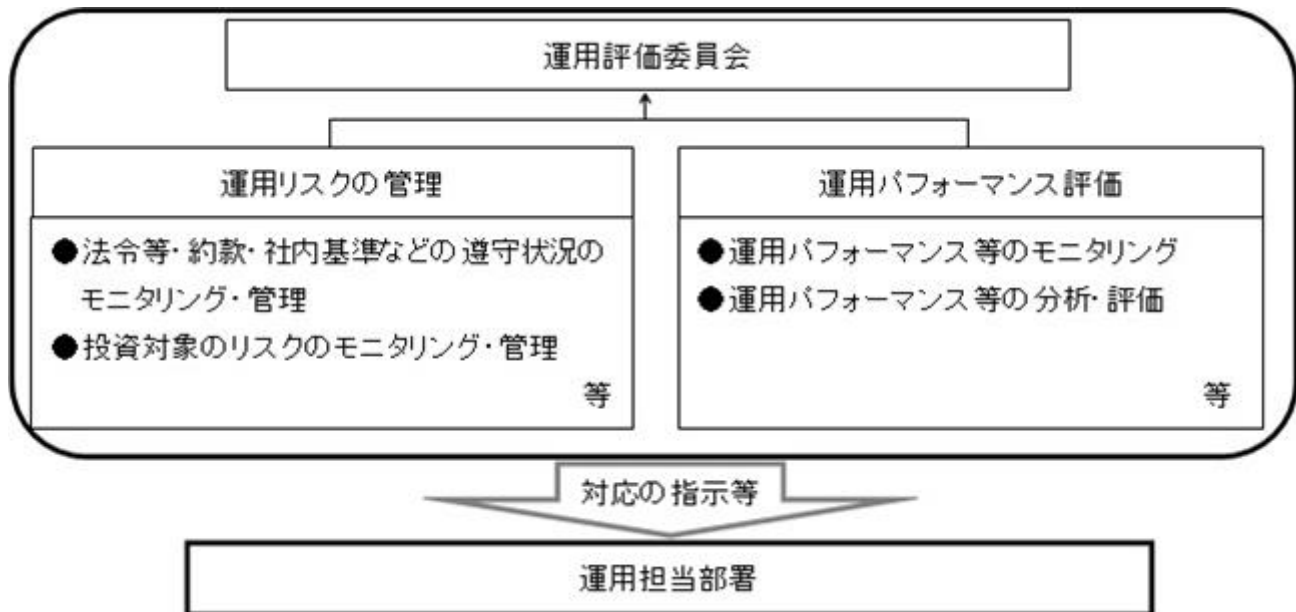
（ハ）有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

- (二) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ホ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ヘ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ト) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (チ) 投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券(ベビーファンド)が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券(ベビーファンド)の価額が変動する可能性があります。
- 当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券にはファミリーファンド方式を採用している場合があります、上記のような要因で、当ファンドの基準価額が変動する可能性があります。

（２）リスク管理体制

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

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



- ・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10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

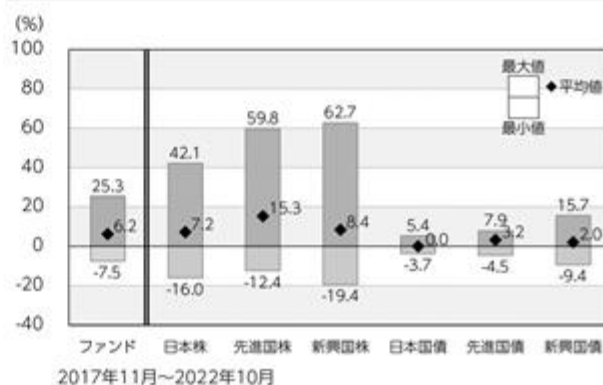
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後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ます。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

b. 信託財産留保額

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

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

(3) 【信託報酬等】

| <p>ファンド</p> | <p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.045%（税抜0.95%）</p> <p>信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率</p> <p>運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。</p> <p>運用管理費用（信託報酬）の配分は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。</p> <table border="1" data-bbox="416 488 1378 1176"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円未満の部分</td> <td>年率0.42%</td> <td>年率0.45%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>300億円以上 500億円未満の部分</td> <td>年率0.37%</td> <td>年率0.50%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>500億円以上の部分</td> <td>年率0.32%</td> <td>年率0.55%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table> <p>委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド）に対する投資顧問報酬（投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうちファンドにおける保有分に対し年率0.05%）が含まれます。</p> | 運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜） | | | | 各販売会社の取扱純資産額 | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 | 300億円未満の部分 | 年率0.42% | 年率0.45% | 年率0.08% | 300億円以上 500億円未満の部分 | 年率0.37% | 年率0.50% | 年率0.08% | 500億円以上の部分 | 年率0.32% | 年率0.55% | 年率0.08% | 主な役務 | 信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価 | 運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
|-----------------------|--|--|-------------------------------|--|--|--------------|------|------|------|------------|---------|---------|---------|-----------------------|---------|---------|---------|------------|---------|---------|---------|------|----------------------------------|--|-------------------------------|
| 運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜） | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 各販売会社の取扱純資産額 | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 300億円未満の部分 | 年率0.42% | 年率0.45% | 年率0.08% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 300億円以上 500億円未満の部分 | 年率0.37% | 年率0.50% | 年率0.08% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 500億円以上の部分 | 年率0.32% | 年率0.55% | 年率0.08% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 主な役務 | 信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価 | 運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>投資対象とする外国投資信託</p> | <p>フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865%</p> <p>当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>実質的な負担</p> | <p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.12365%（税抜1.02865%）程度</p> <p>上記は概算の数値です。実際の運用管理費用（信託報酬）は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2022年10月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2022年10月31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 | 645,875,700 | 14.30 |
| 内 ケイマン諸島 | 645,875,700 | 14.30 |
| 親投資信託受益証券 | 3,789,899,208 | 83.94 |
| 内 日本 | 3,789,899,208 | 83.94 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 79,297,024 | 1.76 |
| 純資産総額 | 4,515,071,932 | 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10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|---------------|---------|
| 株式 | 1,649,154,560 | 95.52 |
| 内 日本 | 1,649,154,560 | 95.52 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 77,318,802 | 4.48 |
| 純資産総額 | 1,726,473,362 | 100.00 |

その他資産の投資状況

2022年10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------|------------|---------|
| 株価指数先物取引（買建） | 57,780,000 | 3.35 |
| 内 日本 | 57,780,000 | 3.35 |

（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10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 国債証券 | 8,411,828,000 | 82.66 |
| 内 日本 | 8,411,828,000 | 82.66 |
| 地方債証券 | 705,016,500 | 6.93 |
| 内 日本 | 705,016,500 | 6.93 |
| 特殊債券 | 616,585,000 | 6.06 |
| 内 日本 | 616,585,000 | 6.06 |
| 社債券 | 398,939,000 | 3.92 |
| 内 日本 | 398,939,000 | 3.92 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 43,854,073 | 0.43 |
| 純資産総額 | 10,176,222,573 | 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10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資証券 | 92,472,718,600 | 97.02 |
| 内 日本 | 92,472,718,600 | 97.02 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 2,842,177,301 | 2.98 |
| 純資産総額 | 95,314,895,901 | 100.00 |

その他資産の投資状況

2022年10月31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） | 2,721,849,000 | 2.86 |
| 内 日本 | 2,721,849,000 | 2.86 |

（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10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------|---------------|---------|
| 株式 | 1,637,478,475 | 88.52 |
| 内 アメリカ | 1,171,992,148 | 63.35 |
| 内 イギリス | 68,249,038 | 3.69 |
| 内 カナダ | 63,385,186 | 3.43 |
| 内 スイス | 54,304,322 | 2.94 |
| 内 フランス | 50,630,932 | 2.74 |
| 内 ドイツ | 36,751,263 | 1.99 |
| 内 オーストラリア | 34,510,948 | 1.87 |
| 内 アイルランド | 30,479,869 | 1.65 |
| 内 オランダ | 27,823,232 | 1.50 |
| 内 スウェーデン | 15,318,280 | 0.83 |
| 内 デンマーク | 12,715,733 | 0.69 |
| 内 スペイン | 11,752,029 | 0.64 |
| 内 香港 | 8,485,455 | 0.46 |
| 内 イタリア | 8,199,914 | 0.44 |
| 内 ジャージー | 6,364,401 | 0.34 |
| 内 フィンランド | 5,850,220 | 0.32 |
| 内 シンガポール | 5,610,608 | 0.30 |
| 内 イスラエル | 4,094,165 | 0.22 |
| 内 ベルギー | 3,803,940 | 0.21 |
| 内 ノルウェー | 3,736,276 | 0.20 |
| 内 パミュダ | 3,167,276 | 0.17 |
| 内 オランダ領キュラソー | 2,565,542 | 0.14 |
| 内 ケイマン諸島 | 2,409,622 | 0.13 |
| 内 ニュージーランド | 1,250,629 | 0.07 |
| 内 ルクセンブルグ | 1,160,023 | 0.06 |
| 内 オーストリア | 936,807 | 0.05 |
| 内 ポルトガル | 909,613 | 0.05 |
| 内 リベリア | 421,678 | 0.02 |
| 内 マン島 | 328,936 | 0.02 |
| 内 パナマ | 270,390 | 0.01 |

| | | | |
|-----------------------|-----------|---------------|--------|
| 投資信託受益証券 | | 2,365,161 | 0.13 |
| | 内 オーストラリア | 1,870,522 | 0.10 |
| | 内 シンガポール | 494,639 | 0.03 |
| 投資証券 | | 35,096,889 | 1.90 |
| | 内 アメリカ | 33,160,204 | 1.79 |
| | 内 イギリス | 697,760 | 0.04 |
| | 内 香港 | 555,538 | 0.03 |
| | 内 フランス | 445,635 | 0.02 |
| | 内 ベルギー | 159,388 | 0.01 |
| | 内 カナダ | 78,364 | 0.00 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 174,998,334 | 9.46 |
| 純資産総額 | | 1,849,938,859 | 100.00 |

その他資産の投資状況

2022年10月31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) | 172,195,059 | 9.31 | |
| | 内 アメリカ | 115,976,385 | 6.27 |
| | 内 ドイツ | 31,959,138 | 1.73 |
| | 内 イギリス | 24,259,536 | 1.31 |

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

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

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

海外国債マザーファンド

2022年10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) | |
|-----------------------|----------------|---------------|-------|
| 国債証券 | 14,386,361,804 | 98.89 | |
| | 内 アメリカ | 7,689,098,884 | 52.85 |
| | 内 フランス | 2,248,883,309 | 15.46 |
| | 内 ドイツ | 1,567,661,911 | 10.78 |
| | 内 イタリア | 1,371,334,255 | 9.43 |
| | 内 カナダ | 1,079,567,835 | 7.42 |
| | 内 イギリス | 429,815,610 | 2.95 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 161,876,618 | 1.11 | |
| 純資産総額 | 14,548,238,422 | 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10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) | |
|-----------------------|-------------|-------------|-------|
| 投資証券 | 601,652,768 | 99.29 | |
| | 内 アメリカ | 601,652,768 | 99.29 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 4,325,297 | 0.71 | |
| 純資産総額 | 605,978,065 | 100.00 | |

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

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2022年10月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率 (%) 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|--|-------------------|-------------|---------------------------|---------------------------|------------------|-----------------|
| 1 | 新光外国株式インデックス マザーファンド 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 162,132,483 | 3.9861 646,292,503 | 4.1487 672,639,032 | - - | 14.90 |
| 2 | フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド ケイマン諸島 | 投資信 託受益 証券 | 344,100 | 1,869.0000 643,122,900 | 1,877.0000 645,875,700 | - - | 14.30 |
| 3 | 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 | 226,901,520 | 2.7448 622,821,982 | 2.7934 633,826,705 | - - | 14.04 |
| 4 | 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 | 2.1428 594,611,799 | 2.2667 628,963,818 | - - | 13.93 |
| 5 | 海外国債マザーファンド 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 235,052,061 | 2.6240 616,800,113 | 2.6589 624,979,924 | - - | 13.84 |
| 6 | 新光日本債券インデックス マザーファンド 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 503,038,704 | 1.2309 619,240,644 | 1.2395 623,516,473 | - - | 13.81 |
| 7 | 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 | 2.4716 574,391,815 | 2.6076 605,973,256 | - - | 13.42 |

(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10月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 14.30 |
| 親投資信託受益証券 | 83.94 |
| 合計 | 98.24 |

(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10月31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 | 32,600 | 2,360.61 76,955,980 | 2,059.50 67,139,700 | - - | 3.89 |

| | | | | | | | |
|----|-------------------------|------------------|--------|-------------------------|-------------------------|--------|------|
| 2 | ソニーグループ 日本 | 株式 電気機器 | 4,200 | 13,952.88 58,602,131 | 9,988.00 41,949,600 | - - | 2.43 |
| 3 | キーエンス 日本 | 株式 電気機器 | 600 | 62,160.00 37,296,000 | 56,320.00 33,792,000 | - - | 1.96 |
| 4 | 日本電信電話 日本 | 株式 情報・通 信業 | 7,600 | 3,370.87 25,618,652 | 4,094.00 31,114,400 | - - | 1.80 |
| 5 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本 | 株式 銀行業 | 38,300 | 707.93 27,114,048 | 699.50 26,790,850 | - - | 1.55 |
| 6 | 第一三共 日本 | 株式 医薬品 | 5,200 | 2,804.12 14,581,442 | 4,767.00 24,788,400 | - - | 1.44 |
| 7 | 任天堂 日本 | 株式 その他製 品 | 3,800 | 5,192.00 19,729,600 | 6,070.00 23,066,000 | - - | 1.34 |
| 8 | ソフトバンクグループ 日本 | 株式 情報・通 信業 | 3,500 | 5,474.90 19,162,176 | 6,400.00 22,400,000 | - - | 1.30 |
| 9 | 武田薬品工業 日本 | 株式 医薬品 | 5,300 | 3,376.04 17,893,053 | 3,918.00 20,765,400 | - - | 1.20 |
| 10 | リクルートホールディングス 日本 | 株式 サービス 業 | 4,500 | 6,026.29 27,118,306 | 4,590.00 20,655,000 | - - | 1.20 |
| 11 | 日立製作所 日本 | 株式 電気機器 | 3,000 | 6,858.52 20,575,576 | 6,760.00 20,280,000 | - - | 1.17 |
| 12 | KDDI 日本 | 株式 情報・通 信業 | 4,600 | 3,607.81 16,595,944 | 4,395.00 20,217,000 | - - | 1.17 |
| 13 | HOYA 日本 | 株式 精密機器 | 1,300 | 15,235.00 19,805,500 | 13,875.00 18,037,500 | - - | 1.04 |
| 14 | 三井住友フィナンシャルグループ 日本 | 株式 銀行業 | 4,300 | 4,293.53 18,462,199 | 4,173.00 17,943,900 | - - | 1.04 |
| 15 | 本田技研工業 日本 | 株式 輸送用機 器 | 4,800 | 3,474.10 16,675,715 | 3,373.00 16,190,400 | - - | 0.94 |
| 16 | 東京海上ホールディングス 日本 | 株式 保険業 | 5,900 | 2,357.20 13,907,500 | 2,691.00 15,876,900 | - - | 0.92 |
| 17 | 東京エレクトロン 日本 | 株式 電気機器 | 400 | 65,220.00 26,088,000 | 39,490.00 15,796,000 | - - | 0.91 |
| 18 | 三菱商事 日本 | 株式 卸売業 | 3,900 | 3,915.55 15,270,655 | 4,031.00 15,720,900 | - - | 0.91 |
| 19 | ダイキン工業 日本 | 株式 機械 | 700 | 25,300.00 17,710,000 | 22,385.00 15,669,500 | - - | 0.91 |
| 20 | 信越化学工業 日本 | 株式 化学 | 1,000 | 19,400.00 19,400,000 | 15,540.00 15,540,000 | - - | 0.90 |
| 21 | 三井物産 日本 | 株式 卸売業 | 4,600 | 2,856.50 13,139,900 | 3,293.00 15,147,800 | - - | 0.88 |
| 22 | 伊藤忠商事 日本 | 株式 卸売業 | 3,900 | 3,497.00 13,638,300 | 3,849.00 15,011,100 | - - | 0.87 |

| | | | | | | | |
|----|---------------------------|------------------|-------|-------------------------|-------------------------|--------|------|
| 23 | ソフトバンク 日本 | 株式 情報・通 信業 | 9,600 | 1,449.72 13,917,348 | 1,465.50 14,068,800 | - - | 0.81 |
| 24 | みずほフィナンシャルグ ループ 日本 | 株式 銀行業 | 8,400 | 1,596.23 13,408,371 | 1,606.00 13,490,400 | - - | 0.78 |
| 25 | 村田製作所 日本 | 株式 電気機器 | 1,800 | 9,063.00 16,313,400 | 7,300.00 13,140,000 | - - | 0.76 |
| 26 | 日本電産 日本 | 株式 電気機器 | 1,500 | 12,200.00 18,300,000 | 8,238.00 12,357,000 | - - | 0.72 |
| 27 | セブン&アイ・ホールディ ングス 日本 | 株式 小売業 | 2,200 | 5,161.00 11,354,200 | 5,554.00 12,218,800 | - - | 0.71 |
| 28 | S M C 日本 | 株式 機械 | 200 | 68,330.00 13,666,000 | 60,120.00 12,024,000 | - - | 0.70 |
| 29 | オリエンタルランド 日本 | 株式 サービス 業 | 600 | 18,440.00 11,064,000 | 19,950.00 11,970,000 | - - | 0.69 |
| 30 | ファナック 日本 | 株式 電気機器 | 600 | 22,424.64 13,454,789 | 19,630.00 11,778,000 | - - | 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10月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|----|---------|
| 株式 | 95.52 |
| 合計 | 95.52 |

(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10月31日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率(%) |
|--------|-------|---------|
| 電気機器 | 国内 | 16.32 |
| 情報・通信業 | | 8.75 |
| 輸送用機器 | | 7.59 |
| 化学 | | 5.68 |
| 医薬品 | | 5.68 |
| 卸売業 | | 5.20 |
| サービス業 | | 5.19 |
| 銀行業 | | 5.14 |
| 機械 | | 4.93 |
| 小売業 | | 4.45 |
| 食料品 | | 3.27 |
| 陸運業 | | 3.17 |
| 精密機器 | | 2.81 |
| その他製品 | | 2.40 |
| 保険業 | | 2.22 |
| 不動産業 | | 2.05 |
| 建設業 | | 1.83 |
| 電気・ガス業 | | 1.19 |
| その他金融業 | | 1.09 |

| | |
|------------|-------|
| ゴム製品 | 0.75 |
| 鉄鋼 | 0.73 |
| 証券、商品先物取引業 | 0.72 |
| 非鉄金属 | 0.65 |
| ガラス・土石製品 | 0.59 |
| 金属製品 | 0.55 |
| 空運業 | 0.51 |
| 海運業 | 0.51 |
| 石油・石炭製品 | 0.49 |
| 繊維製品 | 0.41 |
| 鉱業 | 0.29 |
| パルプ・紙 | 0.15 |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.14 |
| 水産・農林業 | 0.08 |
| 合計 | 95.52 |

（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10月31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 | 150,000,000 | 100.79 151,185,000 | 100.43 150,658,500 | 0.1 2025/12/20 | 1.48 |
| 2 | 147回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証券 | 120,000,000 | 100.42 120,504,000 | 100.13 120,162,000 | 0.005 2026/3/20 | 1.18 |
| 3 | 350回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 120,000,000 | 100.97 121,171,000 | 100.02 120,031,200 | 0.1 2028/3/20 | 1.18 |
| 4 | 351回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 120,000,000 | 101.22 121,464,000 | 99.94 119,932,800 | 0.1 2028/6/20 | 1.18 |
| 5 | 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 | 112.85 112,852,000 | 2.1 2029/12/28 | 1.11 |
| 6 | 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 | 112.23 112,231,000 | 2.22 2029/3/19 | 1.10 |
| 7 | 332回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 110,000,000 | 101.31 111,451,500 | 100.78 110,861,300 | 0.6 2023/12/20 | 1.09 |
| 8 | 138回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証券 | 110,000,000 | 100.42 110,462,000 | 100.21 110,236,500 | 0.1 2023/12/20 | 1.08 |
| 9 | 436回 利付国庫債券 (2年) 日本 | 国債証券 | 110,000,000 | 100.17 110,187,000 | 100.08 110,097,900 | 0.005 2024/5/1 | 1.08 |

| | | | | | | | |
|----|------------------------------|-------|-------------|-----------------------|-----------------------|---------------------|------|
| 10 | 353回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 110,000,000 | 101.28 111,414,700 | 99.75 109,731,600 | 0.1 2028/12/20 | 1.08 |
| 11 | 36回 東日本旅客鉄道社債 日本 | 社債券 | 100,000,000 | 106.31 106,313,000 | 103.97 103,978,000 | 2.11 2024/12/20 | 1.02 |
| 12 | 147回 高速道路機構債 日本 | 特殊債券 | 100,000,000 | 104.72 104,725,000 | 103.20 103,204,000 | 0.955 2034/12/20 | 1.01 |
| 13 | 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 | 103.15 103,150,000 | 0.781 2030/12/6 | 1.01 |
| 14 | 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 | 101.18 101,180,000 | 0.484 2025/6/30 | 0.99 |
| 15 | 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 | 100.40 100,406,000 | 0.195 2025/12/19 | 0.99 |
| 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 | 100.22 100,222,000 | 0.205 2027/4/23 | 0.98 |
| 17 | 439回 利付国庫債券 (2年) 日本 | 国債証券 | 100,000,000 | 100.19 100,191,000 | 100.09 100,096,000 | 0.005 2024/8/1 | 0.98 |
| 18 | 349回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 100,000,000 | 101.16 101,162,000 | 100.07 100,076,000 | 0.1 2027/12/20 | 0.98 |
| 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 | 100.06 100,060,000 | 0.17 2027/10/29 | 0.98 |
| 20 | 50回 西日本高速道路債券 日本 | 社債券 | 100,000,000 | 100.00 100,000,000 | 99.86 99,869,000 | 0.04 2024/6/20 | 0.98 |
| 21 | 11回 プリヂストン社債 日本 | 社債券 | 100,000,000 | 100.56 100,560,000 | 99.78 99,781,000 | 0.295 2027/4/21 | 0.98 |
| 22 | 250回 住宅金融支援機構 日本 | 特殊債券 | 100,000,000 | 101.50 101,501,000 | 99.72 99,726,000 | 0.289 2028/11/20 | 0.98 |
| 23 | 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 | 99.56 99,563,000 | 0.06 2026/3/18 | 0.98 |
| 24 | 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 | 99.42 99,426,000 | 0.001 2026/12/25 | 0.98 |
| 25 | 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 | 97.78 97,786,000 | 0.145 2031/10/29 | 0.96 |
| 26 | 494回 九州電力社債 日本 | 社債券 | 100,000,000 | 99.81 99,815,000 | 95.31 95,311,000 | 0.31 2031/5/23 | 0.94 |
| 27 | 335回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 90,000,000 | 101.77 91,599,300 | 101.02 90,925,200 | 0.5 2024/9/20 | 0.89 |

| | | | | | | | |
|----|----------------------------|------|------------|----------------------|----------------------|------------------|------|
| 28 | 340回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 80,000,000 | 101.92 81,536,000 | 101.27 81,016,000 | 0.4 2025/9/20 | 0.80 |
| 29 | 338回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 80,000,000 | 101.73 81,386,400 | 101.06 80,848,000 | 0.4 2025/3/20 | 0.79 |
| 30 | 333回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 80,000,000 | 101.68 81,349,600 | 100.91 80,729,600 | 0.6 2024/3/20 | 0.79 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 82.66 |
| 地方債証券 | 6.93 |
| 特殊債証券 | 6.06 |
| 社債証券 | 3.92 |
| 合計 | 99.57 |

(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10月31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 | 9,780 | 618,054.14 6,044,569,517 | 661,000.00 6,464,580,000 | - - | 6.78 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本 | 投資証券 | 8,384 | 580,057.00 4,863,197,942 | 623,000.00 5,223,232,000 | - - | 5.48 |
| 3 | 日本都市ファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 42,301 | 101,611.20 4,298,255,548 | 109,500.00 4,631,959,500 | - - | 4.86 |
| 4 | 野村不動産マスターファン ド投資法人 日本 | 投資証券 | 27,111 | 159,016.04 4,311,083,945 | 169,500.00 4,595,314,500 | - - | 4.82 |
| 5 | 日本プロロジスリート投資 法人 日本 | 投資証券 | 13,738 | 296,416.63 4,072,171,675 | 311,500.00 4,279,387,000 | - - | 4.49 |
| 6 | GLP投資法人 日本 | 投資証券 | 27,060 | 146,145.22 3,954,689,822 | 154,100.00 4,169,946,000 | - - | 4.37 |
| 7 | 大和ハウスリート投資法人 日本 | 投資証券 | 12,637 | 284,723.10 3,598,045,833 | 300,000.00 3,791,100,000 | - - | 3.98 |
| 8 | オリックス不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 16,705 | 182,224.33 3,044,057,578 | 199,500.00 3,332,647,500 | - - | 3.50 |
| 9 | ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本 | 投資証券 | 18,873 | 147,213.53 2,778,360,952 | 157,200.00 2,966,835,600 | - - | 3.11 |

| | | | | | | | |
|----|-------------------------------|------|--------|-----------------------------|-----------------------------|--------|------|
| 10 | アドバンス・レジデンス投資法人 日本 | 投資証券 | 8,383 | 330,026.35 2,766,610,897 | 346,000.00 2,900,518,000 | - - | 3.04 |
| 11 | 日本プライムリアルティ投資法人 日本 | 投資証券 | 5,734 | 377,532.79 2,164,773,051 | 403,500.00 2,313,669,000 | - - | 2.43 |
| 12 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 27,036 | 76,100.98 2,057,466,283 | 78,300.00 2,116,918,800 | - - | 2.22 |
| 13 | 積水ハウス・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 25,478 | 78,600.99 2,002,596,115 | 80,100.00 2,040,787,800 | - - | 2.14 |
| 14 | 産業ファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 12,529 | 155,301.38 1,945,771,104 | 157,000.00 1,967,053,000 | - - | 2.06 |
| 15 | アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本 | 投資証券 | 4,426 | 414,534.60 1,834,730,177 | 440,500.00 1,949,653,000 | - - | 2.05 |
| 16 | 日本アコモデーションファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 2,895 | 609,032.95 1,763,150,394 | 633,000.00 1,832,535,000 | - - | 1.92 |
| 17 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 5,653 | 304,521.11 1,721,457,841 | 318,500.00 1,800,480,500 | - - | 1.89 |
| 18 | インヴィンシブル投資法人 日本 | 投資証券 | 36,901 | 46,849.34 1,728,787,553 | 46,700.00 1,723,276,700 | - - | 1.81 |
| 19 | ケネディクス・オフィス投資法人 日本 | 投資証券 | 4,878 | 331,500.00 1,617,057,000 | 338,500.00 1,651,203,000 | - - | 1.73 |
| 20 | フロンティア不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 3,111 | 499,527.48 1,554,029,998 | 525,000.00 1,633,275,000 | - - | 1.71 |
| 21 | 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 | 3,312 | 468,533.02 1,551,781,373 | 493,000.00 1,632,816,000 | - - | 1.71 |
| 22 | ラサールロジポート投資法人 日本 | 投資証券 | 10,263 | 154,503.89 1,585,673,470 | 158,700.00 1,628,738,100 | - - | 1.71 |
| 23 | 森ヒルズリート投資法人 日本 | 投資証券 | 9,859 | 152,112.41 1,499,676,257 | 162,700.00 1,604,059,300 | - - | 1.68 |
| 24 | イオンリート投資法人 日本 | 投資証券 | 9,280 | 152,108.69 1,411,568,648 | 160,000.00 1,484,800,000 | - - | 1.56 |
| 25 | ヒューリックリート投資法人 日本 | 投資証券 | 7,844 | 162,615.49 1,275,555,976 | 174,100.00 1,365,640,400 | - - | 1.43 |
| 26 | 大和証券リビング投資法人 日本 | 投資証券 | 11,618 | 109,708.58 1,274,594,372 | 115,400.00 1,340,717,200 | - - | 1.41 |
| 27 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本 | 投資証券 | 6,013 | 205,417.61 1,235,176,125 | 217,800.00 1,309,631,400 | - - | 1.37 |
| 28 | 三菱地所物流リート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,880 | 409,583.47 1,179,600,411 | 440,000.00 1,267,200,000 | - - | 1.33 |

| | | | | | | | |
|----|--------------------------|------|-------|-----------------------------|-----------------------------|--------|------|
| 29 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本 | 投資証券 | 3,900 | 299,522.95 1,168,139,508 | 315,500.00 1,230,450,000 | - - | 1.29 |
| 30 | 大和証券オフィス投資法人 日本 | 投資証券 | 1,752 | 660,042.02 1,156,393,636 | 702,000.00 1,229,904,000 | - - | 1.29 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 97.02 |
| 合計 | 97.02 |

(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10月31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 | 3,939 | 22,359.09 88,072,457 | 23,090.01 90,951,558 | - - | 4.92 |
| 2 | MICROSOFT CORP アメリカ | 株式 ソフト ウェア | 1,728 | 49,807.94 86,068,132 | 34,970.08 60,428,308 | - - | 3.27 |
| 3 | AMAZON.COM INC アメリカ | 株式 インター ネット販 売・通信 販売 | 2,226 | 26,510.59 59,012,586 | 15,331.56 34,128,067 | - - | 1.84 |
| 4 | TESLA INC アメリカ | 株式 自動車 | 645 | 50,227.15 32,396,512 | 33,880.37 21,852,842 | - - | 1.18 |
| 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 | 1,466 | 22,078.65 32,367,315 | 14,275.95 20,928,550 | - - | 1.13 |
| 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 | 1,367 | 22,127.58 30,248,411 | 14,318.95 19,574,005 | - - | 1.06 |

| | | | | | | | |
|----|-------------------------------------|-------------------------------|-------|-------------------------|-------------------------|--------|------|
| 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 | 228 | 68,844.53 15,696,553 | 81,726.84 18,633,720 | - - | 1.01 |
| 8 | EXXON MOBIL CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・消耗燃料 | 1,031 | 9,838.53 10,143,528 | 16,412.38 16,921,165 | - - | 0.91 |
| 9 | JOHNSON & JOHNSON アメリカ | 株式 医薬品 | 641 | 24,093.73 15,444,082 | 25,926.22 16,618,710 | - - | 0.90 |
| 10 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ | 株式 各種金融サービス | 315 | 42,454.25 13,373,089 | 44,423.14 13,993,290 | - - | 0.76 |
| 11 | JPMORGAN CHASE & CO アメリカ | 株式 銀行 | 716 | 24,875.06 17,810,544 | 18,692.62 13,383,916 | - - | 0.72 |
| 12 | NVIDIA CORP アメリカ | 株式 半導体・半導体製造装置 | 609 | 45,452.06 27,680,309 | 20,510.28 12,490,765 | - - | 0.68 |
| 13 | VISA INC アメリカ | 株式 情報技術サービス | 400 | 31,637.20 12,654,880 | 31,036.74 12,414,699 | - - | 0.67 |
| 14 | CHEVRON CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・消耗燃料 | 453 | 17,198.15 7,790,766 | 26,683.83 12,087,777 | - - | 0.65 |
| 15 | PROCTER & GAMBLE CO アメリカ | 株式 家庭用品 | 588 | 21,555.52 12,674,646 | 20,047.71 11,788,057 | - - | 0.64 |
| 16 | HOME DEPOT INC アメリカ | 株式 専門小売り | 249 | 54,952.56 13,683,189 | 44,277.84 11,025,184 | - - | 0.60 |
| 17 | NESTLE SA-REGISTERED スイス | 株式 食品 | 676 | 18,286.61 12,361,749 | 16,026.06 10,833,621 | - - | 0.59 |
| 18 | ELI LILLY & CO アメリカ | 株式 医薬品 | 196 | 38,847.08 7,614,028 | 53,358.77 10,458,319 | - - | 0.57 |
| 19 | MASTERCARD INC アメリカ | 株式 情報技術サービス | 210 | 51,097.80 10,730,539 | 48,847.21 10,257,916 | - - | 0.55 |
| 20 | PFIZER INC アメリカ | 株式 医薬品 | 1,363 | 7,012.69 9,558,307 | 7,031.97 9,584,577 | - - | 0.52 |
| 21 | BANK OF AMERICA CORP アメリカ | 株式 銀行 | 1,769 | 6,950.42 12,295,308 | 5,364.04 9,488,998 | - - | 0.51 |
| 22 | ABBVIE INC アメリカ | 株式 バイオテクノロジー | 427 | 17,140.33 7,318,924 | 21,884.65 9,344,749 | - - | 0.51 |

| | | | | | | | |
|----|---|--|-------|-------------------------|------------------------|--------|------|
| 23 | MERCK & CO. INC. アメリカ | 株式 医薬品 | 614 | 12,264.06 7,530,137 | 14,940.15 9,173,258 | - - | 0.50 |
| 24 | PEPSICO INC アメリカ | 株式 飲料 | 338 | 24,241.99 8,193,793 | 27,017.41 9,131,887 | - - | 0.49 |
| 25 | COCA-COLA CO/THE アメリカ | 株式 飲料 | 1,007 | 8,375.20 8,433,833 | 9,008.27 9,071,335 | - - | 0.49 |
| 26 | ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス | 株式 医薬品 | 170 | 54,602.54 9,282,433 | 49,330.42 8,386,172 | - - | 0.45 |
| 27 | COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ | 株式 食品・生 活必需品 小売り | 108 | 75,421.34 8,145,505 | 75,741.58 8,180,091 | - - | 0.44 |
| 28 | 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 | 555 | 49,721.95 27,595,685 | 14,707.39 8,162,602 | - - | 0.44 |
| 29 | WALMART INC アメリカ | 株式 食品・生 活必需品 小売り | 366 | 22,207.86 8,128,078 | 21,128.53 7,733,042 | - - | 0.42 |
| 30 | SHELL PLC イギリス | 株式 石油・ガ ス・消耗 燃料 | 1,792 | 2,892.27 5,182,954 | 4,164.65 7,463,065 | - - | 0.40 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|----------|---------|
| 株式 | 88.52 |
| 投資信託受益証券 | 0.13 |
| 投資証券 | 1.90 |
| 合計 | 90.54 |

（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10月31日現在

| 業種 | 国内 / 外国 | 投資比率（％） |
|-------------|---------|---------|
| ソフトウェア | 外国 | 6.19 |
| 銀行 | | 5.42 |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 5.24 |
| コンピュータ・周辺機器 | | 5.13 |
| 医薬品 | | 5.10 |
| 半導体・半導体製造装置 | | 3.66 |
| 情報技術サービス | | 3.55 |
| 保険 | | 2.93 |
| 資本市場 | | 2.92 |

| | |
|-------------------------|------|
| インタラクティブ・メディアおよびサービス | 2.78 |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 2.46 |
| ヘルスケア機器・用品 | 2.13 |
| インターネット販売・通信販売 | 2.12 |
| バイオテクノロジー | 1.94 |
| 化学 | 1.88 |
| 自動車 | 1.79 |
| 電力 | 1.72 |
| 飲料 | 1.72 |
| ホテル・レストラン・レジャー | 1.72 |
| 機械 | 1.59 |
| 食品 | 1.58 |
| 航空宇宙・防衛 | 1.56 |
| 専門小売り | 1.55 |
| 食品・生活必需品小売り | 1.46 |
| ライフサイエンス・ツール/サービス | 1.35 |
| 金属・鉱業 | 1.31 |
| 娯楽 | 1.10 |
| 家庭用品 | 1.06 |
| 各種電気通信サービス | 1.05 |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | 1.05 |
| 各種金融サービス | 0.98 |
| 陸運・鉄道 | 0.98 |
| コングロマリット | 0.88 |
| 総合公益事業 | 0.78 |
| 電気設備 | 0.72 |
| メディア | 0.71 |
| タバコ | 0.69 |
| 専門サービス | 0.64 |
| 通信機器 | 0.63 |
| パーソナル用品 | 0.51 |
| 電子装置・機器・部品 | 0.50 |
| 航空貨物・物流サービス | 0.48 |
| 建設関連製品 | 0.48 |
| 商業サービス・用品 | 0.47 |
| 複合小売り | 0.46 |
| 消費者金融 | 0.38 |
| 商社・流通業 | 0.32 |
| 不動産管理・開発 | 0.29 |
| エネルギー設備・サービス | 0.28 |
| 無線通信サービス | 0.27 |
| 家庭用耐久財 | 0.26 |
| 建設・土木 | 0.24 |
| 建設資材 | 0.23 |
| 容器・包装 | 0.21 |
| 自動車部品 | 0.17 |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.14 |
| 運送インフラ | 0.13 |
| 販売 | 0.11 |
| 水道 | 0.11 |

| | |
|--------------|-------|
| 紙製品・林産品 | 0.11 |
| ガス | 0.10 |
| 海運業 | 0.06 |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.06 |
| 旅客航空輸送業 | 0.05 |
| レジャー用品 | 0.02 |
| 各種消費者サービス | 0.01 |
| 合計 | 88.52 |

(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10月31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 0.125 04/30/23 アメリカ | 国債証 券 | 1,438,122,000 | 97.83 1,406,990,802 | 97.89 1,407,842,781 | 0.125 2023/4/30 | 9.68 |
| 2 | US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ | 国債証 券 | 1,452,948,000 | 93.17 1,353,726,181 | 83.50 1,213,268,330 | 1.875 2032/2/15 | 8.34 |
| 3 | US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ | 国債証 券 | 1,423,296,000 | 100.65 1,432,580,767 | 82.92 1,180,334,916 | 1.625 2031/5/15 | 8.11 |
| 4 | US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ | 国債証 券 | 1,082,298,000 | 99.09 1,072,513,280 | 91.03 985,313,946 | 2.875 2032/5/15 | 6.77 |
| 5 | US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ | 国債証 券 | 1,260,210,000 | 88.15 1,110,908,990 | 77.54 977,253,472 | 0.625 2030/8/15 | 6.72 |
| 6 | US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ | 国債証 券 | 874,734,000 | 95.39 834,444,094 | 80.10 700,675,596 | 1.375 2031/11/15 | 4.82 |
| 7 | US T N/B 2.75 08/15/42 アメリカ | 国債証 券 | 845,082,000 | 85.25 720,500,745 | 77.78 657,315,343 | 2.75 2042/8/15 | 4.52 |
| 8 | US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ | 国債証 券 | 711,648,000 | 97.02 690,462,239 | 79.68 567,094,500 | 1.25 2031/8/15 | 3.90 |
| 9 | FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス | 国債証 券 | 442,770,000 | 142.19 629,597,244 | 118.64 525,321,809 | 5.5 2029/4/25 | 3.61 |
| 10 | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 ドイツ | 国債証 券 | 554,938,400 | 87.29 484,450,891 | 83.94 465,859,688 | - 2031/8/15 | 3.20 |
| 11 | ITALY BTPS 0.95 08/01/30 イタリア | 国債証 券 | 442,770,000 | 100.66 445,692,282 | 81.07 358,953,639 | 0.95 2030/8/1 | 2.47 |
| 12 | FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス | 国債証 券 | 383,734,000 | 106.20 407,537,315 | 91.40 350,752,062 | 0.75 2028/11/25 | 2.41 |
| 13 | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 ドイツ | 国債証 券 | 398,493,000 | 101.92 406,160,005 | 84.88 338,252,813 | - 2031/2/15 | 2.33 |
| 14 | DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 ドイツ | 国債証 券 | 250,903,000 | 155.02 388,967,393 | 128.10 321,411,761 | 6.25 2030/1/4 | 2.21 |
| 15 | ITALY BTPS 0.95 06/01/32 イタリア | 国債証 券 | 413,252,000 | 78.32 323,675,496 | 76.00 314,071,520 | 0.95 2032/6/1 | 2.16 |
| 16 | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 ドイツ | 国債証 券 | 368,975,000 | 85.50 315,501,667 | 82.88 305,834,522 | - 2032/2/15 | 2.10 |
| 17 | FRANCE OAT 0.0 11/25/31 フランス | 国債証 券 | 376,354,500 | 97.90 368,475,555 | 80.26 302,095,617 | - 2031/11/25 | 2.08 |

| | | | | | | | |
|----|---------------------------------------|------|-------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|------|
| 18 | CANADA 2.0 09/01/23 カナダ | 国債証券 | 304,836,000 | 98.30 299,669,029 | 98.26 299,551,667 | 2 2023/9/1 | 2.06 |
| 19 | FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス | 国債証券 | 295,180,000 | 121.54 358,775,055 | 101.43 299,428,525 | 2.5 2030/5/25 | 2.06 |
| 20 | ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア | 国債証券 | 295,180,000 | 121.90 359,850,986 | 99.02 292,313,802 | 3.5 2030/3/1 | 2.01 |
| 21 | FRANCE OAT 1.75 05/25/23 フランス | 国債証券 | 265,662,000 | 100.15 266,065,806 | 100.09 265,924,739 | 1.75 2023/5/25 | 1.83 |
| 22 | FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス | 国債証券 | 295,180,000 | 104.29 307,863,884 | 89.22 263,371,993 | 0.5 2029/5/25 | 1.81 |
| 23 | FRANCE OAT 1.25 05/25/36 フランス | 国債証券 | 295,180,000 | 90.03 265,762,361 | 81.98 241,988,564 | 1.25 2036/5/25 | 1.66 |
| 24 | ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア | 国債証券 | 236,144,000 | 117.20 276,784,382 | 96.28 227,380,696 | 3 2029/8/1 | 1.56 |
| 25 | CANADA 0.25 05/01/23 カナダ | 国債証券 | 217,740,000 | 97.90 213,178,347 | 98.12 213,650,625 | 0.25 2023/5/1 | 1.47 |
| 26 | ITALY BTPS 0.6 08/01/31 イタリア | 国債証券 | 236,144,000 | 96.42 227,705,273 | 75.63 178,614,598 | 0.6 2031/8/1 | 1.23 |
| 27 | CANADA 0.5 12/01/30 カナダ | 国債証券 | 206,853,000 | 87.14 180,253,609 | 80.72 166,987,048 | 0.5 2030/12/1 | 1.15 |
| 28 | UK TREASURY 1.75 09/07/37 イギリス | 国債証券 | 198,030,000 | 88.85 175,953,615 | 77.17 152,824,266 | 1.75 2037/9/7 | 1.05 |
| 29 | UK TREASURY 1.0 01/31/32 イギリス | 国債証券 | 137,760,000 | 93.32 128,566,069 | 80.17 110,450,457 | 1 2032/1/31 | 0.76 |
| 30 | UK TREASURY 0.125 01/31/23 イギリス | 国債証券 | 108,486,000 | 99.15 107,564,833 | 99.39 107,832,914 | 0.125 2023/1/31 | 0.74 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.89 |
| 合計 | 98.89 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

2022年10月31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 | 3,158 | 15,124.00 47,761,600 | 16,750.41 52,897,809 | - - | 8.73 |
| 2 | AMERICAN TOWER CORP アメリカ | 投資証券 | 1,592 | 28,316.17 45,079,354 | 30,350.30 48,317,684 | - - | 7.97 |
| 3 | CROWN CASTLE INC アメリカ | 投資証券 | 1,480 | 19,377.58 28,678,821 | 19,644.45 29,073,786 | - - | 4.80 |

| | | | | | | | |
|----|---|----------|-------|-------------------------|-------------------------|--------|------|
| 4 | EQUINIX INC アメリカ | 投資証 券 | 312 | 77,913.59 24,309,041 | 84,219.09 26,276,357 | - - | 4.34 |
| 5 | PUBLIC STORAGE アメリカ | 投資証 券 | 536 | 43,128.83 23,117,055 | 46,188.91 24,757,261 | - - | 4.09 |
| 6 | REALTY INCOME CORP アメリカ | 投資証 券 | 2,119 | 8,573.87 18,168,042 | 9,238.08 19,575,492 | - - | 3.23 |
| 7 | SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ | 投資証 券 | 1,116 | 14,533.92 16,219,863 | 16,154.40 18,028,321 | - - | 2.98 |
| 8 | VICI PROPERTIES INC アメリカ | 投資証 券 | 3,292 | 4,358.84 14,349,314 | 4,763.59 15,681,750 | - - | 2.59 |
| 9 | SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ | 投資証 券 | 366 | 37,434.16 13,700,905 | 40,031.68 14,651,595 | - - | 2.42 |
| 10 | DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ | 投資証 券 | 972 | 14,115.83 13,720,591 | 15,032.08 14,611,183 | - - | 2.41 |
| 11 | WELLTOWER INC アメリカ | 投資証 券 | 1,588 | 8,796.26 13,968,470 | 9,117.98 14,479,368 | - - | 2.39 |
| 12 | AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ | 投資証 券 | 478 | 25,700.87 12,285,016 | 26,034.45 12,444,469 | - - | 2.05 |
| 13 | EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ | 投資証 券 | 453 | 24,599.29 11,143,482 | 26,495.54 12,002,481 | - - | 1.98 |
| 14 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ | 投資証 券 | 554 | 19,361.27 10,726,145 | 21,604.44 11,968,863 | - - | 1.98 |
| 15 | EQUITY RESIDENTIAL アメリカ | 投資証 券 | 1,267 | 9,433.78 11,952,604 | 9,359.65 11,858,681 | - - | 1.96 |
| 16 | WEYERHAEUSER CO アメリカ | 投資証 券 | 2,548 | 4,306.95 10,974,116 | 4,610.88 11,748,537 | - - | 1.94 |
| 17 | INVITATION HOMES INC アメリカ | 投資証 券 | 2,088 | 4,818.44 10,060,923 | 4,745.80 9,909,235 | - - | 1.64 |
| 18 | MID AMERICA アメリカ | 投資証 券 | 393 | 21,884.65 8,600,670 | 23,218.99 9,125,066 | - - | 1.51 |
| 19 | SUN COMMUNITIES INC アメリカ | 投資証 券 | 416 | 17,983.93 7,481,318 | 19,777.88 8,227,599 | - - | 1.36 |
| 20 | VENTAS INC アメリカ | 投資証 券 | 1,368 | 5,503.41 7,528,666 | 5,884.43 8,049,913 | - - | 1.33 |
| 21 | WP CAREY INC アメリカ | 投資証 券 | 654 | 10,481.98 6,855,216 | 11,254.41 7,360,388 | - - | 1.21 |
| 22 | ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ | 投資証 券 | 223 | 33,672.80 7,509,036 | 32,949.30 7,347,694 | - - | 1.21 |
| 23 | IRON MOUNTAIN INC アメリカ | 投資証 券 | 989 | 6,855.54 6,780,131 | 7,427.82 7,346,119 | - - | 1.21 |
| 24 | HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ | 投資証 券 | 2,426 | 2,598.99 6,305,168 | 2,765.04 6,708,008 | - - | 1.11 |
| 25 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ | 投資証 券 | 1,848 | 3,344.74 6,181,089 | 3,524.14 6,512,611 | - - | 1.07 |
| 26 | UDR INC アメリカ | 投資証 券 | 1,108 | 5,761.38 6,383,613 | 5,868.12 6,501,888 | - - | 1.07 |
| 27 | KIMCO REALTY アメリカ | 投資証 券 | 2,070 | 2,831.76 5,861,755 | 3,129.76 6,478,621 | - - | 1.07 |

| | | | | | | | |
|----|--------------------------------------|----------|-----|-----------|-----------|---|------|
| 28 | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 投資証 券 | 835 | 6,751.75 | 7,405.58 | - | 1.02 |
| | アメリカ | | | 5,637,719 | 6,183,665 | - | |
| 29 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 投資証 券 | 355 | 16,713.34 | 17,046.93 | - | 1.00 |
| | アメリカ | | | 5,933,239 | 6,051,661 | - | |
| 30 | BOSTON PROPERTIES INC | 投資証 券 | 537 | 10,648.03 | 10,793.32 | - | 0.96 |
| | アメリカ | | | 5,717,993 | 5,796,017 | - | |

(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10月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 99.29 |
| 合計 | 99.29 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【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。

【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10月31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 0412月 | 買建 | 3 | 56,530,990 | 57,780,000 | 3.35 |

(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10月31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 0412月 | 買建 | 1,382 | 2,572,593,000 | 2,721,849,000 | 2.86 |

(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10月31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 Dec22 | 買建 | 4 | 121,132,867 | 115,976,385 | 6.27 |
| | EUREX取引所 | DJ EURO STOXX 50 Dec22 | 買建 | 6 | 31,126,731 | 31,959,138 | 1.73 |
| | ICE-EU | FTSE 100 INDEX FUTURE Dec22 | 買建 | 2 | 24,752,889 | 24,259,536 | 1.31 |

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

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

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(2022年10月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額 (分配落) (百万円) | 純資産総額 (分配付) (百万円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落)(円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付)(円) |
|---------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第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 |
| 第32特定期間末 (2022年10月20日) | 4,398 | 4,407 | 1.0262 | 1.0282 |
| 2021年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 | - |
| 5月末日 | 4,549 | - | 1.0438 | - |
| 6月末日 | 4,494 | - | 1.0356 | - |
| 7月末日 | 4,566 | - | 1.0560 | - |
| 8月末日 | 4,541 | - | 1.0595 | - |
| 9月末日 | 4,355 | - | 1.0153 | - |
| 10月末日 | 4,515 | - | 1.0535 | - |

【分配の推移】

| | |
|--|--------------|
| | 1口当たりの分配金(円) |
|--|--------------|

| | |
|---------|--------|
| 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 |
| 第32特定期間 | 0.0120 |

【収益率の推移】

| | 収益率（％） |
|---------|--------|
| 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 |
| 第32特定期間 | 3.4 |

（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 |

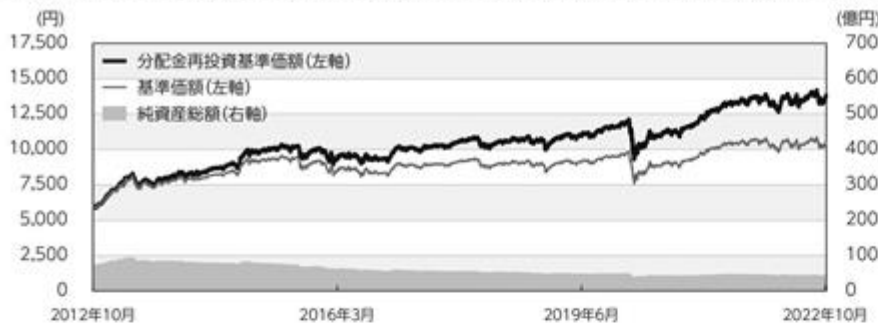
| | | |
|---------|------------|-------------|
| 第14特定期間 | 22,407,208 | 820,891,392 |
| 第15特定期間 | 25,208,228 | 996,341,985 |
| 第16特定期間 | 8,899,172 | 916,673,106 |
| 第17特定期間 | 13,815,643 | 989,033,927 |
| 第18特定期間 | 10,689,548 | 583,223,930 |
| 第19特定期間 | 7,316,627 | 417,039,060 |
| 第20特定期間 | 6,935,970 | 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 |
| 第32特定期間 | 60,021,152 | 172,680,942 |

(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10月31日

基準価額・純資産の推移 (2012年10月31日～2022年10月31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)

| | |
|----------|--------|
| 2022年 6月 | 20円 |
| 2022年 7月 | 20円 |
| 2022年 8月 | 20円 |
| 2022年 9月 | 20円 |
| 2022年10月 | 20円 |
| 直近1年間累計 | 240円 |
| 設定来累計 | 4,880円 |

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名 | 比率(%) |
|----|--|-------|
| 1 | 新光外国株式インデックスマザーファンド | 14.90 |
| 2 | フランクリン・テンプレート・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド | 14.30 |
| 3 | ニュー トピックス インデックス マザーファンド | 14.04 |
| 4 | 新光J-REITマザーファンド | 13.93 |
| 5 | 海外国債マザーファンド | 13.84 |
| 6 | 新光日本債券インデックスマザーファンド | 13.81 |
| 7 | 新光米国REITマザーファンド | 13.42 |

■ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 業種 | 比率(%) |
|----|-------------------|----|------|--------|-------|
| 1 | トヨタ自動車 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 3.89 |
| 2 | ソニーグループ | 株式 | 日本 | 電気機器 | 2.43 |
| 3 | キーエンス | 株式 | 日本 | 電気機器 | 1.96 |
| 4 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.80 |
| 5 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.55 |

■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 | 1.48 |
| 2 | 147回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.005 | 2026/3/20 | 1.18 |
| 3 | 350回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.1 | 2028/3/20 | 1.18 |
| 4 | 351回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.1 | 2028/6/20 | 1.18 |
| 5 | 97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 特殊債券 | 日本 | 2.1 | 2029/12/28 | 1.11 |

■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 | 6.78 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 日本 | 5.48 |
| 3 | 日本都市ファンド投資法人 | 日本 | 4.86 |
| 4 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 日本 | 4.82 |
| 5 | 日本プロロジスリート投資法人 | 日本 | 4.49 |

○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10月31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 | 4.92 |
| 2 | MICROSOFT CORP | 株式 | アメリカ | ソフトウェア | 3.27 |
| 3 | AMAZON.COM INC | 株式 | アメリカ | インターネット販売・通信販売 | 1.84 |
| 4 | TESLA INC | 株式 | アメリカ | 自動車 | 1.18 |
| 5 | ALPHABET INC-CL A | 株式 | アメリカ | インフラティブ・メディアおよびサービス | 1.13 |

■海外国債マザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 利率(%) | 償還日 | 比率(%) |
|----|-------------------------|------|------|-------|-----------|-------|
| 1 | US T N/B 0.125 04/30/23 | 国債証券 | アメリカ | 0.125 | 2023/4/30 | 9.68 |
| 2 | US T N/B 1.875 02/15/32 | 国債証券 | アメリカ | 1.875 | 2032/2/15 | 8.34 |
| 3 | US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | アメリカ | 1.625 | 2031/5/15 | 8.11 |
| 4 | US T N/B 2.875 05/15/32 | 国債証券 | アメリカ | 2.875 | 2032/5/15 | 6.77 |
| 5 | US T N/B 0.625 08/15/30 | 国債証券 | アメリカ | 0.625 | 2030/8/15 | 6.72 |

■フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド(現地2022年10月14日現在)

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

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

①組入公社債の上位5通貨

| 順位 | 通貨 | 比率(%) |
|----|---------|-------|
| 1 | 米ドル | 49.1 |
| 2 | メキシコペソ | 7.1 |
| 3 | ユーロ | 5.8 |
| 4 | コロンビアペソ | 5.4 |
| 5 | ウルグアイペソ | 4.0 |

②組入公社債の上位5カ国

| 順位 | 国/地域 | 比率(%) |
|----|--------|-------|
| 1 | メキシコ | 9.5 |
| 2 | 南アフリカ | 8.0 |
| 3 | その他 | 7.1 |
| 4 | カザフスタン | 5.6 |
| 5 | コロンビア | 5.4 |

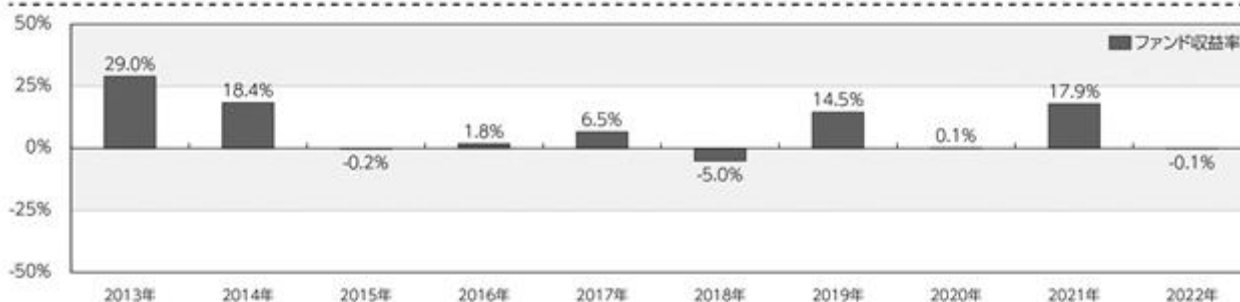
■新光米国REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国/地域 | 比率(%) |
|----|---------------------|------|-------|
| 1 | PROLOGIS INC | アメリカ | 8.73 |
| 2 | AMERICAN TOWER CORP | アメリカ | 7.97 |
| 3 | CROWN CASTLE INC | アメリカ | 4.80 |
| 4 | EQUINIX INC | アメリカ | 4.34 |
| 5 | PUBLIC STORAGE | アメリカ | 4.09 |

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(二)の規定に準じて計算された価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

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

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

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

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

（５）【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

（イ）委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより、受益権の総口数が30億口を下回ることとなった場合、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、知っている受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

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

e. 公告

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

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

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

f. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g. 信託事務処理の再信託

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

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

h. 信託業務の委託等

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

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

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

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

1. 投資信託財産の保存にかかる業務

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

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

4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

i. 関係法人との契約の更改

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

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としません。）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せん。）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(2022年4月21日から2022年10月20日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【新光7資産バランスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 前期 2022年4月20日現在 | 当期 2022年10月20日現在 |
|-----------------|--------------------|---------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 86,871,213 | 98,868,059 |
| 投資信託受益証券 | 630,735,300 | 643,122,900 |
| 親投資信託受益証券 | 4,022,533,272 | 3,674,158,856 |
| 流動資産合計 | 4,740,139,785 | 4,416,149,815 |
| 資産合計 | 4,740,139,785 | 4,416,149,815 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 8,798,114 | 8,572,794 |
| 未払解約金 | - | 5,249,500 |
| 未払受託者報酬 | 325,116 | 318,987 |
| 未払委託者報酬 | 3,535,741 | 3,469,074 |
| その他未払費用 | 14,451 | 14,180 |
| 流動負債合計 | 12,673,422 | 17,624,535 |
| 負債合計 | 12,673,422 | 17,624,535 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,399,057,084 | 4,286,397,294 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 328,409,279 | 112,127,986 |
| （分配準備積立金） | 544,719,180 | 537,033,912 |
| 元本等合計 | 4,727,466,363 | 4,398,525,280 |
| 純資産合計 | 4,727,466,363 | 4,398,525,280 |
| 負債純資産合計 | 4,740,139,785 | 4,416,149,815 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 前期 | | 当期 | |
|---|----|-------------|----|-------------|
| | 自 | 2021年10月21日 | 自 | 2022年4月21日 |
| | 至 | 2022年4月20日 | 至 | 2022年10月20日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 57,438,000 | | 37,851,000 |
| 有価証券売買等損益 | | 56,726,541 | | 173,986,816 |
| 営業収益合計 | | 114,164,541 | | 136,135,816 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 5,933 | | 11,036 |
| 受託者報酬 | | 2,028,652 | | 1,991,650 |
| 委託者報酬 | | 22,062,126 | | 21,659,607 |
| その他費用 | | 90,170 | | 88,541 |
| 営業費用合計 | | 24,186,881 | | 23,750,834 |
| 営業利益又は営業損失() | | 89,977,660 | | 159,886,650 |
| 経常利益又は経常損失() | | 89,977,660 | | 159,886,650 |
| 当期純利益又は当期純損失() | | 89,977,660 | | 159,886,650 |
| 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() | | 286,486 | | 1,364,458 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | | 294,612,313 | | 328,409,279 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,436,807 | | 3,313,266 |
| 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 | | 1,436,807 | | 3,313,266 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 4,889,689 | | 9,316,701 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 4,889,689 | | 9,316,701 |
| 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 | | 53,014,298 | | 51,755,666 |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | | 328,409,279 | | 112,127,986 |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 前期 | 当期 |
|-----------|----------------|----------------|
| | 2022年4月20日現在 | 2022年10月20日現在 |
| 1. 期首元本額 | 4,454,834,209円 | 4,399,057,084円 |
| 期中追加設定元本額 | 59,835,363円 | 60,021,152円 |
| 期中一部解約元本額 | 115,612,488円 | 172,680,942円 |
| 2. 受益権の総数 | 4,399,057,084口 | 4,286,397,294口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 前期 | 当期 |
|-------------|--|---|
| | 自 2021年10月21日 至 2022年4月20日 | 自 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
| 1. 分配金の計算過程 | <p>(自2021年10月21日 至2021年11月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p> | <p>(自2022年4月21日 至2022年5月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,458,479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(20,426,858円)及び分配準備積立金(537,308,236円)より分配対象収益は569,193,573円(1万口当たり1,311.39円)であり、うち8,680,764円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> |

(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2022年5月21日 至2022年6月20日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,497,650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(22,924,764円)及び分配準備積立金(538,710,836円)より分配対象収益は569,133,250円(1万口当たり1,308.65円)であり、うち8,697,974円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2022年6月21日 至2022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(11,660,867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(22,962,745円)及び分配準備積立金(535,117,294円)より分配対象収益は569,740,906円(1万口当たり1,315.58円)であり、うち8,661,408円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2022年7月21日 至2022年8月22日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,724,652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(24,520,179円)及び分配準備積立金(530,811,901円)より分配対象収益は567,056,732円(1万口当たり1,322.97円)であり、うち8,572,460円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

| | | |
|--|---|---|
| | <p>(自2022年2月22日 至2022年3月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p> <p>(自2022年3月23日 至2022年4月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p> | <p>(自2022年8月23日 至2022年9月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,944,021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(26,386,087円)及び分配準備積立金(531,975,992円)より分配対象収益は568,306,100円(1万口当たり1,326.22円)であり、うち8,570,266円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2022年9月21日 至2022年10月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,196,985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(27,505,187円)及び分配準備積立金(532,409,721円)より分配対象収益は573,111,893円(1万口当たり1,337.04円)であり、うち8,572,794円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> |
|--|---|---|

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

| | | |
|-------------------|--|----|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。 | 同左 |
|-------------------|--|----|

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 前期 2022年4月20日現在 | 当期 2022年10月20日現在 |
|----------------------------|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 前期 2022年4月20日現在 | 当期 2022年10月20日現在 |
|-----------|-------------------------------|-------------------------------|
| | 最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円) | 最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円) |
| 投資信託受益証券 | 34,708,200 | 3,441,000 |
| 親投資信託受益証券 | 158,685,966 | 130,502,268 |
| 合計 | 193,394,166 | 133,943,268 |

(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 2022年4月20日現在 | 当期 2022年10月20日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.0747円 (10,747円) | 1.0262円 (10,262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10月20日現在

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|--------------|--|---------------|---------------|----|
| 投資信託受益証券 | フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド | 344,100 | 643,122,900 | |
| 投資信託受益証券 合計 | | 344,100 | 643,122,900 | |
| 親投資信託受益証券 | 海外国債マザーファンド | 235,052,061 | 616,800,113 | |
| | ニュー トピックス インデックス マザーファンド | 226,901,520 | 622,821,982 | |
| | 新光外国株式インデックスマザーファンド | 162,132,483 | 646,292,503 | |
| | 新光日本債券インデックスマザーファンド | 503,038,704 | 619,240,644 | |
| | 新光J-REITマザーファンド | 277,479,957 | 594,611,799 | |
| | 新光米国REITマザーファンド | 232,387,351 | 574,391,815 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 1,636,992,076 | 3,674,158,856 | |
| 合計 | | | 4,317,281,756 | |

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2022年10月20日現在

| | |
|-------------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 62,862,545 |
| 株式 | 1,606,593,570 |
| 派生商品評価勘定 | 399,340 |
| 未収配当金 | 17,107,050 |
| 差入委託証拠金 | 3,480,000 |
| 流動資産合計 | 1,690,442,505 |
| 資産合計 | 1,690,442,505 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 280,660 |
| 前受金 | 540,000 |
| 未払解約金 | 13,000 |
| 流動負債合計 | 833,660 |
| 負債合計 | 833,660 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 615,543,848 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 1,074,064,997 |
| 元本等合計 | 1,689,608,845 |
| 純資産合計 | 1,689,608,845 |
| 負債純資産合計 | 1,690,442,505 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 2022年10月20日現在 |
|---------------------------------------|---------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 653,687,843円 |
| 同期中追加設定元本額 | 23,788,750円 |
| 同期中一部解約元本額 | 61,932,745円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| 新光7資産バランスファンド | 226,901,520円 |
| ニュー トピックス インデックス（変額年金） | 50,159,401円 |
| 世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募） | 286,077,208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） | 11,935,060円 |
| ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募） | 16,615,106円 |
| ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募） | 8,024,334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 | 10,620,035円 |
| 太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30 | 765,399円 |
| 計 | 615,543,848円 |
| 2. 受益権の総数 | 615,543,848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 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
|-----------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |

| | |
|--------------------------|--|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 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。 |
| | 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10月20日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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10月20日現在 |
|----|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) |
| 株式 | 64,610,364 |
| 合計 | 64,610,364 |

(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10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

| 種類 | 2022年10月20日現在 | | | |
|--------------------|---------------|-----------|------------|---------|
| | 契約額等（円） | うち 1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | | |
| 市場取引 先物取引 買建 | 75,600,000 | - | 75,720,000 | 120,000 |
| 合計 | 75,600,000 | - | 75,720,000 | 120,000 |

（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10月20日現在 | |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 2.7449円 (27,449円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年10月20日現在

| 銘柄 | 株式数 | 評価額（円） | | 備考 |
|-----------------|-------|----------|-----------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| 日本水産 | 900 | 540.00 | 486,000 | |
| マルハニチロ | 100 | 2,389.00 | 238,900 | |
| 雪国まいたけ | 100 | 1,060.00 | 106,000 | |
| サカタのタネ | 100 | 4,600.00 | 460,000 | |
| ホクト | 100 | 1,908.00 | 190,800 | |
| ショーボンドホールディングス | 100 | 6,400.00 | 640,000 | |
| ミライト・ワン | 300 | 1,444.00 | 433,200 | |
| タマホーム | 100 | 2,270.00 | 227,000 | |
| INPEX | 2,900 | 1,483.00 | 4,300,700 | |
| 石油資源開発 | 100 | 3,720.00 | 372,000 | |
| K&Oエナジーグループ | 100 | 1,917.00 | 191,700 | |
| 安藤・間 | 400 | 843.00 | 337,200 | |
| 東急建設 | 300 | 640.00 | 192,000 | |
| コムシスホールディングス | 300 | 2,460.00 | 738,000 | |
| 高松コンストラクショングループ | 100 | 1,914.00 | 191,400 | |
| オリエンタル白石 | 400 | 257.00 | 102,800 | |
| 大成建設 | 600 | 4,030.00 | 2,418,000 | |
| 大林組 | 1,900 | 964.00 | 1,831,600 | |
| 清水建設 | 1,800 | 743.00 | 1,337,400 | |
| 飛島建設 | 100 | 1,060.00 | 106,000 | |
| 長谷工コーポレーション | 600 | 1,557.00 | 934,200 | |

| | | | |
|---------------|-------|-----------|-----------|
| 松井建設 | 100 | 560.00 | 56,000 |
| 鹿島建設 | 1,400 | 1,394.00 | 1,951,600 |
| 不動テトラ | 100 | 1,480.00 | 148,000 |
| 鉄建建設 | 100 | 1,785.00 | 178,500 |
| 西松建設 | 100 | 3,775.00 | 377,500 |
| 三井住友建設 | 500 | 441.00 | 220,500 |
| 奥村組 | 100 | 2,841.00 | 284,100 |
| 東鉄工業 | 100 | 2,474.00 | 247,400 |
| 浅沼組 | 100 | 2,828.00 | 282,800 |
| 戸田建設 | 800 | 753.00 | 602,400 |
| 熊谷組 | 100 | 2,549.00 | 254,900 |
| 矢作建設工業 | 100 | 749.00 | 74,900 |
| ピーエス三菱 | 100 | 612.00 | 61,200 |
| 日本ハウスホールディングス | 100 | 451.00 | 45,100 |
| 大東建託 | 200 | 14,400.00 | 2,880,000 |
| 新日本建設 | 100 | 726.00 | 72,600 |
| 東亜建設工業 | 100 | 2,408.00 | 240,800 |
| 日本国土開発 | 200 | 583.00 | 116,600 |
| 東洋建設 | 200 | 903.00 | 180,600 |
| 五洋建設 | 800 | 731.00 | 584,800 |
| 世紀東急工業 | 100 | 800.00 | 80,000 |
| 住友林業 | 400 | 2,280.00 | 912,000 |
| 大和ハウス工業 | 1,700 | 2,982.50 | 5,070,250 |
| ライト工業 | 100 | 2,001.00 | 200,100 |
| 積水ハウス | 2,000 | 2,444.00 | 4,888,000 |
| ユアテック | 200 | 718.00 | 143,600 |
| 中電工 | 100 | 2,102.00 | 210,200 |
| 関電工 | 200 | 831.00 | 166,200 |
| きんでん | 400 | 1,513.00 | 605,200 |
| 東京エネシス | 100 | 942.00 | 94,200 |
| 住友電設 | 100 | 2,638.00 | 263,800 |
| 日本電設工業 | 100 | 1,786.00 | 178,600 |
| エクシオグループ | 300 | 2,195.00 | 658,500 |
| 新日本空調 | 100 | 1,832.00 | 183,200 |
| 九電工 | 100 | 2,928.00 | 292,800 |
| 三機工業 | 100 | 1,608.00 | 160,800 |
| 日揮ホールディングス | 600 | 1,722.00 | 1,033,200 |
| 中外炉工業 | 100 | 1,592.00 | 159,200 |
| 高砂熱学工業 | 200 | 1,790.00 | 358,000 |
| NECネットエスアイ | 200 | 1,625.00 | 325,000 |
| 明星工業 | 100 | 693.00 | 69,300 |
| 大気社 | 100 | 3,440.00 | 344,000 |
| ダイダン | 100 | 2,134.00 | 213,400 |
| 日比谷総合設備 | 100 | 1,885.00 | 188,500 |
| ニッポン | 100 | 1,573.00 | 157,300 |
| 日清製粉グループ本社 | 600 | 1,575.00 | 945,000 |
| 鳥越製粉 | 100 | 620.00 | 62,000 |
| 中部飼料 | 100 | 1,024.00 | 102,400 |
| フィード・ワン | 100 | 677.00 | 67,700 |
| 日本甜菜製糖 | 100 | 1,639.00 | 163,900 |

| | | | |
|-------------------|-------|----------|-----------|
| DM三井製糖ホールディングス | 100 | 1,898.00 | 189,800 |
| MIXI | 100 | 2,285.00 | 228,500 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 100 | 2,443.00 | 244,300 |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 1,100 | 1,718.00 | 1,889,800 |
| UTグループ | 100 | 2,184.00 | 218,400 |
| E・Jホールディングス | 100 | 1,259.00 | 125,900 |
| 夢真ビーネックスグループ | 200 | 1,674.00 | 334,800 |
| コシダカホールディングス | 200 | 1,057.00 | 211,400 |
| パソナグループ | 100 | 1,981.00 | 198,100 |
| リンクアンドモチベーション | 200 | 865.00 | 173,000 |
| エス・エム・エス | 200 | 3,135.00 | 627,000 |
| パーソルホールディングス | 600 | 2,922.00 | 1,753,200 |
| 森永製菓 | 100 | 3,835.00 | 383,500 |
| 江崎グリコ | 200 | 3,390.00 | 678,000 |
| 名糖産業 | 100 | 1,639.00 | 163,900 |
| 井村屋グループ | 100 | 2,239.00 | 223,900 |
| 山崎製パン | 400 | 1,633.00 | 653,200 |
| 寿スピリッツ | 100 | 8,240.00 | 824,000 |
| カルビー | 300 | 3,040.00 | 912,000 |
| 森永乳業 | 100 | 4,205.00 | 420,500 |
| 六甲バター | 100 | 1,406.00 | 140,600 |
| ヤクルト本社 | 400 | 8,310.00 | 3,324,000 |
| 明治ホールディングス | 400 | 6,250.00 | 2,500,000 |
| 雪印メグミルク | 200 | 1,669.00 | 333,800 |
| プリマハム | 100 | 2,040.00 | 204,000 |
| 日本ハム | 200 | 3,625.00 | 725,000 |
| 丸大食品 | 100 | 1,416.00 | 141,600 |
| S Foods | 100 | 2,743.00 | 274,300 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 300 | 671.00 | 201,300 |
| システナ | 1,000 | 417.00 | 417,000 |
| 日鉄ソリューションズ | 100 | 3,590.00 | 359,000 |
| 総合警備保障 | 200 | 3,780.00 | 756,000 |
| いちご | 700 | 334.00 | 233,800 |
| 日本駐車場開発 | 700 | 265.00 | 185,500 |
| カカクコム | 500 | 2,536.00 | 1,268,000 |
| ルネサンス | 100 | 957.00 | 95,700 |
| ディップ | 100 | 3,935.00 | 393,500 |
| SBSホールディングス | 100 | 2,893.00 | 289,300 |
| 新日本科学 | 100 | 2,782.00 | 278,200 |
| ベネフィット・ワン | 200 | 2,135.00 | 427,000 |
| エムスリー | 1,100 | 4,213.00 | 4,634,300 |
| アウトソーシング | 400 | 1,110.00 | 444,000 |
| ディー・エヌ・エー | 200 | 1,879.00 | 375,800 |
| 博報堂DYホールディングス | 800 | 1,244.00 | 995,200 |
| エスプール | 200 | 911.00 | 182,200 |
| アドウェイズ | 100 | 744.00 | 74,400 |
| インフォマート | 600 | 445.00 | 267,000 |
| サッポロホールディングス | 200 | 3,310.00 | 662,000 |
| アサヒグループホールディングス | 1,300 | 4,277.00 | 5,560,100 |
| 麒麟ホールディングス | 2,500 | 2,201.00 | 5,502,500 |

| | | | | |
|------------------------------|-------|----------|-----------|--|
| 宝ホールディングス | 400 | 1,056.00 | 422,400 | |
| オエノンホールディングス | 400 | 288.00 | 115,200 | |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス | 400 | 1,369.00 | 547,600 | |
| サントリー食品インターナショナル | 400 | 5,040.00 | 2,016,000 | |
| 伊藤園 | 200 | 5,280.00 | 1,056,000 | |
| キーコーヒー | 100 | 2,118.00 | 211,800 | |
| 日清オイリオグループ | 100 | 3,200.00 | 320,000 | |
| 不二製油グループ本社 | 100 | 2,335.00 | 233,500 | |
| J・オイルミルズ | 100 | 1,553.00 | 155,300 | |
| ローソン | 100 | 4,715.00 | 471,500 | |
| カワチ薬品 | 100 | 2,115.00 | 211,500 | |
| エービーシー・マート | 100 | 6,690.00 | 669,000 | |
| アスクル | 100 | 1,527.00 | 152,700 | |
| ゲオホールディングス | 100 | 1,957.00 | 195,700 | |
| アダストリア | 100 | 1,982.00 | 198,200 | |
| くら寿司 | 100 | 3,280.00 | 328,000 | |
| エレマテック | 100 | 1,316.00 | 131,600 | |
| パルグループホールディングス | 100 | 2,162.00 | 216,200 | |
| エディオン | 300 | 1,197.00 | 359,100 | |
| あらた | 100 | 4,075.00 | 407,500 | |
| サーラコーポレーション | 100 | 802.00 | 80,200 | |
| J Pホールディングス | 200 | 313.00 | 62,600 | |
| フジオフードグループ本社 | 100 | 1,390.00 | 139,000 | |
| ひらまつ | 200 | 199.00 | 39,800 | |
| 円谷フィールズホールディングス | 100 | 1,823.00 | 182,300 | |
| 双日 | 700 | 2,198.00 | 1,538,600 | |
| アルフレッサ ホールディングス | 700 | 1,670.00 | 1,169,000 | |
| ハニーズホールディングス | 100 | 1,207.00 | 120,700 | |
| キッコーマン | 400 | 8,200.00 | 3,280,000 | |
| 味の素 | 1,300 | 4,091.00 | 5,318,300 | |
| キュービー | 300 | 2,403.00 | 720,900 | |
| ハウス食品グループ本社 | 200 | 2,792.00 | 558,400 | |
| カゴメ | 300 | 2,999.00 | 899,700 | |
| アリアケジャパン | 100 | 4,985.00 | 498,500 | |
| ニチレイ | 200 | 2,285.00 | 457,000 | |
| 横浜冷凍 | 200 | 908.00 | 181,600 | |
| 東洋水産 | 300 | 6,050.00 | 1,815,000 | |
| 日清食品ホールディングス | 200 | 9,650.00 | 1,930,000 | |
| フジッコ | 100 | 1,917.00 | 191,700 | |
| ロック・フィールド | 100 | 1,460.00 | 146,000 | |
| 日本たばこ産業 | 3,600 | 2,435.50 | 8,767,800 | |
| ケンコーマヨネーズ | 100 | 1,693.00 | 169,300 | |
| なとり | 100 | 2,055.00 | 205,500 | |
| ファーマフーズ | 100 | 1,251.00 | 125,100 | |
| 北の達人コーポレーション | 300 | 272.00 | 81,600 | |
| ユーグレナ | 400 | 861.00 | 344,400 | |
| 紀文食品 | 100 | 901.00 | 90,100 | |
| 片倉工業 | 100 | 2,061.00 | 206,100 | |
| ヒューリック | 1,200 | 1,074.00 | 1,288,800 | |

| | | | | |
|---------------------------|-------|----------|-----------|--|
| アルペン | 100 | 2,005.00 | 200,500 | |
| ラクーンホールディングス | 100 | 1,167.00 | 116,700 | |
| クオールホールディングス | 100 | 1,232.00 | 123,200 | |
| アルコニックス | 100 | 1,358.00 | 135,800 | |
| 神戸物産 | 500 | 3,195.00 | 1,597,500 | |
| ビックカメラ | 400 | 1,220.00 | 488,000 | |
| DCMホールディングス | 400 | 1,147.00 | 458,800 | |
| ペッパーフードサービス | 100 | 230.00 | 23,000 | |
| MonotaRO | 800 | 2,240.00 | 1,792,000 | |
| あいホールディングス | 100 | 2,160.00 | 216,000 | |
| J.フロントリテイリング | 800 | 1,249.00 | 999,200 | |
| ドトール・日レスホールディングス | 100 | 1,703.00 | 170,300 | |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 400 | 5,820.00 | 2,328,000 | |
| ZOZO | 500 | 3,020.00 | 1,510,000 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 1,000 | 1,387.00 | 1,387,000 | |
| 東洋紡 | 300 | 1,031.00 | 309,300 | |
| ユニチカ | 200 | 268.00 | 53,600 | |
| 日清紡ホールディングス | 500 | 1,036.00 | 518,000 | |
| 倉敷紡績 | 100 | 2,088.00 | 208,800 | |
| ダイワボウホールディングス | 300 | 1,842.00 | 552,600 | |
| シキボウ | 100 | 855.00 | 85,500 | |
| 日東紡績 | 100 | 2,221.00 | 222,100 | |
| トヨタ紡織 | 200 | 1,864.00 | 372,800 | |
| マクニカホールディングス | 200 | 2,720.00 | 544,000 | |
| ウエルシアホールディングス | 300 | 3,200.00 | 960,000 | |
| クリエイトSDホールディングス | 100 | 3,220.00 | 322,000 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 100 | 660.00 | 66,000 | |
| 八洲電機 | 100 | 1,012.00 | 101,200 | |
| レスターホールディングス | 100 | 1,984.00 | 198,400 | |
| TOKAIホールディングス | 300 | 894.00 | 268,200 | |
| 三洋貿易 | 100 | 1,049.00 | 104,900 | |
| シュッピン | 100 | 1,453.00 | 145,300 | |
| オイシックス・ラ・大地 | 100 | 1,668.00 | 166,800 | |
| ウイン・パートナーズ | 100 | 990.00 | 99,000 | |
| ネクステージ | 100 | 2,661.00 | 266,100 | |
| ジョイフル本田 | 200 | 1,787.00 | 357,400 | |
| ホットランド | 100 | 1,395.00 | 139,500 | |
| すかいらーくホールディングス | 800 | 1,585.00 | 1,268,000 | |
| 綿半ホールディングス | 100 | 1,399.00 | 139,900 | |
| 日本毛織 | 200 | 998.00 | 199,600 | |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 200 | 1,050.00 | 210,000 | |
| 野村不動産ホールディングス | 300 | 3,425.00 | 1,027,500 | |
| 三重交通グループホールディングス | 200 | 520.00 | 104,000 | |
| サムティ | 100 | 2,319.00 | 231,900 | |
| ディア・ライフ | 100 | 618.00 | 61,800 | |
| プレサンスコーポレーション | 100 | 1,498.00 | 149,800 | |
| フージャースホールディングス | 100 | 794.00 | 79,400 | |
| オープンハウスグループ | 200 | 5,130.00 | 1,026,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------|-----------|------------|
| 東急不動産ホールディングス | 1,800 | 783.00 | 1,409,400 |
| 飯田グループホールディングス | 500 | 2,102.00 | 1,051,000 |
| ムゲンエステート | 200 | 472.00 | 94,400 |
| 帝国繊維 | 100 | 1,596.00 | 159,600 |
| 日本コークス工業 | 700 | 86.00 | 60,200 |
| あさひ | 100 | 1,308.00 | 130,800 |
| 日本調剤 | 100 | 1,330.00 | 133,000 |
| コスモス薬品 | 100 | 14,760.00 | 1,476,000 |
| シップヘルスケアホールディングス | 200 | 2,883.00 | 576,600 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 2,200 | 5,693.00 | 12,524,600 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 400 | 904.00 | 361,600 |
| ツルハホールディングス | 100 | 8,780.00 | 878,000 |
| サンマルクホールディングス | 100 | 1,644.00 | 164,400 |
| トリドールホールディングス | 200 | 2,874.00 | 574,800 |
| 帝人 | 600 | 1,383.00 | 829,800 |
| 東レ | 4,000 | 722.50 | 2,890,000 |
| クラレ | 800 | 1,023.00 | 818,400 |
| 旭化成 | 4,000 | 949.90 | 3,799,600 |
| トーカロ | 200 | 1,143.00 | 228,600 |
| SUMCO | 1,100 | 1,834.00 | 2,017,400 |
| ビーロッド | 200 | 559.00 | 111,800 |
| JMホールディングス | 100 | 1,703.00 | 170,300 |
| コメダホールディングス | 100 | 2,448.00 | 244,800 |
| アレンザホールディングス | 100 | 997.00 | 99,700 |
| パロックジャパンリミテッド | 100 | 783.00 | 78,300 |
| クスリのアオキホールディングス | 100 | 7,130.00 | 713,000 |
| FOOD & LIFE COMPANIES | 300 | 2,439.00 | 731,700 |
| セーレン | 100 | 2,294.00 | 229,400 |
| 小松マテーレ | 100 | 766.00 | 76,600 |
| ワコールホールディングス | 100 | 2,360.00 | 236,000 |
| ホギメディカル | 100 | 3,325.00 | 332,500 |
| TSIホールディングス | 200 | 431.00 | 86,200 |
| ワールド | 100 | 1,414.00 | 141,400 |
| TIS | 600 | 3,945.00 | 2,367,000 |
| グリー | 300 | 834.00 | 250,200 |
| コーエーテクモホールディングス | 400 | 2,193.00 | 877,200 |
| ブレインパッド | 100 | 910.00 | 91,000 |
| KLab | 100 | 467.00 | 46,700 |
| ポルトゥウィンホールディングス | 100 | 923.00 | 92,300 |
| ネクソン | 1,400 | 2,533.00 | 3,546,200 |
| アイスタイル | 200 | 491.00 | 98,200 |
| エムアップホールディングス | 100 | 1,536.00 | 153,600 |
| コロブラ | 300 | 676.00 | 202,800 |
| オルトプラス | 100 | 281.00 | 28,100 |
| ブロードリーフ | 400 | 516.00 | 206,400 |
| システム情報 | 100 | 984.00 | 98,400 |
| じげん | 200 | 362.00 | 72,400 |
| ブイキューブ | 100 | 951.00 | 95,100 |

| | | | |
|----------------------|-------|-----------|------------|
| フィックスターズ | 100 | 1,054.00 | 105,400 |
| ティーガイア | 100 | 1,665.00 | 166,500 |
| テクマトリックス | 100 | 1,714.00 | 171,400 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 200 | 2,130.00 | 426,000 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 100 | 9,980.00 | 998,000 |
| インターネットイニシアティブ | 400 | 2,280.00 | 912,000 |
| アバントグループ | 100 | 1,512.00 | 151,200 |
| コムチュア | 100 | 2,390.00 | 239,000 |
| 王子ホールディングス | 2,500 | 534.00 | 1,335,000 |
| 日本製紙 | 300 | 897.00 | 269,100 |
| 北越コーポレーション | 400 | 794.00 | 317,600 |
| 大王製紙 | 300 | 1,160.00 | 348,000 |
| メディカル・データ・ビジョン | 100 | 1,092.00 | 109,200 |
| gumi | 100 | 995.00 | 99,500 |
| ラクス | 300 | 1,496.00 | 448,800 |
| カナミックネットワーク | 200 | 598.00 | 119,600 |
| レンゴー | 500 | 841.00 | 420,500 |
| チェンジ | 100 | 1,910.00 | 191,000 |
| マクロミル | 100 | 1,073.00 | 107,300 |
| マネーフォワード | 100 | 3,820.00 | 382,000 |
| 昭和電工 | 500 | 2,122.00 | 1,061,000 |
| 住友化学 | 4,400 | 505.00 | 2,222,000 |
| 日産化学 | 300 | 6,700.00 | 2,010,000 |
| テイカ | 100 | 1,324.00 | 132,400 |
| 石原産業 | 100 | 1,028.00 | 102,800 |
| 日本曹達 | 100 | 4,515.00 | 451,500 |
| 東ソー | 800 | 1,621.00 | 1,296,800 |
| トクヤマ | 200 | 1,753.00 | 350,600 |
| セントラル硝子 | 100 | 3,345.00 | 334,500 |
| 東亜合成 | 300 | 1,133.00 | 339,900 |
| 関東電化工業 | 100 | 931.00 | 93,100 |
| デンカ | 200 | 3,200.00 | 640,000 |
| イビデン | 300 | 4,070.00 | 1,221,000 |
| 信越化学工業 | 1,000 | 14,935.00 | 14,935,000 |
| 堺化学工業 | 100 | 1,948.00 | 194,800 |
| 第一稀元素化学工業 | 100 | 1,268.00 | 126,800 |
| エア・ウォーター | 500 | 1,648.00 | 824,000 |
| 日本酸素ホールディングス | 500 | 2,333.00 | 1,166,500 |
| 日本パーカライジング | 200 | 950.00 | 190,000 |
| 高圧ガス工業 | 100 | 627.00 | 62,700 |
| 四国化成工業 | 100 | 1,273.00 | 127,300 |
| 日本触媒 | 100 | 5,300.00 | 530,000 |
| 大日精化工業 | 100 | 1,745.00 | 174,500 |
| カネカ | 100 | 3,670.00 | 367,000 |
| 協和キリン | 700 | 3,360.00 | 2,352,000 |
| 三菱瓦斯化学 | 500 | 1,886.00 | 943,000 |
| 三井化学 | 500 | 2,777.00 | 1,388,500 |
| JSR | 600 | 2,717.00 | 1,630,200 |
| 東京応化工業 | 100 | 6,110.00 | 611,000 |

| | | | | |
|------------------|-------|----------|------------|--|
| 三菱ケミカルグループ | 4,000 | 668.30 | 2,673,200 | |
| KHネオケム | 100 | 2,721.00 | 272,100 | |
| ダイセル | 900 | 843.00 | 758,700 | |
| 住友ベークライト | 100 | 4,040.00 | 404,000 | |
| 積水化学工業 | 1,200 | 1,777.00 | 2,132,400 | |
| 日本ゼオン | 500 | 1,313.00 | 656,500 | |
| アイカ工業 | 200 | 3,185.00 | 637,000 | |
| UBE | 300 | 1,940.00 | 582,000 | |
| 積水樹脂 | 100 | 1,687.00 | 168,700 | |
| タキロンシーアイ | 100 | 520.00 | 52,000 | |
| リケンテクノス | 200 | 524.00 | 104,800 | |
| 積水化成成品工業 | 200 | 389.00 | 77,800 | |
| ダイキョーニシカワ | 200 | 589.00 | 117,800 | |
| 日本化薬 | 500 | 1,160.00 | 580,000 | |
| プレステージ・インターナショナル | 300 | 633.00 | 189,900 | |
| プロトコーポレーション | 100 | 1,114.00 | 111,400 | |
| 野村総合研究所 | 1,100 | 3,530.00 | 3,883,000 | |
| 電通グループ | 600 | 4,550.00 | 2,730,000 | |
| インテージホールディングス | 100 | 1,652.00 | 165,200 | |
| ソースネクスト | 300 | 325.00 | 97,500 | |
| シーティーエス | 100 | 774.00 | 77,400 | |
| インフォコム | 100 | 2,030.00 | 203,000 | |
| 扶桑化学工業 | 100 | 3,125.00 | 312,500 | |
| トリケミカル研究所 | 100 | 1,970.00 | 197,000 | |
| シンプレクス・ホールディングス | 100 | 2,019.00 | 201,900 | |
| ラクスル | 100 | 2,745.00 | 274,500 | |
| メルカリ | 300 | 2,141.00 | 642,300 | |
| ADEKA | 300 | 2,140.00 | 642,000 | |
| 日油 | 200 | 5,210.00 | 1,042,000 | |
| アルテリア・ネットワークス | 100 | 1,195.00 | 119,500 | |
| ウイングアーク1st | 100 | 2,165.00 | 216,500 | |
| Sansan | 200 | 1,223.00 | 244,600 | |
| ギフトィ | 100 | 2,345.00 | 234,500 | |
| 花王 | 1,400 | 5,706.00 | 7,988,400 | |
| JMDC | 100 | 4,845.00 | 484,500 | |
| 武田薬品工業 | 5,200 | 3,768.00 | 19,593,600 | |
| アステラス製薬 | 5,700 | 2,005.50 | 11,431,350 | |
| 住友ファーマ | 400 | 1,041.00 | 416,400 | |
| 塩野義製薬 | 800 | 6,848.00 | 5,478,400 | |
| 日本新薬 | 100 | 7,510.00 | 751,000 | |
| 中外製薬 | 1,700 | 3,604.00 | 6,126,800 | |
| 科研製薬 | 100 | 3,800.00 | 380,000 | |
| エーザイ | 700 | 8,262.00 | 5,783,400 | |
| 理研ビタミン | 100 | 1,853.00 | 185,300 | |
| ロート製薬 | 300 | 4,645.00 | 1,393,500 | |
| 小野薬品工業 | 1,300 | 3,445.00 | 4,478,500 | |
| 久光製薬 | 100 | 3,635.00 | 363,500 | |
| 持田製薬 | 100 | 3,450.00 | 345,000 | |
| 参天製薬 | 1,200 | 980.00 | 1,176,000 | |
| ツムラ | 200 | 3,080.00 | 616,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------|-----------|------------|
| 日医工 | 200 | 462.00 | 92,400 |
| テルモ | 1,900 | 4,389.00 | 8,339,100 |
| H.U.グループホールディングス | 200 | 2,746.00 | 549,200 |
| キッセイ薬品工業 | 100 | 2,598.00 | 259,800 |
| 生化学工業 | 100 | 889.00 | 88,900 |
| 栄研化学 | 100 | 1,806.00 | 180,600 |
| JCRファーマ | 200 | 1,998.00 | 399,600 |
| 東和薬品 | 100 | 2,175.00 | 217,500 |
| ゼリア新薬工業 | 100 | 2,134.00 | 213,400 |
| 第一三共 | 4,800 | 4,423.00 | 21,230,400 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 100 | 1,788.00 | 178,800 |
| 大幸薬品 | 100 | 554.00 | 55,400 |
| ダイト | 100 | 2,469.00 | 246,900 |
| 大塚ホールディングス | 1,300 | 4,654.00 | 6,050,200 |
| 大正製薬ホールディングス | 100 | 5,300.00 | 530,000 |
| ペプチドリーム | 300 | 1,607.00 | 482,100 |
| 大日本塗料 | 200 | 724.00 | 144,800 |
| 日本ペイントホールディングス | 2,500 | 969.00 | 2,422,500 |
| 関西ペイント | 600 | 2,113.00 | 1,267,800 |
| 中国塗料 | 100 | 914.00 | 91,400 |
| 藤倉化成 | 200 | 404.00 | 80,800 |
| 太陽ホールディングス | 100 | 2,491.00 | 249,100 |
| D I C | 200 | 2,436.00 | 487,200 |
| サカタインクス | 100 | 1,048.00 | 104,800 |
| 東洋インキS Cホールディングス | 100 | 1,913.00 | 191,300 |
| T & K T O K A | 100 | 937.00 | 93,700 |
| アルプス技研 | 100 | 1,982.00 | 198,200 |
| サニックス | 100 | 237.00 | 23,700 |
| 日本空調サービス | 100 | 745.00 | 74,500 |
| オリエンタルランド | 700 | 19,695.00 | 13,786,500 |
| ダスキン | 100 | 2,908.00 | 290,800 |
| パーク24 | 400 | 2,026.00 | 810,400 |
| 明光ネットワークジャパン | 100 | 610.00 | 61,000 |
| クレスコ | 100 | 1,722.00 | 172,200 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 600 | 1,060.00 | 636,000 |
| ラウンドワン | 600 | 653.00 | 391,800 |
| リゾートトラスト | 300 | 2,377.00 | 713,100 |
| オービック | 200 | 20,890.00 | 4,178,000 |
| ジャストシステム | 100 | 3,020.00 | 302,000 |
| T D C ソフト | 100 | 1,312.00 | 131,200 |
| Zホールディングス | 9,500 | 384.00 | 3,648,000 |
| ビー・エム・エル | 100 | 3,400.00 | 340,000 |
| トレンドマイクロ | 300 | 7,570.00 | 2,271,000 |
| りらいあコミュニケーションズ | 100 | 977.00 | 97,700 |
| リソー教育 | 300 | 298.00 | 89,400 |
| 日本オラクル | 100 | 8,110.00 | 811,000 |
| フューチャー | 100 | 1,643.00 | 164,300 |
| C A C H o l d i n g s | 100 | 1,537.00 | 153,700 |
| ユー・エス・エス | 700 | 2,215.00 | 1,550,500 |
| オービックビジネスコンサルタント | 100 | 4,465.00 | 446,500 |

| | | | | |
|--------------------|--------|-----------|-----------|--|
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 300 | 3,580.00 | 1,074,000 | |
| アイティフォー | 100 | 777.00 | 77,700 | |
| サイバーエージェント | 1,400 | 1,242.00 | 1,738,800 | |
| 楽天グループ | 2,600 | 641.00 | 1,666,600 | |
| モーニングスター | 100 | 454.00 | 45,400 | |
| テー・オー・ダブリュー | 300 | 308.00 | 92,400 | |
| 大塚商会 | 300 | 4,685.00 | 1,405,500 | |
| サイボウズ | 100 | 1,675.00 | 167,500 | |
| 山田コンサルティンググループ | 100 | 1,196.00 | 119,600 | |
| パラカ | 100 | 1,891.00 | 189,100 | |
| 電通国際情報サービス | 100 | 4,590.00 | 459,000 | |
| A C C E S S | 100 | 776.00 | 77,600 | |
| デジタルガレージ | 100 | 3,395.00 | 339,500 | |
| イーエムシステムズ | 100 | 869.00 | 86,900 | |
| WOWOW | 100 | 1,290.00 | 129,000 | |
| スカラ | 200 | 719.00 | 143,800 | |
| フルキャストホールディングス | 100 | 2,849.00 | 284,900 | |
| エン・ジャパン | 100 | 2,484.00 | 248,400 | |
| あすか製薬ホールディングス | 100 | 1,146.00 | 114,600 | |
| サワイグループホールディングス | 100 | 4,230.00 | 423,000 | |
| 富士フイルムホールディングス | 1,200 | 6,812.00 | 8,174,400 | |
| コニカミノルタ | 1,400 | 446.00 | 624,400 | |
| 資生堂 | 1,200 | 5,196.00 | 6,235,200 | |
| ライオン | 700 | 1,584.00 | 1,108,800 | |
| マンダム | 100 | 1,502.00 | 150,200 | |
| ミルボン | 100 | 6,040.00 | 604,000 | |
| ファンケル | 300 | 2,872.00 | 861,600 | |
| コーセー | 100 | 15,510.00 | 1,551,000 | |
| コタ | 100 | 1,573.00 | 157,300 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 300 | 1,657.00 | 497,100 | |
| ノエビアホールディングス | 100 | 5,550.00 | 555,000 | |
| エステー | 100 | 1,537.00 | 153,700 | |
| コニシ | 100 | 1,691.00 | 169,100 | |
| 長谷川香料 | 100 | 3,135.00 | 313,500 | |
| 小林製薬 | 200 | 7,950.00 | 1,590,000 | |
| 荒川化学工業 | 100 | 1,014.00 | 101,400 | |
| メック | 100 | 2,307.00 | 230,700 | |
| タカラバイオ | 200 | 1,673.00 | 334,600 | |
| J C U | 100 | 2,806.00 | 280,600 | |
| デクセリアルズ | 200 | 3,240.00 | 648,000 | |
| 北興化学工業 | 100 | 927.00 | 92,700 | |
| クミアイ化学工業 | 200 | 972.00 | 194,400 | |
| 日本農薬 | 100 | 878.00 | 87,800 | |
| ニチレキ | 100 | 1,324.00 | 132,400 | |
| ユシロ化学工業 | 100 | 835.00 | 83,500 | |
| 出光興産 | 700 | 3,280.00 | 2,296,000 | |
| E N E O S ホールディングス | 10,100 | 481.50 | 4,863,150 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 300 | 3,820.00 | 1,146,000 | |
| テスホールディングス | 100 | 956.00 | 95,600 | |
| インフロニア・ホールディングス | 700 | 1,020.00 | 714,000 | |

| | | | |
|----------------|-------|----------|-----------|
| 横浜ゴム | 300 | 2,296.00 | 688,800 |
| TOYO TIRE | 300 | 1,656.00 | 496,800 |
| ブリヂストン | 1,800 | 5,083.00 | 9,149,400 |
| 住友ゴム工業 | 500 | 1,242.00 | 621,000 |
| 藤倉コンポジット | 100 | 842.00 | 84,200 |
| アキレス | 100 | 1,380.00 | 138,000 |
| ニッタ | 100 | 2,854.00 | 285,400 |
| 住友理工 | 200 | 576.00 | 115,200 |
| 三ツ星ベルト | 100 | 3,080.00 | 308,000 |
| バンドー化学 | 100 | 1,042.00 | 104,200 |
| AGC | 600 | 4,540.00 | 2,724,000 |
| 日本板硝子 | 300 | 542.00 | 162,600 |
| 有沢製作所 | 100 | 1,277.00 | 127,700 |
| 日本電気硝子 | 200 | 2,529.00 | 505,800 |
| 住友大阪セメント | 100 | 3,195.00 | 319,500 |
| 太平洋セメント | 400 | 2,014.00 | 805,600 |
| アジアパイルホールディングス | 200 | 503.00 | 100,600 |
| 東海カーボン | 500 | 940.00 | 470,000 |
| TOTO | 400 | 4,635.00 | 1,854,000 |
| 日本碍子 | 600 | 1,848.00 | 1,108,800 |
| 日本特殊陶業 | 500 | 2,692.00 | 1,346,000 |
| ヨータイ | 100 | 1,397.00 | 139,700 |
| ニチアス | 100 | 2,256.00 | 225,600 |
| 日本製鉄 | 2,800 | 2,117.50 | 5,929,000 |
| 神戸製鋼所 | 1,200 | 608.00 | 729,600 |
| 中山製鋼所 | 100 | 641.00 | 64,100 |
| JFEホールディングス | 1,500 | 1,407.00 | 2,110,500 |
| 東京製鉄 | 200 | 1,317.00 | 263,400 |
| 共英製鋼 | 100 | 1,444.00 | 144,400 |
| 大和工業 | 100 | 4,455.00 | 445,500 |
| 淀川製鋼所 | 100 | 2,415.00 | 241,500 |
| 丸一鋼管 | 200 | 2,914.00 | 582,800 |
| 大同特殊鋼 | 100 | 3,590.00 | 359,000 |
| 山陽特殊製鋼 | 100 | 1,902.00 | 190,200 |
| 日立金属 | 700 | 2,179.00 | 1,525,300 |
| 新日本電工 | 400 | 336.00 | 134,400 |
| 日本製鋼所 | 200 | 3,100.00 | 620,000 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 100 | 1,272.00 | 127,200 |
| 日本軽金属ホールディングス | 200 | 1,458.00 | 291,600 |
| 三井金属鉱業 | 200 | 3,005.00 | 601,000 |
| 三菱マテリアル | 400 | 1,972.00 | 788,800 |
| 住友金属鉱山 | 700 | 4,149.00 | 2,904,300 |
| DOWAホールディングス | 200 | 4,930.00 | 986,000 |
| 古河機械金属 | 100 | 1,265.00 | 126,500 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 100 | 3,255.00 | 325,500 |
| 東邦チタニウム | 100 | 2,148.00 | 214,800 |
| UACJ | 100 | 2,042.00 | 204,200 |
| 古河電気工業 | 200 | 2,301.00 | 460,200 |
| 住友電気工業 | 2,300 | 1,529.00 | 3,516,700 |
| フジクラ | 700 | 876.00 | 613,200 |

| | | | |
|------------------|-------|-----------|------------|
| 昭和電線ホールディングス | 100 | 1,805.00 | 180,500 |
| タツタ電線 | 100 | 447.00 | 44,700 |
| 平河ヒューテック | 100 | 1,059.00 | 105,900 |
| いよぎんホールディングス | 800 | 721.00 | 576,800 |
| しずおかフィナンシャルグループ | 1,300 | 931.00 | 1,210,300 |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 500 | 894.00 | 447,000 |
| リョービ | 100 | 1,287.00 | 128,700 |
| アサヒホールディングス | 300 | 1,932.00 | 579,600 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 300 | 1,776.00 | 532,800 |
| 横河ブリッジホールディングス | 100 | 1,958.00 | 195,800 |
| 三和ホールディングス | 600 | 1,250.00 | 750,000 |
| 文化シャッター | 200 | 1,070.00 | 214,000 |
| 三協立山 | 100 | 548.00 | 54,800 |
| アルインコ | 100 | 1,029.00 | 102,900 |
| L I X I L | 1,000 | 2,166.00 | 2,166,000 |
| ノーリツ | 100 | 1,528.00 | 152,800 |
| 長府製作所 | 100 | 2,047.00 | 204,700 |
| リンナイ | 100 | 10,040.00 | 1,004,000 |
| ユニプレス | 100 | 873.00 | 87,300 |
| 日東精工 | 200 | 535.00 | 107,000 |
| 岡部 | 100 | 656.00 | 65,600 |
| ジーテクト | 100 | 1,298.00 | 129,800 |
| 東プレ | 100 | 1,178.00 | 117,800 |
| 高周波熱錬 | 200 | 677.00 | 135,400 |
| パイオラックス | 100 | 1,858.00 | 185,800 |
| エイチワン | 200 | 596.00 | 119,200 |
| 日本発条 | 600 | 825.00 | 495,000 |
| 三浦工業 | 300 | 3,010.00 | 903,000 |
| タクマ | 200 | 1,238.00 | 247,600 |
| テクノプロ・ホールディングス | 400 | 3,345.00 | 1,338,000 |
| ジャパンマテリアル | 200 | 1,835.00 | 367,000 |
| ベクトル | 100 | 1,075.00 | 107,500 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 100 | 1,044.00 | 104,400 |
| アサンテ | 100 | 1,609.00 | 160,900 |
| パリュールHR | 100 | 1,519.00 | 151,900 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 100 | 3,685.00 | 368,500 |
| シグマックス・ホールディングス | 100 | 1,170.00 | 117,000 |
| ウィルグループ | 100 | 1,402.00 | 140,200 |
| リクルートホールディングス | 4,600 | 4,397.00 | 20,226,200 |
| エラン | 100 | 1,080.00 | 108,000 |
| ツガミ | 200 | 1,164.00 | 232,800 |
| オークマ | 100 | 5,080.00 | 508,000 |
| 芝浦機械 | 100 | 2,905.00 | 290,500 |
| アマダ | 1,000 | 1,036.00 | 1,036,000 |
| アイダエンジニアリング | 200 | 849.00 | 169,800 |
| F U J I | 300 | 1,943.00 | 582,900 |
| 牧野フライス製作所 | 100 | 4,560.00 | 456,000 |
| オーエスジー | 300 | 1,832.00 | 549,600 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 200 | 725.00 | 145,000 |
| D M G 森精機 | 300 | 1,690.00 | 507,000 |

| | | | |
|------------------|-------|-----------|------------|
| ソディック | 200 | 773.00 | 154,600 |
| ディスコ | 100 | 31,000.00 | 3,100,000 |
| 日東工器 | 100 | 1,557.00 | 155,700 |
| 日進工具 | 100 | 1,169.00 | 116,900 |
| 日本郵政 | 6,900 | 990.30 | 6,833,070 |
| ベルシステム24ホールディングス | 100 | 1,409.00 | 140,900 |
| 鎌倉新書 | 100 | 817.00 | 81,700 |
| ソラスト | 200 | 889.00 | 177,800 |
| インソース | 100 | 2,865.00 | 286,500 |
| 豊田自動織機 | 500 | 7,320.00 | 3,660,000 |
| 島精機製作所 | 100 | 2,124.00 | 212,400 |
| オプトラン | 100 | 2,095.00 | 209,500 |
| フリーー | 100 | 1,155.00 | 115,500 |
| 日阪製作所 | 100 | 836.00 | 83,600 |
| やまびこ | 100 | 1,105.00 | 110,500 |
| ペガサスミシン製造 | 100 | 867.00 | 86,700 |
| ナプテスコ | 400 | 3,035.00 | 1,214,000 |
| 三井海洋開発 | 100 | 1,500.00 | 150,000 |
| レオン自動機 | 100 | 1,136.00 | 113,600 |
| S M C | 200 | 58,220.00 | 11,644,000 |
| ホソカワミクロン | 100 | 2,612.00 | 261,200 |
| オイレス工業 | 100 | 1,488.00 | 148,800 |
| サトーホールディングス | 100 | 1,850.00 | 185,000 |
| 技研製作所 | 100 | 3,045.00 | 304,500 |
| 小松製作所 | 3,000 | 2,663.50 | 7,990,500 |
| 住友重機械工業 | 400 | 2,779.00 | 1,111,600 |
| 日立建機 | 300 | 2,651.00 | 795,300 |
| 日工 | 100 | 615.00 | 61,500 |
| 井関農機 | 100 | 1,214.00 | 121,400 |
| T O W A | 100 | 1,657.00 | 165,700 |
| 北川鉄工所 | 100 | 1,269.00 | 126,900 |
| クボタ | 3,000 | 2,000.00 | 6,000,000 |
| 東洋エンジニアリング | 100 | 577.00 | 57,700 |
| 月島機械 | 100 | 925.00 | 92,500 |
| 新東工業 | 200 | 689.00 | 137,800 |
| 澁谷工業 | 100 | 2,516.00 | 251,600 |
| アイチコーポレーション | 100 | 792.00 | 79,200 |
| 小森コーポレーション | 200 | 731.00 | 146,200 |
| 荏原製作所 | 200 | 4,760.00 | 952,000 |
| 西島製作所 | 100 | 1,316.00 | 131,600 |
| 北越工業 | 100 | 1,050.00 | 105,000 |
| ダイキン工業 | 700 | 22,245.00 | 15,571,500 |
| 栗田工業 | 300 | 5,180.00 | 1,554,000 |
| 椿本チエイン | 100 | 3,110.00 | 311,000 |
| 日機装 | 100 | 981.00 | 98,100 |
| レイズネクスト | 100 | 1,223.00 | 122,300 |
| アネスト岩田 | 100 | 912.00 | 91,200 |
| ダイフク | 300 | 6,810.00 | 2,043,000 |
| タダノ | 400 | 907.00 | 362,800 |
| フジテック | 200 | 2,990.00 | 598,000 |

| | | | |
|------------------------|-------|----------|------------|
| CKD | 200 | 1,745.00 | 349,000 |
| キトー | 100 | 2,721.00 | 272,100 |
| 平和 | 200 | 2,404.00 | 480,800 |
| 理想科学工業 | 100 | 2,378.00 | 237,800 |
| SANKYO | 100 | 4,920.00 | 492,000 |
| 日本金銭機械 | 100 | 712.00 | 71,200 |
| マースグループホールディングス | 100 | 1,761.00 | 176,100 |
| 竹内製作所 | 100 | 2,856.00 | 285,600 |
| アマノ | 200 | 2,536.00 | 507,200 |
| JUKI | 100 | 715.00 | 71,500 |
| サンデン | 100 | 206.00 | 20,600 |
| ブラザー工業 | 800 | 2,588.00 | 2,070,400 |
| マックス | 100 | 2,069.00 | 206,900 |
| モリタホールディングス | 100 | 1,280.00 | 128,000 |
| グローリー | 200 | 2,266.00 | 453,200 |
| 新晃工業 | 100 | 1,580.00 | 158,000 |
| 大和冷機工業 | 100 | 1,193.00 | 119,300 |
| セガサミーホールディングス | 600 | 1,891.00 | 1,134,600 |
| TPR | 100 | 1,231.00 | 123,100 |
| ツバキ・ナカシマ | 100 | 1,211.00 | 121,100 |
| ホシザキ | 400 | 4,210.00 | 1,684,000 |
| 大豊工業 | 100 | 706.00 | 70,600 |
| 日本精工 | 1,100 | 741.00 | 815,100 |
| NTN | 1,200 | 261.00 | 313,200 |
| ジェイテクト | 600 | 970.00 | 582,000 |
| ミネベアミツミ | 1,100 | 2,087.00 | 2,295,700 |
| 日本トムソン | 200 | 517.00 | 103,400 |
| THK | 300 | 2,524.00 | 757,200 |
| ユーシン精機 | 100 | 693.00 | 69,300 |
| イーグル工業 | 100 | 1,079.00 | 107,900 |
| 日本ピラー工業 | 100 | 2,377.00 | 237,700 |
| キッツ | 200 | 850.00 | 170,000 |
| 日立製作所 | 3,200 | 6,412.00 | 20,518,400 |
| 東芝 | 1,200 | 5,403.00 | 6,483,600 |
| 三菱電機 | 6,200 | 1,389.00 | 8,611,800 |
| 富士電機 | 400 | 5,240.00 | 2,096,000 |
| 安川電機 | 700 | 4,065.00 | 2,845,500 |
| シンフォニアテクノロジー | 100 | 1,365.00 | 136,500 |
| 明電舎 | 100 | 1,930.00 | 193,000 |
| デンヨー | 100 | 1,424.00 | 142,400 |
| PHCホールディングス | 100 | 1,448.00 | 144,800 |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 200 | 1,741.00 | 348,200 |
| キュービーネットホールディングス | 100 | 1,276.00 | 127,600 |
| 三櫻工業 | 100 | 668.00 | 66,800 |
| マキタ | 800 | 2,799.00 | 2,239,200 |
| 東芝テック | 100 | 3,950.00 | 395,000 |
| マブチモーター | 100 | 3,915.00 | 391,500 |
| 日本電産 | 1,500 | 7,737.00 | 11,605,500 |
| 東光高岳 | 100 | 1,813.00 | 181,300 |

| | | | | |
|-------------------|-------|-----------|------------|--|
| ダイヘン | 100 | 3,645.00 | 364,500 | |
| ヤーマン | 100 | 1,113.00 | 111,300 | |
| JVCケンウッド | 600 | 214.00 | 128,400 | |
| 日新電機 | 200 | 1,340.00 | 268,000 | |
| 大崎電気工業 | 100 | 525.00 | 52,500 | |
| オムロン | 600 | 6,834.00 | 4,100,400 | |
| 日東工業 | 100 | 2,518.00 | 251,800 | |
| I D E C | 100 | 3,080.00 | 308,000 | |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 200 | 2,207.00 | 441,400 | |
| 日本電気 | 800 | 4,840.00 | 3,872,000 | |
| 富士通 | 600 | 16,195.00 | 9,717,000 | |
| 沖電気工業 | 300 | 732.00 | 219,600 | |
| サンケン電気 | 100 | 4,485.00 | 448,500 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 3,600 | 1,203.00 | 4,330,800 | |
| セイコーエプソン | 700 | 2,031.00 | 1,421,700 | |
| ワコム | 500 | 628.00 | 314,000 | |
| アルバック | 100 | 5,480.00 | 548,000 | |
| E I Z O | 100 | 3,730.00 | 373,000 | |
| ジャパディディスプレイ | 2,300 | 49.00 | 112,700 | |
| 日本信号 | 100 | 1,010.00 | 101,000 | |
| 京三製作所 | 200 | 399.00 | 79,800 | |
| 能美防災 | 100 | 1,616.00 | 161,600 | |
| ホーチキ | 100 | 1,454.00 | 145,400 | |
| エレコム | 200 | 1,340.00 | 268,000 | |
| パナソニック ホールディングス | 7,100 | 1,043.50 | 7,408,850 | |
| シャープ | 600 | 864.00 | 518,400 | |
| アンリツ | 400 | 1,615.00 | 646,000 | |
| 富士通ゼネラル | 200 | 3,050.00 | 610,000 | |
| ソニーグループ | 4,200 | 9,725.00 | 40,845,000 | |
| T D K | 1,000 | 4,575.00 | 4,575,000 | |
| タムラ製作所 | 300 | 714.00 | 214,200 | |
| アルプスアルパイン | 500 | 1,094.00 | 547,000 | |
| 日本電波工業 | 100 | 1,469.00 | 146,900 | |
| メイコー | 100 | 2,509.00 | 250,900 | |
| フォスター電機 | 100 | 756.00 | 75,600 | |
| ヨコオ | 100 | 1,954.00 | 195,400 | |
| ホシデン | 100 | 1,510.00 | 151,000 | |
| ヒロセ電機 | 100 | 19,840.00 | 1,984,000 | |
| 日本航空電子工業 | 100 | 2,034.00 | 203,400 | |
| T O A | 100 | 788.00 | 78,800 | |
| マクセル | 100 | 1,347.00 | 134,700 | |
| 古野電気 | 100 | 1,053.00 | 105,300 | |
| スミダコーポレーション | 100 | 932.00 | 93,200 | |
| 横河電機 | 600 | 2,368.00 | 1,420,800 | |
| アズビル | 400 | 3,970.00 | 1,588,000 | |
| 日本光電工業 | 300 | 3,405.00 | 1,021,500 | |
| 堀場製作所 | 100 | 5,780.00 | 578,000 | |
| アドバンテスト | 500 | 7,000.00 | 3,500,000 | |
| エスベック | 100 | 1,760.00 | 176,000 | |
| キーエンス | 600 | 48,050.00 | 28,830,000 | |

| | | | |
|--------------------|-------|-----------|------------|
| シスメックス | 500 | 7,881.00 | 3,940,500 |
| 日本マイクロニクス | 100 | 1,282.00 | 128,200 |
| メガチップス | 100 | 2,450.00 | 245,000 |
| デンソー | 1,300 | 7,119.00 | 9,254,700 |
| コーセル | 100 | 818.00 | 81,800 |
| イリソ電子工業 | 100 | 3,955.00 | 395,500 |
| オブテックスグループ | 100 | 1,987.00 | 198,700 |
| レーザーテック | 300 | 18,580.00 | 5,574,000 |
| スタンレー電気 | 400 | 2,434.00 | 973,600 |
| ウシオ電機 | 300 | 1,516.00 | 454,800 |
| 日本セラミック | 100 | 2,563.00 | 256,300 |
| 古河電池 | 100 | 1,084.00 | 108,400 |
| 山一電機 | 100 | 1,973.00 | 197,300 |
| 日本電子 | 100 | 5,260.00 | 526,000 |
| カシオ計算機 | 400 | 1,315.00 | 526,000 |
| ファナック | 600 | 20,335.00 | 12,201,000 |
| 日本シイエムケイ | 100 | 483.00 | 48,300 |
| 大真空 | 100 | 878.00 | 87,800 |
| ローム | 300 | 9,960.00 | 2,988,000 |
| 浜松ホトニクス | 400 | 6,490.00 | 2,596,000 |
| 三井ハイテック | 100 | 7,390.00 | 739,000 |
| 新光電気工業 | 200 | 3,240.00 | 648,000 |
| 京セラ | 900 | 7,325.00 | 6,592,500 |
| 太陽誘電 | 300 | 3,790.00 | 1,137,000 |
| 村田製作所 | 1,800 | 6,971.00 | 12,547,800 |
| 双葉電子工業 | 200 | 606.00 | 121,200 |
| 日東電工 | 400 | 7,970.00 | 3,188,000 |
| 東海理化電機製作所 | 200 | 1,465.00 | 293,000 |
| ニチコン | 200 | 1,311.00 | 262,200 |
| 日本ケミコン | 100 | 1,792.00 | 179,200 |
| K O A | 100 | 2,223.00 | 222,300 |
| 三井E & Sホールディングス | 300 | 406.00 | 121,800 |
| 日立造船 | 500 | 829.00 | 414,500 |
| 三菱重工業 | 1,000 | 4,892.00 | 4,892,000 |
| 川崎重工業 | 500 | 2,409.00 | 1,204,500 |
| I H I | 400 | 3,190.00 | 1,276,000 |
| 名村造船所 | 200 | 544.00 | 108,800 |
| カーブスホールディングス | 200 | 864.00 | 172,800 |
| 三菱ロジスネクスト | 100 | 733.00 | 73,300 |
| フルサト・マルカホールディングス | 100 | 3,555.00 | 355,500 |
| F P G | 200 | 1,173.00 | 234,600 |
| 全国保証 | 200 | 4,830.00 | 966,000 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 2,700 | 293.00 | 791,100 |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 100 | 1,319.00 | 131,900 |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 100 | 2,226.00 | 222,600 |
| 九州フィナンシャルグループ | 1,300 | 386.00 | 501,800 |
| かんぽ生命保険 | 700 | 2,145.00 | 1,501,500 |
| ゆうちょ銀行 | 1,500 | 994.00 | 1,491,000 |
| 富山第一銀行 | 200 | 424.00 | 84,800 |

| | | | | |
|---------------------|--------|-----------|------------|--|
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 3,200 | 466.00 | 1,491,200 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 400 | 771.00 | 308,400 | |
| 日本モーゲージサービス | 100 | 843.00 | 84,300 | |
| アルヒ | 100 | 1,395.00 | 139,500 | |
| プレミアグループ | 100 | 1,568.00 | 156,800 | |
| 日産自動車 | 7,900 | 461.20 | 3,643,480 | |
| いすゞ自動車 | 1,900 | 1,668.00 | 3,169,200 | |
| トヨタ自動車 | 30,400 | 2,004.00 | 60,921,600 | |
| 日野自動車 | 800 | 595.00 | 476,000 | |
| 三菱自動車工業 | 2,500 | 504.00 | 1,260,000 | |
| 武蔵精密工業 | 200 | 1,635.00 | 327,000 | |
| 日産車体 | 100 | 804.00 | 80,400 | |
| 新明和工業 | 200 | 1,026.00 | 205,200 | |
| 極東開発工業 | 100 | 1,382.00 | 138,200 | |
| トビー工業 | 100 | 1,625.00 | 162,500 | |
| 曙ブレーキ工業 | 400 | 177.00 | 70,800 | |
| タチエス | 100 | 1,098.00 | 109,800 | |
| NOK | 300 | 1,128.00 | 338,400 | |
| フタバ産業 | 200 | 327.00 | 65,400 | |
| KYB | 100 | 3,145.00 | 314,500 | |
| 大同メタル工業 | 200 | 495.00 | 99,000 | |
| プレス工業 | 400 | 411.00 | 164,400 | |
| 太平洋工業 | 100 | 1,041.00 | 104,100 | |
| アイシン | 500 | 3,855.00 | 1,927,500 | |
| マツダ | 2,000 | 964.00 | 1,928,000 | |
| 本田技研工業 | 4,900 | 3,263.00 | 15,988,700 | |
| スズキ | 1,300 | 4,677.00 | 6,080,100 | |
| S U B A R U | 1,700 | 2,310.00 | 3,927,000 | |
| ヤマハ発動機 | 900 | 2,981.00 | 2,682,900 | |
| 小糸製作所 | 600 | 2,073.00 | 1,243,800 | |
| エクセディ | 100 | 1,715.00 | 171,500 | |
| 豊田合成 | 200 | 2,278.00 | 455,600 | |
| 愛三工業 | 100 | 688.00 | 68,800 | |
| ヨロズ | 100 | 862.00 | 86,200 | |
| エフ・シー・シー | 100 | 1,412.00 | 141,200 | |
| シマノ | 200 | 21,555.00 | 4,311,000 | |
| テイ・エス テック | 300 | 1,526.00 | 457,800 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 100 | 1,475.00 | 147,500 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 100 | 2,671.00 | 267,100 | |
| ひろぎんホールディングス | 900 | 622.00 | 559,800 | |
| おきなわフィナンシャルグループ | 100 | 2,057.00 | 205,700 | |
| ダイレクトマーケティングミックス | 100 | 1,670.00 | 167,000 | |
| L I T A L I C O | 100 | 2,790.00 | 279,000 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 100 | 2,479.00 | 247,900 | |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 100 | 4,865.00 | 486,500 | |
| ネットプロテクションズホールディングス | 200 | 423.00 | 84,600 | |
| プロクレアホールディングス | 100 | 2,213.00 | 221,300 | |

| | | | |
|-----------------------------|-------|-----------|------------|
| 小野建 | 100 | 1,445.00 | 144,500 |
| ノジマ | 200 | 1,243.00 | 248,600 |
| カップ・クリエイト | 100 | 1,394.00 | 139,400 |
| コンドーテック | 100 | 1,009.00 | 100,900 |
| ナガイレーベン | 100 | 2,011.00 | 201,100 |
| 三菱食品 | 100 | 3,100.00 | 310,000 |
| 良品計画 | 800 | 1,360.00 | 1,088,000 |
| 第一興商 | 100 | 4,240.00 | 424,000 |
| メディカルホールディングス | 600 | 1,839.00 | 1,103,400 |
| アドヴァングループ | 100 | 867.00 | 86,700 |
| アルビス | 100 | 2,369.00 | 236,900 |
| アズワン | 100 | 6,080.00 | 608,000 |
| シモジマ | 100 | 1,034.00 | 103,400 |
| ドウシシャ | 100 | 1,474.00 | 147,400 |
| G-7ホールディングス | 100 | 1,541.00 | 154,100 |
| イオン北海道 | 100 | 1,193.00 | 119,300 |
| コジマ | 100 | 632.00 | 63,200 |
| コーナン商事 | 100 | 3,000.00 | 300,000 |
| ネットワンシステムズ | 200 | 3,020.00 | 604,000 |
| ワタミ | 100 | 915.00 | 91,500 |
| 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 | 2,595.00 | 3,373,500 |
| 西松屋チェーン | 100 | 1,375.00 | 137,500 |
| ゼンショーホールディングス | 300 | 3,735.00 | 1,120,500 |
| ハビネット | 100 | 2,029.00 | 202,900 |
| 幸楽苑ホールディングス | 100 | 1,057.00 | 105,700 |
| 日本ライフライン | 200 | 998.00 | 199,600 |
| サイゼリヤ | 100 | 2,706.00 | 270,600 |
| VTホールディングス | 300 | 480.00 | 144,000 |
| アルゴグラフィックス | 100 | 3,920.00 | 392,000 |
| IDOM | 200 | 744.00 | 148,800 |
| 日本エム・ディ・エム | 100 | 1,254.00 | 125,400 |
| ユナイテッドアローズ | 100 | 2,001.00 | 200,100 |
| ハイデイ日高 | 100 | 1,914.00 | 191,400 |
| シークス | 100 | 1,108.00 | 110,800 |
| コロワイド | 300 | 1,821.00 | 546,300 |
| オーハシテクニカ | 100 | 1,406.00 | 140,600 |
| スギホールディングス | 100 | 6,170.00 | 617,000 |
| 島津製作所 | 800 | 3,780.00 | 3,024,000 |
| 長野計器 | 100 | 1,079.00 | 107,900 |
| スター精密 | 100 | 1,686.00 | 168,600 |
| 東京計器 | 100 | 1,274.00 | 127,400 |
| 東京精密 | 100 | 4,240.00 | 424,000 |
| マニー | 300 | 2,163.00 | 648,900 |
| ニコン | 900 | 1,355.00 | 1,219,500 |
| トプコン | 300 | 1,561.00 | 468,300 |
| オリンパス | 3,200 | 3,024.00 | 9,676,800 |
| SCREENホールディングス | 100 | 7,750.00 | 775,000 |
| キヤノン電子 | 100 | 1,634.00 | 163,400 |
| HOYA | 1,300 | 14,395.00 | 18,713,500 |

| | | | |
|-------------------|-------|----------|------------|
| ノーリツ鋼機 | 100 | 2,580.00 | 258,000 |
| A & Dホロンホールディングス | 100 | 891.00 | 89,100 |
| 朝日インテック | 700 | 2,503.00 | 1,752,100 |
| キヤノン | 3,000 | 3,295.00 | 9,885,000 |
| リコー | 1,600 | 1,104.00 | 1,766,400 |
| シチズン時計 | 600 | 636.00 | 381,600 |
| メニコン | 200 | 2,933.00 | 586,600 |
| スノーピーク | 100 | 1,850.00 | 185,000 |
| パラマウントベッドホールディングス | 100 | 2,667.00 | 266,700 |
| 前田工織 | 100 | 3,025.00 | 302,500 |
| バンダイナムコホールディングス | 500 | 9,746.00 | 4,873,000 |
| S H O E I | 100 | 5,350.00 | 535,000 |
| マーベラス | 200 | 688.00 | 137,600 |
| パイロットコーポレーション | 100 | 5,820.00 | 582,000 |
| エイベックス | 100 | 1,693.00 | 169,300 |
| フジシールインターナショナル | 100 | 1,660.00 | 166,000 |
| タカラトミー | 200 | 1,262.00 | 252,400 |
| レック | 100 | 836.00 | 83,600 |
| 凸版印刷 | 900 | 2,180.00 | 1,962,000 |
| 大日本印刷 | 700 | 2,903.00 | 2,032,100 |
| N I S S H A | 100 | 1,688.00 | 168,800 |
| 藤森工業 | 100 | 3,100.00 | 310,000 |
| 前澤化成工業 | 100 | 1,340.00 | 134,000 |
| アシックス | 500 | 2,323.00 | 1,161,500 |
| J S P | 100 | 1,455.00 | 145,500 |
| ニチハ | 100 | 2,722.00 | 272,200 |
| エフピコ | 100 | 3,670.00 | 367,000 |
| ヤマハ | 400 | 5,570.00 | 2,228,000 |
| ピジョン | 300 | 2,046.00 | 613,800 |
| 天馬 | 100 | 2,047.00 | 204,700 |
| 象印マホービン | 200 | 1,496.00 | 299,200 |
| リンテック | 100 | 2,228.00 | 222,800 |
| 信越ポリマー | 100 | 1,261.00 | 126,100 |
| 任天堂 | 4,000 | 6,096.00 | 24,384,000 |
| 三菱鉛筆 | 100 | 1,425.00 | 142,500 |
| タカラスタANDARD | 100 | 1,302.00 | 130,200 |
| コクヨ | 200 | 1,850.00 | 370,000 |
| ニフコ | 200 | 3,150.00 | 630,000 |
| オカムラ | 200 | 1,373.00 | 274,600 |
| バルカー | 100 | 2,577.00 | 257,700 |
| 伊藤忠商事 | 3,900 | 3,865.00 | 15,073,500 |
| 丸紅 | 5,700 | 1,311.00 | 7,472,700 |
| スクロール | 100 | 694.00 | 69,400 |
| ヨンドシーホールディングス | 100 | 1,741.00 | 174,100 |
| 長瀬産業 | 300 | 2,043.00 | 612,900 |
| 蝶理 | 100 | 1,930.00 | 193,000 |
| 豊田通商 | 600 | 4,640.00 | 2,784,000 |
| オンワードホールディングス | 400 | 315.00 | 126,000 |
| 三共生興 | 200 | 477.00 | 95,400 |
| 兼松 | 200 | 1,485.00 | 297,000 |

| | | | |
|-------------------|-------|-----------|------------|
| 三井物産 | 4,600 | 3,212.00 | 14,775,200 |
| 東京エレクトロン | 400 | 36,700.00 | 14,680,000 |
| カメイ | 100 | 1,113.00 | 111,300 |
| スターゼン | 100 | 2,105.00 | 210,500 |
| セイコーグループ | 100 | 3,390.00 | 339,000 |
| 山善 | 200 | 908.00 | 181,600 |
| 住友商事 | 3,900 | 1,891.50 | 7,376,850 |
| B I P R O G Y | 200 | 3,210.00 | 642,000 |
| 三菱商事 | 4,300 | 4,076.00 | 17,526,800 |
| キヤノンマーケティングジャパン | 100 | 3,155.00 | 315,500 |
| 佐藤商事 | 100 | 1,177.00 | 117,700 |
| ユアサ商事 | 100 | 3,690.00 | 369,000 |
| 阪和興業 | 100 | 3,580.00 | 358,000 |
| カナデン | 100 | 1,085.00 | 108,500 |
| 菱電商事 | 100 | 1,604.00 | 160,400 |
| ニプロ | 500 | 1,109.00 | 554,500 |
| 岩谷産業 | 100 | 5,380.00 | 538,000 |
| 三愛オプリー | 200 | 1,250.00 | 250,000 |
| 稲畑産業 | 100 | 2,424.00 | 242,400 |
| ゴールドウイン | 100 | 7,760.00 | 776,000 |
| ユニ・チャーム | 1,200 | 4,637.00 | 5,564,400 |
| デサント | 100 | 3,750.00 | 375,000 |
| ワキタ | 100 | 1,174.00 | 117,400 |
| 東邦ホールディングス | 200 | 1,967.00 | 393,400 |
| サンゲツ | 200 | 1,577.00 | 315,400 |
| ミツウロコグループホールディングス | 100 | 1,017.00 | 101,700 |
| 伊藤忠エネクス | 100 | 1,050.00 | 105,000 |
| サンリオ | 200 | 3,960.00 | 792,000 |
| リョーサン | 100 | 2,316.00 | 231,600 |
| 新光商事 | 100 | 928.00 | 92,800 |
| 東陽テクニカ | 100 | 1,238.00 | 123,800 |
| モスフードサービス | 100 | 3,115.00 | 311,500 |
| 加賀電子 | 100 | 4,060.00 | 406,000 |
| 三益半導体工業 | 100 | 2,130.00 | 213,000 |
| 立花エレテック | 100 | 1,627.00 | 162,700 |
| 木曽路 | 100 | 2,202.00 | 220,200 |
| S R Sホールディングス | 100 | 896.00 | 89,600 |
| リテールパートナーズ | 100 | 1,189.00 | 118,900 |
| ケーヨー | 100 | 893.00 | 89,300 |
| 上新電機 | 100 | 1,911.00 | 191,100 |
| 日本瓦斯 | 300 | 2,137.00 | 641,100 |
| ロイヤルホールディングス | 100 | 2,367.00 | 236,700 |
| いなげや | 100 | 1,124.00 | 112,400 |
| チヨダ | 100 | 732.00 | 73,200 |
| リンガーハット | 100 | 2,099.00 | 209,900 |
| MrMaxHD | 100 | 677.00 | 67,700 |
| テンアライド | 100 | 249.00 | 24,900 |
| A O K Iホールディングス | 200 | 736.00 | 147,200 |
| オークワ | 100 | 917.00 | 91,700 |
| コメリ | 100 | 2,703.00 | 270,300 |

| | | | | |
|-------------------|--------|-----------|------------|--|
| 青山商事 | 100 | 1,048.00 | 104,800 | |
| しまむら | 100 | 12,500.00 | 1,250,000 | |
| 高島屋 | 400 | 1,921.00 | 768,400 | |
| 松屋 | 100 | 1,140.00 | 114,000 | |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 300 | 1,298.00 | 389,400 | |
| 丸井グループ | 500 | 2,493.00 | 1,246,500 | |
| クレディセゾン | 400 | 1,623.00 | 649,200 | |
| イオン | 2,200 | 2,796.00 | 6,151,200 | |
| イズミ | 100 | 3,035.00 | 303,500 | |
| 平和堂 | 100 | 1,882.00 | 188,200 | |
| フジ | 100 | 1,811.00 | 181,100 | |
| ヤオコー | 100 | 6,380.00 | 638,000 | |
| ゼビオホールディングス | 100 | 1,023.00 | 102,300 | |
| ケーズホールディングス | 600 | 1,182.00 | 709,200 | |
| PALTAC | 100 | 4,080.00 | 408,000 | |
| 新生銀行 | 400 | 2,321.00 | 928,400 | |
| あおぞら銀行 | 400 | 2,560.00 | 1,024,000 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 38,300 | 693.00 | 26,541,900 | |
| りそなホールディングス | 6,900 | 574.30 | 3,962,670 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 1,100 | 4,299.00 | 4,728,900 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 4,200 | 4,105.00 | 17,241,000 | |
| 千葉銀行 | 1,800 | 828.00 | 1,490,400 | |
| 群馬銀行 | 1,100 | 406.00 | 446,600 | |
| 武蔵野銀行 | 100 | 1,733.00 | 173,300 | |
| 千葉興業銀行 | 300 | 293.00 | 87,900 | |
| 筑波銀行 | 500 | 195.00 | 97,500 | |
| 七十七銀行 | 200 | 1,820.00 | 364,000 | |
| 秋田銀行 | 100 | 1,644.00 | 164,400 | |
| 山形銀行 | 100 | 1,033.00 | 103,300 | |
| 東邦銀行 | 500 | 207.00 | 103,500 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 500 | 2,626.00 | 1,313,000 | |
| スルガ銀行 | 600 | 390.00 | 234,000 | |
| 八十二銀行 | 1,300 | 489.00 | 635,700 | |
| 山梨中央銀行 | 100 | 1,069.00 | 106,900 | |
| 大垣共立銀行 | 100 | 1,762.00 | 176,200 | |
| 福井銀行 | 100 | 1,364.00 | 136,400 | |
| 清水銀行 | 100 | 1,438.00 | 143,800 | |
| 滋賀銀行 | 100 | 2,586.00 | 258,600 | |
| 南都銀行 | 100 | 2,170.00 | 217,000 | |
| 百五銀行 | 500 | 331.00 | 165,500 | |
| 京都銀行 | 200 | 5,530.00 | 1,106,000 | |
| 紀陽銀行 | 200 | 1,457.00 | 291,400 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 400 | 892.00 | 356,800 | |
| 山陰合同銀行 | 400 | 709.00 | 283,600 | |
| 百十四銀行 | 100 | 1,685.00 | 168,500 | |
| 四国銀行 | 100 | 868.00 | 86,800 | |
| 阿波銀行 | 100 | 1,898.00 | 189,800 | |
| 大分銀行 | 100 | 1,821.00 | 182,100 | |
| 佐賀銀行 | 100 | 1,559.00 | 155,900 | |
| 琉球銀行 | 200 | 772.00 | 154,400 | |

| | | | |
|---------------------------|--------|----------|------------|
| セブン銀行 | 1,700 | 272.00 | 462,400 |
| みずほフィナンシャルグループ | 7,800 | 1,621.50 | 12,647,700 |
| 山口フィナンシャルグループ | 700 | 797.00 | 557,900 |
| 芙蓉総合リース | 100 | 8,370.00 | 837,000 |
| みずほリース | 100 | 3,205.00 | 320,500 |
| 東京センチュリー | 100 | 4,920.00 | 492,000 |
| SBIホールディングス | 800 | 2,618.00 | 2,094,400 |
| 日本証券金融 | 300 | 843.00 | 252,900 |
| アイフル | 1,100 | 393.00 | 432,300 |
| 北洋銀行 | 900 | 236.00 | 212,400 |
| 愛媛銀行 | 100 | 858.00 | 85,800 |
| 京葉銀行 | 300 | 496.00 | 148,800 |
| 栃木銀行 | 400 | 305.00 | 122,000 |
| 東和銀行 | 200 | 523.00 | 104,600 |
| リコーリース | 100 | 3,630.00 | 363,000 |
| イオンフィナンシャルサービス | 400 | 1,440.00 | 576,000 |
| アコム | 1,300 | 321.00 | 417,300 |
| ジャックス | 100 | 3,630.00 | 363,000 |
| オリエントコーポレーション | 100 | 1,160.00 | 116,000 |
| オリックス | 3,900 | 2,105.50 | 8,211,450 |
| 三菱HCキャピタル | 2,100 | 637.00 | 1,337,700 |
| ジャフコグループ | 200 | 2,272.00 | 454,400 |
| トモニホールディングス | 500 | 317.00 | 158,500 |
| 大和証券グループ本社 | 4,200 | 576.00 | 2,419,200 |
| 野村ホールディングス | 10,000 | 481.40 | 4,814,000 |
| 岡三証券グループ | 400 | 333.00 | 133,200 |
| 丸三証券 | 200 | 419.00 | 83,800 |
| 東洋証券 | 200 | 232.00 | 46,400 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 600 | 349.00 | 209,400 |
| 水戸証券 | 300 | 233.00 | 69,900 |
| いちよし証券 | 100 | 600.00 | 60,000 |
| 松井証券 | 200 | 777.00 | 155,400 |
| SOMPOホールディングス | 900 | 6,084.00 | 5,475,600 |
| 日本取引所グループ | 1,500 | 1,962.00 | 2,943,000 |
| マネックスグループ | 600 | 483.00 | 289,800 |
| 極東証券 | 100 | 646.00 | 64,600 |
| 岩井コスモホールディングス | 100 | 1,251.00 | 125,100 |
| アイザワ証券グループ | 100 | 682.00 | 68,200 |
| フィデアホールディングス | 100 | 1,304.00 | 130,400 |
| 池田泉州ホールディングス | 800 | 219.00 | 175,200 |
| アニコムホールディングス | 200 | 583.00 | 116,600 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 1,400 | 3,922.00 | 5,490,800 |
| 第一生命ホールディングス | 3,200 | 2,318.00 | 7,417,600 |
| 東京海上ホールディングス | 5,400 | 2,651.00 | 14,315,400 |
| イー・ギャランティ | 100 | 2,372.00 | 237,200 |
| T&Dホールディングス | 1,500 | 1,374.00 | 2,061,000 |
| アドバンスクリエイト | 100 | 984.00 | 98,400 |
| 三井不動産 | 2,600 | 2,876.50 | 7,478,900 |

| | | | |
|------------------|-------|-----------|-----------|
| 三菱地所 | 3,700 | 1,928.00 | 7,133,600 |
| 平和不動産 | 100 | 4,120.00 | 412,000 |
| 東京建物 | 500 | 2,081.00 | 1,040,500 |
| 京阪神ビルディング | 100 | 1,251.00 | 125,100 |
| 住友不動産 | 1,200 | 3,473.00 | 4,167,600 |
| テーオーシー | 100 | 755.00 | 75,500 |
| レオパレス21 | 600 | 274.00 | 164,400 |
| スターツコーポレーション | 100 | 2,616.00 | 261,600 |
| フジ住宅 | 100 | 629.00 | 62,900 |
| 空港施設 | 100 | 560.00 | 56,000 |
| ゴールドクレスト | 100 | 1,751.00 | 175,100 |
| リログループ | 400 | 2,146.00 | 858,400 |
| エスリード | 100 | 1,747.00 | 174,700 |
| 日神グループホールディングス | 200 | 427.00 | 85,400 |
| 日本エスコン | 200 | 833.00 | 166,600 |
| MIRARTHホールディングス | 300 | 395.00 | 118,500 |
| イオンモール | 300 | 1,644.00 | 493,200 |
| カチタス | 200 | 3,100.00 | 620,000 |
| 東祥 | 100 | 1,163.00 | 116,300 |
| トーセイ | 100 | 1,377.00 | 137,700 |
| サンフロンティア不動産 | 100 | 1,165.00 | 116,500 |
| FJネクストホールディングス | 100 | 1,016.00 | 101,600 |
| 東武鉄道 | 600 | 3,555.00 | 2,133,000 |
| 相鉄ホールディングス | 200 | 2,401.00 | 480,200 |
| 東急 | 1,500 | 1,759.00 | 2,638,500 |
| 京浜急行電鉄 | 700 | 1,575.00 | 1,102,500 |
| 小田急電鉄 | 800 | 1,902.00 | 1,521,600 |
| 京王電鉄 | 300 | 5,410.00 | 1,623,000 |
| 京成電鉄 | 400 | 3,965.00 | 1,586,000 |
| 富士急行 | 100 | 4,710.00 | 471,000 |
| 東日本旅客鉄道 | 1,000 | 8,187.00 | 8,187,000 |
| 西日本旅客鉄道 | 700 | 6,027.00 | 4,218,900 |
| 東海旅客鉄道 | 500 | 17,705.00 | 8,852,500 |
| 西武ホールディングス | 800 | 1,465.00 | 1,172,000 |
| 鴻池運輸 | 100 | 1,576.00 | 157,600 |
| 西日本鉄道 | 200 | 2,965.00 | 593,000 |
| 近鉄グループホールディングス | 600 | 5,210.00 | 3,126,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 700 | 4,525.00 | 3,167,500 |
| 南海電気鉄道 | 300 | 3,035.00 | 910,500 |
| 京阪ホールディングス | 200 | 4,015.00 | 803,000 |
| 名古屋鉄道 | 600 | 2,335.00 | 1,401,000 |
| 山陽電気鉄道 | 100 | 2,302.00 | 230,200 |
| アルプス物流 | 100 | 1,071.00 | 107,100 |
| ヤマトホールディングス | 900 | 2,192.00 | 1,972,800 |
| 山九 | 200 | 4,285.00 | 857,000 |
| 日新 | 100 | 1,953.00 | 195,300 |
| センコーグループホールディングス | 200 | 993.00 | 198,600 |
| ニッコンホールディングス | 200 | 2,352.00 | 470,400 |
| 福山通運 | 100 | 3,300.00 | 330,000 |
| セイノーホールディングス | 300 | 1,159.00 | 347,700 |

| | | | | |
|-----------------------------------|-------|-----------|------------|--|
| 日立物流 | 100 | 8,630.00 | 863,000 | |
| A Z - C O M丸和ホールディングス | 100 | 1,480.00 | 148,000 | |
| C & F ロジホールディングス | 100 | 1,222.00 | 122,200 | |
| 日本郵船 | 1,500 | 2,685.00 | 4,027,500 | |
| 商船三井 | 1,000 | 2,889.00 | 2,889,000 | |
| 川崎汽船 | 600 | 2,282.00 | 1,369,200 | |
| 飯野海運 | 300 | 744.00 | 223,200 | |
| 共栄タンカー | 100 | 883.00 | 88,300 | |
| 九州旅客鉄道 | 400 | 3,195.00 | 1,278,000 | |
| S Gホールディングス | 1,100 | 2,005.00 | 2,205,500 | |
| N I P P O N E X P R E S Sホールディングス | 200 | 7,440.00 | 1,488,000 | |
| 日本航空 | 1,400 | 2,837.00 | 3,971,800 | |
| A N Aホールディングス | 1,500 | 2,966.50 | 4,449,750 | |
| T R Eホールディングス | 100 | 1,595.00 | 159,500 | |
| K P Pグループホールディングス | 100 | 835.00 | 83,500 | |
| ブックオフグループホールディングス | 100 | 1,223.00 | 122,300 | |
| 三菱倉庫 | 200 | 3,440.00 | 688,000 | |
| 三井倉庫ホールディングス | 100 | 3,260.00 | 326,000 | |
| 住友倉庫 | 200 | 2,047.00 | 409,400 | |
| 澁澤倉庫 | 100 | 2,031.00 | 203,100 | |
| 乾汽船 | 100 | 1,838.00 | 183,800 | |
| 日本トランスシティ | 200 | 487.00 | 97,400 | |
| 安田倉庫 | 100 | 929.00 | 92,900 | |
| 上組 | 300 | 2,912.00 | 873,600 | |
| T B Sホールディングス | 300 | 1,578.00 | 473,400 | |
| 日本テレビホールディングス | 600 | 1,151.00 | 690,600 | |
| 朝日放送グループホールディングス | 100 | 621.00 | 62,100 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 200 | 1,414.00 | 282,800 | |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 600 | 518.00 | 310,800 | |
| テレビ東京ホールディングス | 100 | 1,931.00 | 193,100 | |
| ビジョン | 100 | 1,324.00 | 132,400 | |
| U S E N - N E X T H O L D I N G S | 100 | 2,254.00 | 225,400 | |
| コネクシオ | 100 | 1,136.00 | 113,600 | |
| 日本通信 | 600 | 217.00 | 130,200 | |
| 日本電信電話 | 7,300 | 4,093.00 | 29,878,900 | |
| K D D I | 4,800 | 4,293.00 | 20,606,400 | |
| ソフトバンク | 9,900 | 1,453.00 | 14,384,700 | |
| 光通信 | 100 | 18,020.00 | 1,802,000 | |
| G M Oインターネットグループ | 200 | 2,593.00 | 518,600 | |
| K A D O K A W A | 400 | 2,673.00 | 1,069,200 | |
| 学研ホールディングス | 200 | 948.00 | 189,600 | |
| ゼンリン | 100 | 904.00 | 90,400 | |
| 東京電力ホールディングス | 5,000 | 482.00 | 2,410,000 | |
| 中部電力 | 1,900 | 1,233.00 | 2,342,700 | |
| 関西電力 | 2,300 | 1,139.00 | 2,619,700 | |
| 中国電力 | 1,000 | 685.00 | 685,000 | |
| 北陸電力 | 600 | 464.00 | 278,400 | |
| 東北電力 | 1,400 | 609.00 | 852,600 | |

| | | | |
|----------------------|-------|----------|-----------|
| 四国電力 | 600 | 680.00 | 408,000 |
| 九州電力 | 1,300 | 728.00 | 946,400 |
| 北海道電力 | 600 | 435.00 | 261,000 |
| 沖縄電力 | 100 | 979.00 | 97,900 |
| 電源開発 | 500 | 2,104.00 | 1,052,000 |
| イーレックス | 100 | 2,578.00 | 257,800 |
| レノバ | 100 | 3,505.00 | 350,500 |
| 東京瓦斯 | 1,200 | 2,587.00 | 3,104,400 |
| 大阪瓦斯 | 1,100 | 2,203.00 | 2,423,300 |
| 東邦瓦斯 | 300 | 2,883.00 | 864,900 |
| 西部ガスホールディングス | 100 | 1,689.00 | 168,900 |
| 静岡ガス | 100 | 1,045.00 | 104,500 |
| メタウォーター | 100 | 1,889.00 | 188,900 |
| 東宝 | 400 | 5,170.00 | 2,068,000 |
| エイチ・アイ・エス | 200 | 2,161.00 | 432,200 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 1,700 | 2,079.00 | 3,534,300 |
| 共立メンテナンス | 100 | 6,290.00 | 629,000 |
| イチネンホールディングス | 100 | 1,266.00 | 126,600 |
| スペース | 100 | 886.00 | 88,600 |
| アインホールディングス | 100 | 6,370.00 | 637,000 |
| 東京テアトル | 100 | 1,120.00 | 112,000 |
| 東京都競馬 | 100 | 3,890.00 | 389,000 |
| 常磐興産 | 100 | 1,198.00 | 119,800 |
| カナモト | 100 | 2,136.00 | 213,600 |
| D T S | 100 | 3,460.00 | 346,000 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 300 | 6,650.00 | 1,995,000 |
| シーイーシー | 100 | 1,538.00 | 153,800 |
| カブコン | 600 | 3,745.00 | 2,247,000 |
| 西尾レントオール | 100 | 3,015.00 | 301,500 |
| 日本空港ビルデング | 200 | 6,580.00 | 1,316,000 |
| トランス・コスモス | 100 | 3,495.00 | 349,500 |
| 乃村工藝社 | 300 | 1,091.00 | 327,300 |
| S C S K | 500 | 2,194.00 | 1,097,000 |
| 日本管財 | 100 | 2,495.00 | 249,500 |
| トーカイ | 100 | 1,849.00 | 184,900 |
| セコム | 600 | 8,595.00 | 5,157,000 |
| アイネス | 100 | 1,475.00 | 147,500 |
| 丹青社 | 100 | 832.00 | 83,200 |
| メイテック | 200 | 2,425.00 | 485,000 |
| T K C | 100 | 3,735.00 | 373,500 |
| 富士ソフト | 100 | 7,900.00 | 790,000 |
| 応用地質 | 100 | 2,203.00 | 220,300 |
| 船井総研ホールディングス | 100 | 2,577.00 | 257,700 |
| N S D | 200 | 2,472.00 | 494,400 |
| コナミグループ | 200 | 6,330.00 | 1,266,000 |
| いであ | 100 | 1,529.00 | 152,900 |
| ベネッセホールディングス | 200 | 2,145.00 | 429,000 |
| イオンディライト | 100 | 2,926.00 | 292,600 |
| ナック | 100 | 920.00 | 92,000 |

| | | | | |
|-----------------|---------|-----------|---------------|--|
| ダイセキ | 100 | 4,365.00 | 436,500 | |
| トラスコ中山 | 100 | 2,011.00 | 201,100 | |
| ヤマダホールディングス | 2,300 | 484.00 | 1,113,200 | |
| オートバックスセブン | 200 | 1,416.00 | 283,200 | |
| アークランズ | 100 | 1,576.00 | 157,600 | |
| ニトリホールディングス | 300 | 12,170.00 | 3,651,000 | |
| グルメ杵屋 | 100 | 1,016.00 | 101,600 | |
| 吉野家ホールディングス | 200 | 2,302.00 | 460,400 | |
| 加藤産業 | 100 | 3,495.00 | 349,500 | |
| イエローハット | 100 | 1,808.00 | 180,800 | |
| J B C Cホールディングス | 100 | 1,953.00 | 195,300 | |
| J Kホールディングス | 100 | 1,055.00 | 105,500 | |
| サガミホールディングス | 100 | 1,227.00 | 122,700 | |
| 日伝 | 100 | 1,702.00 | 170,200 | |
| 関西フードマーケット | 100 | 1,415.00 | 141,500 | |
| ミロク情報サービス | 100 | 1,467.00 | 146,700 | |
| 因幡電機産業 | 200 | 2,743.00 | 548,600 | |
| プレナス | 100 | 2,635.00 | 263,500 | |
| ミニストップ | 100 | 1,418.00 | 141,800 | |
| アークス | 100 | 1,994.00 | 199,400 | |
| バローホールディングス | 100 | 1,739.00 | 173,900 | |
| ミスミグループ本社 | 800 | 3,150.00 | 2,520,000 | |
| 大 庄 | 100 | 1,039.00 | 103,900 | |
| ファーストリテイリング | 100 | 84,230.00 | 8,423,000 | |
| ソフトバンクグループ | 3,900 | 5,780.00 | 22,542,000 | |
| スズケン | 200 | 3,180.00 | 636,000 | |
| サンドラッグ | 200 | 3,600.00 | 720,000 | |
| サックスパー ホールディングス | 100 | 759.00 | 75,900 | |
| ジェコス | 100 | 799.00 | 79,900 | |
| ペルーナ | 200 | 722.00 | 144,400 | |
| 合計 | 680,100 | | 1,606,593,570 | |

(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10月20日現在

| | |
|-------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 44,632,260 |
| 国債証券 | 8,328,913,600 |
| 地方債証券 | 702,927,800 |
| 特殊債証券 | 614,287,000 |
| 社債証券 | 398,435,000 |
| 未収利息 | 12,983,089 |
| 前払費用 | 307,740 |
| 流動資産合計 | 10,102,486,489 |
| 資産合計 | 10,102,486,489 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 1,094,000 |
| 流動負債合計 | 1,094,000 |
| 負債合計 | 1,094,000 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 8,205,666,929 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 1,895,725,560 |
| 元本等合計 | 10,101,392,489 |
| 純資産合計 | 10,101,392,489 |
| 負債純資産合計 | 10,102,486,489 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | 2022年10月20日現在 |
|---------------------------------------|----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 8,442,176,295円 |
| 同期中追加設定元本額 | 369,030,485円 |
| 同期中一部解約元本額 | 605,539,851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 | 2,647,688,641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 | 4,442,000,453円 |
| 世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募） | 508,118,520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） | 26,275,736円 |
| ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募） | 49,092,250円 |
| ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募） | 29,452,625円 |
| 計 | 8,205,666,929円 |
| 2. 受益権の総数 | 8,205,666,929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 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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10月20日現在 |
|----|---------------|
|----|---------------|

| | |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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10月20日現在 | |
|-------|---------------------------|-------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) | |
| 国債証券 | | 473,212,500 |
| 地方債証券 | | 14,704,200 |
| 特殊債券 | | 11,234,000 |
| 社債券 | | 8,253,000 |
| 合計 | | 507,403,700 |

(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10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| 2022年10月20日現在 | |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.2310円 (12,310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10月20日現在

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|------|-----------------|-------------|------------|----|
| 国債証券 | 430回 利付国庫債券(2年) | 90,000,000 | 90,097,200 | |

| | | | |
|-----------------|-------------|-------------|--|
| 433回 利付国庫債券(2年) | 80,000,000 | 80,071,200 | |
| 436回 利付国庫債券(2年) | 110,000,000 | 110,091,300 | |
| 439回 利付国庫債券(2年) | 100,000,000 | 100,062,000 | |
| 138回 利付国庫債券(5年) | 110,000,000 | 110,236,500 | |
| 139回 利付国庫債券(5年) | 60,000,000 | 60,135,000 | |
| 140回 利付国庫債券(5年) | 70,000,000 | 70,162,400 | |
| 141回 利付国庫債券(5年) | 40,000,000 | 40,095,600 | |
| 142回 利付国庫債券(5年) | 60,000,000 | 60,155,400 | |
| 143回 利付国庫債券(5年) | 50,000,000 | 50,138,500 | |
| 144回 利付国庫債券(5年) | 80,000,000 | 80,234,400 | |
| 145回 利付国庫債券(5年) | 80,000,000 | 80,244,800 | |
| 146回 利付国庫債券(5年) | 150,000,000 | 150,474,000 | |
| 147回 利付国庫債券(5年) | 120,000,000 | 119,958,000 | |
| 148回 利付国庫債券(5年) | 40,000,000 | 39,956,000 | |
| 149回 利付国庫債券(5年) | 80,000,000 | 79,843,200 | |
| 150回 利付国庫債券(5年) | 50,000,000 | 49,865,000 | |
| 151回 利付国庫債券(5年) | 20,000,000 | 19,929,600 | |
| 153回 利付国庫債券(5年) | 60,000,000 | 59,707,200 | |
| 1回 利付国庫債券(40年) | 10,000,000 | 12,170,800 | |
| 2回 利付国庫債券(40年) | 10,000,000 | 11,689,000 | |
| 3回 利付国庫債券(40年) | 20,000,000 | 23,448,000 | |
| 4回 利付国庫債券(40年) | 20,000,000 | 23,418,600 | |
| 5回 利付国庫債券(40年) | 20,000,000 | 22,476,400 | |
| 6回 利付国庫債券(40年) | 20,000,000 | 21,922,400 | |
| 7回 利付国庫債券(40年) | 20,000,000 | 20,943,400 | |
| 8回 利付国庫債券(40年) | 20,000,000 | 19,415,600 | |
| 9回 利付国庫債券(40年) | 50,000,000 | 35,395,000 | |
| 10回 利付国庫債券(40年) | 30,000,000 | 25,033,800 | |
| 11回 利付国庫債券(40年) | 30,000,000 | 24,111,600 | |
| 12回 利付国庫債券(40年) | 30,000,000 | 21,468,900 | |

| | | | |
|------------------|-------------|-------------|--|
| 13回 利付国庫債券(40年) | 40,000,000 | 28,406,400 | |
| 14回 利付国庫債券(40年) | 40,000,000 | 30,282,800 | |
| 15回 利付国庫債券(40年) | 10,000,000 | 8,279,600 | |
| 332回 利付国庫債券(10年) | 110,000,000 | 110,877,800 | |
| 333回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 80,745,600 | |
| 334回 利付国庫債券(10年) | 60,000,000 | 60,639,000 | |
| 335回 利付国庫債券(10年) | 90,000,000 | 90,904,500 | |
| 336回 利付国庫債券(10年) | 30,000,000 | 30,337,500 | |
| 337回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 80,553,600 | |
| 338回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 80,800,000 | |
| 339回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 70,764,400 | |
| 340回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 80,944,000 | |
| 341回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 70,664,300 | |
| 342回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 80,231,200 | |
| 343回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 70,165,900 | |
| 344回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 80,140,000 | |
| 345回 利付国庫債券(10年) | 60,000,000 | 60,074,400 | |
| 346回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 70,045,500 | |
| 347回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 69,983,200 | |
| 348回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 69,913,900 | |
| 349回 利付国庫債券(10年) | 100,000,000 | 99,769,000 | |
| 350回 利付国庫債券(10年) | 100,000,000 | 99,678,000 | |
| 351回 利付国庫債券(10年) | 120,000,000 | 119,494,800 | |
| 352回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 69,651,400 | |
| 353回 利付国庫債券(10年) | 110,000,000 | 109,363,100 | |

| | | | |
|------------------|------------|------------|--|
| 354回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 69,512,800 | |
| 355回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 79,368,800 | |
| 356回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 79,264,800 | |
| 357回 利付国庫債券(10年) | 60,000,000 | 59,407,800 | |
| 358回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 69,160,000 | |
| 359回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 78,860,000 | |
| 360回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 78,762,400 | |
| 361回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 78,692,800 | |
| 362回 利付国庫債券(10年) | 60,000,000 | 58,966,800 | |
| 363回 利付国庫債券(10年) | 80,000,000 | 78,548,800 | |
| 364回 利付国庫債券(10年) | 60,000,000 | 58,855,800 | |
| 365回 利付国庫債券(10年) | 70,000,000 | 68,781,300 | |
| 366回 利付国庫債券(10年) | 60,000,000 | 60,000,000 | |
| 367回 利付国庫債券(10年) | 60,000,000 | 59,745,000 | |
| 10回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 21,367,200 | |
| 11回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 11,294,800 | |
| 12回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 11,716,600 | |
| 15回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,183,900 | |
| 17回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,102,300 | |
| 19回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,014,800 | |
| 20回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,270,000 | |
| 21回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,030,000 | |
| 22回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,297,200 | |
| 23回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,313,700 | |
| 26回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,209,300 | |

| | | | |
|-----------------|------------|------------|--|
| 27回 利付国庫債券(30年) | 10,000,000 | 12,355,800 | |
| 28回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 24,749,400 | |
| 29回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 24,431,400 | |
| 30回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 36,160,500 | |
| 31回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 23,781,800 | |
| 32回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 36,104,400 | |
| 33回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 34,610,400 | |
| 34回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 35,569,500 | |
| 35回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 34,551,900 | |
| 36回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 23,045,000 | |
| 37回 利付国庫債券(30年) | 60,000,000 | 68,007,600 | |
| 38回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 22,296,400 | |
| 39回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 22,636,600 | |
| 40回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 33,372,000 | |
| 41回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 21,853,600 | |
| 42回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 21,814,800 | |
| 43回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 21,794,200 | |
| 44回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 32,659,200 | |
| 45回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 31,465,500 | |
| 46回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 31,422,900 | |
| 47回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 21,311,400 | |
| 48回 利付国庫債券(30年) | 40,000,000 | 40,959,200 | |
| 49回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 30,670,500 | |
| 50回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 26,992,800 | |
| 51回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 23,879,700 | |

| | | | |
|-----------------|------------|------------|--|
| 52回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 25,005,600 | |
| 53回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 17,018,800 | |
| 54回 利付国庫債券(30年) | 40,000,000 | 35,536,400 | |
| 55回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 17,702,600 | |
| 56回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 17,636,600 | |
| 57回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 26,355,900 | |
| 58回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 26,256,900 | |
| 59回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 17,019,400 | |
| 60回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 17,793,800 | |
| 61回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 16,866,800 | |
| 62回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 15,930,200 | |
| 63回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 15,427,800 | |
| 64回 利付国庫債券(30年) | 40,000,000 | 30,738,000 | |
| 65回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 15,368,200 | |
| 66回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 15,353,800 | |
| 67回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 24,154,500 | |
| 68回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 24,117,900 | |
| 69回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 24,757,800 | |
| 70回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 16,468,000 | |
| 71回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 24,645,600 | |
| 72回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 16,392,800 | |
| 73回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 24,582,000 | |
| 74回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 26,586,000 | |
| 75回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 28,650,600 | |
| 70回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 20,812,000 | |

| | | | |
|------------------|------------|------------|--|
| 72回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 20,814,200 | |
| 78回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 21,017,400 | |
| 81回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,584,500 | |
| 84回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,632,800 | |
| 88回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,828,600 | |
| 90回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,837,900 | |
| 92回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 21,685,800 | |
| 95回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,037,000 | |
| 99回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 33,014,700 | |
| 105回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,126,900 | |
| 108回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,045,200 | |
| 110回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,202,600 | |
| 111回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,307,600 | |
| 112回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,483,800 | |
| 113回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 33,830,100 | |
| 114回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,322,000 | |
| 116回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,418,800 | |
| 117回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,692,000 | |
| 118回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,294,500 | |
| 120回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 21,988,600 | |
| 121回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,500,000 | |
| 122回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,172,600 | |
| 123回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,896,200 | |
| 124回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,368,300 | |
| 125回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,568,200 | |

| | | | |
|------------------|------------|------------|--|
| 126回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,404,000 | |
| 127回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,321,900 | |
| 128回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,701,800 | |
| 129回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,266,500 | |
| 130回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,585,200 | |
| 131回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,205,800 | |
| 132回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,238,600 | |
| 133回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,655,400 | |
| 134回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,714,400 | |
| 135回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,265,800 | |
| 136回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,348,800 | |
| 137回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,565,800 | |
| 138回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 33,286,800 | |
| 139回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,378,400 | |
| 140回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 56,441,000 | |
| 141回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 45,167,200 | |
| 142回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,779,200 | |
| 143回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 33,581,100 | |
| 144回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 22,187,600 | |
| 145回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 45,179,200 | |
| 146回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 45,178,400 | |
| 147回 利付国庫債券(20年) | 60,000,000 | 67,084,800 | |
| 148回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 44,270,000 | |
| 149回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 44,237,200 | |
| 150回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 43,752,800 | |

| | | | |
|------------------|------------|------------|--|
| 151回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 53,492,000 | |
| 152回 利付国庫債券(20年) | 60,000,000 | 64,120,800 | |
| 153回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 53,992,000 | |
| 154回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 42,646,400 | |
| 155回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 51,996,000 | |
| 156回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 38,458,000 | |
| 157回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 37,296,400 | |
| 158回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 48,394,500 | |
| 159回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 48,914,000 | |
| 160回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 49,481,500 | |
| 161回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 38,924,400 | |
| 162回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 38,778,800 | |
| 163回 利付国庫債券(20年) | 60,000,000 | 57,984,600 | |
| 164回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 37,962,800 | |
| 165回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 37,803,200 | |
| 166回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 38,805,200 | |
| 167回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 37,451,200 | |
| 168回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 27,520,500 | |
| 169回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 35,923,600 | |
| 170回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 26,806,500 | |
| 171回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 44,481,500 | |
| 172回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 27,030,000 | |
| 173回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 35,885,200 | |
| 174回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 35,729,200 | |
| 175回 利付国庫債券(20年) | 50,000,000 | 45,320,500 | |

| | | | | |
|----------|------------------------|---------------|----------------|--|
| | 176回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 36,104,400 | |
| | 177回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 35,308,800 | |
| | 178回 利付国庫債券(20年) | 40,000,000 | 35,876,800 | |
| | 179回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 26,832,300 | |
| | 180回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 28,311,300 | |
| | 181回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 28,751,100 | |
| 国債証券 合計 | | 8,320,000,000 | 8,328,913,600 | |
| 地方債証券 | 18回 東京都公募公債 20年 | 100,000,000 | 111,872,000 | |
| | 218回 神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 100,252,000 | |
| | 412回 大阪府公募公債 10年 | 50,000,000 | 49,764,500 | |
| | 190回 大阪府公募公債 5年 | 100,000,000 | 99,215,000 | |
| | 12回 兵庫県公募公債 15年 | 100,000,000 | 102,717,000 | |
| | 令和3年度11回 愛知県公募公債 | 100,000,000 | 97,328,000 | |
| | 24年度1回 福岡県公募公債 30年 | 10,000,000 | 11,538,700 | |
| | 169回 共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,021,000 | |
| | 485回 名古屋市公募公債 10年 | 30,000,000 | 30,219,600 | |
| 地方債証券 合計 | | 690,000,000 | 702,927,800 | |
| 特殊債券 | 147回 高速道路機構債 | 100,000,000 | 102,103,000 | |
| | 97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 112,507,000 | |
| | 249回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 101,099,000 | |
| | 327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 99,777,000 | |
| | 250回 住宅金融支援機構 | 100,000,000 | 99,427,000 | |
| | 87回 中日本高速道路債券 | 100,000,000 | 99,374,000 | |
| 特殊債券 合計 | | 600,000,000 | 614,287,000 | |
| 社債券 | 50回 西日本高速道路債券 | 100,000,000 | 99,842,000 | |
| | 11回 プリズトン社債 | 100,000,000 | 99,582,000 | |
| | 36回 東日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 103,985,000 | |
| | 494回 九州電力社債 | 100,000,000 | 95,026,000 | |
| 社債券 合計 | | 400,000,000 | 398,435,000 | |
| 合計 | | | 10,044,563,400 | |

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10月20日現在

| | |
|-------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 1,655,582,179 |
| 投資証券 | 87,722,787,650 |
| 未収入金 | 113,661,626 |
| 未収配当金 | 887,474,550 |
| 前払金 | 212,551,600 |
| 差入委託証拠金 | 154,093,000 |
| 流動資産合計 | 90,746,150,605 |
| 資産合計 | 90,746,150,605 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 207,866,620 |
| 未払金 | 30,421,874 |
| 未払解約金 | 65,516,000 |
| 流動負債合計 | 303,804,494 |
| 負債合計 | 303,804,494 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 42,205,375,103 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 48,236,971,008 |
| 元本等合計 | 90,442,346,111 |
| 純資産合計 | 90,442,346,111 |
| 負債純資産合計 | 90,746,150,605 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 2022年10月20日現在 |
|---------------------------------------|-----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 45,103,573,674円 |
| 同期中追加設定元本額 | 648,713,742円 |
| 同期中一部解約元本額 | 3,546,912,313円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| J-REITパッケージ | 2,292,211,040円 |
| 新光J-REITオープン | 37,688,179,319円 |
| One DC 国内リートインデックスファンド | 1,246,086,982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） | 701,417,805円 |
| 計 | 42,205,375,103円 |
| 2. 受益権の総数 | 42,205,375,103口 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
|-----------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2022年10月20日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2022年10月20日現在 |
|------|-------------------|
| | 当期の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | 10,337,521,410 |
| 合計 | 10,337,521,410 |

(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10月21日から2022年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

| 種類 | 2022年10月20日現在 | | | | |
|--------------------|---------------|-----|--|---------------|-------------|
| | 契約額等（円） | | | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | うち | | | |
| | | 1年超 | | | |
| 市場取引 先物取引 買建 | 2,780,307,600 | - | | 2,572,593,000 | 207,714,600 |
| 合計 | 2,780,307,600 | - | | 2,572,593,000 | 207,714,600 |

（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10月20日現在 | |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 2.1429円 (21,429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10月20日現在

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 （円） | 評価額 （円） | 備考 |
|--------------|------------------------|---------------|---------------|----|
| 投資証券 | CREロジスティクスファンド 投資法人 | 3,263 | 630,737,900 | |
| | GLP投資法人 | 25,950 | 3,793,890,000 | |
| | NTT都市開発リート投資法人 | 8,100 | 1,153,440,000 | |
| | Oneリート投資法人 | 1,470 | 343,392,000 | |
| | SOSILA物流リート投資法人 | 3,939 | 542,794,200 | |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 6,905 | 568,281,500 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 1,396 | 143,229,600 | |
| | アクティブ・プロパティーズ 投資法人 | 4,449 | 1,844,110,500 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 8,425 | 2,780,250,000 | |
| | アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 3,673 | 511,648,900 | |
| | イオンリート投資法人 | 9,328 | 1,418,788,800 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 37,088 | 1,737,572,800 | | |

| | | | |
|-------------------------|--------|---------------|--|
| エスコンジャパンリート投資法人 | 1,713 | 184,318,800 | |
| オリックス不動産投資法人 | 16,790 | 3,059,138,000 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 5,773 | 609,628,800 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 2,476 | 1,641,588,000 | |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 6,043 | 1,241,232,200 | |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 3,663 | 932,233,500 | |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 3,920 | 1,174,040,000 | |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 2,190 | 253,164,000 | |
| サンケイリアルエステート投資法人 | 2,699 | 243,989,600 | |
| ザイマックス・リート投資法人 | 1,367 | 159,392,200 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 27,174 | 2,067,941,400 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 7,730 | 1,004,900,000 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 8,426 | 4,887,080,000 | |
| スターアジア不動産投資法人 | 10,521 | 561,821,400 | |
| スターツプロシード投資法人 | 1,312 | 297,168,000 | |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 3,690 | 353,502,000 | |
| トーセイ・リート投資法人 | 1,869 | 256,987,500 | |
| ヒューリックリート投資法人 | 7,884 | 1,281,938,400 | |
| フロンティア不動産投資法人 | 3,126 | 1,561,437,000 | |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 2,078 | 388,170,400 | |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 1,052 | 139,810,800 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 18,969 | 2,792,236,800 | |
| ラサールロジポート投資法人 | 10,316 | 1,593,822,000 | |
| 阪急阪神リート投資法人 | 3,806 | 554,153,600 | |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 3,329 | 1,559,636,500 | |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 2,600 | 1,063,400,000 | |
| 産業ファンド投資法人 | 12,592 | 1,955,537,600 | |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 1,977 | 259,777,800 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 6,022 | 812,970,000 | |
| 森ヒルズリート投資法人 | 9,909 | 1,507,158,900 | |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 1,474 | 984,632,000 | |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 25,608 | 2,012,788,800 | |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 1,360 | 90,712,000 | |
| 大和ハウスリート投資法人 | 12,702 | 3,616,259,400 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 1,761 | 1,162,260,000 | |
| 大和証券リビング投資法人 | 11,677 | 1,280,966,900 | |
| 投資法人みらい | 10,237 | 477,556,050 | |

| | | | |
|--------------------|---------|----------------|--|
| 東海道リート投資法人 | 1,022 | 119,369,600 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 5,650 | 1,110,790,000 | |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 2,910 | 1,772,190,000 | |
| 日本ビルファンド投資法人 | 9,830 | 6,074,940,000 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 5,763 | 2,175,532,500 | |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 13,808 | 4,092,691,200 | |
| 日本リート投資法人 | 2,737 | 962,055,500 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 5,682 | 1,730,169,000 | |
| 日本都市ファンド投資法人 | 42,516 | 4,319,625,600 | |
| 福岡リート投資法人 | 4,358 | 706,867,600 | |
| 平和不動産リート投資法人 | 5,759 | 834,479,100 | |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 27,249 | 4,332,591,000 | |
| 投資証券 合計 | 497,105 | 87,722,787,650 | |
| 合計 | | 87,722,787,650 | |

(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10月20日現在

| | |
|-------------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 95,258,719 |
| コール・ローン | 4,302,081 |
| 株式 | 1,574,792,689 |
| 投資信託受益証券 | 2,267,161 |
| 投資証券 | 33,338,224 |
| 派生商品評価勘定 | 456,656 |
| 未収入金 | 381,558 |
| 未収配当金 | 1,111,657 |
| 差入委託証拠金 | 86,664,974 |
| 流動資産合計 | 1,798,573,719 |
| 資産合計 | 1,798,573,719 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 13,229,256 |
| 未払解約金 | 21,000 |
| 流動負債合計 | 13,250,256 |
| 負債合計 | 13,250,256 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 447,877,147 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 1,337,446,316 |
| 元本等合計 | 1,785,323,463 |
| 純資産合計 | 1,785,323,463 |
| 負債純資産合計 | 1,798,573,719 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 2022年10月20日現在 |
|---------------------------------------|---------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 463,055,146円 |
| 同期中追加設定元本額 | 12,458,033円 |
| 同期中一部解約元本額 | 27,636,032円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| 新光7資産バランスファンド | 162,132,483円 |
| 新光外国株式インデックスVA | 189,509,806円 |
| 世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募） | 79,857,359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） | 2,768,462円 |
| ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募） | 7,982,132円 |
| ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募） | 5,626,905円 |
| 計 | 447,877,147円 |

| | |
|-----------|--------------|
| 2. 受益権の総数 | 447,877,147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 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。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10月20日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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10月20日現在 |
|----|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) |

| | |
|----------|-------------|
| 株式 | 414,903,787 |
| 投資信託受益証券 | 711,458 |
| 投資証券 | 12,970,031 |
| 合計 | 428,585,276 |

(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10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

| 種類 | 2022年10月20日現在 | | | |
|--------------------|---------------|-----------|-------------|------------|
| | 契約額等(円) | 時価(円) | | 評価損益(円) |
| | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 先物取引 買建 | 182,863,643 | - | 170,091,043 | 12,772,600 |
| 合計 | 182,863,643 | - | 170,091,043 | 12,772,600 |

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| 2022年10月20日現在 | |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 3.9862円 (39,862円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年10月20日現在

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------|---------------------------------|-------|---------|-------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | AMAZON.COM INC | 2,226 | 115.070 | 256,145.820 | |
| | ABBOTT LABORATORIES | 427 | 98.110 | 41,892.970 | |
| | AES CORP | 157 | 24.130 | 3,788.410 | |
| | ABIOMED INC | 12 | 253.240 | 3,038.880 | |
| | INTL BUSINESS MACHINES CORP | 218 | 122.510 | 26,707.180 | |
| | ADVANCED MICRO DEVICES | 393 | 57.230 | 22,491.390 | |
| | ADOBE INC | 114 | 299.830 | 34,180.620 | |
| | CHUBB LTD | 106 | 195.980 | 20,773.880 | |
| | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 55 | 241.450 | 13,279.750 | |
| | ALLSTATE CORP | 63 | 135.150 | 8,514.450 | |

| | | | | |
|------------------------------------|-------|-----------|-------------|--|
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 169 | 179.280 | 30,298.320 | |
| AMGEN INC | 132 | 248.190 | 32,761.080 | |
| HESS CORP | 67 | 129.000 | 8,643.000 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 156 | 143.970 | 22,459.320 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 134 | 85.900 | 11,510.600 | |
| AFLAC INC | 146 | 60.140 | 8,780.440 | |
| AMERICAN INTL GROUP | 185 | 52.750 | 9,758.750 | |
| AMERCO | 2 | 536.490 | 1,072.980 | |
| ANALOG DEVICES | 127 | 141.330 | 17,948.910 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 181 | 52.410 | 9,486.210 | |
| VALERO ENERGY CORP | 102 | 123.960 | 12,643.920 | |
| ANSYS INC | 19 | 214.190 | 4,069.610 | |
| APPLE INC | 3,939 | 143.860 | 566,664.540 | |
| APPLIED MATERIALS INC | 210 | 77.260 | 16,224.600 | |
| ALBEMARLE CORP | 28 | 256.510 | 7,182.280 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 133 | 88.350 | 11,750.550 | |
| AMEREN CORP | 58 | 78.560 | 4,556.480 | |
| ARROW ELECTRONICS INC | 21 | 95.800 | 2,011.800 | |
| AUTODESK INC | 54 | 197.020 | 10,639.080 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 104 | 233.240 | 24,256.960 | |
| AUTOZONE INC | 5 | 2,289.800 | 11,449.000 | |
| AVERY DENNISON CORP | 17 | 171.270 | 2,911.590 | |
| BALL CORP | 79 | 48.940 | 3,866.260 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 315 | 278.340 | 87,677.100 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 173 | 39.020 | 6,750.460 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 128 | 55.320 | 7,080.960 | |
| BECTON DICKINSON & CO | 71 | 225.470 | 16,008.370 | |
| AMETEK INC | 57 | 117.990 | 6,725.430 | |
| VERIZON COMM INC | 1,021 | 36.570 | 37,337.970 | |
| WR BERKLEY CORP | 45 | 71.460 | 3,215.700 | |
| BEST BUY CO INC | 52 | 63.740 | 3,314.480 | |
| BIO-RAD LABORATORIES-CL A | 6 | 385.230 | 2,311.380 | |
| YUM! BRANDS INC | 72 | 110.450 | 7,952.400 | |
| FIRSTENERGY CORP | 141 | 36.920 | 5,205.720 | |
| BOEING CO | 138 | 138.390 | 19,097.820 | |
| ROBERT HALF INTL INC | 25 | 80.830 | 2,020.750 | |
| BORGWARNER INC | 42 | 34.070 | 1,430.940 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 353 | 40.960 | 14,458.880 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 30 | 93.450 | 2,803.500 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 42 | 122.500 | 5,145.000 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|-------|-----------|------------|--|
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC | 5 | 1,166.970 | 5,834.850 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 510 | 71.140 | 36,281.400 | |
| ONEOK INC | 113 | 55.140 | 6,230.820 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 17 | 131.480 | 2,235.160 | |
| UNITED RENTALS INC | 18 | 286.850 | 5,163.300 | |
| SEMPRA ENERGY | 80 | 143.740 | 11,499.200 | |
| FEDEX CORP | 59 | 152.960 | 9,024.640 | |
| VERISIGN INC | 26 | 182.100 | 4,734.600 | |
| AMPHENOL CORP | 144 | 70.090 | 10,092.960 | |
| BROWN-FORMAN CORP | 80 | 64.260 | 5,140.800 | |
| QUANTA SERVICES INC | 33 | 132.570 | 4,374.810 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 218 | 6.140 | 1,338.520 | |
| CSX CORP | 542 | 27.920 | 15,132.640 | |
| COTERRA ENERGY INC | 205 | 30.120 | 6,174.600 | |
| CAMPBELL SOUP CO | 55 | 50.980 | 2,803.900 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 41 | 223.260 | 9,153.660 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 64 | 70.800 | 4,531.200 | |
| CARLISLE COS INC | 11 | 285.960 | 3,145.560 | |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED | 204 | 7.680 | 1,566.720 | |
| CATERPILLAR INC | 130 | 184.410 | 23,973.300 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 26 | 111.850 | 2,908.100 | |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | 194 | 6.850 | 1,328.900 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 716 | 116.510 | 83,421.160 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 62 | 73.620 | 4,564.440 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 40 | 101.040 | 4,041.600 | |
| CINTAS CORP | 23 | 400.250 | 9,205.750 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 1,008 | 41.880 | 42,215.040 | |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | 128 | 14.820 | 1,896.960 | |
| CLOROX COMPANY | 28 | 136.870 | 3,832.360 | |
| COCA-COLA CO/THE | 1,007 | 55.960 | 56,351.720 | |
| COPART INC | 49 | 110.950 | 5,436.550 | |
| COGNEX CORP | 46 | 43.450 | 1,998.700 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 186 | 71.750 | 13,345.500 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A | 66 | 149.990 | 9,899.340 | |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 15 | 353.210 | 5,298.150 | |
| NRG ENERGY, INC. | 63 | 41.960 | 2,643.480 | |
| COMCAST CORP-CL A | 1,091 | 30.390 | 33,155.490 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 103 | 34.930 | 3,597.790 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 89 | 84.540 | 7,524.060 | |
| CMS ENERGY CORP | 79 | 55.630 | 4,394.770 | |
| COOPER COS INC | 10 | 256.480 | 2,564.800 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO | 39 | 48.310 | 1,884.090 | |
| CORNING INC | 181 | 31.420 | 5,687.020 | |

| | | | | |
|--------------------------------|-------|---------|-------------|--|
| SEALED AIR CORP | 32 | 47.630 | 1,524.160 | |
| HEICO CORP-CL A | 14 | 118.190 | 1,654.660 | |
| CUMMINS INC | 33 | 224.760 | 7,417.080 | |
| DR HORTON INC | 78 | 67.790 | 5,287.620 | |
| DANAHER CORP | 169 | 257.890 | 43,583.410 | |
| MOODY'S CORP | 42 | 241.880 | 10,158.960 | |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 135 | 59.810 | 8,074.350 | |
| TARGET CORP | 112 | 155.390 | 17,403.680 | |
| DEERE & CO | 71 | 371.320 | 26,363.720 | |
| MORGAN STANLEY | 318 | 77.640 | 24,689.520 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 57 | 133.980 | 7,636.860 | |
| COSTAR GROUP INC | 93 | 72.290 | 6,722.970 | |
| THE WALT DISNEY CO | 445 | 98.990 | 44,050.550 | |
| DOLLAR TREE INC | 58 | 139.970 | 8,118.260 | |
| DOVER CORP | 35 | 121.360 | 4,247.600 | |
| OMNICOM GROUP | 49 | 68.410 | 3,352.090 | |
| DTE ENERGY CO | 52 | 108.630 | 5,648.760 | |
| DUKE ENERGY CORP | 196 | 89.290 | 17,500.840 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 34 | 133.000 | 4,522.000 | |
| EBAY INC | 135 | 37.810 | 5,104.350 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 1,769 | 33.920 | 60,004.480 | |
| CITIGROUP INC | 471 | 43.340 | 20,413.140 | |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 25 | 73.140 | 1,828.500 | |
| EATON CORP PLC | 102 | 139.000 | 14,178.000 | |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 70 | 153.720 | 10,760.400 | |
| DISH NETWORK CORP | 70 | 13.750 | 962.500 | |
| ECOLAB INC | 60 | 145.730 | 8,743.800 | |
| PERKINELMER INC | 32 | 127.660 | 4,085.120 | |
| ELECTRONIC ARTS INC | 64 | 123.840 | 7,925.760 | |
| SALESFORCE INC | 238 | 153.670 | 36,573.460 | |
| ERIE INDEMNITY CO | 6 | 238.770 | 1,432.620 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 144 | 81.200 | 11,692.800 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 31 | 102.040 | 3,163.240 | |
| ENTERGY CORP | 50 | 101.740 | 5,087.000 | |
| EOG RESOURCES INC | 146 | 130.070 | 18,990.220 | |
| EQUIFAX INC | 29 | 160.120 | 4,643.480 | |
| EQT CORP | 86 | 42.210 | 3,630.060 | |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE | 56 | 207.290 | 11,608.240 | |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL | 43 | 91.010 | 3,913.430 | |
| EXXON MOBIL CORP | 1,031 | 103.790 | 107,007.490 | |
| FMC CORP | 28 | 116.670 | 3,266.760 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 485 | 73.640 | 35,715.400 | |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 10 | 406.100 | 4,061.000 | |
| FAIR ISAAC CORP | 7 | 408.950 | 2,862.650 | |
| ASSURANT INC | 9 | 151.990 | 1,367.910 | |
| FASTENAL CO | 141 | 46.080 | 6,497.280 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 168 | 33.260 | 5,587.680 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|-----|---------|------------|--|
| M&T BANK CORP | 44 | 163.060 | 7,174.640 | |
| FISERV INC | 144 | 96.230 | 13,857.120 | |
| FORD MOTOR CO | 980 | 12.130 | 11,887.400 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 72 | 22.250 | 1,602.000 | |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 334 | 28.360 | 9,472.240 | |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 3 | 867.090 | 2,601.270 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 48 | 178.050 | 8,546.400 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 63 | 28.820 | 1,815.660 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 57 | 239.370 | 13,644.090 | |
| GENERAL MILLS INC | 140 | 78.130 | 10,938.200 | |
| GENUINE PARTS CO | 35 | 158.970 | 5,563.950 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 308 | 66.190 | 20,386.520 | |
| GARTNER INC | 20 | 286.270 | 5,725.400 | |
| MCKESSON CORP | 37 | 360.660 | 13,344.420 | |
| NVIDIA CORP | 609 | 120.510 | 73,390.590 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 274 | 70.530 | 19,325.220 | |
| WW GRAINGER INC | 11 | 521.130 | 5,732.430 | |
| HALLIBURTON CO | 233 | 31.960 | 7,446.680 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 94 | 88.240 | 8,294.560 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 85 | 311.760 | 26,499.600 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 49 | 237.610 | 11,642.890 | |
| HASBRO INC | 25 | 64.840 | 1,621.000 | |
| HENRY SCHEIN INC | 38 | 67.680 | 2,571.840 | |
| HEICO CORP | 13 | 148.960 | 1,936.480 | |
| HERSHEY FOODS CORP | 34 | 226.260 | 7,692.840 | |
| HP INC | 258 | 25.490 | 6,576.420 | |
| F5 INC | 14 | 142.400 | 1,993.600 | |
| CROWN HOLDINGS INC NPR | 35 | 83.080 | 2,907.800 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 73 | 27.370 | 1,998.010 | |
| HOLOGIC INC | 54 | 62.170 | 3,357.180 | |
| HOME DEPOT INC | 249 | 275.490 | 68,597.010 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 41 | 88.350 | 3,622.350 | |
| HORMEL FOODS CORP | 67 | 46.120 | 3,090.040 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 168 | 27.000 | 4,536.000 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 6 | 216.540 | 1,299.240 | |
| HUMANA INC | 31 | 500.210 | 15,506.510 | |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 20 | 167.960 | 3,359.200 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 381 | 13.620 | 5,189.220 | |
| BIOGEN INC | 35 | 264.450 | 9,255.750 | |
| IDEX CORP | 18 | 204.060 | 3,673.080 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 78 | 191.950 | 14,972.100 | |
| INTUIT INC | 64 | 402.070 | 25,732.480 | |
| IDEXX LABORATORIES INC | 20 | 335.490 | 6,709.800 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 59 | 145.140 | 8,563.260 | |

| | | | | |
|----------------------------------|-----|-----------|-------------|--|
| INTEL CORP | 995 | 26.000 | 25,870.000 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 66 | 92.550 | 6,108.300 | |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 80 | 32.560 | 2,604.800 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 96 | 28.490 | 2,735.040 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 19 | 187.110 | 3,555.090 | |
| INCYTE CORP | 42 | 69.590 | 2,922.780 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 641 | 164.690 | 105,566.290 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 85 | 68.000 | 5,780.000 | |
| KLA CORPORATION | 35 | 271.960 | 9,518.600 | |
| DEVON ENERGY CORP | 144 | 71.940 | 10,359.360 | |
| KELLOGG CO | 68 | 73.580 | 5,003.440 | |
| KEYCORP | 195 | 16.490 | 3,215.550 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 85 | 114.940 | 9,769.900 | |
| BLACKROCK INC/NEW YORK | 37 | 577.900 | 21,382.300 | |
| KROGER CO | 174 | 42.940 | 7,471.560 | |
| LAM RESEARCH CORP | 35 | 330.080 | 11,552.800 | |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 11 | 348.510 | 3,833.610 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 23 | 114.400 | 2,631.200 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 42 | 82.940 | 3,483.480 | |
| PLUG POWER INC | 130 | 16.950 | 2,203.500 | |
| LENNAR CORP | 59 | 72.290 | 4,265.110 | |
| ELI LILLY & CO | 196 | 329.290 | 64,540.840 | |
| BATH & BODY WORKS INC | 45 | 32.910 | 1,480.950 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 41 | 48.470 | 1,987.270 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 179 | 165.790 | 29,676.410 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 75 | 128.960 | 9,672.000 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 58 | 439.960 | 25,517.680 | |
| LOEWS CORP | 55 | 54.540 | 2,999.700 | |
| LOWE'S COS INC | 155 | 183.940 | 28,510.700 | |
| DOMINION ENERGY INC | 204 | 65.690 | 13,400.760 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 81 | 32.460 | 2,629.260 | |
| MCCORMICK & CO INC | 61 | 74.690 | 4,556.090 | |
| MCDONALD'S CORPORATION | 180 | 250.750 | 45,135.000 | |
| S&P GLOBAL INC | 84 | 296.870 | 24,937.080 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 9 | 279.680 | 2,517.120 | |
| MARKEL CORPORATION | 3 | 1,161.780 | 3,485.340 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 152 | 85.950 | 13,064.400 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 120 | 156.970 | 18,836.400 | |
| MASCO CORP | 62 | 46.350 | 2,873.700 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|-------|-----------|-------------|--|
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 16 | 313.340 | 5,013.440 | |
| METLIFE INC | 175 | 67.340 | 11,784.500 | |
| MEDTRONIC PLC | 326 | 83.660 | 27,273.160 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 196 | 72.210 | 14,153.160 | |
| CVS HEALTH CORP | 316 | 91.660 | 28,964.560 | |
| MERCK & CO. INC. | 614 | 93.260 | 57,261.640 | |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 108 | 60.770 | 6,563.160 | |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 25 | 208.820 | 5,220.500 | |
| MICROSOFT CORP | 1,728 | 236.480 | 408,637.440 | |
| MICRON TECH INC | 267 | 53.030 | 14,159.010 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 126 | 59.320 | 7,474.320 | |
| 3M CO | 137 | 114.200 | 15,645.400 | |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 17 | 94.950 | 1,614.150 | |
| ENTEGRIS INC | 35 | 76.500 | 2,677.500 | |
| CHARLES RIVER LABORATORIES INT | 12 | 199.600 | 2,395.200 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 42 | 223.850 | 9,401.700 | |
| ILLUMINA INC | 39 | 204.730 | 7,984.470 | |
| XCEL ENERGY INC | 135 | 61.100 | 8,248.500 | |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 19 | 109.500 | 2,080.500 | |
| NETAPP INC | 60 | 62.290 | 3,737.400 | |
| NEWELL BRANDS INC | 74 | 15.030 | 1,112.220 | |
| NEWMONT CORP | 200 | 40.370 | 8,074.000 | |
| NVR INC | 1 | 3,977.850 | 3,977.850 | |
| NIKE INC-CL B | 308 | 88.570 | 27,279.560 | |
| NORDSON CORP | 10 | 216.760 | 2,167.600 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 59 | 217.620 | 12,839.580 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 90 | 74.500 | 6,705.000 | |
| NISOURCE INC | 113 | 24.880 | 2,811.440 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 48 | 79.590 | 3,820.320 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 36 | 510.910 | 18,392.760 | |
| WELLS FARGO & CO | 922 | 43.620 | 40,217.640 | |
| NUCOR CORP | 63 | 121.890 | 7,679.070 | |
| CHENIERE ENERGY INC | 53 | 170.750 | 9,049.750 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 91 | 95.230 | 8,665.930 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 236 | 68.460 | 16,156.560 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 24 | 260.760 | 6,258.240 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 15 | 737.720 | 11,065.800 | |
| ORACLE CORP | 389 | 66.300 | 25,790.700 | |
| PACCAR INC | 87 | 90.740 | 7,894.380 | |
| PTC INC | 27 | 108.620 | 2,932.740 | |
| EXELON CORP | 259 | 36.850 | 9,544.150 | |

| | | | | |
|---------------------------------|-------|---------|------------|--|
| PARKER HANNIFIN CORP | 30 | 265.580 | 7,967.400 | |
| PAYCHEX INC | 83 | 111.450 | 9,250.350 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 20 | 204.980 | 4,099.600 | |
| PPL CORPORATION | 202 | 25.330 | 5,116.660 | |
| PEPSICO INC | 338 | 173.360 | 58,595.680 | |
| PENTAIR PLC | 48 | 40.130 | 1,926.240 | |
| PFIZER INC | 1,363 | 43.110 | 58,758.930 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 72 | 41.340 | 2,976.480 | |
| CONOCOPHILLIPS | 317 | 121.110 | 38,391.870 | |
| PG&E CORP | 392 | 13.960 | 5,472.320 | |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 58 | 250.550 | 14,531.900 | |
| ALTRIA GROUP INC | 452 | 44.670 | 20,190.840 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 103 | 151.700 | 15,625.100 | |
| BROWN & BROWN INC | 58 | 62.900 | 3,648.200 | |
| GARMIN LTD | 39 | 81.200 | 3,166.800 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 53 | 114.640 | 6,075.920 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 108 | 471.430 | 50,914.440 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 55 | 101.150 | 5,563.250 | |
| QUEST DIAGNOSTICS | 28 | 126.660 | 3,546.480 | |
| PROCTER & GAMBLE CO | 588 | 129.560 | 76,181.280 | |
| PROGRESSIVE CORP | 138 | 121.200 | 16,725.600 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 131 | 54.800 | 7,178.800 | |
| PULTE GROUP INC | 65 | 37.160 | 2,415.400 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 64 | 112.670 | 7,210.880 | |
| QUALCOMM INC | 272 | 112.850 | 30,695.200 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 48 | 100.000 | 4,800.000 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 37 | 32.690 | 1,209.530 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 26 | 709.370 | 18,443.620 | |
| RESMED INC | 36 | 215.300 | 7,750.800 | |
| US BANCORP | 356 | 41.260 | 14,688.560 | |
| SEAGEN INC | 33 | 129.830 | 4,284.390 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 100 | 48.720 | 4,872.000 | |
| ROSS STORES INC | 84 | 83.660 | 7,027.440 | |
| ROLLINS INC | 37 | 36.880 | 1,364.560 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 27 | 371.430 | 10,028.610 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 28 | 233.930 | 6,550.040 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 54 | 46.690 | 2,521.260 | |
| RPM INTERNATIONAL INC | 29 | 89.610 | 2,598.690 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 154 | 264.060 | 40,665.240 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 346 | 57.700 | 19,964.200 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 25 | 208.560 | 5,214.000 | |

| | | | | |
|--|-------|-----------|------------|--|
| THE TRAVELERS COMPANIES INC | 55 | 174.170 | 9,579.350 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 149 | 76.730 | 11,432.770 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 10 | 1,771.820 | 17,718.200 | |
| SCHLUMBERGER LTD | 343 | 45.470 | 15,596.210 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 348 | 68.710 | 23,911.080 | |
| POOL CORP | 10 | 298.120 | 2,981.200 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 48 | 108.120 | 5,189.760 | |
| BUNGE LTD | 34 | 90.600 | 3,080.400 | |
| SEI INVESTMENTS CO | 33 | 48.440 | 1,598.520 | |
| ELEVANCE HEALTH INC | 58 | 487.810 | 28,292.980 | |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 34 | 142.990 | 4,861.660 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 66 | 78.770 | 5,198.820 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 61 | 207.240 | 12,641.640 | |
| CENTENE CORP | 144 | 75.720 | 10,903.680 | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 13 | 315.370 | 4,099.810 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 26 | 50.770 | 1,320.020 | |
| SNAP-ON INC | 15 | 213.700 | 3,205.500 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 95 | 96.420 | 9,159.900 | |
| ADVANCE AUTO PARTS | 14 | 171.250 | 2,397.500 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 100 | 56.740 | 5,674.000 | |
| SOUTHERN CO | 268 | 64.690 | 17,336.920 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 326 | 42.440 | 13,835.440 | |
| SOUTHWEST AIRLINES | 52 | 33.120 | 1,722.240 | |
| AT&T INC | 1,737 | 15.540 | 26,992.980 | |
| CHEVRON CORP | 453 | 168.000 | 76,104.000 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 39 | 74.090 | 2,889.510 | |
| STATE STREET CORP | 81 | 64.570 | 5,230.170 | |
| STARBUCKS CORP | 278 | 87.520 | 24,330.560 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 42 | 80.680 | 3,388.560 | |
| STRYKER CORP | 81 | 216.690 | 17,551.890 | |
| NETFLIX INC | 106 | 272.380 | 28,872.280 | |
| NORTONLIFELOCK INC | 130 | 21.510 | 2,796.300 | |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 30 | 49.420 | 1,482.600 | |
| SYNOPSIS INC | 36 | 288.960 | 10,402.560 | |
| SYSCO CORP | 125 | 77.450 | 9,681.250 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 88 | 211.140 | 18,580.320 | |
| TELEFLEX INC | 12 | 197.900 | 2,374.800 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 278 | 8.070 | 2,243.460 | |
| TERADYNE INC | 43 | 73.180 | 3,146.740 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 225 | 152.650 | 34,346.250 | |
| TEXTRON INC | 45 | 61.840 | 2,782.800 | |

| | | | | |
|-------------------------------|-----|---------|-------------|--|
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 95 | 505.610 | 48,032.950 | |
| GLOBE LIFE INC | 17 | 112.560 | 1,913.520 | |
| DAVITA INC | 16 | 90.670 | 1,450.720 | |
| TRACTOR SUPPLY CO | 24 | 196.320 | 4,711.680 | |
| BIO-TECHNE CORP | 10 | 290.020 | 2,900.200 | |
| TRIMBLE INC | 66 | 54.830 | 3,618.780 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 11 | 336.370 | 3,700.070 | |
| TYSON FOODS INC | 78 | 65.020 | 5,071.560 | |
| UGI CORP | 40 | 32.600 | 1,304.000 | |
| MARATHON OIL CORP | 183 | 28.350 | 5,188.050 | |
| UNION PACIFIC CORP | 155 | 200.060 | 31,009.300 | |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 365 | 87.630 | 31,984.950 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 228 | 520.320 | 118,632.960 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 18 | 95.050 | 1,710.900 | |
| VF CORP | 73 | 28.450 | 2,076.850 | |
| PARAMOUNT GLOBAL | 149 | 19.080 | 2,842.920 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 61 | 292.020 | 17,813.220 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 32 | 154.770 | 4,952.640 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 168 | 33.390 | 5,609.520 | |
| WALMART INC | 366 | 133.760 | 48,956.160 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 99 | 161.500 | 15,988.500 | |
| WATERS CORP | 14 | 277.360 | 3,883.040 | |
| WEBSTER FINANCIAL CORP | 36 | 48.550 | 1,747.800 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 16 | 243.640 | 3,898.240 | |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 26 | 143.040 | 3,719.040 | |
| VAIL RESORTS INC | 12 | 211.440 | 2,537.280 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 78 | 33.360 | 2,602.080 | |
| WABTEC CORP | 43 | 87.100 | 3,745.300 | |
| WHIRLPOOL CORP | 14 | 137.780 | 1,928.920 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 40 | 81.690 | 3,267.600 | |
| WYNN RESORTS LTD | 18 | 54.480 | 980.640 | |
| NASDAQ INC | 87 | 56.000 | 4,872.000 | |
| CME GROUP INC | 85 | 172.800 | 14,688.000 | |
| WILLIAMS COS INC | 280 | 30.880 | 8,646.400 | |
| LKQ CORP | 68 | 51.150 | 3,478.200 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 73 | 50.350 | 3,675.550 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 85 | 86.770 | 7,375.450 | |
| CARMAX INC | 38 | 57.500 | 2,185.000 | |
| TJX COMPANIES INC | 280 | 66.100 | 18,508.000 | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP | 11 | 260.460 | 2,865.060 | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 343 | 4.290 | 1,471.470 | |

| | | | | |
|--------------------------------|-----|-----------|------------|--|
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 100 | 49.750 | 4,975.000 | |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 30 | 192.000 | 5,760.000 | |
| SIGNATURE BANK | 16 | 152.290 | 2,436.640 | |
| CBRE GROUP INC | 82 | 67.830 | 5,562.060 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC | 59 | 16.570 | 977.630 | |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 254 | 20.900 | 5,308.600 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 10 | 323.400 | 3,234.000 | |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 11 | 314.830 | 3,463.130 | |
| WESTLAKE CORP | 12 | 91.960 | 1,103.520 | |
| T-MOBILE US INC | 152 | 135.740 | 20,632.480 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 88 | 35.600 | 3,132.800 | |
| MOSAIC CO/THE | 88 | 50.720 | 4,463.360 | |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 9 | 233.470 | 2,101.230 | |
| CELANESE CORP | 30 | 92.590 | 2,777.700 | |
| DEXCOM INC | 96 | 96.840 | 9,296.640 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 36 | 96.120 | 3,460.320 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 53 | 100.660 | 5,334.980 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 26 | 264.300 | 6,871.800 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 90 | 17.450 | 1,570.500 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 131 | 91.630 | 12,003.530 | |
| LIVE NATION | 45 | 79.620 | 3,582.900 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 7 | 1,527.210 | 10,690.470 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 13 | 541.500 | 7,039.500 | |
| MASTERCARD INC | 210 | 297.760 | 62,529.600 | |
| WESTERN UNION CO | 56 | 14.250 | 798.000 | |
| OWENS CORNING | 19 | 83.990 | 1,595.810 | |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 31 | 93.190 | 2,888.890 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 25 | 49.800 | 1,245.000 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 28 | 143.500 | 4,018.000 | |
| DELTA AIR LINES INC | 27 | 32.520 | 878.040 | |
| INSULET CORP | 15 | 215.820 | 3,237.300 | |
| DISCOVER FINANCIAL | 71 | 93.430 | 6,633.530 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 80 | 112.030 | 8,962.400 | |
| MASIMO CORP | 15 | 135.080 | 2,026.200 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 29 | 296.870 | 8,609.230 | |
| VMWARE INC | 51 | 107.730 | 5,494.230 | |
| MERCADOLIBRE INC | 11 | 815.450 | 8,969.950 | |
| ULTA BEAUTY INC | 14 | 386.260 | 5,407.640 | |
| INVESCO LTD | 75 | 14.640 | 1,098.000 | |
| MSCI INC | 18 | 398.790 | 7,178.220 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|-----|---------|-------------|--|
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 375 | 86.470 | 32,426.250 | |
| VISA INC | 400 | 186.410 | 74,564.000 | |
| KEURIG DR PEPPER INC | 195 | 37.780 | 7,367.100 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 50 | 134.000 | 6,700.000 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 126 | 108.870 | 13,717.620 | |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 23 | 55.010 | 1,265.230 | |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE | 492 | 17.990 | 8,851.080 | |
| XYLEM INC | 46 | 92.900 | 4,273.400 | |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | 57 | 79.000 | 4,503.000 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 8 | 243.140 | 1,945.120 | |
| SPLUNK INC | 39 | 77.080 | 3,006.120 | |
| EPAM SYSTEMS INC | 13 | 331.650 | 4,311.450 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 55 | 209.190 | 11,505.450 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 38 | 169.360 | 6,435.680 | |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 16 | 132.330 | 2,117.280 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 18 | 167.480 | 3,014.640 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 41 | 111.790 | 4,583.390 | |
| NXP SEMICONDUCTOR NV | 66 | 141.320 | 9,327.120 | |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP | 28 | 98.620 | 2,761.360 | |
| TARGA RESOURCES CORP | 55 | 67.120 | 3,691.600 | |
| LEAR CORP | 13 | 126.820 | 1,648.660 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 23 | 119.750 | 2,754.250 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 57 | 48.410 | 2,759.370 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 56 | 238.370 | 13,348.720 | |
| FORTINET INC | 175 | 51.790 | 9,063.250 | |
| HORIZON PHARMA PLC | 54 | 63.740 | 3,441.960 | |
| TESLA INC | 645 | 222.040 | 143,215.800 | |
| GENERAC HOLDINGS INC | 15 | 110.300 | 1,654.500 | |
| ENPHASE ENERGY INC | 31 | 243.190 | 7,538.890 | |
| GENERAL MOTORS CO | 339 | 33.630 | 11,400.570 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 84 | 26.430 | 2,220.120 | |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 19 | 237.060 | 4,504.140 | |
| APTIV PLC | 73 | 85.950 | 6,274.350 | |
| PHILLIPS 66 | 121 | 97.950 | 11,851.950 | |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 17 | 55.770 | 948.090 | |
| META PLATFORMS INC | 555 | 133.230 | 73,942.650 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 47 | 178.390 | 8,384.330 | |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 44 | 146.030 | 6,425.320 | |

| | | | | |
|-------------------------------------|-----|---------|------------|--|
| SERVICENOW INC | 47 | 355.440 | 16,705.680 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 75 | 160.110 | 12,008.250 | |
| WORKDAY INC | 49 | 146.500 | 7,178.500 | |
| ABBVIE INC | 427 | 143.130 | 61,116.510 | |
| ZOETIS INC | 118 | 148.130 | 17,479.340 | |
| NEWS CORP/NEW-CL A | 90 | 16.590 | 1,493.100 | |
| CDW CORP | 30 | 159.470 | 4,784.100 | |
| HOWMET AEROSPACE INC | 90 | 34.240 | 3,081.600 | |
| TWILIO INC | 45 | 68.760 | 3,094.200 | |
| COUPA SOFTWARE INC | 20 | 52.370 | 1,047.400 | |
| SNAP INC | 283 | 10.860 | 3,073.380 | |
| TRADE DESK INC A | 115 | 55.230 | 6,351.450 | |
| LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C | 39 | 59.500 | 2,320.500 | |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 9 | 40.680 | 366.120 | |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C | 36 | 40.410 | 1,454.760 | |
| OKTA INC | 35 | 53.830 | 1,884.050 | |
| BLACK KNIGHT INC | 39 | 60.680 | 2,366.520 | |
| BAKER HUGHES CO | 242 | 25.650 | 6,207.300 | |
| BROADCOM INC | 98 | 435.300 | 42,659.400 | |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 23 | 31.770 | 730.710 | |
| MONGODB INC | 16 | 184.770 | 2,956.320 | |
| BURLINGTON STORES INC | 12 | 115.370 | 1,384.440 | |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 107 | 11.910 | 1,274.370 | |
| VEEVA SYSTEMS INC | 36 | 156.200 | 5,623.200 | |
| TWITTER INC | 148 | 51.830 | 7,670.840 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | 24 | 40.170 | 964.080 | |
| EVERGY INC | 57 | 58.320 | 3,324.240 | |
| ALLEGION PLC | 20 | 92.110 | 1,842.200 | |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 30 | 56.840 | 1,705.200 | |
| STERIS PLC | 25 | 167.130 | 4,178.250 | |
| DOCUSIGN INC | 51 | 46.550 | 2,374.050 | |
| WIX.COM LTD | 14 | 72.710 | 1,017.940 | |
| DROPBOX INC | 57 | 20.900 | 1,191.300 | |
| KKR & CO INC | 139 | 45.770 | 6,362.030 | |
| FUTU HOLDINGS LTD ADR | 16 | 34.070 | 545.120 | |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC | 51 | 76.330 | 3,892.830 | |
| MODERNA INC | 86 | 123.520 | 10,622.720 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 65 | 128.700 | 8,365.500 | |
| ARAMARK | 40 | 34.810 | 1,392.400 | |
| AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC | 150 | 6.110 | 916.500 | |
| CIGNA CORP | 75 | 293.080 | 21,981.000 | |
| DELL TECHNOLOGIES INC | 79 | 34.490 | 2,724.710 | |
| DOW INC | 185 | 45.130 | 8,349.050 | |
| AMCOR PLC | 318 | 11.060 | 3,517.080 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|-----|-----------|------------|--|
| PINTEREST INC | 158 | 23.040 | 3,640.320 | |
| FOX CORP-A | 71 | 29.320 | 2,081.720 | |
| FOX CORP-B | 24 | 27.660 | 663.840 | |
| CLARIVATE ANALYTICS PLC | 105 | 8.920 | 936.600 | |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC | 52 | 152.540 | 7,932.080 | |
| CHEWY INC | 26 | 34.840 | 905.840 | |
| AVANTOR INC | 134 | 20.140 | 2,698.760 | |
| LYFT INC | 78 | 13.020 | 1,015.560 | |
| DYNATRACE INC | 38 | 33.650 | 1,278.700 | |
| CLOUDFLARE INC | 65 | 51.630 | 3,355.950 | |
| TRADEWEB MARKETS INC | 24 | 53.350 | 1,280.400 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 200 | 34.890 | 6,978.000 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 100 | 66.280 | 6,628.000 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 370 | 27.530 | 10,186.100 | |
| CORTEVA INC | 182 | 61.800 | 11,247.600 | |
| MATCH GROUP INC | 66 | 44.730 | 2,952.180 | |
| BILL.COM HOLDINGS INC | 19 | 126.340 | 2,400.460 | |
| BLACKSTONE INC | 173 | 87.740 | 15,179.020 | |
| CARLYLE GROUP INC | 43 | 25.900 | 1,113.700 | |
| DATADOG INC | 57 | 79.000 | 4,503.000 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC | 50 | 52.850 | 2,642.500 | |
| INGERSOLL RAND INC | 105 | 46.310 | 4,862.550 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 12 | 320.500 | 3,846.000 | |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC | 82 | 31.500 | 2,583.000 | |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD | 20 | 23.510 | 470.200 | |
| UNITY SOFTWARE INC | 51 | 29.480 | 1,503.480 | |
| AON PLC | 50 | 280.930 | 14,046.500 | |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 550 | 12.610 | 6,935.500 | |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP | 1 | 2,092.830 | 2,092.830 | |
| BENTLEY SYSTEMS INC | 54 | 33.310 | 1,798.740 | |
| COINBASE GLOBAL INC | 30 | 63.190 | 1,895.700 | |
| AFFIRM HOLDINGS INC | 29 | 17.910 | 519.390 | |
| IAC INC | 17 | 48.370 | 822.290 | |
| AIRBNB INC | 90 | 116.870 | 10,518.300 | |
| ZENDESK INC | 30 | 76.730 | 2,301.900 | |
| CONSTELLATION ENERGY CORP | 77 | 85.690 | 6,598.130 | |
| APPROVIN CORP | 32 | 17.440 | 558.080 | |
| ROYALTY PHARMA PLC | 75 | 41.040 | 3,078.000 | |
| ROBLOX CORP | 91 | 41.440 | 3,771.040 | |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC | 69 | 44.350 | 3,060.150 | |
| VIATRIS INC | 354 | 9.380 | 3,320.520 | |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 48 | 37.310 | 1,790.880 | |
| SNOWFLAKE INC | 57 | 171.040 | 9,749.280 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|-------|---------|-------------|--|
| DOORDASH INC | 48 | 45.780 | 2,197.440 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 64 | 105.110 | 6,727.040 | |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 96 | 49.460 | 4,748.160 | |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC | 385 | 7.910 | 3,045.350 | |
| FNF GROUP | 57 | 36.900 | 2,103.300 | |
| AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC | 150 | 2.060 | 309.000 | |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 33 | 114.150 | 3,766.950 | |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 206 | 38.100 | 7,848.600 | |
| APA CORP | 86 | 41.910 | 3,604.260 | |
| LUCID GROUP INC | 101 | 12.640 | 1,276.640 | |
| GRAB HOLDINGS LTD | 153 | 2.380 | 364.140 | |
| CATALENT INC | 39 | 71.080 | 2,772.120 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 104 | 31.590 | 3,285.360 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | 111 | 36.720 | 4,075.920 | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD | 8 | 149.040 | 1,192.320 | |
| WAYFAIR INC | 21 | 31.650 | 664.650 | |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 43 | 161.150 | 6,929.450 | |
| HUBSPOT INC | 11 | 263.570 | 2,899.270 | |
| QORVO INC | 25 | 81.780 | 2,044.500 | |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I | 33 | 75.110 | 2,478.630 | |
| SOLAREGE TECHNOLOGIES INC | 13 | 199.460 | 2,592.980 | |
| GODADDY INC | 39 | 75.180 | 2,932.020 | |
| ETSY INC | 26 | 94.330 | 2,452.580 | |
| TRANSUNION | 39 | 55.950 | 2,182.050 | |
| ALCOA CORP | 46 | 37.620 | 1,730.520 | |
| BLOCK INC | 125 | 53.940 | 6,742.500 | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 126 | 54.100 | 6,816.600 | |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | 52 | 44.970 | 2,338.440 | |
| TELADOC HEALTH INC | 42 | 24.250 | 1,018.500 | |
| WESTROCK CO | 54 | 32.470 | 1,753.380 | |
| KRAFT HEINZ CO | 184 | 36.290 | 6,677.360 | |
| NOVOCURE LTD | 28 | 71.110 | 1,991.080 | |
| FORTIVE CORP | 85 | 60.670 | 5,156.950 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 64 | 132.130 | 8,456.320 | |
| ALPHABET INC-CL A | 1,466 | 99.630 | 146,057.580 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | 337 | 12.820 | 4,320.340 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 265 | 84.470 | 22,384.550 | |
| SEA LTD ADR | 94 | 47.920 | 4,504.480 | |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 94 | 28.140 | 2,645.160 | |
| ZILLOW GROUP INC-C | 52 | 28.720 | 1,493.440 | |

| | | | | | |
|----------|---------------------------------|--------|---------|----------------------------------|--|
| | ALPHABET INC-CL C | 1,367 | 100.290 | 137,096.430 | |
| | ZSCALER INC | 22 | 148.770 | 3,272.940 | |
| | CABLE ONE INC | 1 | 779.900 | 779.900 | |
| | LINDE PLC | 123 | 283.910 | 34,920.930 | |
| | ROKU INC | 35 | 51.100 | 1,788.500 | |
| | CHARTER COMMUNICATIONS INC | 28 | 324.650 | 9,090.200 | |
| | VISTRA CORP | 95 | 22.200 | 2,109.000 | |
| アメリカ・ドル | 小計 | 83,221 | | 7,801,758.870 (1,170,107,795) | |
| イギリス・ポンド | ANTOFAGASTA PLC | 69 | 10.855 | 748.990 | |
| | ASHTREAD GROUP | 110 | 43.260 | 4,758.600 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 53 | 23.450 | 1,242.850 | |
| | BARCLAYS PLC | 3,904 | 1.443 | 5,633.470 | |
| | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 208 | 3.442 | 715.930 | |
| | BT GROUP PLC | 1,778 | 1.277 | 2,270.500 | |
| | BUNZL PLC | 94 | 27.780 | 2,611.320 | |
| | AVIVA PLC | 786 | 4.083 | 3,209.230 | |
| | CRODA INTERNATIONAL | 30 | 64.960 | 1,948.800 | |
| | DIAGEO PLC | 547 | 36.615 | 20,028.400 | |
| | SCHRODERS PLC | 229 | 3.783 | 866.300 | |
| | DCC PLC | 22 | 48.050 | 1,057.100 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 873 | 9.044 | 7,895.410 | |
| | KINGFISHER PLC | 277 | 2.030 | 562.310 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 790 | 8.096 | 6,395.840 | |
| | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 519 | 33.035 | 17,145.160 | |
| | HALMA PLC | 74 | 20.440 | 1,512.560 | |
| | NEXT PLC | 27 | 47.590 | 1,284.930 | |
| | IMPERIAL BRANDS PLC | 220 | 20.260 | 4,457.200 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 52 | 18.870 | 981.240 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 323 | 26.300 | 8,494.900 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 452 | 18.120 | 8,190.240 | |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 4,794 | 4.740 | 22,723.560 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 1,632 | 2.280 | 3,720.960 | |
| | UNILEVER PLC | 614 | 38.995 | 23,942.930 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 165 | 8.988 | 1,483.020 | |
| | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 76 | 13.220 | 1,004.720 | |
| | PEARSON PLC | 156 | 8.898 | 1,388.080 | |
| | PERSIMMON PLC | 64 | 12.330 | 789.120 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 649 | 8.930 | 5,795.570 | |
| | RIO TINTO PLC | 263 | 47.330 | 12,447.790 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 6,068 | 1.011 | 6,134.740 | |
| | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 176 | 59.120 | 10,405.120 | |

| | | | | |
|------------------------------|--------|---------|------------|--|
| RELX PLC | 486 | 22.230 | 10,803.780 | |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 440 | 5.074 | 2,232.560 | |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC | 2,163 | 0.740 | 1,600.620 | |
| NATWEST GROUP PLC | 1,472 | 2.311 | 3,401.790 | |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 100 | 9.936 | 993.600 | |
| SSE PLC | 234 | 14.780 | 3,458.520 | |
| BP PLC | 4,590 | 4.552 | 20,893.680 | |
| SAGE GROUP PLC(THE) | 255 | 7.014 | 1,788.570 | |
| SMITHS GROUP PLC | 111 | 15.335 | 1,702.180 | |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 14 | 106.000 | 1,484.000 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 631 | 5.602 | 3,534.860 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 15,801 | 0.406 | 6,415.200 | |
| TAYLOR WIMPLEY PLC | 1,208 | 0.887 | 1,071.490 | |
| TESCO PLC | 1,834 | 2.050 | 3,759.700 | |
| 3I GROUP PLC | 267 | 10.975 | 2,930.320 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 195 | 10.005 | 1,950.970 | |
| GSK PLC | 1,019 | 13.822 | 14,084.610 | |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 81 | 74.600 | 6,042.600 | |
| WPP PLC | 274 | 7.492 | 2,052.800 | |
| ASTRAZENECA PLC | 374 | 98.090 | 36,685.660 | |
| WHITBREAD PLC | 63 | 25.480 | 1,605.240 | |
| INTERTEK GROUP PLC | 49 | 37.240 | 1,824.760 | |
| BURBERRY GROUP PLC | 83 | 18.600 | 1,543.800 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 44 | 45.560 | 2,004.640 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 302 | 1.829 | 552.350 | |
| ADMIRAL GROUP PLC | 59 | 19.485 | 1,149.610 | |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 34 | 33.730 | 1,146.820 | |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 43 | 12.330 | 530.190 | |
| AVEVA GROUP PLC | 29 | 31.500 | 913.500 | |
| ABRDN PLC | 765 | 1.444 | 1,104.660 | |
| EXPERIAN PLC | 235 | 26.760 | 6,288.600 | |
| MONDI PLC | 125 | 14.415 | 1,801.870 | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 117 | 7.652 | 895.280 | |
| OCADO GROUP PLC | 126 | 4.780 | 602.280 | |
| INFORMA PLC | 294 | 5.566 | 1,636.400 | |
| GLENCORE PLC | 2,486 | 4.730 | 11,758.780 | |
| ENTAIN PLC | 153 | 11.540 | 1,765.620 | |
| COCA-COLA HBC AG | 32 | 19.595 | 627.040 | |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 130 | 5.384 | 699.920 | |
| FERGUSON PLC | 47 | 92.880 | 4,365.360 | |
| M&G PLC | 858 | 1.761 | 1,510.930 | |
| JD SPORTS FASHION PLC | 595 | 0.984 | 585.480 | |
| HALEON PLC | 1,274 | 2.669 | 3,400.300 | |
| SHELL PLC | 1,792 | 22.730 | 40,732.160 | |

| | | | | | |
|---------------------|--|---------|-----------|-----------------------------|--|
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 100 | 18.270 | 1,827.000 | |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 284 | 5.178 | 1,470.550 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 1,427 | 1.037 | 1,479.790 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | 69,189 | | 412,557.330 (69,313,757) | |
| イスラエル・ シュケル | BANK HAPOALIM BM | 318 | 32.170 | 10,230.060 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL BM | 429 | 32.390 | 13,895.310 | |
| | BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 171 | 6.120 | 1,046.520 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 5 | 735.000 | 3,675.000 | |
| | TOWER SEMICONDUCTOR LTD | 25 | 151.000 | 3,775.000 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK LTD | 247 | 18.700 | 4,618.900 | |
| | ICL GROUP LTD | 193 | 30.390 | 5,865.270 | |
| | NICE LTD | 16 | 679.900 | 10,878.400 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 48 | 128.400 | 6,163.200 | |
| AZRIELI GROUP | 17 | 257.000 | 4,369.000 | | |
| イスラエル・シュケル 小計 | | 1,469 | | 64,516.660 (2,733,474) | |
| オーストラリ ア・ドル | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 50 | 58.310 | 2,915.500 | |
| | AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 720 | 25.830 | 18,597.600 | |
| | WESTPAC BANKING CORPORATION | 845 | 23.650 | 19,984.250 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 426 | 17.210 | 7,331.460 | |
| | TELSTRA CORP LTD | 956 | 3.880 | 3,709.280 | |
| | ASX LTD | 48 | 67.080 | 3,219.840 | |
| | BHP GROUP LTD | 1,224 | 39.250 | 48,042.000 | |
| | AMPOL LTD | 49 | 30.690 | 1,503.810 | |
| | COMPUTERSHARE LT | 150 | 25.210 | 3,781.500 | |
| | CSL LIMITED | 117 | 276.960 | 32,404.320 | |
| | REA GROUP LTD | 17 | 119.850 | 2,037.450 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 756 | 12.680 | 9,586.080 | |
| | COCHLEAR LTD | 14 | 201.340 | 2,818.760 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 315 | 5.640 | 1,776.600 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 417 | 100.480 | 41,900.160 | |
| | RIO TINTO LIMITED | 98 | 94.010 | 9,212.980 | |
| | APA GROUP | 357 | 9.880 | 3,527.160 | |
| | ARISTOCRAT LEISU | 148 | 35.740 | 5,289.520 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 522 | 4.890 | 2,552.580 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 119 | 33.160 | 3,946.040 | |
| ORICA LTD | 100 | 13.730 | 1,373.000 | | |
| LEND LEASE CORP LTD | 207 | 8.250 | 1,707.750 | | |

| | | | | | |
|--------------------------------------|-----------------------------|---------|-----------------------------|------------|--|
| BLUESCOPE STEEL LTD | 133 | 16.400 | 2,181.200 | | |
| MACQUARIE GROUP LTD | 88 | 162.340 | 14,285.920 | | |
| SUNCORP GROUP LTD | 321 | 10.630 | 3,412.230 | | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 757 | 31.660 | 23,966.620 | | |
| NEWCREST MINING LTD | 195 | 17.400 | 3,393.000 | | |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 136 | 6.000 | 816.000 | | |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 428 | 12.020 | 5,144.560 | | |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 333 | 8.030 | 2,673.990 | | |
| REECE LTD | 101 | 14.940 | 1,508.940 | | |
| SANTOS LTD | 759 | 7.380 | 5,601.420 | | |
| SONIC HEALTHCARE | 85 | 31.050 | 2,639.250 | | |
| WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD | 40 | 27.350 | 1,094.000 | | |
| WESFARMERS LTD | 285 | 44.680 | 12,733.800 | | |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 437 | 32.550 | 14,224.350 | | |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 273 | 33.450 | 9,131.850 | | |
| SEEK LTD | 81 | 21.120 | 1,710.720 | | |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD | 16 | 60.740 | 971.840 | | |
| MINERAL RESOURCES LTD | 45 | 72.290 | 3,253.050 | | |
| BRAMBLES LTD | 288 | 11.540 | 3,323.520 | | |
| EVOLUTION MINING LTD | 356 | 2.010 | 715.560 | | |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 267 | 3.580 | 955.860 | | |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 186 | 13.050 | 2,427.300 | | |
| XERO LTD | 41 | 76.420 | 3,133.220 | | |
| IDP EDUCATION LTD | 49 | 29.280 | 1,434.720 | | |
| LOTTERY CORP LTD | 433 | 4.140 | 1,792.620 | | |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA | 402 | 7.290 | 2,930.580 | | |
| MEDIBANK PVT LTD | 807 | 3.505 | 2,828.530 | | |
| SOUTH32 LTD(AUD) | 1,072 | 3.770 | 4,041.440 | | |
| COLES GROUP LTD | 354 | 16.550 | 5,858.700 | | |
| WISETECH GLOBAL LTD | 39 | 57.740 | 2,251.860 | | |
| オーストラリア・ドル 小計 | 16,462 | | 367,654.290 (34,511,708) | | |
| カナダ・ドル | AGNICO EAGLE MINES LTD | 97 | 55.620 | 5,395.140 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 421 | 19.910 | 8,382.110 | |
| | BANK OF MONTREAL | 157 | 120.920 | 18,984.440 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 287 | 64.890 | 18,623.430 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 84 | 88.280 | 7,415.520 | |
| | BCE INC | 8 | 59.130 | 473.040 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT | 350 | 53.370 | 18,679.500 | |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 71 | 8.730 | 619.830 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|-----|---------|------------|--|
| SAPUTO INC | 38 | 31.650 | 1,202.700 | |
| BLACKBERRY LTD | 197 | 5.840 | 1,150.480 | |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO | 122 | 14.550 | 1,775.100 | |
| CGI INC | 57 | 105.070 | 5,988.990 | |
| CCL INDUSTRIES INC | 36 | 65.560 | 2,360.160 | |
| CAE INC | 67 | 23.630 | 1,583.210 | |
| CAMECO CORP | 90 | 31.410 | 2,826.900 | |
| ROGERS COMM-CL B | 73 | 52.870 | 3,859.510 | |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 208 | 59.070 | 12,286.560 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 270 | 76.220 | 20,579.400 | |
| CANADIAN TIRE CORP-CL A | 11 | 150.170 | 1,651.870 | |
| CANADIAN UTILITIES LTD | 43 | 34.590 | 1,487.370 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 143 | 155.520 | 22,239.360 | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 53 | 42.750 | 2,265.750 | |
| OPEN TEXT CORP | 77 | 37.460 | 2,884.420 | |
| EMPIRE CO LTD | 48 | 34.030 | 1,633.440 | |
| KINROSS GOLD CORP | 311 | 4.590 | 1,427.490 | |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC | 33 | 87.450 | 2,885.850 | |
| FORTIS INC | 102 | 51.370 | 5,239.740 | |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 146 | 23.000 | 3,358.000 | |
| TELUS CORP | 88 | 27.900 | 2,455.200 | |
| GREAT WEST LIFECO INC | 70 | 29.770 | 2,083.900 | |
| IMPERIAL OIL LTD | 61 | 67.060 | 4,090.660 | |
| ENBRIDGE INC | 507 | 51.350 | 26,034.450 | |
| IGM FINANCIAL INC | 35 | 36.150 | 1,265.250 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 501 | 21.930 | 10,986.930 | |
| LOBLAW CO LTD | 45 | 109.040 | 4,906.800 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 204 | 57.070 | 11,642.280 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 73 | 70.040 | 5,112.920 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 143 | 56.250 | 8,043.750 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 6 | 622.350 | 3,734.100 | |
| METRO INC | 56 | 69.340 | 3,883.040 | |
| EMERA INC | 58 | 51.680 | 2,997.440 | |
| ONEX CORP | 13 | 66.510 | 864.630 | |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 73 | 21.090 | 1,539.570 | |
| POWER CORP OF CANADA | 133 | 32.250 | 4,289.250 | |
| QUEBECOR INC-B | 38 | 24.480 | 930.240 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 348 | 123.280 | 42,901.440 | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 222 | 97.560 | 21,658.320 | |
| SHAW COMM INC-B | 132 | 33.750 | 4,455.000 | |
| SUNCOR ENERGY INC | 355 | 43.500 | 15,442.500 | |

| | | | | |
|--|--------|-----------|-----------------------------|--|
| LUNDIN MINING CORP | 208 | 6.630 | 1,379.040 | |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 114 | 45.030 | 5,133.420 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 48 | 140.290 | 6,733.920 | |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 19 | 99.460 | 1,889.740 | |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$ | 434 | 85.710 | 37,198.140 | |
| TC ENERGY CORP | 243 | 58.450 | 14,203.350 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 19 | 98.690 | 1,875.110 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 16 | 144.890 | 2,318.240 | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 43 | 195.830 | 8,420.690 | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 116 | 42.790 | 4,963.640 | |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 5 | 1,840.060 | 9,200.300 | |
| FRANCO-NEVADA CORP NPR | 49 | 161.670 | 7,921.830 | |
| TOURMALINE OIL CORP | 84 | 75.000 | 6,300.000 | |
| KEYERA CORP | 42 | 28.560 | 1,199.520 | |
| PARKLAND CORP | 41 | 27.450 | 1,125.450 | |
| ALTAGAS LTD | 79 | 25.390 | 2,005.810 | |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 142 | 43.940 | 6,239.480 | |
| DOLLARAMA INC | 67 | 80.220 | 5,374.740 | |
| CENOVUS ENERGY INC W/I | 358 | 24.430 | 8,745.940 | |
| ARC RESOURCES LTD | 171 | 18.100 | 3,095.100 | |
| NORTHLAND POWER INC | 57 | 38.130 | 2,173.410 | |
| TMX GROUP LTD | 17 | 129.330 | 2,198.610 | |
| BRP INC | 7 | 83.840 | 586.880 | |
| IVANHOE MINES LTD | 210 | 8.630 | 1,812.300 | |
| NUTRIEN LTD | 128 | 112.440 | 14,392.320 | |
| TFI INTERNATIONAL INC | 19 | 131.450 | 2,497.550 | |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC | 29 | 23.850 | 691.650 | |
| WSP GLOBAL INC | 32 | 153.500 | 4,912.000 | |
| IA FINANCIAL CORP INC | 34 | 73.740 | 2,507.160 | |
| GFL ENVIRONMENTAL INC | 58 | 35.250 | 2,044.500 | |
| NUVEI CORP | 14 | 36.010 | 504.140 | |
| BROOKFIELD RENEWABLE CORP | 18 | 42.370 | 762.660 | |
| AIR CANADA | 21 | 18.050 | 379.050 | |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 61 | 76.790 | 4,684.190 | |
| SHOPIFY INC | 280 | 39.040 | 10,931.200 | |
| FIRSTSERVICE CORP | 9 | 163.230 | 1,469.070 | |
| HYDRO ONE LTD | 74 | 31.530 | 2,333.220 | |
| カナダ・ドル 小計 | 10,127 | | 546,780.350 (59,544,380) | |
| シンガポール・ ドル | | | | |
| SINGAPORE TECH ENG | 300 | 3.260 | 978.000 | |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 500 | 32.850 | 16,425.000 | |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 200 | 8.470 | 1,694.000 | |

| | | | | | |
|---------|--|-------|-----------|---------------------------|--|
| | GENTING SINGAPORE LTD | 2,300 | 0.775 | 1,782.500 | |
| | KEPPEL CORP LTD | 300 | 6.620 | 1,986.000 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 800 | 11.640 | 9,312.000 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 2,100 | 2.460 | 5,166.000 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 400 | 5.050 | 2,020.000 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 300 | 26.270 | 7,881.000 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 100 | 6.110 | 611.000 | |
| | VENTURE CORP LTD | 100 | 16.000 | 1,600.000 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 300 | 3.550 | 1,065.000 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE | 600 | 3.180 | 1,908.000 | |
| | シンガポール・ドル 小計 | 8,300 | | 52,428.500 (5,518,624) | |
| スイス・フラン | CREDIT SUISSE GROUP AG | 688 | 4.626 | 3,182.680 | |
| | LOGITECH INTL-REG | 39 | 43.950 | 1,714.050 | |
| | NESTLE SA-REGISTERED | 676 | 106.400 | 71,926.400 | |
| | CIE FINANC RICHEMONT | 130 | 100.000 | 13,000.000 | |
| | ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN | 170 | 326.000 | 55,420.000 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 7 | 160.550 | 1,123.850 | |
| | SIKA INHABER | 35 | 219.900 | 7,696.500 | |
| | SGS SA-REG | 1 | 2,129.000 | 2,129.000 | |
| | NOVARTIS AG-REG SHS | 533 | 76.780 | 40,923.740 | |
| | BALOISE HOLDING AG -R | 8 | 133.100 | 1,064.800 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG | 1 | 1,854.000 | 1,854.000 | |
| | CLARIANT AG-REG | 69 | 16.660 | 1,149.540 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 6 | 456.400 | 2,738.400 | |
| | ABB LTD | 397 | 26.760 | 10,623.720 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 44 | 29.590 | 1,301.960 | |
| | GEBERIT AG | 7 | 436.300 | 3,054.100 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 18 | 490.600 | 8,830.800 | |
| | LINDT & SPRUENGLI PART | 1 | 9,590.000 | 9,590.000 | |
| | GIVAUDAN-REG | 2 | 2,920.000 | 5,840.000 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 37 | 416.600 | 15,414.200 | |
| | ROCHE HOLDING AG-BEARER | 7 | 392.000 | 2,744.000 | |
| | HOLCIM LTD | 133 | 42.400 | 5,639.200 | |
| | TEMENOS GROUP | 21 | 53.620 | 1,126.020 | |
| | BACHEM HOLDING AG | 5 | 72.500 | 362.500 | |
| | SONOVA HOLDING AG | 13 | 228.900 | 2,975.700 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG | 14 | 207.500 | 2,905.000 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG | 30 | 95.400 | 2,862.000 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 6 | 232.500 | 1,395.000 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 10 | 43.240 | 432.400 | |
| | SCHINDLER NAMEN | 6 | 156.000 | 936.000 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 8 | 462.900 | 3,703.200 | |

| | | | | | |
|-----------------|---------------------------------|-------|---------|-----------------------------|--|
| | EMS-CHEMIE HOLDING | 2 | 649.000 | 1,298.000 | |
| | SWISS PRIME SITE AG | 12 | 79.150 | 949.800 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 5 | 825.400 | 4,127.000 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 62 | 44.870 | 2,781.940 | |
| | SWISS RE LTD | 78 | 74.400 | 5,803.200 | |
| | SIG GROUP AG | 50 | 19.810 | 990.500 | |
| | ALCON INC | 113 | 58.840 | 6,648.920 | |
| | UBS GROUP AG | 875 | 14.865 | 13,006.870 | |
| | VAT GROUP AG | 7 | 210.200 | 1,471.400 | |
| スイス・フラン | 小計 | 4,326 | | 320,736.390 (47,841,040) | |
| スウェーデン・ クローナ | ATLAS COPCO AB-A SHS | 624 | 108.700 | 67,828.800 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 375 | 98.270 | 36,851.250 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 714 | 72.190 | 51,543.660 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 49 | 201.800 | 9,888.200 | |
| | INVESTOR AB-A SHS | 102 | 178.300 | 18,186.600 | |
| | LUNDBERGS B | 9 | 413.200 | 3,718.800 | |
| | SKF AB-B SHS | 53 | 167.000 | 8,851.000 | |
| | SANDVIK AB | 292 | 165.800 | 48,413.600 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 379 | 116.850 | 44,286.150 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 112 | 145.550 | 16,301.600 | |
| | SWEDBANK AB | 230 | 159.150 | 36,604.500 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | 143 | 144.900 | 20,720.700 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 365 | 103.250 | 37,686.250 | |
| | VOLVO AB-A SHS | 47 | 183.100 | 8,605.700 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 362 | 175.960 | 63,697.520 | |
| | HOLMEN AB-B SHS | 28 | 436.400 | 12,219.200 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 413 | 110.300 | 45,553.900 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 145 | 89.240 | 12,939.800 | |
| | INDUSTRIVARDEN A | 19 | 235.300 | 4,470.700 | |
| | INDUSTRIVARDEN C | 40 | 234.000 | 9,360.000 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 58 | 122.660 | 7,114.280 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 101 | 85.400 | 8,625.400 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 471 | 171.200 | 80,635.200 | |
| | HENNES&MAURITZ AB-B SHS | 211 | 113.800 | 24,011.800 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 244 | 214.200 | 52,264.800 | |
| | TELIA CO AB | 640 | 32.460 | 20,774.400 | |
| | BOLIDEN AB | 76 | 359.500 | 27,322.000 | |
| | ALFA LAVAL AB | 73 | 280.600 | 20,483.800 | |
| | KINNEVIK AB-B | 83 | 133.000 | 11,039.000 | |
| | FASTIGHETS AB BALDER | 144 | 39.670 | 5,712.480 | |
| | INDUTRADE AB | 76 | 179.900 | 13,672.400 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 141 | 63.760 | 8,990.160 | |
| | NIBE INDUSTRIER AB | 342 | 86.320 | 29,521.440 | |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|---------|------------|-------------------------------|--|
| | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 41 | 209.400 | 8,585.400 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 473 | 105.850 | 50,067.050 | |
| | SAGAX AB | 60 | 180.350 | 10,821.000 | |
| | EPIROC AB-A | 166 | 168.000 | 27,888.000 | |
| | EPIROC AB-B | 117 | 145.600 | 17,035.200 | |
| | ESSITY AB-B | 157 | 222.300 | 34,901.100 | |
| | EQT AB | 78 | 198.400 | 15,475.200 | |
| | EMBRACER GROUP AB | 154 | 55.400 | 8,531.600 | |
| | VOLVO CAR AB | 144 | 45.005 | 6,480.720 | |
| | LIFCO AB | 43 | 152.300 | 6,548.900 | |
| | EVOLUTION AB | 46 | 924.000 | 42,504.000 | |
| | NORDEA BANK ABP | 810 | 103.500 | 83,835.000 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR | 23 | 178.300 | 4,100.900 | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | | 9,473 | | 1,184,669.160 (15,803,487) | |
| デンマーク・クローネ | CARLSBERG AS-B | 20 | 913.800 | 18,276.000 | |
| | A P MOLLER A/S | 1 | 15,215.000 | 15,215.000 | |
| | AP MOLLER MAERSK A | 1 | 14,530.000 | 14,530.000 | |
| | DANSKE BANK A/S | 124 | 101.050 | 12,530.200 | |
| | GENMAB A/S | 16 | 2,801.000 | 44,816.000 | |
| | NOVOZYMES-B SHS | 48 | 373.900 | 17,947.200 | |
| | ROCKWOOL AS | 2 | 1,357.500 | 2,715.000 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 401 | 799.200 | 320,479.200 | |
| | GN STORE NORD A/S | 38 | 149.800 | 5,692.400 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 249 | 144.380 | 35,950.620 | |
| | COLOPLAST-B | 31 | 801.000 | 24,831.000 | |
| | DSV A/S | 44 | 946.800 | 41,659.200 | |
| | DEMANT A/S | 33 | 200.700 | 6,623.100 | |
| | TRYG A/S | 84 | 157.450 | 13,225.800 | |
| | PANDORA A/S | 24 | 389.700 | 9,352.800 | |
| | CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 27 | 425.000 | 11,475.000 | |
| ORSTED A/S | 47 | 594.500 | 27,941.500 | | |
| デンマーク・クローネ 小計 | | 1,190 | | 623,260.020 (12,271,990) | |
| ニュージーランド・ドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 345 | 7.210 | 2,487.450 | |
| | FISHER & PAYKEL | 148 | 19.600 | 2,900.800 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 595 | 5.155 | 3,067.220 | |
| | MIGHTY RIVER POWER LTD | 87 | 5.200 | 452.400 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 456 | 4.520 | 2,061.120 | |
| ニュージーランド・ドル 小計 | | 1,631 | | 10,968.990 (931,487) | |
| ノルウェー・クローネ | MOWI ASA | 113 | 137.950 | 15,588.350 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 358 | 60.200 | 21,551.600 | |
| | TELENOR ASA | 162 | 93.000 | 15,066.000 | |

| | | | | | |
|-----|--------------------------------|-------|---------|----------------------------|--|
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 26 | 357.400 | 9,292.400 | |
| | ORKLA ASA | 236 | 78.140 | 18,441.040 | |
| | EQUINOR ASA | 235 | 359.100 | 84,388.500 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 33 | 426.600 | 14,077.800 | |
| | AKER BP ASA | 61 | 306.400 | 18,690.400 | |
| | SALMAR ASA | 11 | 324.000 | 3,564.000 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 24 | 195.000 | 4,680.000 | |
| | ADEVINTA ASA | 72 | 73.800 | 5,313.600 | |
| | DNB BANK ASA | 229 | 186.000 | 42,594.000 | |
| | ノルウェー・クローネ 小計 | 1,560 | | 253,247.690 (3,570,792) | |
| ユーロ | CRH PLC | 198 | 34.370 | 6,805.260 | |
| | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 36 | 121.050 | 4,357.800 | |
| | KERRY GROUP PLC-A | 44 | 88.960 | 3,914.240 | |
| | KINGSPAN GROUP PLC | 39 | 49.830 | 1,943.370 | |
| | UMICORE | 47 | 31.930 | 1,500.710 | |
| | AIR LIQUIDE | 130 | 120.960 | 15,724.800 | |
| | AIRBUS SE | 143 | 100.880 | 14,425.840 | |
| | AXA SA | 472 | 24.495 | 11,561.640 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 130 | 21.430 | 2,785.900 | |
| | ADIDAS AG | 43 | 115.680 | 4,974.240 | |
| | ASSICURAZIONI GENERALI | 277 | 14.655 | 4,059.430 | |
| | DASSAULT AVIATION SA | 2 | 141.700 | 283.400 | |
| | DANONE | 153 | 48.090 | 7,357.770 | |
| | SAFRAN SA | 88 | 106.040 | 9,331.520 | |
| | INTESA SANPAOLO | 3,928 | 1.791 | 7,035.040 | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 76 | 77.660 | 5,902.160 | |
| | ACCOR SA | 56 | 22.500 | 1,260.000 | |
| | BOUYGUES | 48 | 27.370 | 1,313.760 | |
| | BNP PARIBAS | 272 | 45.915 | 12,488.880 | |
| | THALES SA | 26 | 116.000 | 3,016.000 | |
| | CAPGEMINI SA | 42 | 162.900 | 6,841.800 | |
| | UNICREDIT SPA | 473 | 11.204 | 5,299.490 | |
| | D'IETTEREN TRDG | 6 | 157.800 | 946.800 | |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 44 | 120.100 | 5,284.400 | |
| | COMMERZBANK AG | 231 | 7.890 | 1,822.590 | |
| | EIFFAGE | 13 | 84.460 | 1,097.980 | |
| | FRESENIUS SE & CO KGAA | 117 | 21.630 | 2,530.710 | |
| | UNITED INTERNET | 42 | 19.085 | 801.570 | |
| | PUBLICIS GROUPE | 63 | 56.980 | 3,589.740 | |
| | IBERDROLA SA | 1,370 | 9.554 | 13,088.980 | |
| | ENI SPA | 623 | 11.866 | 7,392.510 | |
| | JERONIMO MARTINS | 86 | 19.770 | 1,700.220 | |
| | KESKO OYJ-B | 72 | 18.820 | 1,355.040 | |
| | KBC GROUPE | 68 | 49.080 | 3,337.440 | |
| | HANNOVER RUECK SE | 14 | 156.050 | 2,184.700 | |

| | | | | |
|--|-------|---------|------------|--|
| WARTSILA OYJ | 111 | 7.328 | 813.400 | |
| L'OREAL | 59 | 327.600 | 19,328.400 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 68 | 625.000 | 42,500.000 | |
| GEA GROUP AG | 20 | 34.320 | 686.400 | |
| BOLLORE | 224 | 4.844 | 1,085.050 | |
| MEDIOBANCA SPA | 168 | 8.416 | 1,413.880 | |
| MICHELIN(CGDE) -B | 164 | 23.300 | 3,821.200 | |
| CONTINENTAL AG | 25 | 49.770 | 1,244.250 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 225 | 34.345 | 7,727.620 | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 79 | 17.920 | 1,415.680 | |
| OMV AG | 35 | 40.110 | 1,403.850 | |
| VERBUND AG | 22 | 80.100 | 1,762.200 | |
| PERNOD-RICARD | 51 | 180.000 | 9,180.000 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD | 46 | 57.780 | 2,657.880 | |
| RENAULT SA | 25 | 32.035 | 800.870 | |
| REPSOL SA | 386 | 12.930 | 4,990.980 | |
| REMY COINTREAU | 3 | 163.000 | 489.000 | |
| MERCK KGAA | 31 | 163.850 | 5,079.350 | |
| COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN | 130 | 39.440 | 5,127.200 | |
| RWE AG | 143 | 37.960 | 5,428.280 | |
| SEB SA | 9 | 62.250 | 560.250 | |
| SOCIETE GENERALE-A | 211 | 22.535 | 4,754.880 | |
| VINCI S.A. | 131 | 86.550 | 11,338.050 | |
| SODEXO | 26 | 84.820 | 2,205.320 | |
| SOFINA | 3 | 187.500 | 562.500 | |
| SOLVAY SA | 18 | 88.380 | 1,590.840 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 133 | 125.460 | 16,686.180 | |
| VIVENDI SE | 221 | 8.134 | 1,797.610 | |
| SAP SE | 251 | 89.160 | 22,379.160 | |
| TELEFONICA S.A | 1,318 | 3.396 | 4,475.920 | |
| TOTALENERGIES SE | 602 | 52.610 | 31,671.220 | |
| VALEO | 78 | 16.950 | 1,322.100 | |
| E.ON SE | 505 | 8.052 | 4,066.260 | |
| VOEST-ALPINE AG | 26 | 20.140 | 523.640 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 31 | 59.450 | 1,842.950 | |
| SIEMENS AG-REG | 191 | 107.980 | 20,624.180 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 138 | 34.640 | 4,780.320 | |
| ING GROEP NV-CVA | 937 | 9.539 | 8,938.040 | |
| PUMA AG | 29 | 46.810 | 1,357.490 | |
| BAYER AG | 243 | 49.750 | 12,089.250 | |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 169 | 13.930 | 2,354.170 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 45 | 63.280 | 2,847.600 | |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 197 | 57.470 | 11,321.590 | |
| BASF SE | 209 | 45.050 | 9,415.450 | |

| | | | | |
|------------------------------------|-------|-----------|------------|--|
| BEIERSDORF AG | 20 | 99.700 | 1,994.000 | |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 37 | 43.860 | 1,622.820 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 58 | 28.120 | 1,630.960 | |
| ASM INTERNATIONAL NV | 12 | 244.450 | 2,933.400 | |
| ORANGE | 527 | 9.526 | 5,020.200 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 128 | 45.440 | 5,816.320 | |
| RANDSTAD NV | 32 | 46.390 | 1,484.480 | |
| ALLIANZ SE | 101 | 172.380 | 17,410.380 | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 792 | 4.256 | 3,370.750 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 265 | 27.665 | 7,331.220 | |
| HERMES INTL | 8 | 1,305.000 | 10,440.000 | |
| ENDESA S.A. | 51 | 15.045 | 767.290 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 188 | 6.757 | 1,270.310 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 95 | 24.610 | 2,337.950 | |
| MUENCHENER RUECKVER AG- REG | 36 | 251.600 | 9,057.600 | |
| ARCELOR MITTAL (NL) | 120 | 22.080 | 2,649.600 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 169 | 34.260 | 5,789.940 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 78 | 23.840 | 1,859.520 | |
| RHEINMETALL STAMM | 11 | 150.350 | 1,653.850 | |
| HEINEKEN NV | 67 | 87.640 | 5,871.880 | |
| AKZO NOBEL | 41 | 61.660 | 2,528.060 | |
| ASML HOLDING NV | 99 | 436.500 | 43,213.500 | |
| AEGON NV | 404 | 4.227 | 1,707.700 | |
| VOLKSWAGEN AG | 5 | 168.800 | 844.000 | |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 45 | 129.860 | 5,843.700 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 1,467 | 4.965 | 7,283.650 | |
| KERING | 18 | 459.000 | 8,262.000 | |
| ACCIONA S.A. | 4 | 167.400 | 669.600 | |
| FORTUM OYJ | 90 | 13.905 | 1,251.450 | |
| AGEAS | 50 | 40.110 | 2,005.500 | |
| UCB SA | 35 | 74.320 | 2,601.200 | |
| NEMETSCHEK SE | 12 | 47.840 | 574.080 | |
| CARREFOUR SA | 136 | 15.255 | 2,074.680 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 15 | 24.020 | 360.300 | |
| NOKIA OYJ | 1,278 | 4.747 | 6,066.660 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 181 | 13.484 | 2,440.600 | |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 67 | 101.300 | 6,787.100 | |
| SANOFI | 275 | 80.930 | 22,255.750 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 169 | 32.805 | 5,544.040 | |
| ELISA OYJ | 33 | 48.000 | 1,584.000 | |
| BANCO SANTANDER SA | 4,420 | 2.634 | 11,642.280 | |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 72 | 15.310 | 1,102.320 | |
| QIAGEN N.V. | 53 | 43.650 | 2,313.450 | |

| | | | | |
|--------------------------------|-------|---------|------------|--|
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 482 | 8.887 | 4,283.530 | |
| BMW VORZUG | 19 | 72.950 | 1,386.050 | |
| ENEL SPA | 1,958 | 4.283 | 8,386.110 | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 810 | 18.230 | 14,766.300 | |
| SARTORIUS AG | 7 | 315.700 | 2,209.900 | |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 27 | 26.580 | 717.660 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 315 | 24.770 | 7,802.550 | |
| RATIONAL AG | 1 | 552.000 | 552.000 | |
| CARL ZEISS MEDITEC AG | 12 | 113.250 | 1,359.000 | |
| BECHTLE AG | 21 | 33.560 | 704.760 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 888 | 2.782 | 2,470.410 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 38 | 61.500 | 2,337.000 | |
| TELEPERFORMANCE | 14 | 264.100 | 3,697.400 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 47 | 163.300 | 7,675.100 | |
| EURAZEO | 11 | 54.750 | 602.250 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 27 | 73.100 | 1,973.700 | |
| HEINEKEN HOLDING NV-A | 16 | 70.000 | 1,120.000 | |
| INDITEX | 303 | 22.730 | 6,887.190 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 66 | 157.150 | 10,371.900 | |
| SNAM SPA | 513 | 4.227 | 2,168.450 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 292 | 8.841 | 2,581.570 | |
| ENAGAS | 11 | 15.200 | 167.200 | |
| WENDEL | 13 | 77.100 | 1,002.300 | |
| TENARIS SA | 138 | 14.705 | 2,029.290 | |
| TELECOM ITALIA SPA | 1,698 | 0.188 | 319.220 | |
| ATLANTIA SPA | 119 | 22.510 | 2,678.690 | |
| PROXIMUS | 39 | 9.582 | 373.690 | |
| TERNA SPA | 287 | 6.208 | 1,781.690 | |
| BIOMERIEUX | 11 | 85.380 | 939.180 | |
| GRIFOLS SA | 92 | 8.380 | 770.960 | |
| FERROVIAL SA | 136 | 23.980 | 3,261.280 | |
| NESTE OYJ | 100 | 44.890 | 4,489.000 | |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP | 9,000 | 0.000 | 0.000 | |
| RECORDATI SPA | 33 | 35.950 | 1,186.350 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 89 | 8.806 | 783.730 | |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG | 11 | 173.550 | 1,909.050 | |
| KONE OYJ | 74 | 40.300 | 2,982.200 | |
| ELIA GROUP | 4 | 119.100 | 476.400 | |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 8 | 290.000 | 2,320.000 | |
| ENGIE | 418 | 12.258 | 5,123.840 | |
| ALSTOM | 87 | 19.150 | 1,666.050 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 75 | 11.930 | 894.750 | |
| IPSEN SA | 5 | 103.100 | 515.500 | |
| ARKEMA SA | 14 | 77.680 | 1,087.520 | |
| LEGRAND SA | 66 | 72.840 | 4,807.440 | |
| AMPLIFON SPA | 27 | 25.640 | 692.280 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|-------|---------|------------|--|
| ADP | 10 | 127.800 | 1,278.000 | |
| ORION OYJ | 14 | 43.290 | 606.060 | |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 92 | 9.694 | 891.840 | |
| SYMRISE AG | 30 | 98.640 | 2,959.200 | |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 60 | 32.240 | 1,934.400 | |
| PRYSMIAN SPA | 62 | 31.990 | 1,983.380 | |
| DIASORIN ITALIA SPA | 3 | 126.000 | 378.000 | |
| CAIXABANK | 1,237 | 3.405 | 4,211.980 | |
| BUREAU VERITAS SA | 49 | 23.980 | 1,175.020 | |
| GETLINK | 123 | 15.735 | 1,935.400 | |
| EDP RENOVAVEIS SA | 78 | 20.130 | 1,570.140 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 122 | 49.810 | 6,076.820 | |
| BRENTAG SE | 39 | 58.820 | 2,293.980 | |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 66 | 18.515 | 1,221.990 | |
| EDENRED | 51 | 48.740 | 2,485.740 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 239 | 2.113 | 505.000 | |
| LEG IMMOBILIEN SE | 19 | 59.880 | 1,137.720 | |
| KION GROUP AG | 14 | 22.280 | 311.920 | |
| VONOVIA SE | 159 | 20.680 | 3,288.120 | |
| KNORR-BREMSE AG | 22 | 45.420 | 999.240 | |
| OCI NV | 29 | 41.380 | 1,200.020 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 65 | 44.840 | 2,914.600 | |
| FERRARI NV | 30 | 191.850 | 5,755.500 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 269 | 12.600 | 3,389.400 | |
| AROUNDTOWN SA | 287 | 1.900 | 545.300 | |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 25 | 31.580 | 789.500 | |
| MONCLER SPA | 60 | 46.330 | 2,779.800 | |
| NEXI SPA | 160 | 8.854 | 1,416.640 | |
| PROSUS NV | 211 | 50.710 | 10,699.810 | |
| DR ING HC F PORSCHE AG | 28 | 93.360 | 2,614.080 | |
| JDE PEET'S BV | 9 | 29.560 | 266.040 | |
| EXOR NV | 29 | 68.140 | 1,976.060 | |
| SIEMENS ENERGY AG | 92 | 11.310 | 1,040.520 | |
| EURONEXT NV | 16 | 62.660 | 1,002.560 | |
| IMCD NV | 12 | 120.900 | 1,450.800 | |
| WORLDLINE SA | 70 | 43.700 | 3,059.000 | |
| NN GROUP NV | 69 | 41.750 | 2,880.750 | |
| FINECOBANK SPA | 147 | 12.690 | 1,865.430 | |
| ARGENX SE | 12 | 374.100 | 4,489.200 | |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV | 169 | 18.932 | 3,199.500 | |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 117 | 26.035 | 3,046.090 | |
| ZALANDO SE | 43 | 23.060 | 991.580 | |
| STELLANTIS NV | 540 | 12.968 | 7,002.720 | |
| AENA SME SA | 17 | 107.550 | 1,828.350 | |
| CELLNEX TELECOM SAU | 134 | 29.520 | 3,955.680 | |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV | 60 | 15.508 | 930.480 | |

| | | | | | |
|--------|---|--------|-----------|------------------------------|--|
| | ABN AMRO BANK NV | 70 | 9.550 | 668.500 | |
| | SCOUT24 SE | 20 | 53.780 | 1,075.600 | |
| | COVESTRO AG | 43 | 35.250 | 1,515.750 | |
| | HELLOFRESH SE | 52 | 21.580 | 1,122.160 | |
| | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 202 | 46.660 | 9,425.320 | |
| | POSTE ITALIANE SPA | 150 | 8.350 | 1,252.500 | |
| | AMUNDI SA | 10 | 44.380 | 443.800 | |
| | INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA | 59 | 8.432 | 497.480 | |
| | ADYEN NV | 5 | 1,326.000 | 6,630.000 | |
| | DELIVERY HERO SE | 49 | 35.710 | 1,749.790 | |
| ユーロ 小計 | | 53,243 | | 962,068.980 (140,904,623) | |
| 香港・ドル | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 864 | 13.020 | 11,249.280 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 235 | 54.200 | 12,737.000 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 500 | 36.400 | 18,200.000 | |
| | HONG KONG EXCHANGES &CLEAR | 266 | 252.800 | 67,244.800 | |
| | MTR CORP | 403 | 34.900 | 14,064.700 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 200 | 118.800 | 23,760.000 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 86 | 21.450 | 1,844.700 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 67 | 37.050 | 2,482.350 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 1,515 | 6.520 | 9,877.800 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 537 | 40.950 | 21,990.150 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 1,184 | 26.300 | 31,139.200 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 890 | 18.820 | 16,749.800 | |
| | SINO LAND CO | 576 | 9.880 | 5,690.880 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 500 | 89.500 | 44,750.000 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 273 | 75.450 | 20,597.850 | |
| | CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD | 600 | 14.720 | 8,832.000 | |
| | AIA GROUP LTD | 2,951 | 68.000 | 200,668.000 | |
| | HKT TRUST / HKT LTD | 1,080 | 9.140 | 9,871.200 | |
| | SANDS CHINA LTD | 574 | 15.300 | 8,782.200 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 432 | 16.680 | 7,205.760 | |
| | ESR GROUP LTD | 600 | 17.740 | 10,644.000 | |
| | HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD | 500 | 5.000 | 2,500.000 | |
| | BUDWEISER BREWING CO APAC LTD | 500 | 18.940 | 9,470.000 | |
| | WH GROUP LTD | 1,500 | 4.700 | 7,050.000 | |

| | | | | | |
|-------|---------------------------|---------|--------|----------------------------------|--|
| | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 534 | 42.300 | 22,588.200 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 534 | 45.550 | 24,323.700 | |
| 香港・ドル | 小計 | 17,901 | | 614,313.570 (11,739,532) | |
| 合計 | | 278,092 | | 1,574,792,689 (1,574,792,689) | |

(2) 株式以外の有価証券

2022年10月20日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 | |
|-------------------------|-------------|--|-----------|------------|---------------------------|--|
| 投資信託受益証券 | オーストラリア・ドル | DEXUS | 286.000 | 2,207.920 | | |
| | | GOODMAN GROUP | 410.000 | 6,851.100 | | |
| | | GPT GROUP | 525.000 | 2,115.750 | | |
| | | MIRVAC GROUP | 1,078.000 | 2,102.100 | | |
| | | SCENTRE GROUP | 1,109.000 | 2,927.760 | | |
| | | STOCKLAND | 473.000 | 1,579.820 | | |
| | | VICINITY CENTRES | 700.000 | 1,260.000 | | |
| | | オーストラリア・ドル 小計 | | 4,581.000 | 19,044.450 (1,787,703) | |
| | シンガポール・ドル | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 1,079.000 | 1,952.990 | | |
| | | CAPLAND ASCENDAS REIT | 600.000 | 1,542.000 | | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 500.000 | 740.000 | | |
| | | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL | 200.000 | 320.000 | | |
| | | シンガポール・ドル 小計 | | 2,379.000 | 4,554.990 (479,458) | |
| | 投資信託受益証券 合計 | | | 6,960 | 2,267,161 (2,267,161) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 37.000 | 4,831.830 | | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT | 82.000 | 2,582.180 | | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 113.000 | 21,581.870 | | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 80.000 | 1,362.400 | | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 35.000 | 6,067.250 | | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 41.000 | 2,944.620 | | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 24.000 | 2,705.520 | | |
| | | CROWN CASTLE INC | 105.000 | 13,723.500 | | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 65.000 | 6,188.650 | | |
| | | EQUINIX INC | 22.000 | 11,561.440 | | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 45.000 | 2,642.850 | | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 80.000 | 5,090.400 | | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 18.000 | 4,088.160 | | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 30.000 | 4,977.600 | | | | |

| | | | | |
|----------|-----------------------------------|-----------|-----------------------------|--|
| | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 50.000 | 2,277.000 | |
| | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 96.000 | 1,825.920 | |
| | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 139.000 | 3,135.840 | |
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 154.000 | 2,699.620 | |
| | INVITATION HOMES INC | 160.000 | 5,200.000 | |
| | IRON MOUNTAIN INC | 60.000 | 2,774.400 | |
| | KIMCO REALTY | 151.000 | 2,884.100 | |
| | MEDICAL PROPERTIES TRUST | 125.000 | 1,375.000 | |
| | MID AMERICA | 29.000 | 4,280.690 | |
| | PROLOGIS INC | 229.000 | 23,360.290 | |
| | PUBLIC STORAGE | 40.000 | 11,636.000 | |
| | REALTY INCOME CORP | 148.000 | 8,558.840 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 38.000 | 2,064.160 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 25.000 | 6,312.250 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 81.000 | 7,940.430 | |
| | SUN COMMUNITIES INC | 31.000 | 3,760.300 | |
| | UDR INC | 65.000 | 2,525.900 | |
| | VENTAS INC | 95.000 | 3,526.400 | |
| | VICI PROPERTIES INC | 245.000 | 7,203.000 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 26.000 | 561.340 | |
| | WELLTOWER INC | 111.000 | 6,585.630 | |
| | WEYERHAEUSER CO | 184.000 | 5,345.200 | |
| | WP CAREY INC | 53.000 | 3,747.100 | |
| アメリカ・ドル | 小計 | 3,112.000 | 209,927.680 (31,484,953) | |
| イギリス・ポンド | BRITISH LAND CO PLC | 255.000 | 869.800 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 134.000 | 690.900 | |
| | SEGRO PLC | 297.000 | 2,124.730 | |
| イギリス・ポンド | 小計 | 686.000 | 3,685.430 (619,189) | |
| カナダ・ドル | CANADIAN APT PPTYS REIT | 10.000 | 394.400 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 15.000 | 278.250 | |
| カナダ・ドル | 小計 | 25.000 | 672.650 (73,252) | |
| ユーロ | COVIVIO | 4.000 | 196.000 | |
| | GECINA SA | 7.000 | 578.550 | |
| | KLEPIERRE | 31.000 | 599.070 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 33.000 | 1,454.470 | |
| | WAREHOUSES DE PAUW | 41.000 | 1,011.060 | |
| ユーロ | 小計 | 116.000 | 3,839.150 (562,282) | |
| 香港・ドル | LINK REIT | 607.000 | 31,321.200 | |

| | | | | |
|---------|----------|---------|----------------------------|--|
| | 香港・ドル 小計 | 607.000 | 31,321.200 (598,548) | |
| 投資証券 合計 | | 4,546 | 33,338,224 (33,338,224) | |
| 合計 | | | 35,605,385 (35,605,385) | |

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

(注)

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式 時価比率 (%) | 組入 投資信託受益証券 時価比率 (%) | 組入 投資証券 時価比率 (%) | 有価証券の合計金額に 対する比率 (%) |
|-------------|--------------|---------------------|-------------------------------|---------------------------|----------------------------|
| アメリカ・ドル | 株式 599銘柄 | 65.54 | - | - | 74.61 |
| | 投資証券 37銘柄 | - | - | 1.76 | |
| イギリス・ポンド | 株式 80銘柄 | 3.88 | - | - | 4.34 |
| | 投資証券 3銘柄 | - | - | 0.03 | |
| イスラエル・シケル | 株式 10銘柄 | 0.15 | - | - | 0.17 |
| オーストラリア・ドル | 株式 52銘柄 | 1.93 | - | - | 2.25 |
| | 投資信託受益証券 7銘柄 | - | 0.10 | - | |
| カナダ・ドル | 株式 86銘柄 | 3.34 | - | - | 3.70 |
| | 投資証券 2銘柄 | - | - | 0.00 | |
| シンガポール・ドル | 株式 13銘柄 | 0.31 | - | - | 0.37 |
| | 投資信託受益証券 4銘柄 | - | 0.03 | - | |
| スイス・フラン | 株式 40銘柄 | 2.68 | - | - | 2.97 |
| スウェーデン・クローナ | 株式 46銘柄 | 0.89 | - | - | 0.98 |
| デンマーク・クローネ | 株式 17銘柄 | 0.69 | - | - | 0.76 |
| ニュージーランド・ドル | 株式 5銘柄 | 0.05 | - | - | 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 224銘柄 | 7.89 | - | - | 8.78 |
| | 投資証券 5銘柄 | - | - | 0.03 | |
| 香港・ドル | 株式 26銘柄 | 0.66 | - | - | 0.77 |
| | 投資証券 1銘柄 | - | - | 0.03 | |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

海外国債マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2022年10月20日現在

| | |
|-------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 73,229 |
| コール・ローン | 53,117,564 |
| 国債証券 | 14,206,319,968 |
| 未収入金 | 87,288,436 |
| 未収利息 | 79,568,378 |
| 前払費用 | 12,464,666 |
| 流動資産合計 | 14,438,832,241 |
| 資産合計 | 14,438,832,241 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 326,919 |
| 未払解約金 | 42,700,000 |
| 流動負債合計 | 43,026,919 |
| 負債合計 | 43,026,919 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 5,485,988,479 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 8,909,816,843 |
| 元本等合計 | 14,395,805,322 |
| 純資産合計 | 14,395,805,322 |
| 負債純資産合計 | 14,438,832,241 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 項目 | 自 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
|-------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | 2022年10月20日現在 |
|---------------------------------------|----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 5,769,509,411円 |
| 同期中追加設定元本額 | - 円 |
| 同期中一部解約元本額 | 283,520,932円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| 海外国債ファンド | 3,957,219,993円 |
| 海外国債ファンド（3ヵ月決算型） | 730,439,676円 |
| 新光7資産バランスファンド | 235,052,061円 |
| 海外国債ファンド（1年決算型） | 19,371,557円 |
| 海外国債ファンド（変額年金） | 543,905,192円 |
| 計 | 5,485,988,479円 |
| 2. 受益権の総数 | 5,485,988,479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 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> |

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2022年10月20日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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10月20日現在 |
|------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) |
| 国債証券 | 2,070,844,099 |
| 合計 | 2,070,844,099 |

(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10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

| 種類 | 2022年10月20日現在 | | | |
|---------------------|---------------|-----------|------------|---------|
| | 契約額等（円） | うち 1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| | | | | |
| 市場取引以外の取引 為替予約取引 | | | | |
| 売建 | 86,999,293 | - | 87,326,212 | 326,919 |
| アメリカ・ドル | 51,161,466 | - | 51,391,759 | 230,293 |
| カナダ・ドル | 35,837,827 | - | 35,934,453 | 96,626 |
| 合計 | 86,999,293 | - | 87,326,212 | 326,919 |

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| 2022年10月20日現在 | |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 2,6241円 (26,241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10月20日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------|-------------------------|----------------|----------------|----|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | US T N/B 0.125 04/30/23 | 7,400,000.000 | 7,238,703.050 | |
| | | US T N/B 0.625 08/15/30 | 8,500,000.000 | 6,510,468.750 | |
| | | US T N/B 1.25 08/15/31 | 4,800,000.000 | 3,784,687.480 | |
| | | US T N/B 1.375 11/15/31 | 5,900,000.000 | 4,675,519.480 | |
| | | US T N/B 1.625 05/15/31 | 9,600,000.000 | 7,873,874.950 | |
| | | US T N/B 1.875 02/15/32 | 9,800,000.000 | 8,096,484.320 | |
| | | US T N/B 2.75 08/15/42 | 5,700,000.000 | 4,429,078.120 | |
| | | US T N/B 2.875 05/15/32 | 9,800,000.000 | 8,829,570.280 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | 61,500,000.000 | 51,438,386.430 | |

| | | | | |
|-------------------------|-------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--|
| | | (9,223,770,000) | (7,714,729,196) | |
| イギリス・ポンド | UK TREASURY 0.125 01/31/23 | 630,000.000 | 625,193.100 | |
| | UK TREASURY 0.25 07/31/31 | 450,000.000 | 328,747.500 | |
| | UK TREASURY 1.0 01/31/32 | 800,000.000 | 618,072.000 | |
| | UK TREASURY 1.75 09/07/37 | 1,150,000.000 | 845,629.040 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | 3,030,000.000 (509,070,300) | 2,417,641.640 (406,187,972) | |
| カナダ・ドル | CANADA 0.25 05/01/23 | 2,000,000.000 | 1,958,880.000 | |
| | CANADA 0.25 11/01/22 | 870,000.000 | 869,214.390 | |
| | CANADA 0.5 12/01/30 | 1,900,000.000 | 1,492,565.900 | |
| | CANADA 1.25 06/01/30 | 800,000.000 | 677,964.800 | |
| | CANADA 1.5 06/01/31 | 900,000.000 | 763,049.700 | |
| | CANADA 1.5 12/01/31 | 1,050,000.000 | 883,825.950 | |
| | CANADA 2.0 09/01/23 | 2,800,000.000 | 2,746,189.600 | |
| | CANADA 2.75 08/01/24 | 420,000.000 | 409,743.180 | |
| カナダ・ドル 小計 | | 10,740,000.000 (1,169,586,000) | 9,801,433.520 (1,067,376,110) | |
| ユーロ | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 | 2,700,000.000 | 2,246,643.000 | |
| | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 | 2,500,000.000 | 2,022,605.000 | |
| | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 | 3,760,000.000 | 3,090,156.000 | |
| | DEUTSCHLAND 08/15/29 | 500,000.000 | 430,944.000 | |
| | DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | 400,000.000 | 471,568.400 | |
| | DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | 1,700,000.000 | 2,149,939.000 | |
| | FRANCE OAT 0.0 11/25/31 | 2,550,000.000 | 1,987,951.950 | |
| | FRANCE OAT 0.5 05/25/29 | 2,000,000.000 | 1,748,672.000 | |
| | FRANCE OAT 0.75 11/25/28 | 2,600,000.000 | 2,335,070.400 | |
| | FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 2,000,000.000 | 1,581,400.000 | |
| | FRANCE OAT 1.75 05/25/23 | 1,800,000.000 | 1,801,967.400 | |
| | FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 2,000,000.000 | 1,986,208.000 | |
| | FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 3,000,000.000 | 3,503,550.000 | |
| | ITALY BTPS 0.6 08/01/31 | 1,600,000.000 | 1,152,600.000 | |
| | ITALY BTPS 0.95 06/01/32 | 2,800,000.000 | 2,022,440.000 | |
| | ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 3,000,000.000 | 2,330,400.000 | |
| | ITALY BTPS 3.0 08/01/29 | 1,600,000.000 | 1,489,401.600 | |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 2,000,000.000 | 1,910,580.000 | | |
| ユーロ 小計 | | 38,510,000.000 (5,640,174,600) | 34,262,096.750 (5,018,026,690) | |
| 国債証券 合計 | | 16,542,600,900 (16,542,600,900) | 14,206,319,968 (14,206,319,968) | |
| 合計 | | | 14,206,319,968 (14,206,319,968) | |

(注)

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券 時価比率 (%) | 有価証券の合計金額に 対する比率 (%) |
|----------|-----------|---------------------|----------------------------|
| アメリカ・ドル | 国債証券 8銘柄 | 53.59 | 54.30 |
| イギリス・ポンド | 国債証券 4銘柄 | 2.82 | 2.86 |
| カナダ・ドル | 国債証券 8銘柄 | 7.41 | 7.51 |
| ユーロ | 国債証券 18銘柄 | 34.86 | 35.32 |

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

新光米国REITマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年10月20日現在

| | |
|-------------|-------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 3,417,316 |
| コール・ローン | 1,113,131 |
| 投資証券 | 569,946,230 |
| 未収配当金 | 611,137 |
| 流動資産合計 | 575,087,814 |
| 資産合計 | 575,087,814 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 703,748 |
| 流動負債合計 | 703,748 |
| 負債合計 | 703,748 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 232,387,351 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 341,996,715 |
| 元本等合計 | 574,384,066 |
| 純資産合計 | 574,384,066 |
| 負債純資産合計 | 575,087,814 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 自 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
|-------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. 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礎となる事項 | 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10月20日現在 |
|---------------------------------------|---------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 259,914,707円 |
| 同期中追加設定元本額 | - 円 |
| 同期中一部解約元本額 | 27,527,356円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| 新光7資産バランスファンド | 232,387,351円 |
| 計 | 232,387,351円 |
| 2. 受益権の総数 | 232,387,351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 2022年4月21日 至 2022年10月20日 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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10月20日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価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10月20日現在 | |
|------|---------------------------|-------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) | |
| 投資証券 | | 192,404,571 |
| 合計 | | 192,404,571 |

(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10月21日から2022年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 2022年10月20日現在 |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.4717円 (24,717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10月20日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------|-------------------------|---------|------------|----|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ACADIA REALTY TRUST | 311.000 | 4,052.330 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 267.000 | 17,248.200 | |
| | | ALEXANDER & BALDWIN INC | 245.000 | 4,346.300 | |
| | | ALEXANDER'S INC. | 7.000 | 1,493.170 | |

| | | | |
|--|-----------|-------------|--|
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 554.000 | 72,346.860 | |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC | 39.000 | 660.660 | |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 169.000 | 4,329.780 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 1,034.000 | 32,560.660 | |
| AMERICAN TOWER CORP | 1,592.000 | 304,056.080 | |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 916.000 | 20,371.840 | |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | 523.000 | 19,262.090 | |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 512.000 | 3,671.040 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 726.000 | 11,688.600 | |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 226.000 | 2,443.060 | |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 115.000 | 886.650 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 478.000 | 82,861.300 | |
| BLUEROCK HOMES TRUST INC | 12.000 | 294.480 | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 537.000 | 38,567.340 | |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 217.000 | 1,037.260 | |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 574.000 | 3,495.660 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 1,020.000 | 19,482.000 | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 566.000 | 8,954.120 | |
| BRT APARTMENTS CORP | 43.000 | 901.280 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 355.000 | 40,019.150 | |
| CARETRUST REIT INC | 327.000 | 5,693.070 | |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC | 89.000 | 2,326.460 | |
| CENTERSPACE | 51.000 | 3,350.700 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 162.000 | 1,914.840 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 145.000 | 1,412.300 | |
| COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC | 790.000 | 5,664.300 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 81.000 | 2,562.030 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 382.000 | 9,229.120 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 517.000 | 11,436.040 | |
| CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP | 58.000 | 390.920 | |
| CROWN CASTLE INC | 1,480.000 | 193,436.000 | |
| CTO REALTY GROUTH INC | 60.000 | 1,110.000 | |
| CUBESMART | 762.000 | 29,420.820 | |

| | | | |
|--|-----------|-------------|--|
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 708.000 | 6,209.160 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 972.000 | 92,544.120 | |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 803.000 | 851.180 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 571.000 | 9,370.110 | |
| EAST GROUP | 141.000 | 20,048.790 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 304.000 | 4,809.280 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 484.000 | 3,223.440 | |
| EPR PROPERTIES | 252.000 | 9,313.920 | |
| EQUINIX INC | 312.000 | 163,962.240 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 606.000 | 35,590.380 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 1,267.000 | 80,619.210 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 475.000 | 9,105.750 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 223.000 | 50,647.760 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 453.000 | 75,161.760 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 153.000 | 2,025.720 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 273.000 | 24,905.790 | |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 449.000 | 19,800.900 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 272.000 | 6,481.760 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 331.000 | 827.500 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 835.000 | 38,025.900 | |
| GETTY REALTY CORP | 138.000 | 3,866.760 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 125.000 | 2,035.000 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 106.000 | 2,033.080 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 203.000 | 1,587.460 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 353.000 | 3,815.930 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 1,293.000 | 24,592.860 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 1,848.000 | 41,690.880 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 109.000 | 891.620 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 350.000 | 8,900.500 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 2,426.000 | 42,527.780 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 472.000 | 4,814.400 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 751.000 | 11,678.050 | |
| INDUS REALTY TRUST INC | 19.000 | 964.820 | |

| | | | |
|---------------------------------------|-----------|-------------|--|
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 220.000 | 1,111.000 | |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 229.000 | 5,143.340 | |
| INVITATION HOMES INC | 2,088.000 | 67,860.000 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 989.000 | 45,731.360 | |
| ISTAR INC | 221.000 | 1,960.270 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 363.000 | 6,802.620 | |
| KILROY REALTY CORP | 396.000 | 16,303.320 | |
| KIMCO REALTY | 2,070.000 | 39,537.000 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 738.000 | 13,092.120 | |
| LAMAR ADVERTISING CO | 295.000 | 25,670.900 | |
| LIFE STORAGE INC | 287.000 | 29,569.610 | |
| LTC PROPERTIES INC | 132.000 | 5,025.240 | |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 946.000 | 8,684.280 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 2,025.000 | 22,275.000 | |
| MID AMERICA | 393.000 | 58,010.730 | |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 148.000 | 8,086.720 | |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 598.000 | 23,531.300 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 289.000 | 11,577.340 | |
| NETSTREIT CORP | 206.000 | 3,642.080 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 75.000 | 2,978.250 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 162.000 | 2,349.000 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 801.000 | 24,013.980 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 55.000 | 1,224.850 | |
| ORION OFFICE REIT INC | 193.000 | 1,729.280 | |
| OUTFRONT MEDIA INC | 499.000 | 8,358.250 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 632.000 | 4,044.800 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 758.000 | 9,391.620 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 440.000 | 6,899.200 | |
| PHILLIPS EDISON & CO INC | 396.000 | 11,194.920 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 755.000 | 10,841.800 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 420.000 | 4,040.400 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 121.000 | 2,116.290 | |
| POSTAL REALTY TRUST INC | 64.000 | 965.120 | |
| POTLATCH CORP | 271.000 | 11,937.550 | |
| PROLOGIS INC | 3,158.000 | 322,147.580 | |
| PUBLIC STORAGE | 536.000 | 155,922.400 | |
| RAYONIER INC | 499.000 | 16,152.630 | |
| REALTY INCOME CORP | 2,119.000 | 122,541.770 | |

| | | | |
|-------------------------------------|-----------|-------------|--|
| REGENCY CENTERS CORP | 584.000 | 31,722.880 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 402.000 | 5,475.240 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 586.000 | 30,073.520 | |
| RLJ LODGING TRUST | 542.000 | 6,178.800 | |
| RPT REALTY | 283.000 | 2,411.160 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 183.000 | 15,501.930 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 773.000 | 9,762.990 | |
| SAFEHOLD INC | 76.000 | 1,906.080 | |
| SAUL CENTERS INC | 40.000 | 1,493.600 | |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 366.000 | 92,411.340 | |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 556.000 | 4,297.880 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 1,116.000 | 109,401.480 | |
| SITE CENTERS CORP | 651.000 | 7,343.280 | |
| SL GREEN | 218.000 | 8,118.320 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 462.000 | 16,156.140 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 614.000 | 17,308.660 | |
| STORE CAPITAL CORP | 866.000 | 27,244.360 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 351.000 | 2,793.960 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 416.000 | 50,460.800 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 713.000 | 7,500.760 | |
| TANGER FACTORY OUTLET | 346.000 | 5,705.540 | |
| TERRENO REALTY CORP | 250.000 | 13,187.500 | |
| THE MACERICH COMPANY | 724.000 | 6,689.760 | |
| THE NECESSITY RETAIL REIT INC | 446.000 | 2,733.980 | |
| UDR INC | 1,108.000 | 43,056.880 | |
| UMH PROPERTIES INC | 162.000 | 2,634.120 | |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 43.000 | 1,921.240 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 392.000 | 5,229.280 | |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 99.000 | 1,723.590 | |
| VENTAS INC | 1,368.000 | 50,780.160 | |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 297.000 | 3,659.040 | |
| VICI PROPERTIES INC | 3,292.000 | 96,784.800 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 602.000 | 12,997.180 | |
| WASHINGTON REIT | 287.000 | 5,042.590 | |
| WELLTOWER INC | 1,588.000 | 94,216.040 | |
| WEYERHAEUSER CO | 2,548.000 | 74,019.400 | |
| WHITESTONE REIT | 166.000 | 1,414.320 | |
| WP CAREY INC | 654.000 | 46,237.800 | |

| | | | | |
|---------|-------------------------------|------------|--------------------------------|--|
| | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 386.000 | 6,187.580 | |
| | アメリカ・ドル 小計 | 83,162.000 | 3,800,148.220 (569,946,230) | |
| 投資証券 合計 | | 83,162 | 569,946,230 (569,946,230) | |
| 合計 | | | 569,946,230 (569,946,230) | |

(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 147銘柄 | 99.23 | 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・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド

「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」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

2022年5月31日現在

| | 2022年 (日本円) | 2021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 | 13,785,685,489 | 18,753,592,218 |
| ブローカーに対する債権 | - | 117,814,864 |
| 現金および現金同等物 | 932,564,219 | 1,259,624,258 |
| その他の債権 | 23,997,115 | 1,175,263 |
| 資産合計 | 14,742,246,823 | 20,132,206,603 |
| 負債 | | |
| 流動負債 | | |
| ブローカーに対する債務 | - | 117,069,215 |
| 未払費用 | 22,867,234 | 25,152,333 |
| 負債合計 | 22,867,234 | 142,221,548 |
| 受益証券保有者に帰属する純資産 | 14,719,379,589 | 19,989,985,055 |

投資ポートフォリオ(無監査)
2022年5月31日終了会計年度

| | 公正価値 2022年 (日本円) | 公正価値 2021年 (日本円) |
|--|------------------------|------------------------|
| 債券 | | |
| アンゴラ | | |
| Angolan Government International Bond 8.00% due 26/11/2029 REGS | 373,796,272 | - |
| Angolan Government International Bond 8.75% due 14/04/2032 REGS | 74,060,733 | - |
| アンゴラ合計 | 447,857,005 | - |
| アルゼンチン | | |
| Provincia De Tierra Del Fuego Argentina 8.95% due 17/04/2027 REGS | - | 324,696,635 |
| Provincia Del Chubut Argentina 7.75% due 26/07/2026 REGS | - | 119,052,823 |
| アルゼンチン合計 | - | 443,749,458 |
| アルメニア | | |
| Republic Of International Armenian Bond 3.60% due 02/02/2031 REGS | 192,003,090 | - |
| アルメニア合計 | 192,003,090 | - |
| アゼルバイジャン | | |
| Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026 REGS | 230,112,583 | 226,135,734 |
| アゼルバイジャン合計 | 230,112,583 | 226,135,734 |
| ベラルーシ | | |
| Development Bank of the Republic of Belarus JSC 12.00% due 15/05/2022 REGS | - | 270,989,742 |
| Republic of Belarus International Bond 6.20% due 28/02/2030 REGS | 36,477,510 | 242,199,755 |
| Republic of Belarus Ministry of Finance 6.378% due 24/02/2031 REGS | 49,873,408 | 227,784,666 |
| ベラルーシ合計 | 86,350,918 | 740,974,163 |
| ベナン | | |
| Benin, Republik 4.875% due 19/01/2032 REGS | 262,768,469 | 216,767,944 |
| ベナン合計 | 262,768,469 | 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 |
| ボスニア・ヘルツェゴビナ合計 | - | 137,290,090 |
| ブラジル | | |
| Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 8.20% due 06/04/2028 REGS | - | 416,445,758 |
| ブラジル合計 | - | 416,445,758 |
| カメルーン | | |
| Republic of Cameroon International Bank 5.95% due 07/07/2032 REGS | 185,152,065 | - |
| Republic of Cameroon International Bond 9.50% due 19/11/2025 REGS | - | 428,139,883 |
| カメルーン合計 | 185,152,065 | 428,139,883 |

| | 公正価値 2022年 (日本円) | 公正価値 2021年 (日本円) |
|---|------------------------|------------------------|
| 債券(続き) | | |
| コロンビア | | |
| Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS | 449,619,438 | 447,483,246 |
| Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS | 425,919,617 | 375,305,415 |
| コロンビア合計 | 875,539,055 | 822,788,661 |
| コスタリカ | | |
| Costa Rica Government International Bond 7.158% due 12/03/2045 | 210,246,526 | 129,447,393 |
| コスタリカ合計 | 210,246,526 | 129,447,393 |
| ドミニカ共和国 | | |
| Dominican Republic 6.40% due 05/06/2049 REGS | 28,362,208 | 84,614,071 |
| Dominican Republic 8.90% due 15/02/2023 REGS | 69,469,152 | 135,200,388 |
| Dominican Republic International Bond 9.75% due 05/06/2026 REGS | 443,966,178 | 413,745,120 |
| ドミニカ共和国合計 | 541,797,538 | 633,559,579 |
| エジプト | | |
| Egypt Government Bond 13.659% due 07/09/2023 REGS | 165,919,244 | - |
| Egypt Government Bond 14.196% due 07/07/2023 REGS | 200,162,562 | - |
| Egypt Government International Bond 7.50% due 16/02/2061 REGS | 99,080,008 | 139,981,457 |
| Egypt Government International Bond 7.625% due 29/05/2032 REGS | 56,792,288 | 65,287,221 |
| Egypt Treasury Bills 0% due 03/08/2021 TBLM | - | 85,525,478 |
| 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 | 521,954,102 | 736,296,339 |
| エルサルバドル | | |
| Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035 REGS | - | 545,761,541 |
| エルサルバドル合計 | - | 545,761,541 |
| エチオピア | | |
| Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS | 284,872,788 | 394,357,040 |
| エチオピア合計 | 284,872,788 | 394,357,040 |
| ジョージア | | |
| Georgian Treasury Bond 8.00% due 04/02/2023 REGS | 52,286,151 | - |
| ジョージア合計 | 52,286,151 | - |
| ガーナ | | |
| Ghana Govt 18.25% due 25/07/2022 | - | 509,197,795 |
| Saderea DAC 12.50% due 30/11/2026 REGS | 66,787,030 | 97,058,452 |
| ガーナ合計 | 66,787,030 | 606,256,247 |

| | 公正価値 2022年 (日本円) | 公正価値 2021年 (日本円) |
|---|------------------------|------------------------|
| 債券(続き) | | |
| ホンジュラス | | |
| Honduras Government International Bond 5.625% due 24/06/2030 | 162,442,918 | 198,720,395 |
| ホンジュラス合計 | 162,442,918 | 198,720,395 |
| インドネシア | | |
| Republic of Indonesia 3.375% due 15/04/2023 REGS | - | 462,911,060 |
| Republic of Indonesia 4.35% due 08/01/2027 | 67,020,188 | 63,084,409 |
| インドネシア合計 | 67,020,188 | 525,995,469 |
| ジャマイカ | | |
| Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045 | 230,643,062 | 236,241,591 |
| ジャマイカ合計 | 230,643,062 | 236,241,591 |
| ヨルダン | | |
| Jordan Kingdom 6.125% due 29/01/2026 REGS | 387,395,833 | 483,707,229 |
| ヨルダン合計 | 387,395,833 | 483,707,229 |
| カザフスタン | | |
| Astana Finance JSC 0% due 22/12/2024 REGS | - | 3,312,777 |
| Development Bank of Kazakhstan JSC 5.30% due 26/04/2023 REGS | 262,839,281 | - |
| Kazakhstan Government Bond - MEUKAM 5.00% due 15/05/2023 | 193,004,355 | 82,469,905 |
| Kazakhstan Government International Bond 4.875% due 14/10/2044 REGS | 94,511,492 | 108,907,524 |
| Kazakhstan Temir Zholy Finance Bv 6.95% due 10/07/2042 REGS | 226,441,491 | 271,876,764 |
| Kazakhstan Treasury bill - MEKKAM 0% due 20/01/2022 | - | 220,968,865 |
| カザフスタン合計 | 776,796,619 | 687,535,835 |
| ケニア | | |
| Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025 | 185,259,896 | 320,246,776 |
| Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 12/05/2025 | 240,225,895 | 227,840,744 |
| ケニア合計 | 425,485,791 | 548,087,520 |
| メキシコ | | |
| Mexican Bonos 8.00% due 07/11/2047 | 506,829,899 | 1,229,538,462 |
| Mexico Government International Bond 2.659% due 24/05/2031 | 182,653,869 | 174,771,330 |
| Mexico Government International Bond 4.60% due 23/01/2046 | 159,842,501 | 165,424,766 |
| Mexican Udibonos 4.00% due 30/11/2028 | 473,646,328 | - |
| メキシコ合計 | 1,322,972,597 | 1,569,734,558 |
| ナイジェリア | | |
| BOI FINANCE BV 7.50% due 16/02/2027 | 159,111,620 | - |
| ナイジェリア合計 | 159,111,620 | - |

| | 公正価値 2022年 (日本円) | 公正価値 2021年 (日本円) |
|---|------------------------|------------------------|
| 債券(続き) | | |
| パキスタン | | |
| Pakistan 7.375% due on 08/04/2031 | 155,309,254 | 108,859,182 |
| パキスタン合計 | 155,309,254 | 108,859,182 |
| パラグアイ | | |
| Rutas 2 and 7 Finance Ltd 0% due 30/09/2036 REGS | 327,268,485 | 321,819,276 |
| パラグアイ合計 | 327,268,485 | 321,819,276 |
| ペルー | | |
| Iirsa Norte Finance Ltd 8.75% due 30/05/2024 REGS | 102,472,559 | 156,108,197 |
| Peru Government Bond 5.40% due 12/08/2034 | 192,344,800 | - |
| ペルー合計 | 294,817,359 | 156,108,197 |
| ルーマニア | | |
| Romani 6.125% due 22/01/2044 REGS | 508,080,700 | - |
| ルーマニア合計 | 508,080,700 | - |
| ロシア | | |
| Russian Federal Inflation Linked Bond 2.50% due 17/07/2030 | - | 330,058,282 |
| Russian Federation Bond 7.65% due 10/04/2030 | 58,390,596 | 57,165,071 |
| Russian Foreign Bond 5.625% due 04/04/2042 | 19,650,328 | - |
| RZD Capital Plc (Russian Railways) 5.70% due 05/04/2022 REGS | - | 195,182,291 |
| ロシア合計 | 78,040,924 | 582,405,644 |
| 南アフリカ | | |
| Government of South Africa 4.30% due 12/10/2028 | 611,531,085 | 409,964,336 |
| Government of South Africa 7.00% due 28/02/2031 | 506,372,125 | 779,924,376 |
| 南アフリカ合計 | 1,117,903,210 | 1,189,888,712 |
| 国際機関 | | |
| Asian Infrastructure Investment Bank 16.00% due 14/09/2021 | - | 536,285,823 |
| Asian Infrastructure Investment Bank 17.50% due 14/09/2022 | 213,576,816 | - |
| European Bank for Reconstruction & Development 6.45% due 13/12/2022 | 395,047,704 | - |
| European Bank for Reconstruction & Development 6.85% due 21/06/2021 | - | 335,224,500 |
| European Investment Bank 8.50% due 01/12/2023 REGS | 173,359,197 | - |
| Inter-American Development Bank 7.875% due 14/03/2023 REGS | 196,533,987 | 175,558,404 |
| Inter-American Development Bank 8.01% due 11/12/2021 REGS | - | 133,049,543 |
| International Finance Corp 7.50% 29/10/2021 | - | 301,626,776 |
| 国際機関合計 | 978,517,704 | 1,481,745,046 |
| スリナム | | |
| Government of Suriname 9.25% due 26/10/2026 REGS | 187,660,917 | 223,080,079 |
| Suriname Government International Bond 9.875% due 30/12/2023 REGS | 207,099,640 | 148,260,584 |
| スリナム合計 | 394,760,557 | 371,340,663 |

| | 公正価値 2022年 (日本円) | 公正価値 2021年 (日本円) |
|--|------------------------|------------------------|
| 債券（続き） | | |
| トリニダード・トバゴ | | |
| Heritage Petroleum Co. Ltd 9.00% due 12/08/2029 REGS | 474,108,523 | - |
| Trinidad Petroleum Holdings Ltd 9.75% due 15/06/2026 REGS | - | 790,910,549 |
| トリニダード・トバゴ合計 | 474,108,523 | 790,910,549 |
| チュニジア | | |
| 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 |
| トルコ | | |
| Government of Turkey 4.875% due 16/04/2043 | - | 215,527,227 |
| Istanbul Metropolitan Municipality 10.75% due 12/04/2027 | 94,817,838 | - |
| Turkey Government International Bond 5.95% due 15/01/2031 REGS | 118,041,099 | - |
| Turkiye Ithracat Kredi Bankasi AS 6.125% due 03/05/2024 | - | 175,504,543 |
| Ziraat Bank 5.375% due 02/03/2026 | 370,445,427 | 177,665,785 |
| トルコ合計 | 583,304,364 | 568,697,555 |
| ウクライナ | | |
| KYIV Finance PLC (CITY OF KIEV) 7.50% due 15/12/2022 REGS | - | 463,251,022 |
| ST Savings Bank 9.625% due 20/03/2025 | 65,945,990 | - |
| Ukraine Government International Bond 7.375% due 25/09/2032 | 153,116,778 | - |
| ウクライナ合計 | 219,062,768 | 463,251,022 |
| ウルグアイ | | |
| Uruguay Government International Bond 8.25% due 21/05/2031 | 193,675,234 | - |
| Uruguay Republic of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked | 460,804,656 | 791,766,489 |
| ウルグアイ合計 | 654,479,890 | 791,766,489 |
| ウズベキスタン | | |
| IPOTEKA Bank, ATIB 16.00% due 16/04/2024 | 215,148,352 | 190,050,369 |
| Republic of Uzbekistan Bond 14.00% due 19/07/2024 REGS | 83,298,852 | - |
| Republic of Uzbekistan Bond 14.50% due 25/11/2023 REGS | 139,570,294 | 127,964,450 |
| ウズベキスタン合計 | 438,017,498 | 318,014,819 |
| 債券合計 | 13,713,267,184 | 18,681,150,579 |
| 原油ワラント | | |
| ベネズエラ | | |
| Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020 | 72,418,305 | 72,441,639 |
| ベネズエラ合計 | 72,418,305 | 72,441,639 |
| 原油ワラント合計 | 72,418,305 | 72,441,639 |
| 投資ポートフォリオ | 13,785,685,489 | 18,753,592,218 |

(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10月31日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 4,516,531,928円 |
| 負債総額 | 1,459,996円 |
| 純資産総額(-) | 4,515,071,932円 |
| 発行済数量 | 4,285,855,333口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0535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10月31日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,726,484,362円 |
| 負債総額 | 11,000円 |
| 純資産総額(-) | 1,726,473,362円 |
| 発行済数量 | 618,060,203口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.7934円 |

新光日本債券インデックスマザーファンド

2022年10月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 10,290,390,873円 |
| 負債総額 | 114,168,300円 |
| 純資産総額(-) | 10,176,222,573円 |
| 発行済数量 | 8,209,859,915口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.2395円 |

新光J-REITマザーファンド

2022年10月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 95,641,627,913円 |
| 負債総額 | 326,732,012円 |
| 純資産総額(-) | 95,314,895,901円 |
| 発行済数量 | 42,049,959,251口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.2667円 |

新光外国株式インデックスマザーファンド

2022年10月31日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,855,826,063円 |
| 負債総額 | 5,887,204円 |
| 純資産総額(-) | 1,849,938,859円 |
| 発行済数量 | 445,912,599口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 4.1487円 |

海外国債マザーファンド

2022年10月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 14,882,150,058円 |
| 負債総額 | 333,911,636円 |
| 純資産総額(-) | 14,548,238,422円 |
| 発行済数量 | 5,471,623,462口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.6589円 |

新光米国REITマザーファンド

2022年10月31日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 605,978,065円 |
| 負債総額 | 0円 |
| 純資産総額(-) | 605,978,065円 |
| 発行済数量 | 232,387,351口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.6076円 |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2022年10月31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10月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年10月31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 | 1,393,735,163,884 |
| 追加型株式投資信託 | 807 | 14,679,766,624,746 |
| 単位型公社債投資信託 | 25 | 48,503,770,742 |
| 単位型株式投資信託 | 221 | 1,123,384,448,891 |
| 合計 | 1,079 | 17,245,390,008,263 |

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第38期中間会計期間（自2022年4月1日至2022年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：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 |
| ソフトウェア | 2,878 | 3,107 |
| ソフトウェア仮勘定 | 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 | | | | | | | | 株主資本 合計 |
|-----------------------------|-------|-------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 資本準備金 | その他 資本剰余金 | 資本剰余金 合計 | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | | | |
| | | | | | | 別途 積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000 | 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 | | | | | | | | 株主資本 合計 |
|-----------------------------|-------|-------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 資本準備金 | その他 資本剰余金 | 資本剰余金 合計 | | 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 | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 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</p> |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 3. 固定資産の減価償却の方法 | <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p> |
| 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 |
| 5. 引当金の計上基準 | <p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 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。 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。 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。</p> <p>(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。</p> |

| | |
|----------------|---|
| 6. 収益及び費用の計上基準 | <p>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。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は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。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は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。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は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。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p> |
| 7. 消費税等の会計処理 | 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。 |

(会計上の見積りの変更)

第37期

(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あります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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 其他有価証券 | 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 其他有価証券 | 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 其他有価証券(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 其他有価証券(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 | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | 1 | 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 | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | 1 | 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 | 第37期 |
|-----------------|----------------|----------------|
| | (2021年3月31日現在) | (2022年3月31日現在) |
| | (百万円) | (百万円) |
| 繰延税金資産 | | |
| 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

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

| | | |
|-------|-----------|------------|
| 取得の対価 | MHAMの普通株式 | 144,212百万円 |
| 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 | 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

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

| | | 第38期中間会計期間末 (2022年9月30日現在) |
|-----------|-------|-------------------------------|
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | | 27,934 |
| 金銭の信託 | | 29,712 |
| 未収委託者報酬 | | 17,398 |
| 未収運用受託報酬 | | 3,150 |
| 未収投資助言報酬 | | 291 |
| 未収収益 | | 16 |
| 前払費用 | | 939 |
| その他 | | 2,564 |
| | 流動資産計 | 82,009 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1 | 1,055 |
| 器具備品 | 1 | 138 |
| リース資産 | 1 | 8 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | | 3,151 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 1,794 |
| 電話加入権 | | 2 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 182 |
| 関係会社株式 | | 5,810 |
| 長期差入保証金 | | 779 |
| 繰延税金資産 | | 2,962 |
| その他 | | 411 |
| | 固定資産計 | 16,298 |
| 資産合計 | | 98,307 |

(単位:百万円)

| | 第38期中間会計期間末 (2022年9月30日現在) |
|--------------|-------------------------------|
| (負債の部) | |
| 流動負債 | |
| 預り金 | 959 |
| リース債務 | 1 |
| 未払金 | 7,709 |
| 未払収益分配金 | 0 |
| 未払手数料 | 7,486 |
| その他未払金 | 221 |
| 未払費用 | 9,245 |
| 未払法人税等 | 2,605 |
| 未払消費税等 | 719 |
| 契約負債 | 20 |
| 賞与引当金 | 866 |
| 役員賞与引当金 | 26 |
| 流動負債計 | 22,155 |
| 固定負債 | |
| リース債務 | 7 |
| 退職給付引当金 | 2,600 |
| 時効後支払損引当金 | 108 |
| 固定負債計 | 2,716 |
| 負債合計 | 24,871 |
| (純資産の部) | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 2,000 |
| 資本剰余金 | 19,552 |
| 資本準備金 | 2,428 |
| その他資本剰余金 | 17,124 |
| 利益剰余金 | 51,882 |
| 利益準備金 | 123 |
| その他利益剰余金 | 51,759 |
| 別途積立金 | 31,680 |
| 繰越利益剰余金 | 20,079 |
| 株主資本計 | 73,435 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 0 |
| 評価・換算差額等計 | 0 |
| 純資産合計 | 73,435 |
| 負債・純資産合計 | 98,307 |

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

| | 第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日) | |
|------------|--|--------|
| | | |
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 48,925 | |
| 運用受託報酬 | 7,371 | |
| 投資助言報酬 | 1,029 | |
| その他営業収益 | 11 | |
| | 営業収益計 | 57,336 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 20,939 | |
| 広告宣伝費 | 102 | |
| 公告費 | 0 | |
| 調査費 | 16,544 | |
| 調査費 | 5,756 | |
| 委託調査費 | 10,787 | |
| 委託計算費 | 277 | |
| 営業雑経費 | 371 | |
| 通信費 | 17 | |
| 印刷費 | 249 | |
| 協会費 | 34 | |
| 諸会費 | 20 | |
| 支払販売手数料 | 49 | |
| | 営業費用計 | 38,235 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 4,691 | |
| 役員報酬 | 81 | |
| 給料・手当 | 4,561 | |
| 賞与 | 49 | |
| 交際費 | 4 | |
| 寄付金 | 4 | |
| 旅費交通費 | 48 | |
| 租税公課 | 243 | |
| 不動産賃借料 | 504 | |
| 退職給付費用 | 235 | |
| 固定資産減価償却費 | 1 655 | |
| 福利厚生費 | 26 | |
| 修繕費 | 0 | |
| 賞与引当金繰入額 | 866 | |
| 役員賞与引当金繰入額 | 26 | |
| 機器リース料 | 0 | |
| 事務委託費 | 2,103 | |
| 事務用消耗品費 | 18 | |
| 器具備品費 | 0 | |
| 諸経費 | 159 | |
| | 一般管理費計 | 9,590 |
| 営業利益 | | 9,510 |

（単位：百万円）

| | 第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日） | |
|--------------|--|--------------|
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 6 | |
| 受取配当金 | 2,400 | |
| 時効成立分配金・償還金 | 0 | |
| 時効後支払損引当金戻入額 | 25 | |
| 為替差益 | 28 | |
| 雑収入 | 2 | |
| | | 営業外収益計 2,463 |
| 営業外費用 | | |
| 金銭の信託運用損 | 530 | |
| 早期割増退職金 | 3 | |
| 雑損失 | 28 | |
| | | 営業外費用計 561 |
| 経常利益 | | 11,411 |
| 特別利益 | | |
| 投資有価証券売却益 | 4 | |
| | | 特別利益計 4 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産除却損 | 12 | |
| 投資有価証券売却損 | 9 | |
| 関係会社株式評価損 | 584 | |
| | | 特別損失計 605 |
| 税引前中間純利益 | | 10,809 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 2,457 |
| 法人税等調整額 | | 129 |
| 法人税等合計 | | 2,587 |
| 中間純利益 | | 8,222 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

(単位:百万円)

| | 株主資本 | | | | | | |
|---------------------------|-------|-------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他 資本剰余金 | 資本剰余金 合計 | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | |
| | | | | | | 別途 積立金 | 繰越利益 剰余金 |
| 当期首残高 | 2,000 | 2,428 | 17,124 | 19,552 | 123 | 31,680 | 24,216 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 12,360 |
| 中間純利益 | | | | | | | 8,222 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額) | | | | | | | |
| 当中間期変動額 合計 | - | - | - | - | - | - | 4,137 |
| 当中間期末残高 | 2,000 | 2,428 | 17,124 | 19,552 | 123 | 31,680 | 20,079 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | | 純資産 合計 |
|---------------------------|-------------|------------|----------------------|----------------|-----------|
| | 利益剰余金 | 株主資本 合計 | その他 有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | |
| | 利益剰余金 合計 | | | | |
| 当期首残高 | 56,020 | 77,573 | 0 | 0 | 77,573 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 12,360 | 12,360 | | | 12,360 |
| 中間純利益 | 8,222 | 8,222 | | | 8,222 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額) | | - | 0 | 0 | 0 |
| 当中間期変動額 合計 | 4,137 | 4,137 | 0 | 0 | 4,137 |
| 当中間期末残高 | 51,882 | 73,435 | 0 | 0 | 73,435 |

重要な会計方針

| | |
|--------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p> |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 3. 固定資産の減価償却の方法 | <p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p> |
| 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 |

| | |
|-------------------|---|
| 5. 引当金の計上基準 | <p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日次事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> |
| 6. 重要な収益及び費用の計上基準 | <p>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。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p> |
| 7. 消費税等の会計処理 | 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。 |

（会計方針の変更）

「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 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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しております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当中間財務諸表への影響はありません。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

| 項目 | 第38期中間会計期間末 （2022年9月30日現在） | | |
|------------------|-------------------------------|-----|--------|
| 1.有形固定資産の減価償却累計額 | 建物 | ... | 469百万円 |
| | 器具備品 | ... | 975百万円 |
| | リース資産 | ... | 0百万円 |

（中間損益計算書関係）

| 項目 | 第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日） | | |
|-----------|--|-----|--------|
| 1.減価償却実施額 | 有形固定資産 | ... | 74百万円 |
| | 無形固定資産 | ... | 580百万円 |

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

| 決議 | 株式の 種類 | 配当金の 総額 （百万円） | 1株当たり 配当額 （円） | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|------------|---------------------|---------------------|------------|------------|
| 2022年6月16日 定時株主総会 | 普通株式 | 12,360 | 309,000 | 2022年3月31日 | 2022年6月17日 |
| | A種種類 株式 | | | | |

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

(金融商品関係)

第38期中間会計期間末(2022年9月30日現在)

1.金融商品の時価等に関する事項

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

| | 中間貸借対照表計上額 (百万円) | 時価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|----------------------|---------------------|-------------|-------------|
| (1) 金銭の信託 | 29,712 | 29,712 | - |
| (2) 投資有価証券 其他有価証券 | 1 | 1 | - |
| 資産計 | 29,714 | 29,714 | - |

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

2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

| 区分 | 時価(百万円) | | | |
|--------|---------|--------|------|--------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 金銭の信託 | - | 29,712 | - | 29,712 |
| 投資有価証券 | - | - | - | - |
| 其他有価証券 | - | 1 | - | 1 |
| 資産計 | - | 29,714 | - | 29,714 |

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 (百万円) |
|-----------------|---------------------|
| 投資有価証券(その他有価証券) | |
| 非上場株式 | 180 |
| 関係会社株式 | |
| 非上場株式 | 5,810 |

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末
(2022年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,810百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額180百万円)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。

(持分法損益等)

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2022年4月1日から2022年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

| | |
|------|-----------|
| 流動資産 | - 百万円 |
| 固定資産 | 72,873百万円 |
| 資産合計 | 72,873百万円 |
| 流動負債 | - 百万円 |
| 固定負債 | 4,223百万円 |
| 負債合計 | 4,223百万円 |
| 純資産 | 68,650百万円 |

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額53,357百万円及び顧客関連資産の金額23,061百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

| | |
|------------|------------|
| 営業収益 | - 百万円 |
| 営業利益 | 4,019百万円 |
| 経常利益 | 4,019百万円 |
| 税引前中間純利益 | 4,019百万円 |
| 中間純利益 | 3,372百万円 |
| 1株当たり中間純利益 | 84,308円98銭 |

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,114百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第38期中間会計期間
(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

| | |
|---------|-----------|
| 委託者報酬 | 48,925百万円 |
| 運用受託報酬 | 7,338百万円 |
| 投資助言報酬 | 1,029百万円 |
| 成功報酬(注) | 32百万円 |
| その他営業収益 | 11百万円 |
| 合計 | 57,336百万円 |

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において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. 重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

(セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

| 第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日) | |
|--|---------------|
| 1株当たり純資産額 | 1,835,889円89銭 |
| 1株当たり中間純利益金額 | 205,562円11銭 |

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日) |
|----------------------------|--|
| 中間純利益金額 | 8,222百万円 |
| 普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額 | 8,222百万円 |
| 普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数 | 40,000株 |
| (うち普通株式) | (24,490株) |
| (うちA種種類株式) | (15,510株) |

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は、アストマックス株式会社からPayPayアセットマネジメント株式会社（以下「PPAM」といいます。）の発行済株式の49.9%を2022年8月1日付で譲り受けており、同日付でPPAMは委託会社の関連会社となりました。

(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（2022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) 17,495 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 西村証券株式会社 | 500 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| SMB C日興証券株式会社 | 10,000 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 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2022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) 2021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
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

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、継続企業的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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年12月16日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光7資産バランスファンドの2022年4月21日から2022年10月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの2022年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11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 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 敬指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記の中間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) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。