

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年1月20日提出
【計算期間】	第32特定期間(自 2022年4月21日至 2022年10月20日)
【ファンド名】	新光7資産バランスファンド
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
		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。

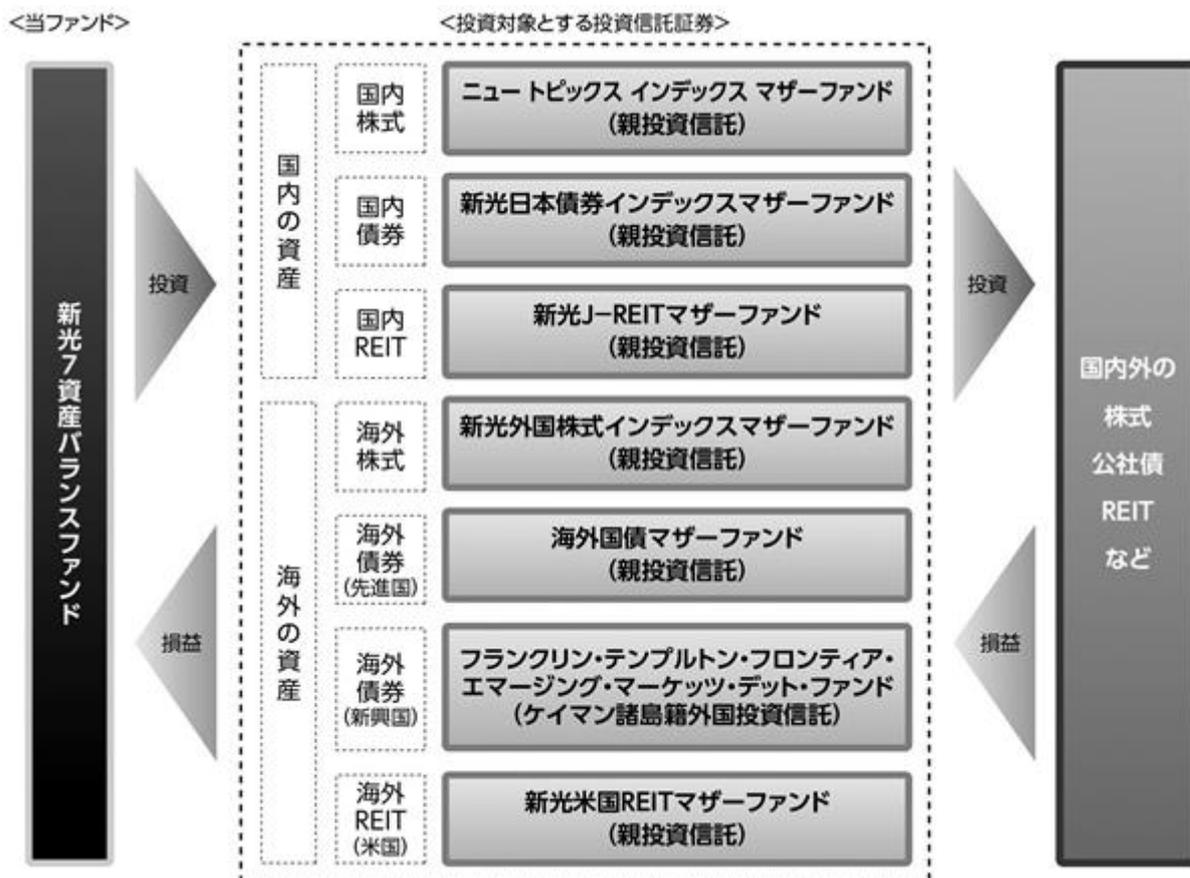
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



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。

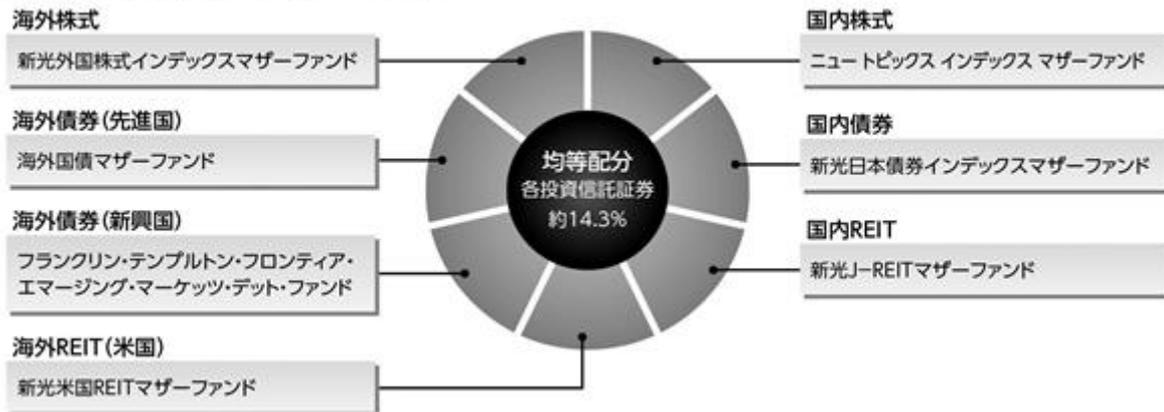


2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



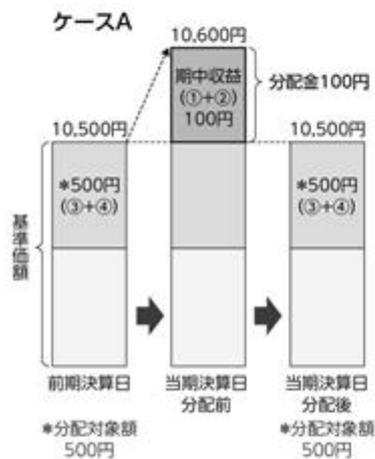
◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係(イメージ)

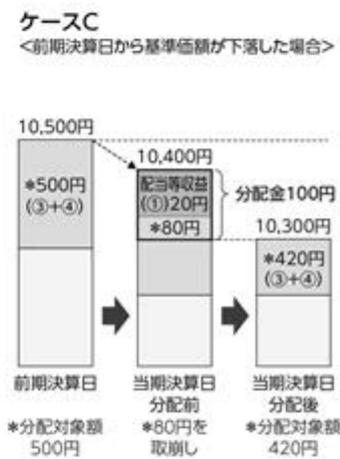
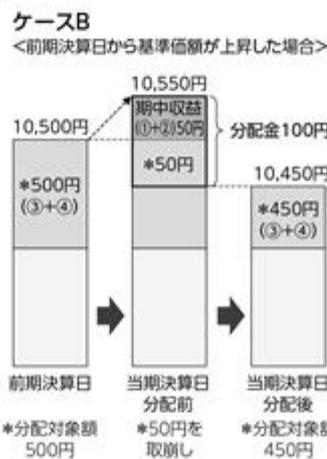
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

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

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

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

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

◆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



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

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

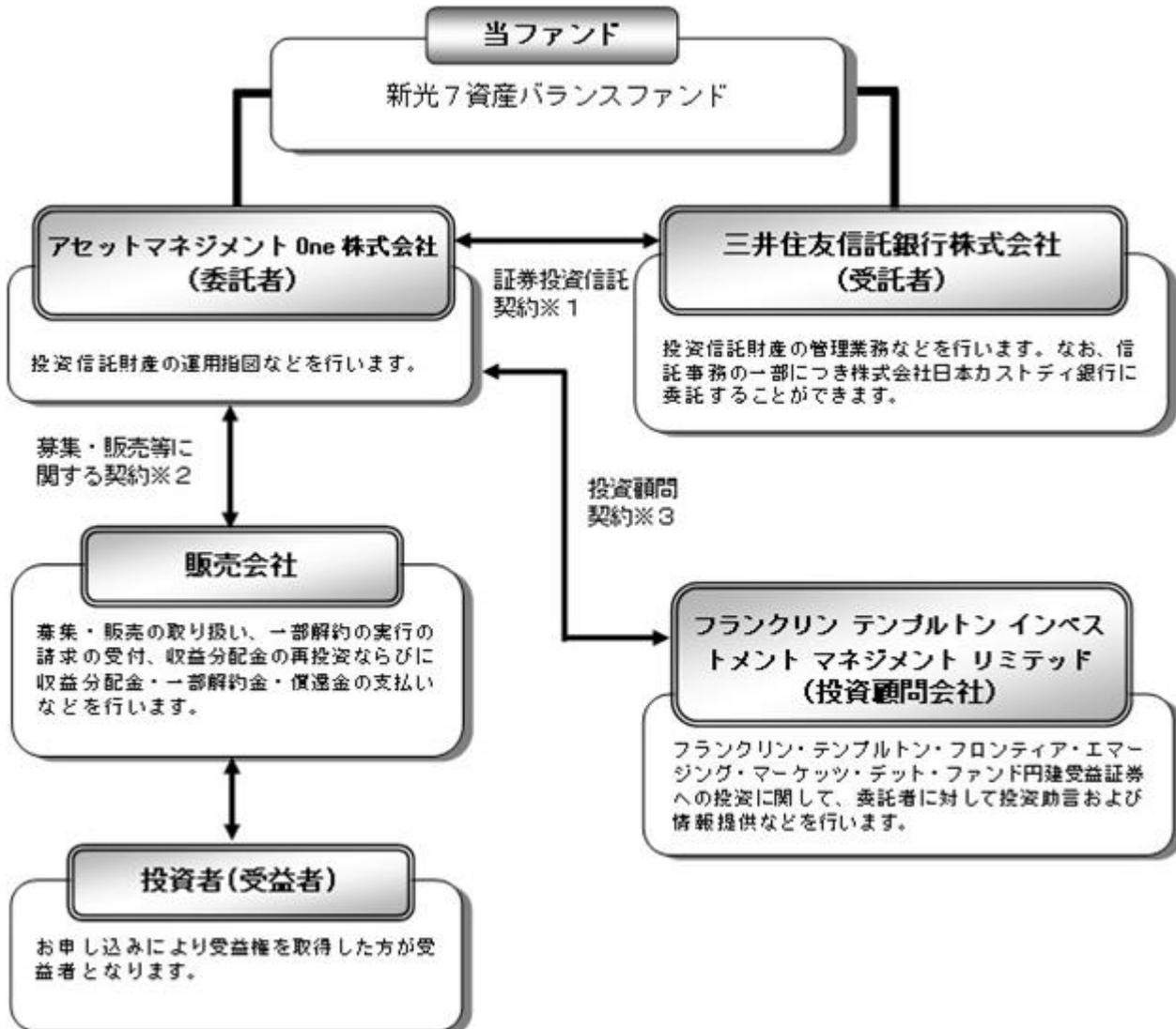
元本払戻金(特別分配金) : 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み



1 証券投資信託契約

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

2 募集・販売等に関する契約

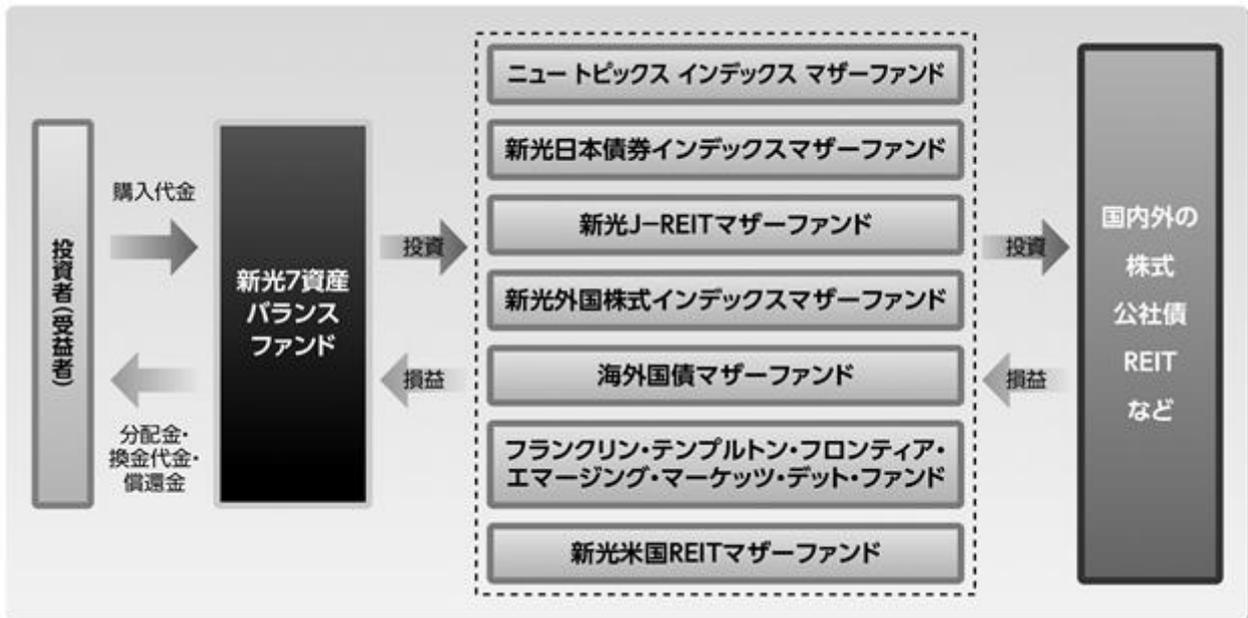
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2022年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「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

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

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

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

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

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

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

(2) 【投資対象】

a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

b. 運用の指図範囲

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

1. ケイマン諸島籍外国投資信託 フランクリン・テンプレート・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。

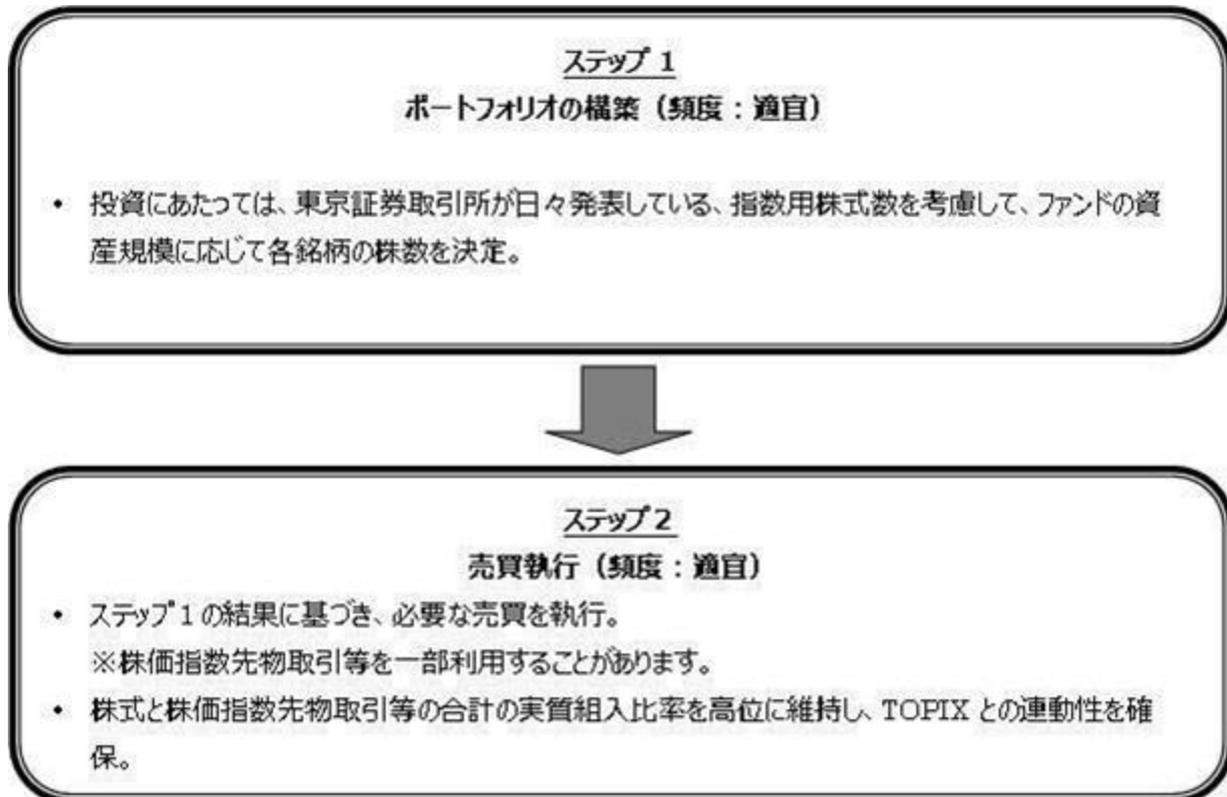
J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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

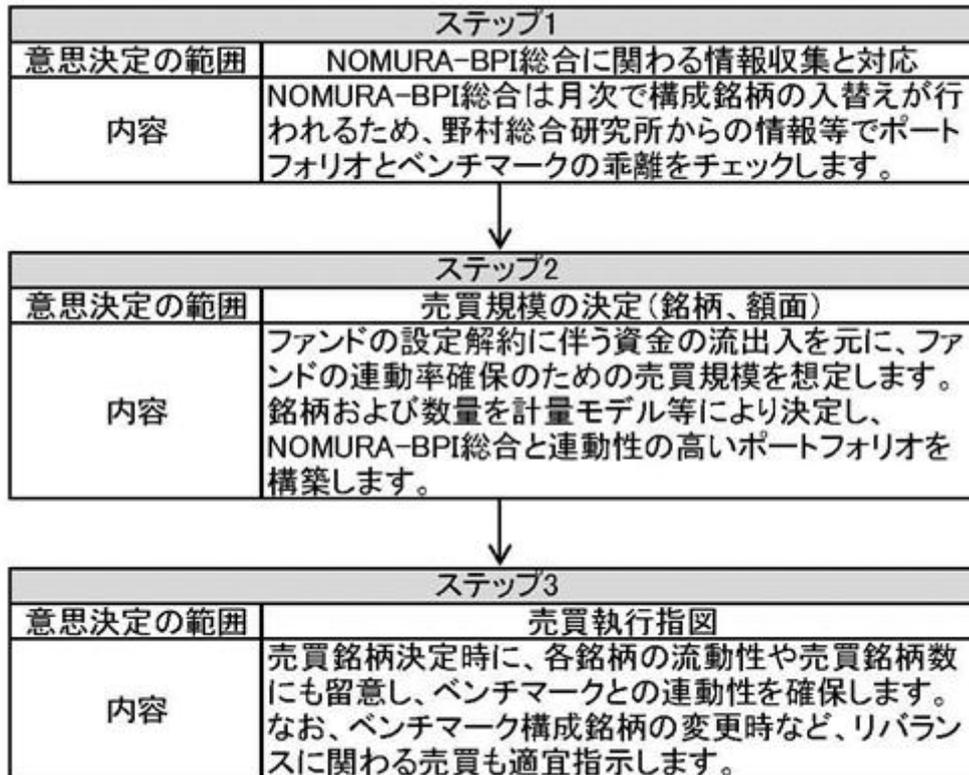
NOMURA - B P I 総合について

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。

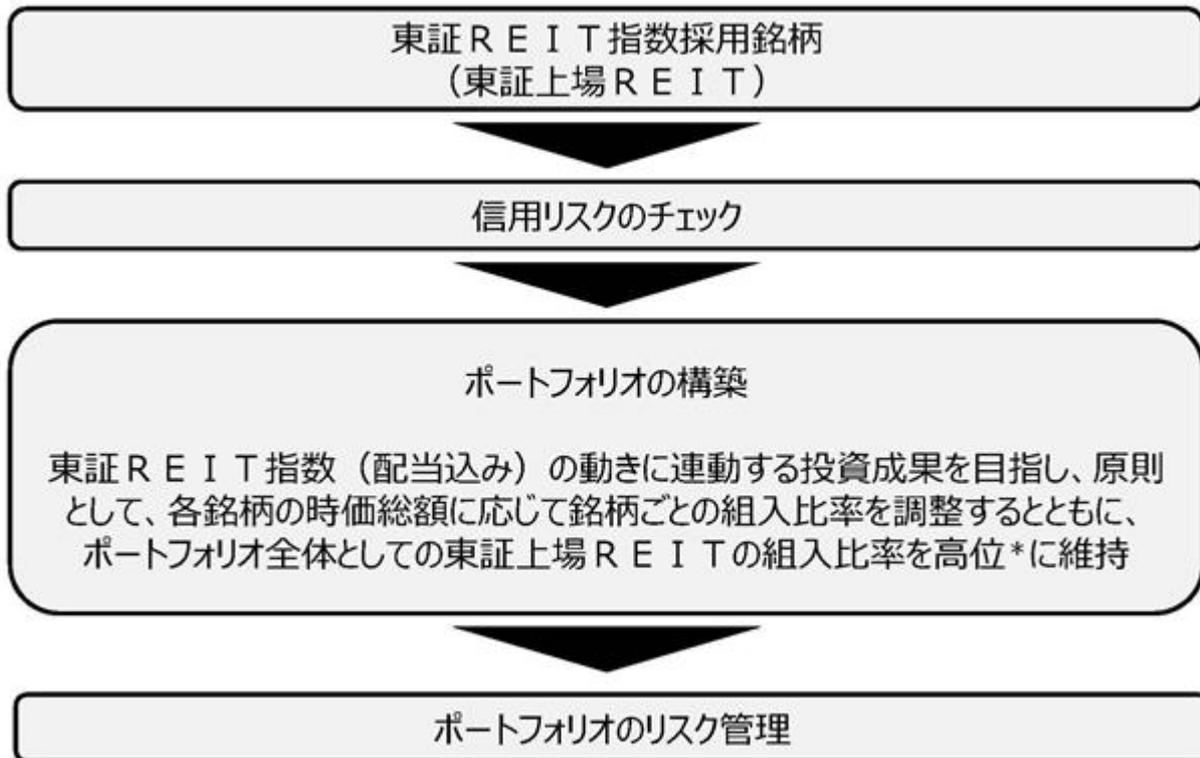
J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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。

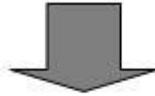
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

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。

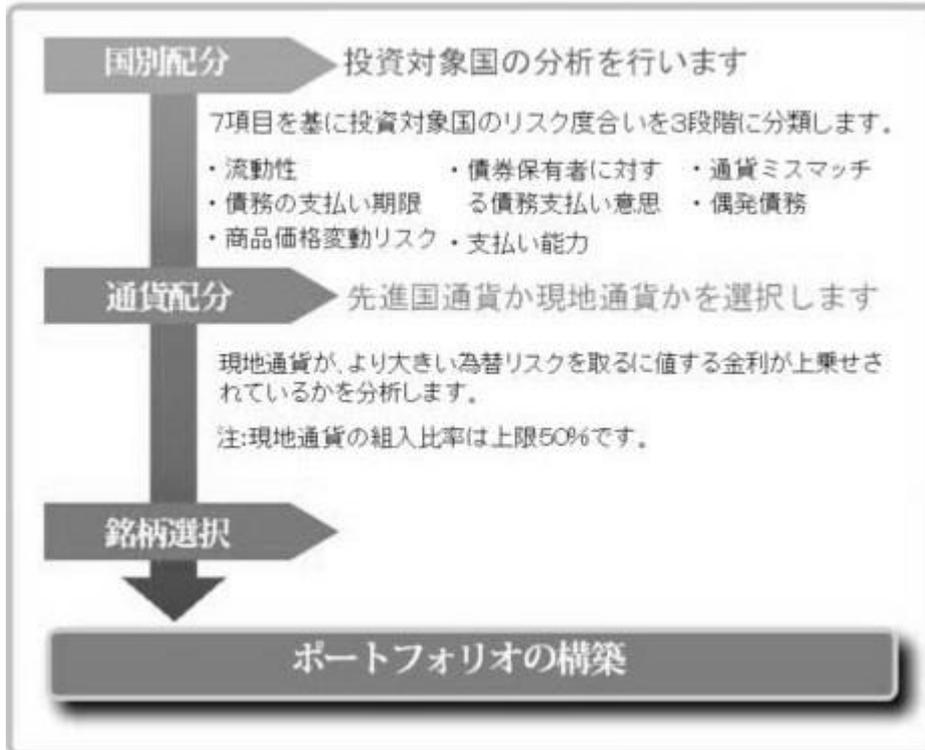
ファンド名	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、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 (F T I M L 社) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン・テンプレトン (設立 : 1947年、運用総資産 : 約187.9兆円) の一員です。 F T I M L 社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

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 : F T I M L 社資料を基にアセットマネジメントOne作成

運用プロセスは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。

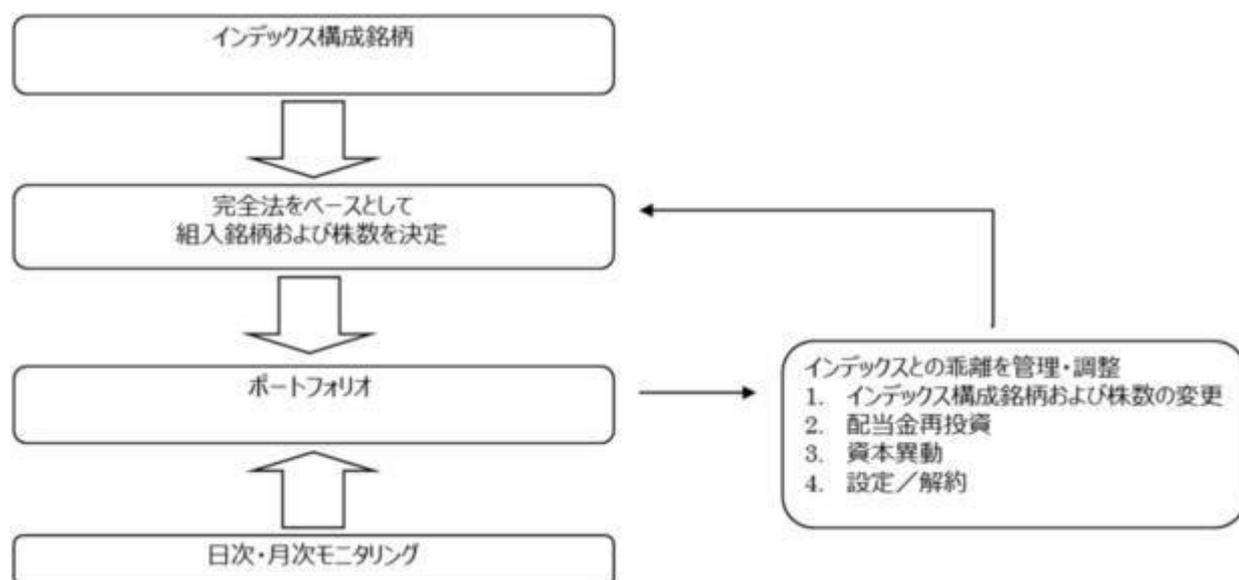
新光米国REITマザーファンド（以下「当マザーファンド」といいます。）は、アセットマネジメントOne株式会社によって単独で開発されたものです。当マザーファンドは、いかなる方法においても、FTSE、London Stock Exchange Group plcおよび、そのグループ企業（以下、総称して「LSE Group」といいます。）またはNareitによって出資、保証、販売または販売促進されることはありません。

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。



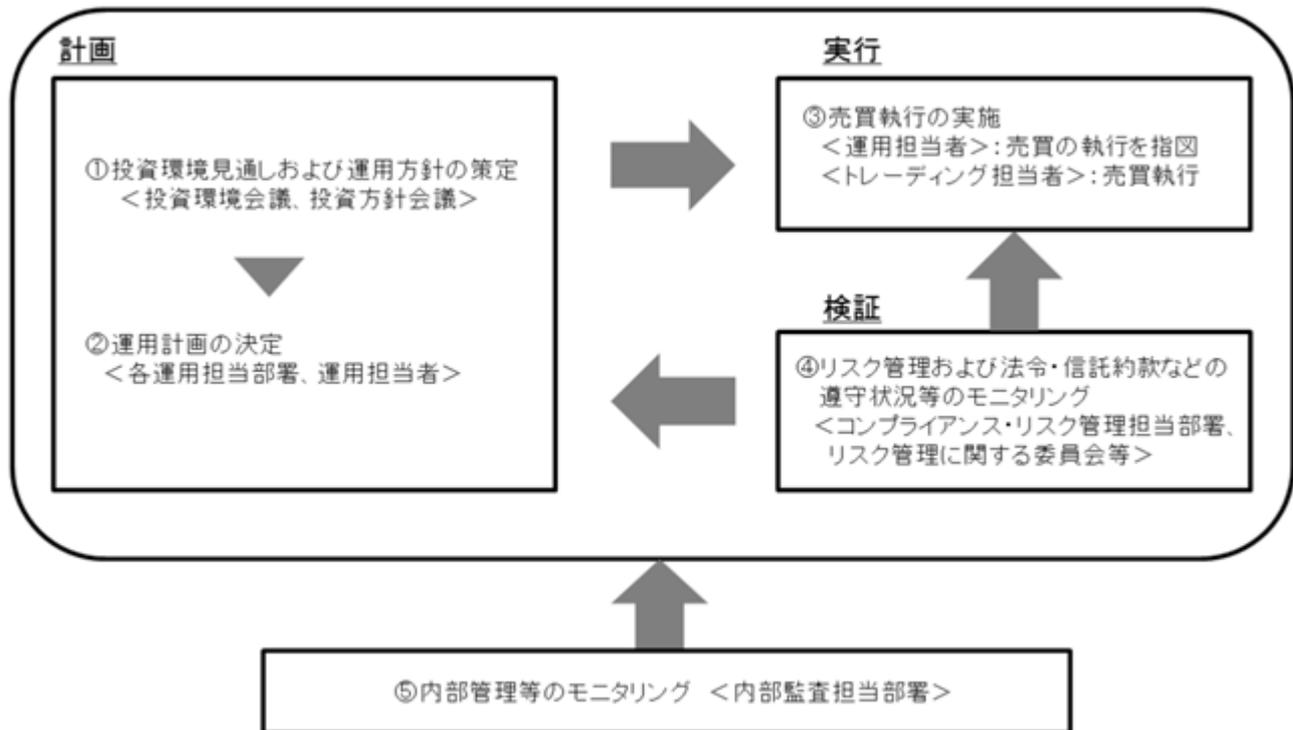
運用プロセスは2022年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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。

定期的に関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られたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

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

(ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d. 同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

e. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

f. 外国為替予約の指図

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

g. 資金の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当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。実質的に投資する資産の価格変動などの影響により投資信託証券の構成比率が基本投資配分からかい離することが想定されます。一時的に構成比率が大きくなった資産の収益率が低くなった場合や、一つあるいは複数またはすべての資産価値が下落する場合には、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

b. 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

c. REITの価格変動リスク

REITの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

d. 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

e . カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

f . 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

g . 信用リスク

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

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

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

h . 流動性リスク

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

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

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

i . 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

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

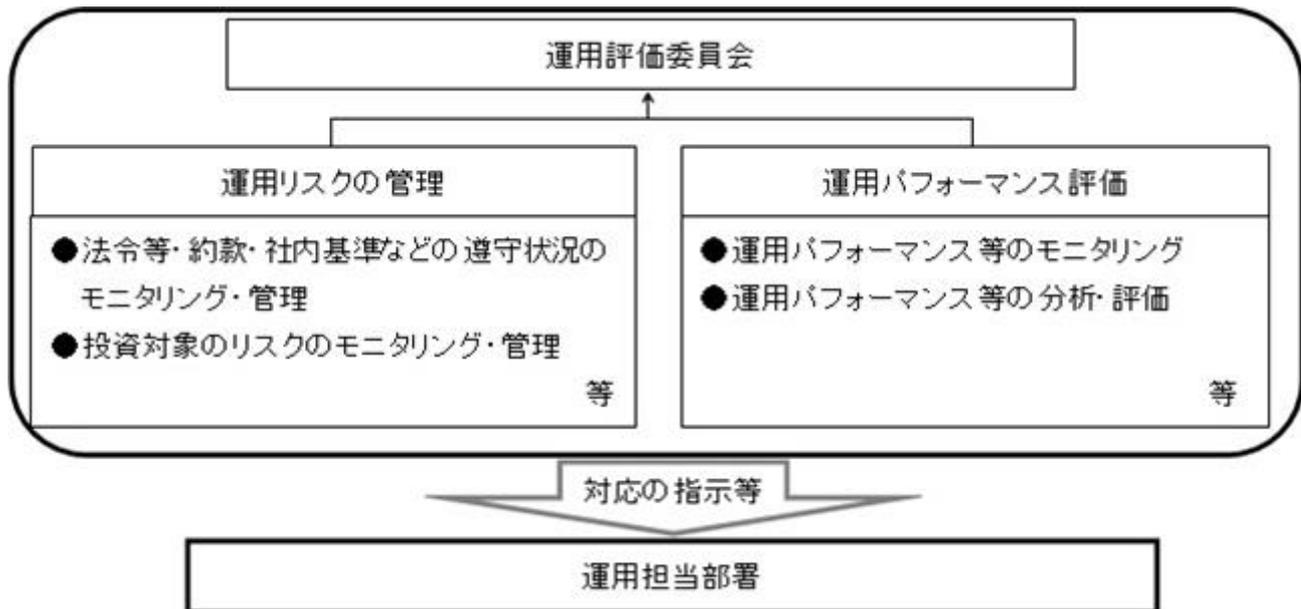
（ハ）有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

- (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＞

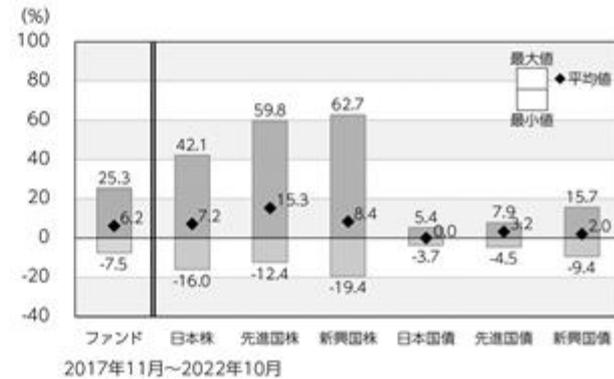
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



*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="414 488 1380 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
	内 ドイツ	31,959,138
	内 イギリス	24,259,536

(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
	内 フランス	2,248,883,309
	内 ドイツ	1,567,661,911
	内 イタリア	1,371,334,255
	内 カナダ	1,079,567,835
	内 イギリス	429,815,610
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
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-R E I T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R E I T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
特殊債券	6.06
社債券	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

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 アメリカ	835	6,751.75	7,405.58	-	1.02
	5,637,719			6,183,665	-		
29	CAMDEN PROPERTY TRUST	投資証券 アメリカ	355	16,713.34	17,046.93	-	1.00
	5,933,239			6,051,661	-		
30	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券 アメリカ	537	10,648.03	10,793.32	-	0.96
	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 - R E I T マザーファンド

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国 R E I T マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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。

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・テンプレート・フロンティア・エマーシング・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 テンプレート 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・テンプレート・フロンティア・エマーシング・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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第 2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

2 【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

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

(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られない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記（二）の規定に準じて計算された価額とします。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。)

インターネットホームページ

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

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

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

(4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5)【その他】

a. 信託の終了(投資信託契約の解約)

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

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

b. 投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d. 運用報告書

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

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

e. 公告

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

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

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

f. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g. 信託事務処理の再信託

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

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

h. 信託業務の委託等

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

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

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

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

(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します。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

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

- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(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	<u>4,740,139,785</u>	<u>4,416,149,815</u>
資産合計	<u>4,740,139,785</u>	<u>4,416,149,815</u>
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	<u>12,673,422</u>	<u>17,624,535</u>
負債合計	<u>12,673,422</u>	<u>17,624,535</u>
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	<u>4,727,466,363</u>	<u>4,398,525,280</u>
純資産合計	<u>4,727,466,363</u>	<u>4,398,525,280</u>
負債純資産合計	<u>4,740,139,785</u>	<u>4,416,149,815</u>

(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 至 2022年4月20日	自 2022年4月21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	
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>

<p>(自2021年11月23日 至2021年12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(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。</p>	<p>(自2022年5月21日 至2022年6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(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。</p>
<p>(自2021年12月21日 至2022年1月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p>	<p>(自2022年6月21日 至2022年7月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p>
<p>(自2022年1月21日 至2022年2月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p>	<p>(自2022年7月21日 至2022年8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(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>

<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	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. 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った場合、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	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・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	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 - R E I Tマザーファンド	277,479,957	594,611,799	
	新光米国 R E I T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・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」投資信託証券、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」受益証券、「新光日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「新光J - R E I Tマザーファンド」受益証券、「新光外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「海外国債マザーファンド」受益証券及び「新光米国 R E I Tマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」及び「親投資信託受益証券」は、すべてこれらの証券であります。

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額 元本の内訳 ファンド名 新光7資産バランスファンド ニュー トピックス インデックス（変額年金） 世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募） 新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募） ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募） ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募） 太陽財形株投 太陽一般財形 30 太陽財形株投 太陽一般財形 50 太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30 計	653,687,843円 23,788,750円 61,932,745円 226,901,520円 50,159,401円 286,077,208円 11,935,060円 16,615,106円 8,024,334円 4,445,785円 10,620,035円 765,399円 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にしてあります。

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	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		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	75,600,000	-		75,720,000
合計	75,600,000	-		75,720,000

(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	
I N P E X	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
ダイダク	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
キリンホールディングス	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
ビーロット	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
J S R	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
J C R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 Holdings	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	
ACCESS	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	
JCU	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	
ENEOS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
LIXIL	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
FUJI	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
DMG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
ペガサスマシン製造	100	867.00	86,700
ナブテスコ	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	
N O K	300	1,128.00	338,400	
フタバ産業	200	327.00	65,400	
K Y B	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	
メディバ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
タカラスタンダード	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
キャ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
三愛オブリ	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
M r M a x H D	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	
PALTA C	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
常盤興産	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	
ベルーナ	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	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年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）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
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

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	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 Ihracat 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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（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 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	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おります。

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

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。 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、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>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) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2022年5月10日	臨時報告書
2022年7月20日	有価証券報告書
2022年7月20日	有価証券届出書
2022年8月3日	臨時報告書

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 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員指定有限責任社員 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、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) 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) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。