【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年7月20日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　杉原　規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	新光７資産バランスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

新光７資産バランスファンド

愛称として「七重奏」という名称を用いることがあります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

（イ）追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

（ロ）当初元本は１口当たり１円です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

（イ）発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については１万口当たりの価額を発表します。

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター　0120-104-694

（受付時間は営業日の午前９時から午後５時までです。）

インターネットホームページ

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

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

（５）【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時から午後５時までです。）
インターネットホームページ
http://www.am-one.co.jp/

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

（６）【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時から午後５時までです。）
インターネットホームページ
http://www.am-one.co.jp/

（７）【申込期間】

2023年7月21日から2024年1月19日までです。

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

（８）【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所（販売会社）については、下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター　0120-104-694

（受付時間は営業日の午前９時から午後５時までです。）

インターネットホームページ

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

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

（イ）申込証拠金

ありません。

（ロ）日本以外の地域における発行

ありません。

（ハ）振替受益権について

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

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

ａ．ファンドの目的及び基本的性格

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

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

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

■商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型	国　内	株　　式
追加型	海　外	債　　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

■商品分類の定義

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

■属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

■属性区分の定義

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

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

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

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

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

b．ファンドの特色

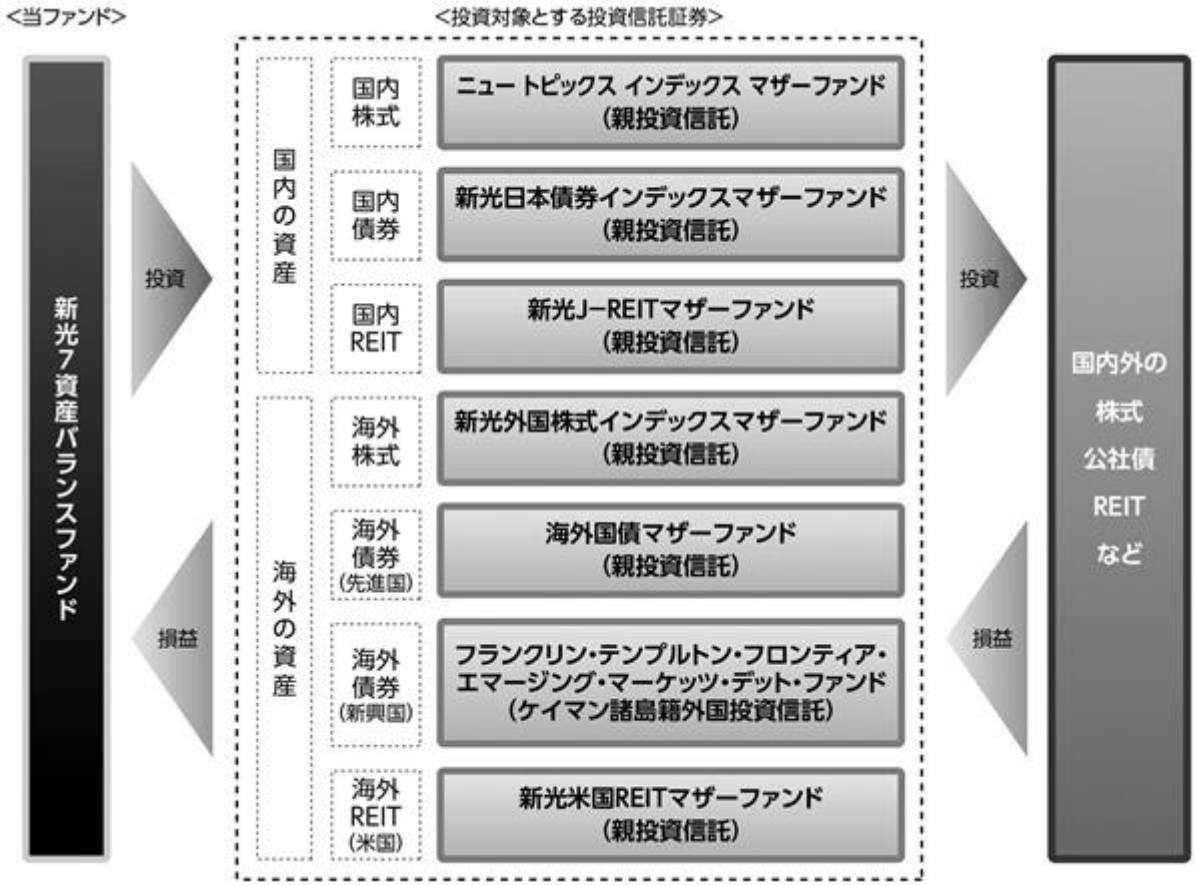
1 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産（株式、公社債、不動産投資信託証券）にバランスよく分散投資します。

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

●投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とします。

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

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



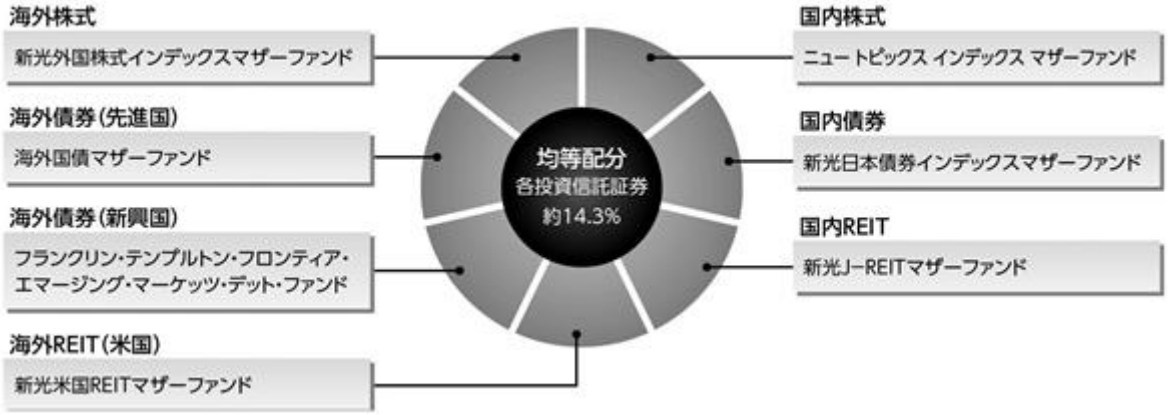
2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

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

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

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



■分配方針

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

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

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

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

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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ

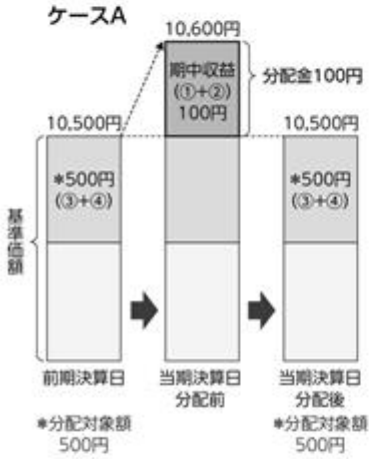
◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係（イメージ）

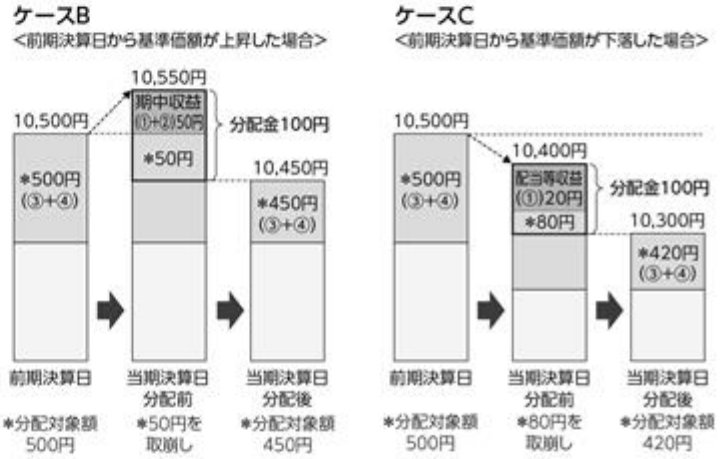
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



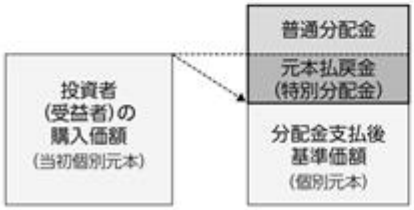
上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

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

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

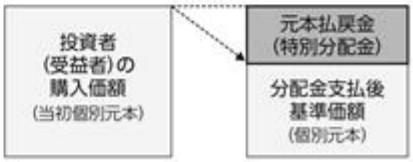
◆投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



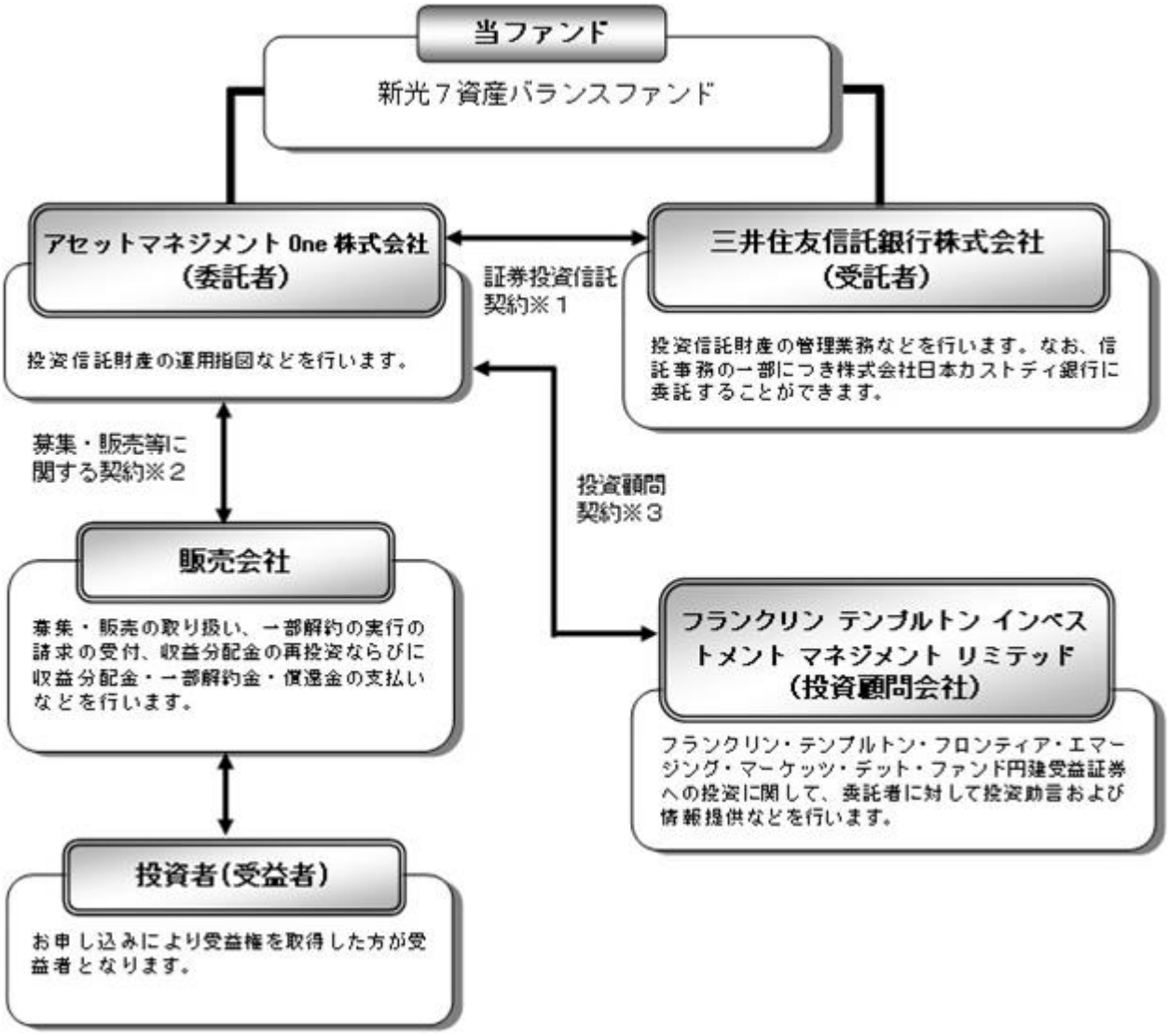
普通分配金　　：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】

ａ．ファンドの仕組み



※１　証券投資信託契約

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

※２　募集・販売等に関する契約

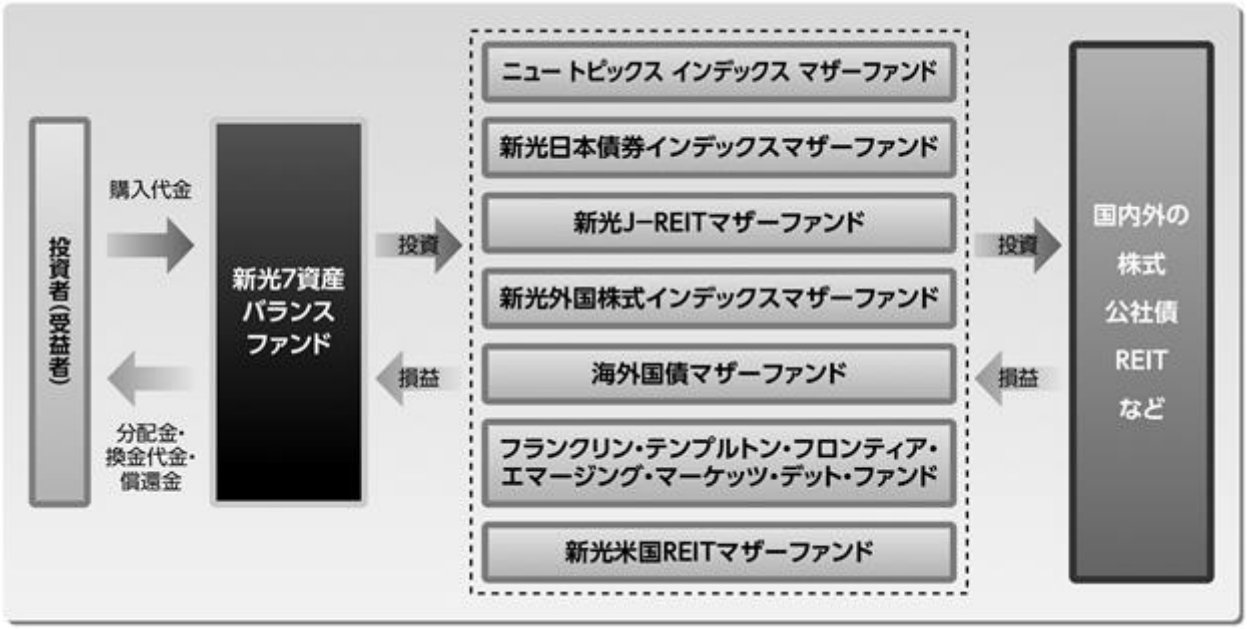
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

※３　投資顧問契約

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

■当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



ｂ．委託会社の概況

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

資本金の額
20億円（2023年4月28日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2023年4月28日現在）

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

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

ａ．基本方針

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

ｂ．運用の方法

（イ）主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

（ロ）投資態度

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

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

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

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

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

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

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

（２）【投資対象】

ａ．投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ｂ．運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

８．コマーシャル・ペーパー

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

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

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

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

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

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

東証株価指数について

東証株価指数（TOPIX）とは、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。

①東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。

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

③ＪＰＸは、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

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

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。

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

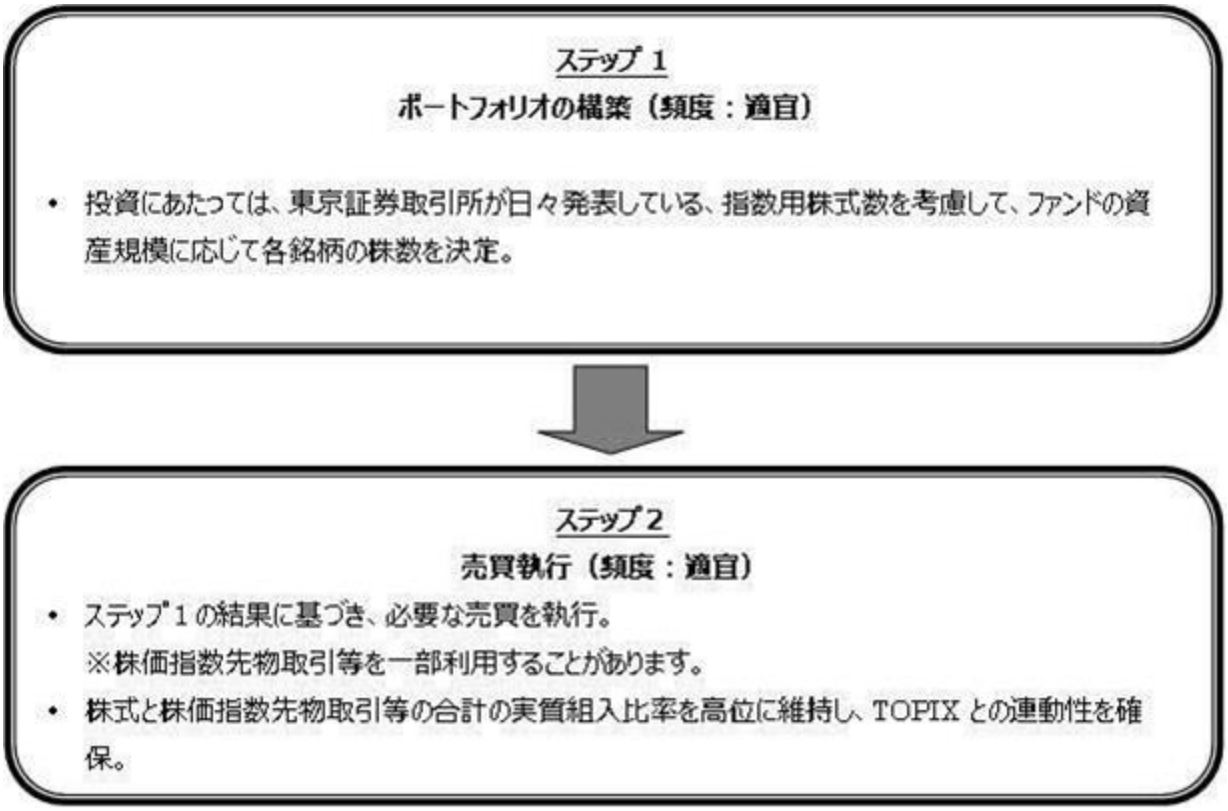
⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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

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

運用プロセス

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



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

※運用プロセスは2023年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合について

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募利付債券市場全体の動向を表す投資収益指標で、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

運用プロセス

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

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

↓

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

↓

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

なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

※運用プロセスは2023年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

東証REIT指数（配当込み）について

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

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

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

③ＪＰＸは、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

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

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。

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

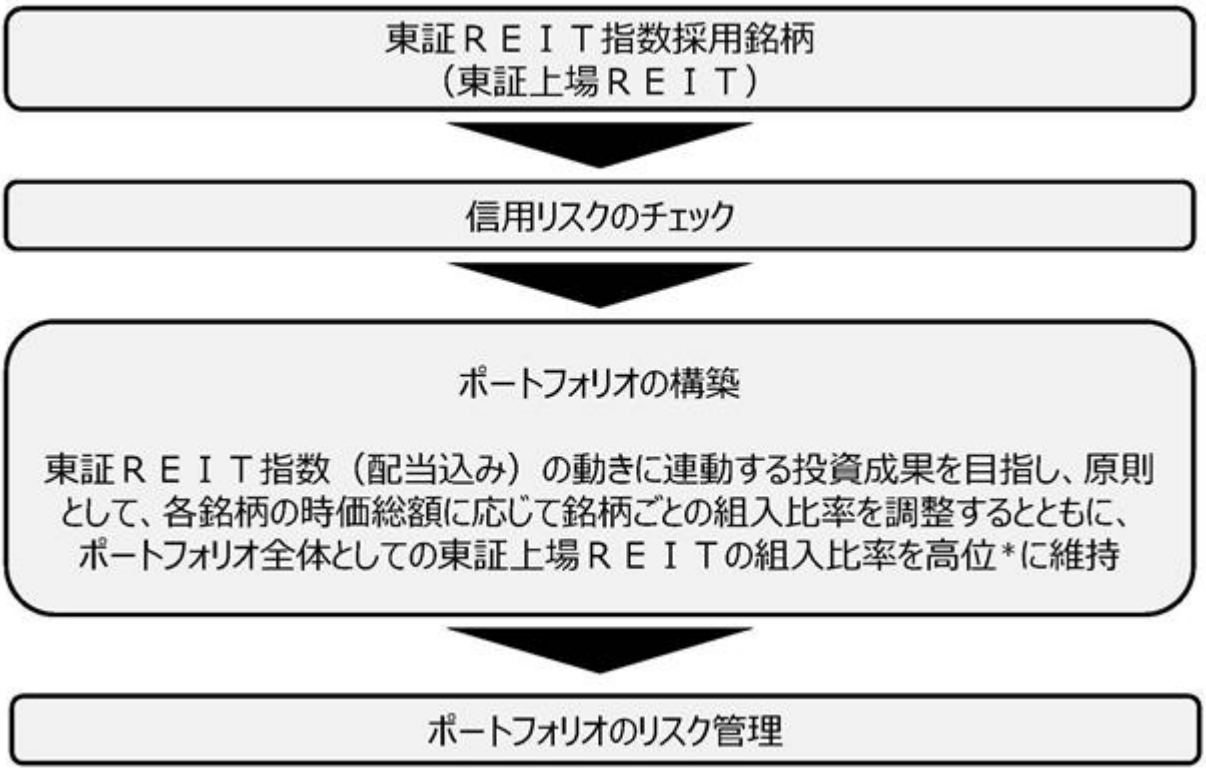
⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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

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

運用プロセス

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



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

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

＊不動産投信指数先物取引を一部利用することがあります。

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

※運用プロセスは2023年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

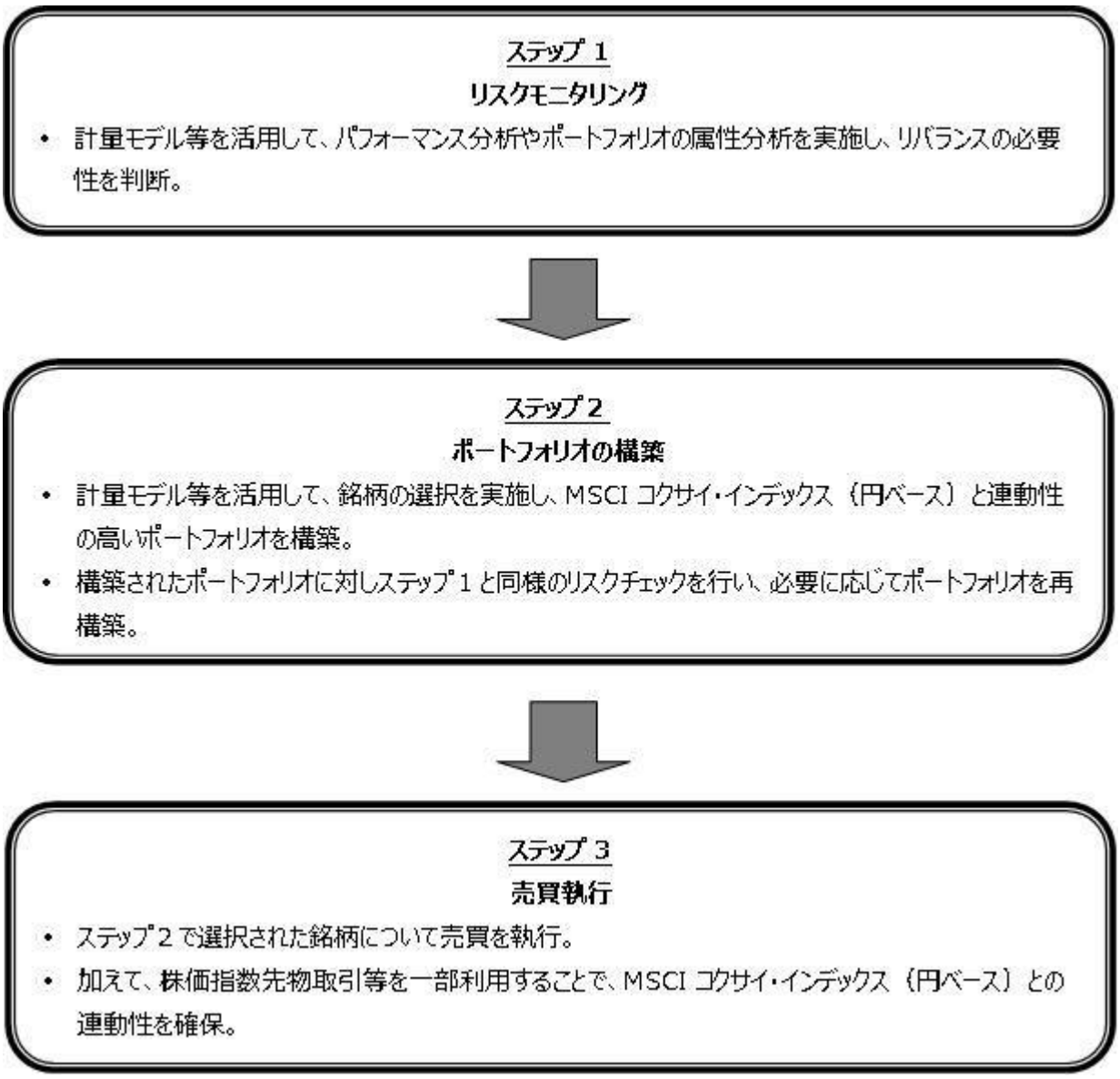
MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、アセットマネジメントOne株式会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会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

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

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

運用プロセス

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



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

※運用プロセスは2023年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、７～10年、円ベース）について

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

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

運用プロセス

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

※運用プロセスは2023年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

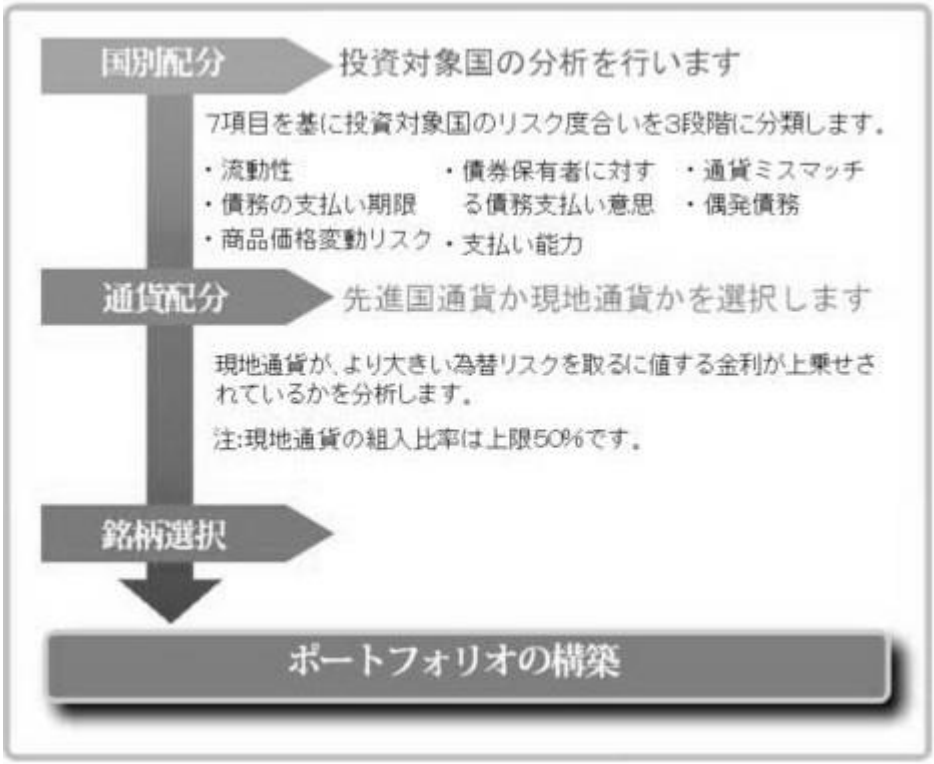
ファンド名	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド （以下、当概要において「ファンド」といいます。）
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託／円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、政府保証債は除きます。 ・クレジットリンク債への投資は、純資産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

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（ＦＴＩＭＬ社）は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン・テンプルトン（設立：1947年、運用総資産：約189.9兆円※）の一員です。ＦＴＩＭＬ社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

※2023年3月末現在、1米ドル＝133.53円で換算

運用プロセス



出所：ＦＴＩＭＬ社資料を基にアセットマネジメントOne作成

※運用プロセスは2023年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

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

FTSE NAREIT All Equity REITs インデックス（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。

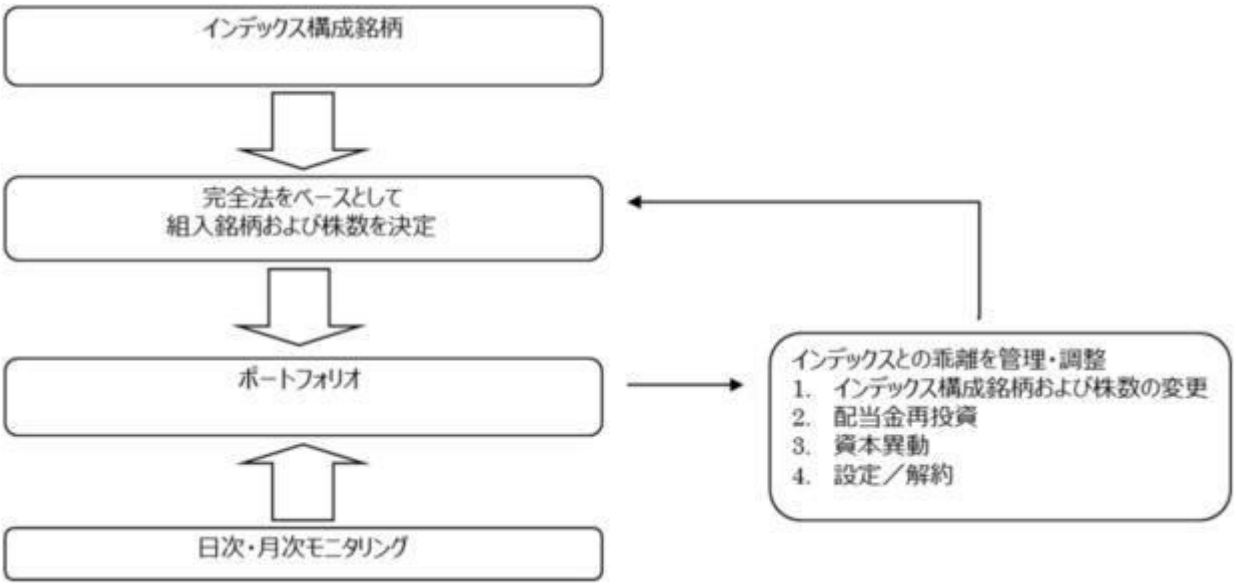
新光米国ＲＥＩＴマザーファンド（以下「当マザーファンド」ということがあります。）は、アセットマネジメントOne株式会社によって単独で開発されたものです。当マザーファンドは、いかなる方法においても、FTSE、London Stock Exchange Group plcおよび、そのグループ企業（以下、総称して「LSE Group」といいます。）またはNareitによって出資、保証、販売または販売促進されることはありません。

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。

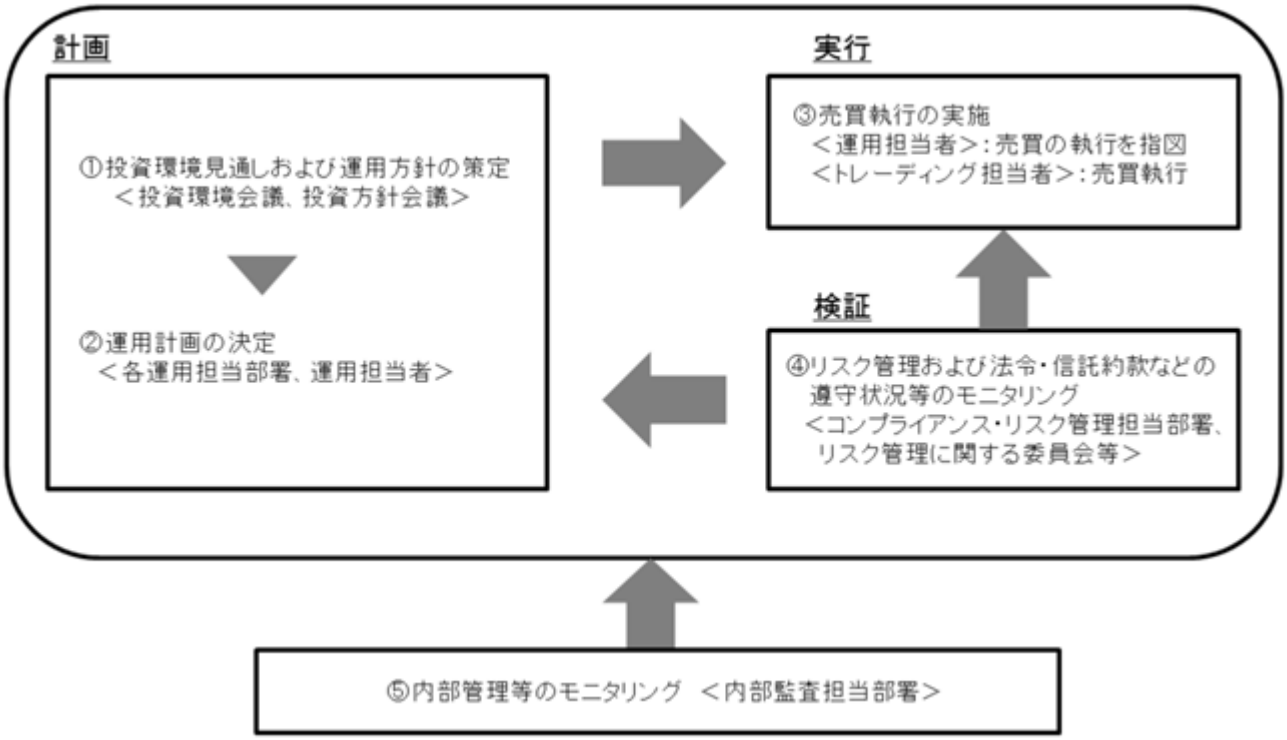


※運用プロセスは2023年4月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

※前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。
※前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は2023年7月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2023年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（５）【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

ａ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ｂ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ｃ．公社債の借り入れ

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

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

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

（ニ）借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

ｄ．同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

ｅ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ｆ．外国為替予約の指図

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

ｇ．資金の借り入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

ｈ．受託者の自己または利害関係人等との取引

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

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

ｉ．デリバティブ取引等に係る投資制限

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

ｊ．信用リスク集中回避のための投資制限

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

ｋ．ファンドの投資制限

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

ａ．資産配分リスク

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

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

ｂ．株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

ｃ．ＲＥＩＴの価格変動リスク

ＲＥＩＴの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

ｄ．為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

ｅ．カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

ｆ．金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

ｇ．信用リスク

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

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

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

ｈ．流動性リスク

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

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

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

ｉ．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

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

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

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

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

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

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

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

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

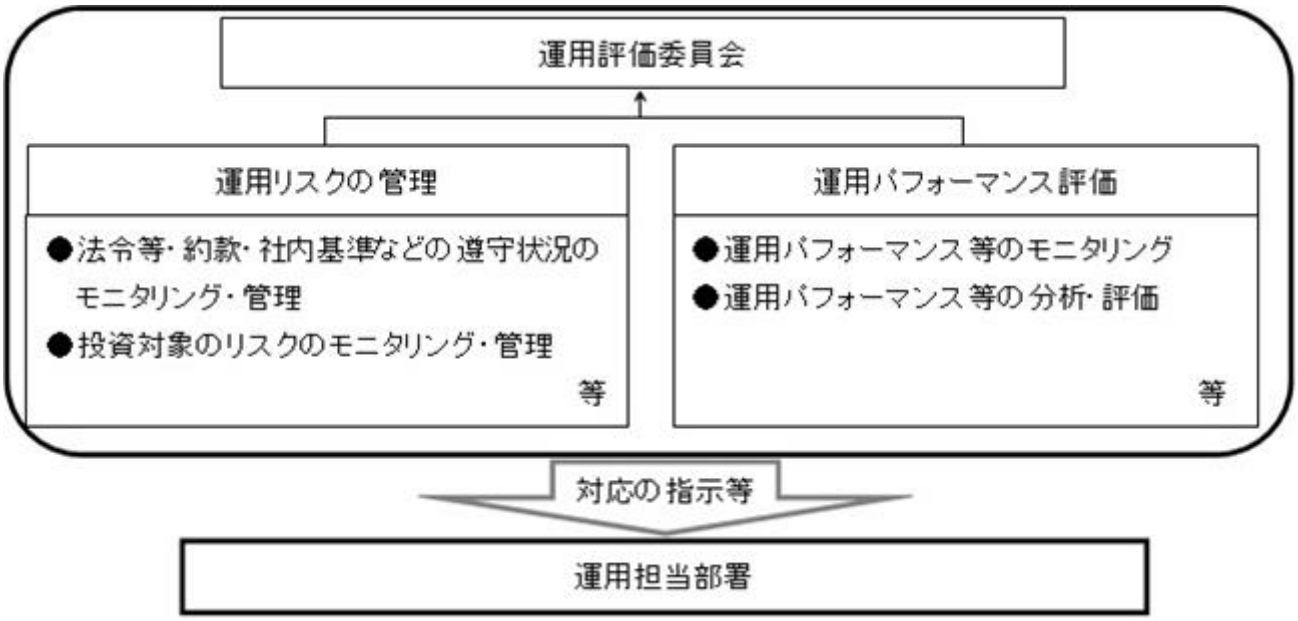
（２）リスク管理体制

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

・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。

・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。

・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



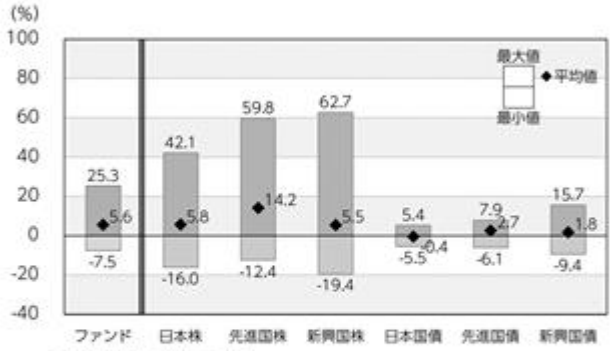
・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は2023年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2018年5月～2023年4月

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

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時から午後５時までです。）
インターネットホームページ
http://www.am-one.co.jp/

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

ａ．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

ｂ．信託財産留保額

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

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

（３）【信託報酬等】

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

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

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

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

＜2024年1月1日以降＞

少額投資非課税制度（ＮＩＳＡ）をご利用の場合、一定の額を上限として、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無期限で非課税となります。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。また、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

○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、2023年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

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

③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券		618,691,800	14.17
	内　ケイマン諸島	618,691,800	14.17
親投資信託受益証券		3,623,447,659	82.97
	内　日本	3,623,447,659	82.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		125,250,344	2.87
純資産総額		4,367,389,803	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

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		1,550,659,940	96.29
	内　日本	1,550,659,940	96.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		59,789,382	3.71
純資産総額		1,610,449,322	100.00

その他資産の投資状況

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）		41,160,000	2.56
	内　日本	41,160,000	2.56

（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

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		8,723,071,800	83.27
	内　日本	8,723,071,800	83.27
地方債証券		671,776,700	6.41
	内　日本	671,776,700	6.41
特殊債券		613,729,000	5.86
	内　日本	613,729,000	5.86
社債券		397,952,000	3.80
	内　日本	397,952,000	3.80
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		69,430,868	0.66
純資産総額		10,475,960,368	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

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		82,959,397,368	97.23
	内　日本	82,959,397,368	97.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,367,183,182	2.77
純資産総額		85,326,580,550	100.00

その他資産の投資状況

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		2,247,805,500	2.63
	内　日本	2,247,805,500	2.63

（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

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		1,492,812,496	89.50
	内　アメリカ	1,031,377,394	61.84
	内　イギリス	67,421,954	4.04
	内　フランス	55,468,511	3.33
	内　カナダ	55,124,634	3.31
	内　スイス	52,841,079	3.17
	内　ドイツ	40,612,500	2.43
	内　オーストラリア	32,119,411	1.93
	内　オランダ	28,835,128	1.73
	内　アイルランド	28,397,926	1.70
	内　スウェーデン	14,981,610	0.90
	内　デンマーク	14,660,887	0.88
	内　スペイン	12,536,162	0.75
	内　香港	9,706,360	0.58
	内　イタリア	8,696,165	0.52
	内　ジャージィー	5,723,189	0.34
	内　シンガポール	5,673,640	0.34
	内　フィンランド	5,468,248	0.33
	内　ベルギー	3,866,561	0.23
	内　イスラエル	3,283,091	0.20
	内　ノルウェー	3,147,466	0.19
	内　バミューダ	3,110,997	0.19
	内　ケイマン諸島	2,527,053	0.15
	内　オランダ領キュラソー	2,090,684	0.13
	内　ニュージーランド	1,317,428	0.08
	内　ルクセンブルグ	998,542	0.06
	内　ポルトガル	934,322	0.06
	内　オーストリア	833,983	0.05
	内　リベリア	446,604	0.03
	内　マン島	367,441	0.02
	内　パナマ	243,526	0.01

投資信託受益証券		2,432,615	0.15
	内　オーストラリア	1,919,905	0.12
	内　シンガポール	512,710	0.03
投資証券		30,214,349	1.81
	内　アメリカ	28,344,620	1.70
	内　イギリス	717,541	0.04
	内　フランス	470,420	0.03
	内　香港	441,637	0.03
	内　ベルギー	160,724	0.01
	内　カナダ	79,407	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		142,424,750	8.54
純資産総額		1,667,884,210	100.00

その他資産の投資状況

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		137,340,672	8.23
	内　アメリカ	111,428,497	6.68
	内　イギリス	13,124,480	0.79
	内　ドイツ	12,787,695	0.77

（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

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		13,331,157,004	98.61
	内　アメリカ	6,092,437,116	45.06
	内　フランス	2,418,985,070	17.89
	内　イタリア	1,956,084,828	14.47
	内　ドイツ	1,525,725,612	11.29
	内　イギリス	741,472,662	5.48
	内　カナダ	596,451,716	4.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		188,580,964	1.39
純資産総額		13,519,737,968	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

2023年4月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		577,464,052	99.24
	内　アメリカ	577,464,052	99.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,437,800	0.76
純資産総額		581,901,852	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド ケイマン諸島	投資信託受益証券	344,100	1,804.0000 620,756,400	1,798.0000 618,691,800	－ －	14.17
2	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	204,751,522	2.9944 613,128,432	3.0210 618,554,347	－ －	14.16
3	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	277,479,957	2.1487 596,248,931	2.1949 609,040,757	－ －	13.95
4	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	2.5795 606,340,296	2.5865 607,962,155	－ －	13.92
5	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	146,523,768	4.1894 613,861,326	4.1449 607,326,365	－ －	13.91
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	479,625,172	1.2366 593,152,450	1.2482 598,668,139	－ －	13.71
7	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	244,032,668	2.4246 591,706,010	2.3845 581,895,896	－ －	13.32

（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

2023年4月28日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	14.17
親投資信託受益証券	82.97
合計	97.13

（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

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	29,200	1,815.38 53,009,300	1,857.00 54,224,400	－ －	3.37

2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	3,800	11,000.28 41,801,100	12,830.00 48,754,000	－ －	3.03
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	500	55,080.00 27,540,000	61,100.00 30,550,000	－ －	1.90
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	6,800	3,740.00 25,432,000	4,149.00 28,213,200	－ －	1.75
5	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	32,800	976.01 32,013,450	852.90 27,975,120	－ －	1.74
6	第一三共 日本	株式 医薬品	4,700	4,148.10 19,496,100	4,647.00 21,840,900	－ －	1.36
7	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	4,700	4,095.00 19,246,500	4,512.00 21,206,400	－ －	1.32
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,800	5,720.00 21,736,000	5,549.00 21,086,200	－ －	1.31
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,600	6,480.00 16,848,000	7,485.00 19,461,000	－ －	1.21
10	任天堂 日本	株式 その他製品	3,400	5,397.00 18,349,800	5,721.00 19,451,400	－ －	1.21
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,500	4,341.00 15,193,500	5,018.00 17,563,000	－ －	1.09
12	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	4,100	3,885.00 15,928,500	4,248.00 17,416,800	－ －	1.08
13	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	1,100	15,030.00 16,533,000	15,495.00 17,044,500	－ －	1.06
14	信越化学工業 日本	株式 化学	4,400	3,341.90 14,704,400	3,863.00 16,997,200	－ －	1.06
15	三井物産 日本	株式 卸売業	4,000	3,814.00 15,256,000	4,229.00 16,916,000	－ －	1.05
16	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	3,500	4,050.00 14,175,000	4,492.00 15,722,000	－ －	0.98
17	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	4,100	4,079.31 16,725,200	3,824.00 15,678,400	－ －	0.97
18	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	1,100	13,210.00 14,531,000	14,210.00 15,631,000	－ －	0.97
19	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	4,300	3,067.00 13,188,100	3,588.00 15,428,400	－ －	0.96
20	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	7,600	2,042.56 15,523,500	1,965.00 14,934,000	－ －	0.93
21	ダイキン工業 日本	株式 機械	600	21,275.00 12,765,000	24,620.00 14,772,000	－ －	0.92
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	5,200	2,751.00 14,305,200	2,720.00 14,144,000	－ －	0.88

23	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	2,900	3,789.00 10,988,100	4,799.00 13,917,100	－ －	0.86
24	ＳＭＣ 日本	株式 機械	200	60,650.00 12,130,000	67,750.00 13,550,000	－ －	0.84
25	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	2,600	5,924.00 15,402,400	5,094.00 13,244,400	－ －	0.82
26	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	8,600	1,461.93 12,572,600	1,531.50 13,170,900	－ －	0.82
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,600	7,185.00 11,496,000	7,880.00 12,608,000	－ －	0.78
28	ファナック 日本	株式 電気機器	2,600	4,232.84 11,005,400	4,589.00 11,931,400	－ －	0.74
29	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	1,900	6,142.00 11,669,800	6,145.00 11,675,500	－ －	0.72
30	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	5,000	1,887.00 9,435,000	2,048.00 10,240,000	－ －	0.64

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.29
合計	96.29

（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

2023年4月28日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	16.90
情報・通信業		8.20
輸送用機器		7.13
卸売業		5.92
化学		5.91
銀行業		5.89
医薬品		5.45
機械		5.26
サービス業		4.88
小売業		4.53
食料品		3.55
陸運業		2.96
精密機器		2.42
その他製品		2.29
保険業		2.14
建設業		1.93
不動産業		1.87
電気・ガス業		1.22
その他金融業		1.07

鉄鋼	0.85
ゴム製品	0.75
非鉄金属	0.71
証券、商品先物取引業	0.70
ガラス・土石製品	0.61
海運業	0.57
金属製品	0.53
空運業	0.48
繊維製品	0.46
石油・石炭製品	0.45
鉱業	0.28
パルプ・紙	0.16
倉庫・運輸関連業	0.13
水産・農林業	0.09
合計	96.29

（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。

新光日本債券インデックスマザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	１４６回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	150,000,000	100.48 150,723,000	100.38 150,574,500	0.1 2025/12/20	1.44
2	３３９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	120,000,000	101.13 121,367,400	100.97 121,167,600	0.4 2025/6/20	1.16
3	１４７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	120,000,000	100.18 120,220,800	100.12 120,154,800	0.005 2026/3/20	1.15
4	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	120,000,000	100.07 120,094,800	100.02 120,028,800	0.1 2028/3/20	1.15
5	３５１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	120,000,000	100.02 120,032,400	99.97 119,968,800	0.1 2028/6/20	1.15
6	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	112.91 112,915,000	111.71 111,718,000	2.1 2029/12/28	1.07
7	１８回　東京都公募公債２０年 日本	地方債証券	100,000,000	112.28 112,282,000	111.00 111,006,000	2.22 2029/3/19	1.06
8	３５３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	110,000,000	99.87 109,865,800	99.86 109,846,000	0.1 2028/12/20	1.05
9	３６回　東日本旅客鉄道社債 日本	社債券	100,000,000	103.94 103,945,000	103.12 103,127,000	2.11 2024/12/20	0.98

10	１２回　兵庫県公募公債 １５年 日本	地方債証券	100,000,000	103.26 103,260,000	102.27 102,275,000	0.781 2030/12/6	0.98
11	１４７回　高速道路機構債 日本	特殊債券	100,000,000	102.62 102,620,000	101.84 101,841,000	0.955 2034/12/20	0.97
12	２４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	101.19 101,195,000	100.91 100,918,000	0.484 2025/6/30	0.96
13	１４４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	100,000,000	100.38 100,388,000	100.33 100,331,000	0.1 2025/6/20	0.96
14	２１８回　神奈川県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	100.38 100,387,000	100.26 100,266,000	0.195 2025/12/19	0.96
15	１６９回　共同発行市場公募地方債 日本	地方債証券	100,000,000	100.22 100,229,000	100.20 100,205,000	0.205 2027/4/23	0.96
16	３４９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	100,000,000	100.12 100,127,000	100.13 100,138,000	0.1 2027/12/20	0.96
17	４３９回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	100,000,000	100.11 100,111,000	100.13 100,131,000	0.005 2024/8/1	0.96
18	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	100.12 100,123,000	100.00 100,000,000	0.17 2027/10/29	0.95
19	５０回　西日本高速道路債券 日本	社債券	100,000,000	99.87 99,871,000	99.96 99,965,000	0.04 2024/6/20	0.95
20	１１回　ブリヂストン社債 日本	社債券	100,000,000	99.93 99,932,000	99.72 99,726,000	0.295 2027/4/21	0.95
21	２５０回　住宅金融支援機構 日本	特殊債券	100,000,000	99.81 99,813,000	99.64 99,640,000	0.289 2028/11/20	0.95
22	８７回　中日本高速道路債券 日本	特殊債券	100,000,000	99.59 99,597,000	99.61 99,612,000	0.06 2026/3/18	0.95
23	１９０回　大阪府公募公債　５年 日本	地方債証券	100,000,000	99.43 99,430,000	99.47 99,474,000	0.001 2026/12/25	0.95
24	令和３年度１１回　愛知県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	97.92 97,924,000	96.91 96,917,000	0.145 2031/10/29	0.93
25	４９４回　九州電力社債 日本	社債券	100,000,000	95.44 95,447,000	95.13 95,134,000	0.31 2031/5/23	0.91
26	３３５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	90,000,000	101.03 90,927,900	100.81 90,731,700	0.5 2024/9/20	0.87
27	３４８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	90,000,000	100.05 90,048,300	100.21 90,196,200	0.1 2027/9/20	0.86

28	３６０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	90,000,000	99.01 89,112,100	99.01 89,117,100	0.1 2030/9/20	0.85
29	３４０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	101.30 81,041,600	101.07 80,860,800	0.4 2025/9/20	0.77
30	３３８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	80,000,000	101.07 80,857,600	100.86 80,694,400	0.4 2025/3/20	0.77

（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

2023年4月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	83.27
地方債証券	6.41
特殊債券	5.86
社債券	3.80
合計	99.34

（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

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	9,184	617,290.00 5,669,191,387	570,000.00 5,234,880,000	－ －	6.14
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	8,072	578,811.94 4,672,169,999	539,000.00 4,350,808,000	－ －	5.10
3	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	13,269	297,401.34 3,946,218,489	309,500.00 4,106,755,500	－ －	4.81
4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	25,457	158,946.79 4,046,308,680	159,100.00 4,050,208,700	－ －	4.75
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	39,720	101,645.71 4,037,367,662	99,500.00 3,952,140,000	－ －	4.63
6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	25,408	146,177.97 3,714,090,094	155,500.00 3,950,944,000	－ －	4.63
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	11,866	284,785.62 3,379,266,202	289,500.00 3,435,207,000	－ －	4.03
8	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	7,871	330,129.94 2,598,452,819	353,000.00 2,778,463,000	－ －	3.26
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	15,685	182,247.07 2,858,545,384	175,800.00 2,757,423,000	－ －	3.23

10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	17,610	147,281.29 2,593,623,652	151,000.00 2,659,110,000	－ －	3.12
11	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	34,649	47,003.95 1,628,640,143	58,700.00 2,033,896,300	－ －	2.38
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	25,386	76,127.49 1,932,572,507	76,800.00 1,949,644,800	－ －	2.28
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	5,384	377,261.31 2,031,174,905	353,500.00 1,903,244,000	－ －	2.23
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	12,011	154,945.94 1,861,055,789	155,800.00 1,871,313,800	－ －	2.19
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	23,655	78,484.57 1,856,552,735	77,100.00 1,823,800,500	－ －	2.14
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	2,718	609,053.97 1,655,408,692	661,000.00 1,796,598,000	－ －	2.11
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	5,308	304,511.08 1,616,344,822	323,000.00 1,714,484,000	－ －	2.01
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	4,156	414,193.76 1,721,389,271	396,000.00 1,645,776,000	－ －	1.93
19	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	3,110	468,530.08 1,457,128,567	511,000.00 1,589,210,000	－ －	1.86
20	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	9,637	154,590.78 1,489,791,441	161,600.00 1,557,339,200	－ －	1.83
21	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	2,921	499,726.37 1,459,700,731	491,500.00 1,435,671,500	－ －	1.68
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	9,257	152,171.53 1,408,651,870	153,700.00 1,422,800,900	－ －	1.67
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	9,037	151,810.15 1,371,908,331	155,900.00 1,408,868,300	－ －	1.65
24	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	4,581	331,215.98 1,517,300,431	300,500.00 1,376,590,500	－ －	1.61
25	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	3,764	299,476.82 1,127,230,776	340,500.00 1,281,642,000	－ －	1.50
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	10,909	109,803.18 1,197,842,909	115,700.00 1,262,171,300	－ －	1.48
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	5,773	205,474.05 1,186,201,709	213,400.00 1,231,958,200	－ －	1.44
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	7,365	162,495.04 1,196,775,986	156,700.00 1,154,095,500	－ －	1.35

29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	2,705	409,691.42 1,108,215,308	417,500.00 1,129,337,500	－ －	1.32
30	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	14,652.48	68,543.06 1,004,325,928	71,600.00 1,049,117,568	－ －	1.23

（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

2023年4月28日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.23
合計	97.23

（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

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	3,571	18,090.11 64,599,793	22,588.83 80,664,723	－ －	4.84
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,590	30,113.52 47,880,506	40,886.84 65,010,088	－ －	3.90
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	2,059	11,553.95 23,789,599	14,730.15 30,329,392	－ －	1.82
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	552	18,477.74 10,199,717	36,518.23 20,158,065	－ －	1.21
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	1,337	11,712.23 15,659,253	14,431.04 19,294,309	－ －	1.16
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	1,229	11,722.96 14,407,520	14,535.66 17,864,336	－ －	1.07

7	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	504	13,610.17 6,859,526	31,998.05 16,127,018	－ －	0.97
8	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	926	14,606.75 13,525,856	15,670.40 14,510,797	－ －	0.87
9	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	210	72,518.72 15,228,932	65,786.73 13,815,215	－ －	0.83
10	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	601	23,820.14 14,315,908	21,486.28 12,913,257	－ －	0.77
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	587	23,130.71 13,577,731	21,863.18 12,833,692	－ －	0.77
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	293	38,716.62 11,343,970	43,757.22 12,820,868	－ －	0.77
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	659	17,402.02 11,467,935	18,382.51 12,114,078	－ －	0.73
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	366	26,011.83 9,520,330	30,717.10 11,242,462	－ －	0.67
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	534	18,306.06 9,775,437	20,987.32 11,207,229	－ －	0.67
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	651	16,376.72 10,661,250	17,064.09 11,108,726	－ －	0.67
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	193	42,336.79 8,171,001	50,120.35 9,673,228	－ －	0.58
18	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	181	48,725.40 8,819,298	52,357.64 9,476,733	－ －	0.57
19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	413	23,865.75 9,856,555	22,393.00 9,248,310	－ －	0.55
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	228	38,461.77 8,769,285	39,424.82 8,988,861	－ －	0.54
21	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	571	13,626.26 7,780,598	15,446.40 8,819,900	－ －	0.53

22	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	371	16,857.16 6,254,009	22,179.64 8,228,649	－ －	0.49
23	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・アパレル・贅沢品	62	97,410.30 6,039,439	129,845.87 8,050,444	－ －	0.48
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	398	19,800.26 7,880,507	19,967.93 7,947,237	－ －	0.48
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	312	23,948.91 7,472,060	25,443.11 7,938,253	－ －	0.48
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	929	7,882.81 7,323,139	8,541.39 7,934,959	－ －	0.48
27	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	94	63,142.64 5,935,409	82,947.32 7,797,049	－ －	0.47
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	90	73,413.03 6,607,173	83,524.16 7,517,175	－ －	0.45
29	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品	348	18,183.31 6,327,795	19,775.99 6,882,045	－ －	0.41
30	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	500	12,278.04 6,139,022	13,709.80 6,854,904	－ －	0.41

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率（%）
株式	89.50
投資信託受益証券	0.15
投資証券	1.81
合計	91.46

（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

2023年4月28日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	6.97
医薬品		5.07
銀行		5.06
コンピュータ・周辺機器		5.03
石油・ガス・消耗燃料		4.61
半導体・半導体製造装置		4.47
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.32
保険		2.98
金融サービス		2.91
資本市場		2.77

ヘルスケア機器・用品	2.34
大規模小売り	2.22
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	2.05
ホテル・レストラン・レジャー	1.98
化学	1.89
バイオテクノロジー	1.89
飲料	1.76
電力	1.74
生活必需品流通・小売り	1.70
機械	1.69
食品	1.63
航空宇宙・防衛	1.62
専門小売り	1.51
金属・鉱業	1.50
自動車	1.39
繊維・アパレル・贅沢品	1.38
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.28
家庭用品	1.12
情報技術サービス	1.09
各種電気通信サービス	1.07
娯楽	1.04
専門サービス	0.96
陸上運輸	0.89
コングロマリット	0.88
電気設備	0.78
総合公益事業	0.77
メディア	0.68
パーソナルケア用品	0.64
タバコ	0.61
通信機器	0.61
航空貨物・物流サービス	0.54
建設関連製品	0.52
商業サービス・用品	0.47
電子装置・機器・部品	0.46
商社・流通業	0.33
消費者金融	0.33
不動産管理・開発	0.31
家庭用耐久財	0.31
建設・土木	0.30
無線通信サービス	0.27
建設資材	0.26
エネルギー設備・サービス	0.25
容器・包装	0.21
自動車用部品	0.16
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
運送インフラ	0.12
ガス	0.12
販売	0.11
水道	0.10
紙製品・林産品	0.08

海上運輸	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
旅客航空輸送	0.04
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.02
合計	89.50

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

海外国債マザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,099,866,000	80.20 882,102,796	83.94 923,242,982	1.25 2031/8/15	6.83
2	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,032,801,000	79.84 824,665,816	84.37 871,425,843	1.375 2031/11/15	6.45
3	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	912,084,000	82.75 754,776,872	87.69 799,854,908	1.875 2032/2/15	5.92
4	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	898,671,000	82.13 738,102,018	87.01 781,984,186	1.625 2031/5/15	5.78
5	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	938,910,000	76.85 721,564,587	81.48 765,064,945	0.625 2030/8/15	5.66
6	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	695,788,000	99.52 692,461,304	98.07 682,389,210	2.5 2030/5/25	5.05
7	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	710,889,000	92.22 655,597,763	94.98 675,261,239	2.875 2032/5/15	4.99
8	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	603,585,000	96.49 582,435,947	99.78 602,311,809	3.5 2033/2/15	4.46
9	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	603,585,000	93.64 565,242,682	96.51 582,577,410	2.875 2028/5/15	4.31
10	UK TREASURY 1.0 01/31/32 イギリス	国債証券	586,775,000	80.86 474,498,286	79.76 468,011,740	1 2032/1/31	3.46
11	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 ドイツ	国債証券	556,630,400	82.73 460,505,896	82.29 458,101,252	－ 2031/8/15	3.39
12	ITALY BTPS 4.4 05/01/33 イタリア	国債証券	429,316,000	100.76 432,621,733	100.81 432,836,391	4.4 2033/5/1	3.20
13	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	370,100,000	117.48 434,820,571	114.59 424,119,055	5.5 2029/4/25	3.14
14	FRANCE OAT 0.0 11/25/31 フランス	国債証券	540,346,000	78.99 426,850,852	78.34 423,345,961	－ 2031/11/25	3.13
15	ITALY BTPS 0.95 06/01/32 イタリア	国債証券	547,748,000	74.70 409,167,756	75.82 415,357,308	0.95 2032/6/1	3.07
16	DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 ドイツ	国債証券	370,100,000	102.82 380,540,521	98.66 365,151,763	2.3 2033/2/15	2.70
17	ITALY BTPS 0.95 08/01/30 イタリア	国債証券	444,120,000	79.59 353,475,108	80.79 358,804,548	0.95 2030/8/1	2.65
18	FRANCE OAT 2.0 11/25/32 フランス	国債証券	370,100,000	90.38 334,520,066	92.07 340,751,440	2 2032/11/25	2.52
19	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 ドイツ	国債証券	399,708,000	83.73 334,691,496	83.26 332,808,872	－ 2031/2/15	2.46

20	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 ドイツ	国債証券	370,100,000	81.58 301,942,013	81.25 300,720,313	－ 2032/2/15	2.22
21	FRANCE OAT 1.75 06/25/39 フランス	国債証券	355,296,000	81.88 290,951,894	81.50 289,588,978	1.75 2039/6/25	2.14
22	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証券	296,080,000	97.45 288,552,166	97.36 288,273,258	3.5 2030/3/1	2.13
23	CANADA 1.5 12/01/31 カナダ	国債証券	300,638,500	86.65 260,530,376	89.18 268,110,316	1.5 2031/12/1	1.98
24	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	296,080,000	88.28 261,384,753	87.40 258,790,426	0.5 2029/5/25	1.91
25	ITALY BTPS 0.6 08/01/31 イタリア	国債証券	310,884,000	74.43 231,407,956	75.72 235,425,384	0.6 2031/8/1	1.74
26	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	236,864,000	94.88 224,756,933	95.15 225,387,939	3 2029/8/1	1.67
27	UK TREASURY 4.25 06/07/32 イギリス	国債証券	184,415,000	103.88 191,579,522	104.42 192,569,462	4.25 2032/6/7	1.42
28	CANADA 2.5 12/01/32 カナダ	国債証券	157,712,000	94.36 148,829,660	96.25 151,803,793	2.5 2032/12/1	1.12
29	CANADA 1.25 06/01/30 カナダ	国債証券	108,427,000	85.81 93,044,461	89.37 96,910,859	1.25 2030/6/1	0.72
30	US T N/B 2.75 08/15/42 アメリカ	国債証券	107,304,000	82.04 88,038,639	84.53 90,713,794	2.75 2042/8/15	0.67

（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

2023年4月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.61
合計	98.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	3,225	13,876.97 44,753,249	16,388.00 52,851,310	－ －	9.08
2	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券	1,701	25,824.51 43,927,497	27,582.49 46,917,820	－ －	8.06
3	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	338	72,389.65 24,467,704	96,552.13 32,634,623	－ －	5.61
4	CROWN CASTLE INC アメリカ	投資証券	1,581	17,589.73 27,809,378	16,493.96 26,076,960	－ －	4.48
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	573	39,179.75 22,449,999	39,223.63 22,475,143	－ －	3.86
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	2,299	7,813.81 17,963,957	8,354.95 19,208,047	－ －	3.30

7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	1,733	8,111.77 14,057,701	10,460.79 18,128,564	－ －	3.12
8	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	1,195	13,309.57 15,904,938	14,834.77 17,727,559	－ －	3.05
9	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	3,672	3,986.78 14,639,473	4,465.18 16,396,169	－ －	2.82
10	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,051	12,792.82 13,445,254	13,647.72 14,343,761	－ －	2.46
11	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証券	391	34,033.49 13,307,098	34,451.28 13,470,454	－ －	2.31
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	512	23,221.73 11,889,527	23,828.19 12,200,035	－ －	2.10
13	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	1,356	8,505.20 11,533,063	8,290.57 11,242,020	－ －	1.93
14	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証券	2,695	3,918.48 10,560,308	3,942.08 10,623,907	－ －	1.83
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	629	17,461.35 10,983,190	16,460.43 10,353,612	－ －	1.78
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	2,235	4,353.43 9,729,929	4,408.85 9,853,786	－ －	1.69
17	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	485	22,208.26 10,771,010	20,269.72 9,830,816	－ －	1.69
18	VENTAS INC アメリカ	投資証券	1,462	5,057.27 7,393,740	6,322.88 9,244,062	－ －	1.59
19	MID AMERICA アメリカ	投資証券	420	19,831.86 8,329,385	20,296.55 8,524,551	－ －	1.46
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	445	16,489.22 7,337,705	18,174.61 8,087,703	－ －	1.39
21	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	1,057	6,267.96 6,625,244	7,374.46 7,794,812	－ －	1.34
22	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	764	9,613.41 7,344,648	9,854.53 7,528,861	－ －	1.29
23	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	234	30,340.89 7,099,770	28,363.12 6,636,972	－ －	1.14
24	UDR INC アメリカ	投資証券	1,200	5,231.80 6,278,171	5,511.40 6,613,682	－ －	1.14
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	894	6,162.12 5,508,937	6,902.32 6,170,682	－ －	1.06
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	650	7,965.56 5,177,620	9,116.81 5,925,930	－ －	1.02
27	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	2,001	3,026.28 6,055,603	2,844.89 5,692,639	－ －	0.98
28	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	2,212	2,568.21 5,680,889	2,547.12 5,634,248	－ －	0.97
29	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	2,592	2,344.55 6,077,074	2,134.00 5,531,349	－ －	0.95
30	LIFE STORAGE INC アメリカ	投資証券	308	14,151.52 4,358,671	17,856.72 5,499,871	－ －	0.95

（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

2023年4月28日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	99.24
合計	99.24

（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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

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

新光日本債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド
該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

海外国債マザーファンド
該当事項はありません。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）
ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド

2023年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０５０６月	買建	2	40,495,660	41,160,000	2.56

（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

2023年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０５０６月	買建	1,203	2,168,888,700	2,247,805,500	2.63

（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

2023年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Jun23	買建	4	106,098,506	111,428,497	6.68
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun23	買建	1	12,688,590	13,124,480	0.79
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun23	買建	2	12,678,145	12,787,695	0.77

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

海外国債マザーファンド
該当事項はありません。

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2023年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第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
第33特定期間末 (2023年4月20日)	4,351	4,359	1.0280	1.0300
2022年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	－
11月末日	4,440	－	1.0406	－
12月末日	4,240	－	0.9943	－
2023年1月末日	4,290	－	1.0081	－
2月末日	4,343	－	1.0225	－
3月末日	4,285	－	1.0115	－
4月末日	4,367	－	1.0293	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
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
第33特定期間	0.0120

③【収益率の推移】

	収益率（%）
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
第33特定期間	1.3

（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

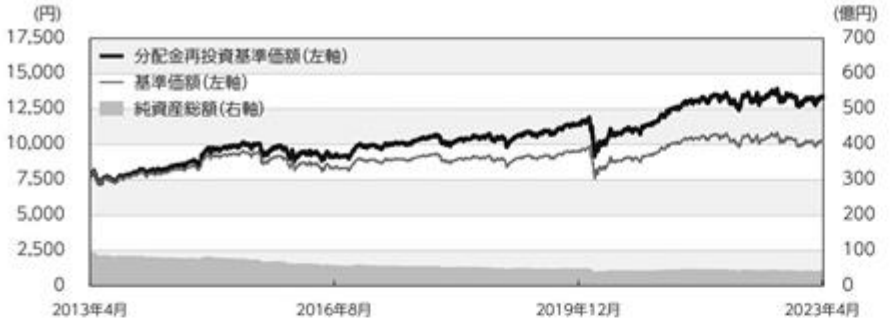
第21特定期間	5,348,676	374,412,075
第22特定期間	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	45,095,213	164,575,560
第24特定期間	4,817,074	285,434,876
第25特定期間	13,966,043	287,993,351
第26特定期間	34,127,005	222,623,381
第27特定期間	9,232,953	232,290,245
第28特定期間	14,557,001	198,285,857
第29特定期間	8,969,863	253,533,579
第30特定期間	20,473,306	177,049,394
第31特定期間	59,835,363	115,612,488
第32特定期間	60,021,152	172,680,942
第33特定期間	7,853,916	61,140,924

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

≪参考情報≫

データの基準日:2023年4月28日

基準価額・純資産の推移 〈2013年4月30日～2023年4月28日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2006年10月31日)

分配の推移(税引前)

2022年12月	20円
2023年 1月	20円
2023年 2月	20円
2023年 3月	20円
2023年 4月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	5,000円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド	14.17
2	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド	14.16
3	新光J-REITマザーファンド	13.95
4	海外国債マザーファンド	13.92
5	新光外国株式インデックスマザーファンド	13.91
6	新光日本債券インデックスマザーファンド	13.71
7	新光米国REITマザーファンド	13.32

■ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.37
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	3.03
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.90
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.75
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.74

■新光日本債券インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	146回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/12/20	1.44
2	339回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	1.16
3	147回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/3/20	1.15
4	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.15
5	351回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/6/20	1.15

■新光J-REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.14
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.10
3	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.81
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.75
5	日本都市ファンド投資法人	日本	4.63

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

データの基準日:2023年4月28日

■新光外国株式インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.84
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.90
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	1.82
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.21
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.16

■海外国債マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	6.83
2	US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	アメリカ	1.375	2031/11/15	6.45
3	US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	アメリカ	1.875	2032/2/15	5.92
4	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	5.78
5	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	5.66

■フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド(現地2023年4月14日現在)

※フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッドからの情報を基に作成しております。
※比率(%)は、フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

①組入公社債の上位5通貨

順位	通貨	比率(%)
1	米ドル	45.3
2	ユーロ	7.8
3	メキシコペソ	7.1
4	ウルグアイペソ	4.5
5	南アフリカランド	3.8

②組入公社債の上位5ヵ国

順位	国/地域	比率(%)
1	その他	11.1
2	メキシコ	9.8
3	南アフリカ	6.3
4	カザフスタン	5.4
5	ウルグアイ	4.5

■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	9.08
2	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	8.06
3	EQUINIX INC	アメリカ	5.61
4	CROWN CASTLE INC	アメリカ	4.48
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.86

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。
※2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

２【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間は営業日の午前９時から午後５時までです。）

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

（ホ）一部解約金は、受益者の一部解約の実行の請求受付日から起算して、原則として、５営業日目から販売会社において受益者に支払われます。ただし、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

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

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

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

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター　0120-104-694

（受付時間は営業日の午前９時から午後５時までです。）

インターネットホームページ

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

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

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

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

（５）【その他】

ａ．信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ｂ．投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

ｃ．異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

ｄ．運用報告書

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

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

ｅ．公告

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

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

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

ｆ．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

ｇ．信託事務処理の再信託

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

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

ｈ．信託業務の委託等

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

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

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

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

１．投資信託財産の保存にかかる業務

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

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

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

ｉ．関係法人との契約の更改

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

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

４【受益者の権利等】

ａ．収益分配金請求権

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

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

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

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

ｂ．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

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

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2022年10月21日から2023年4月20日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【新光７資産バランスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2022年10月20日現在	当期 2023年4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	98,868,059	129,466,790
投資信託受益証券	643,122,900	620,756,400
親投資信託受益証券	3,674,158,856	3,614,437,445
流動資産合計	4,416,149,815	4,364,660,635
資産合計	4,416,149,815	4,364,660,635
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	8,572,794	8,466,220
未払解約金	5,249,500	974,907
未払受託者報酬	318,987	317,731
未払委託者報酬	3,469,074	3,455,373
その他未払費用	14,180	14,125
流動負債合計	17,624,535	13,228,356
負債合計	17,624,535	13,228,356
純資産の部		
元本等		
元本	4,286,397,294	4,233,110,286
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	112,127,986	118,321,993
（分配準備積立金）	537,033,912	543,047,530
元本等合計	4,398,525,280	4,351,432,279
純資産合計	4,398,525,280	4,351,432,279
負債純資産合計	4,416,149,815	4,364,660,635

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2022年4月21日 至　2022年10月20日	当期 自　2022年10月21日 至　2023年4月20日
営業収益		
受取配当金	37,851,000	33,033,600
有価証券売買等損益	△173,986,816	47,912,089
営業収益合計	△136,135,816	80,945,689
営業費用		
支払利息	11,036	16,286
受託者報酬	1,991,650	1,900,405
委託者報酬	21,659,607	20,667,355
その他費用	88,541	84,472
営業費用合計	23,750,834	22,668,518
営業利益又は営業損失（△）	△159,886,650	58,277,171
経常利益又は経常損失（△）	△159,886,650	58,277,171
当期純利益又は当期純損失（△）	△159,886,650	58,277,171
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△1,364,458	380,665
期首剰余金又は期首欠損金（△）	328,409,279	112,127,986
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,313,266	152,631
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	3,313,266	152,631
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,316,701	814,436
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,316,701	814,436
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	51,755,666	51,040,694
期末剰余金又は期末欠損金（△）	112,127,986	118,321,993

（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10月21日 至　2023年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期 2022年10月20日現在	当期 2023年4月20日現在
１．　期首元本額	4,399,057,084円	4,286,397,294円
期中追加設定元本額	60,021,152円	7,853,916円
期中一部解約元本額	172,680,942円	61,140,924円
２．　受益権の総数	4,286,397,294口	4,233,110,286口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自　2022年4月21日 至　2022年10月20日	当期 自　2022年10月21日 至　2023年4月20日
１．　分配金の計算過程	（自2022年4月21日　至2022年5月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。	（自2022年10月21日　至2022年11月21日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,398,074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（27,555,036円）及び分配準備積立金（535,151,430円）より分配対象収益は572,104,540円（1万口当たり1,339.04円）であり、うち8,544,956円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

		（自2022年5月21日　至2022年6月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,497,650円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（22,924,764円）及び分配準備積立金（538,710,836円）より分配対象収益は569,133,250円（1万口当たり1,308.65円）であり、うち8,697,974円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自2022年6月21日　至2022年7月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,660,867円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（22,962,745円）及び分配準備積立金（535,117,294円）より分配対象収益は569,740,906円（1万口当たり1,315.58円）であり、うち8,661,408円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自2022年7月21日　至2022年8月22日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,724,652円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（24,520,179円）及び分配準備積立金（530,811,901円）より分配対象収益は567,056,732円（1万口当たり1,322.97円）であり、うち8,572,460円（1万口当たり20円）を分配金額としております。	（自2022年11月22日　至2022年12月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,369,105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（27,920,209円）及び分配準備積立金（534,713,114円）より分配対象収益は570,002,428円（1万口当たり1,336.33円）であり、うち8,530,857円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自2022年12月21日　至2023年1月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,496,699円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（28,052,268円）及び分配準備積立金（532,737,157円）より分配対象収益は569,286,124円（1万口当たり1,336.27円）であり、うち8,520,475円（1万口当たり20円）を分配金額としております。 （自2023年1月21日　至2023年2月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,335,130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（28,083,221円）及び分配準備積立金（531,230,017円）より分配対象収益は569,648,368円（1万口当たり1,340.60円）であり、うち8,498,403円（1万口当たり20円）を分配金額としております。	

	（自2022年8月23日　至2022年9月20日） 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。	（自2023年2月21日　至2023年3月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,277,553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（28,104,208円）及び分配準備積立金（531,816,533円）より分配対象収益は571,198,294円（1万口当たり1,347.20円）であり、うち8,479,783円（1万口当たり20円）を分配金額としております。
	（自2022年9月21日　至2022年10月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。	（自2023年3月21日　至2023年4月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,841,652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（28,147,866円）及び分配準備積立金（533,672,098円）より分配対象収益は579,661,616円（1万口当たり1,369.35円）であり、うち8,466,220円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自　2022年4月21日 至　2022年10月20日	当期 自　2022年10月21日 至　2023年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左

３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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10月20日現在	当期 2023年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期 2022年10月20日現在	当期 2023年4月20日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	△3,441,000	22,710,600
親投資信託受益証券	△130,502,268	152,260,477
合計	△133,943,268	174,971,077

（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10月20日現在	当期 2023年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0262円 (10,262円)	1.0280円 (10,280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

2023年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド	344,100	620,756,400	
投資信託受益証券　合計		344,100	620,756,400	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	235,052,061	606,340,296	
	ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド	204,751,522	613,128,432	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	146,523,768	613,861,326	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	479,625,172	593,152,450	
	新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド	277,479,957	596,248,931	
	新光米国ＲＥＩＴマザーファンド	244,032,668	591,706,010	
親投資信託受益証券　合計		1,587,465,148	3,614,437,445	
合計			4,235,193,845	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	31,217,451
株式	1,565,032,540
派生商品評価勘定	889,340
未収配当金	19,190,681
差入委託証拠金	1,620,000
流動資産合計	1,617,950,012
資産合計	1,617,950,012
負債の部	
流動負債	
前受金	910,000
流動負債合計	910,000
負債合計	910,000
純資産の部	
元本等	
元本	540,012,065
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,077,027,947
元本等合計	1,617,040,012
純資産合計	1,617,040,012
負債純資産合計	1,617,950,012

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10月21日 至　2023年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	615,543,848円
同期中追加設定元本額	22,194,172円
同期中一部解約元本額	97,725,955円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	204,751,522円
ニュー　トピックス　インデックス（変額年金）	43,836,727円
世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	246,356,954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）	8,630,371円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	15,868,910円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	7,001,582円
太陽財形株投　太陽一般財形　３０	3,775,460円
太陽財形株投　太陽一般財形　５０	9,126,193円
太陽財形株投　太陽年金・住宅財形　３０	664,346円
計	540,012,065円
２．　受益権の総数	540,012,065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10月21日 至　2023年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年4月20日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	103,193,150
合計	103,193,150

（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（2023年1月15日から2023年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年4月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	39,880,000	－	40,770,000	890,000
合計	39,880,000	－	40,770,000	890,000

（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）

	2023年4月20日現在
1口当たり純資産額	2.9945円
（1万口当たり純資産額）	(29,945円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年4月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ニッスイ	800	585.00	468,000	
マルハニチロ	100	2,477.00	247,700	
雪国まいたけ	100	1,011.00	101,100	
サカタのタネ	100	3,950.00	395,000	
ショーボンドホールディングス	100	5,570.00	557,000	
ミライト・ワン	300	1,668.00	500,400	
タマホーム	100	3,690.00	369,000	
ＩＮＰＥＸ	2,800	1,471.00	4,118,800	
石油資源開発	100	4,450.00	445,000	
安藤・間	400	856.00	342,400	
東急建設	300	692.00	207,600	
コムシスホールディングス	300	2,495.00	748,500	
ビーアールホールディングス	200	355.00	71,000	
高松コンストラクショングループ	100	2,120.00	212,000	
ヤマウラ	100	1,190.00	119,000	
オリエンタル白石	300	325.00	97,500	
大成建設	500	4,230.00	2,115,000	
大林組	1,800	1,032.00	1,857,600	
清水建設	1,500	763.00	1,144,500	
飛島建設	100	1,080.00	108,000	
長谷工コーポレーション	500	1,590.00	795,000	

鹿島建設	1,200	1,677.00	2,012,400	
不動テトラ	100	1,669.00	166,900	
鉄建建設	100	1,856.00	185,600	
西松建設	100	3,500.00	350,000	
三井住友建設	500	390.00	195,000	
奥村組	100	3,235.00	323,500	
東鉄工業	100	2,658.00	265,800	
戸田建設	700	734.00	513,800	
熊谷組	100	2,775.00	277,500	
矢作建設工業	100	838.00	83,800	
ピーエス三菱	100	667.00	66,700	
日本ハウスホールディングス	200	399.00	79,800	
大東建託	200	13,430.00	2,686,000	
新日本建設	100	971.00	97,100	
東亜建設工業	100	2,819.00	281,900	
日本国土開発	200	609.00	121,800	
東洋建設	200	964.00	192,800	
五洋建設	800	628.00	502,400	
世紀東急工業	100	914.00	91,400	
住友林業	400	2,811.00	1,124,400	
大和ハウス工業	1,400	3,212.00	4,496,800	
ライト工業	100	1,955.00	195,500	
積水ハウス	1,600	2,750.00	4,400,000	
日特建設	100	977.00	97,700	
ユアテック	100	827.00	82,700	
中電工	100	2,169.00	216,900	
関電工	200	948.00	189,600	
きんでん	400	1,685.00	674,000	
東京エネシス	100	898.00	89,800	
住友電設	100	2,678.00	267,800	
日本電設工業	100	1,680.00	168,000	
エクシオグループ	200	2,460.00	492,000	
九電工	100	3,385.00	338,500	
三機工業	100	1,480.00	148,000	
日揮ホールディングス	500	1,694.00	847,000	
中外炉工業	100	1,813.00	181,300	
高砂熱学工業	100	2,197.00	219,700	
ＮＥＣネッツエスアイ	200	1,635.00	327,000	
明星工業	100	821.00	82,100	
大氣社	100	3,655.00	365,500	
日比谷総合設備	100	2,203.00	220,300	
ニップン	100	1,705.00	170,500	
日清製粉グループ本社	500	1,625.00	812,500	
中部飼料	100	1,062.00	106,200	
フィード・ワン	100	697.00	69,700	
日本甜菜製糖	100	1,715.00	171,500	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	100	2,163.00	216,300	
ＭＩＸＩ	100	2,796.00	279,600	
ジェイエイシーリクルートメント	100	2,561.00	256,100	
日本M&Aセンターホールディングス	1,000	1,006.00	1,006,000	

ＵＴグループ	100	2,545.00	254,500	
Ｅ・Ｊホールディングス	100	1,585.00	158,500	
オープンアップグループ	200	1,960.00	392,000	
コシダカホールディングス	200	1,178.00	235,600	
パソナグループ	100	1,847.00	184,700	
リンクアンドモチベーション	200	488.00	97,600	
エス・エム・エス	200	3,095.00	619,000	
パーソルホールディングス	600	2,698.00	1,618,800	
森永製菓	100	3,800.00	380,000	
江崎グリコ	200	3,425.00	685,000	
山崎製パン	400	1,584.00	633,600	
寿スピリッツ	100	9,640.00	964,000	
カルビー	200	2,859.00	571,800	
森永乳業	100	4,810.00	481,000	
六甲バター	100	1,385.00	138,500	
ヤクルト本社	400	9,840.00	3,936,000	
明治ホールディングス	600	3,240.00	1,944,000	
雪印メグミルク	100	1,797.00	179,700	
プリマハム	100	2,266.00	226,600	
日本ハム	200	3,910.00	782,000	
丸大食品	100	1,509.00	150,900	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	100	2,970.00	297,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	300	712.00	213,600	
システナ	1,000	281.00	281,000	
日鉄ソリューションズ	100	3,620.00	362,000	
綜合警備保障	200	3,675.00	735,000	
キューブシステム	100	1,152.00	115,200	
いちご	700	255.00	178,500	
日本駐車場開発	700	231.00	161,700	
コア	100	1,608.00	160,800	
カカクコム	400	1,849.00	739,600	
ルネサンス	100	945.00	94,500	
ディップ	100	3,325.00	332,500	
デジタルホールディングス	100	1,137.00	113,700	
新日本科学	100	2,328.00	232,800	
ベネフィット・ワン	300	1,826.00	547,800	
エムスリー	1,100	3,388.00	3,726,800	
アウトソーシング	300	1,364.00	409,200	
ディー・エヌ・エー	200	1,825.00	365,000	
博報堂ＤＹホールディングス	700	1,535.00	1,074,500	
ファンコミュニケーションズ	200	399.00	79,800	
エスプール	200	630.00	126,000	
アドウェイズ	100	679.00	67,900	
バリューコマース	100	1,749.00	174,900	
インフォマート	600	283.00	169,800	
サッポロホールディングス	200	3,695.00	739,000	
アサヒグループホールディングス	1,200	5,063.00	6,075,600	
キリンホールディングス	2,300	2,178.50	5,010,550	
宝ホールディングス	400	1,046.00	418,400	
オエノンホールディングス	300	279.00	83,700	

コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	400	1,441.00	576,400	
サントリー食品インターナショナル	400	5,030.00	2,012,000	
伊藤園	200	4,315.00	863,000	
キーコーヒー	100	2,077.00	207,700	
日清オイリオグループ	100	3,275.00	327,500	
不二製油グループ本社	100	2,038.00	203,800	
Ｊ－オイルミルズ	100	1,557.00	155,700	
ローソン	100	5,930.00	593,000	
エービーシー・マート	100	7,870.00	787,000	
アスクル	100	1,853.00	185,300	
ゲオホールディングス	100	1,645.00	164,500	
アダストリア	100	2,565.00	256,500	
くら寿司	100	3,370.00	337,000	
エレマテック	100	1,763.00	176,300	
パルグループホールディングス	100	3,300.00	330,000	
エディオン	200	1,313.00	262,600	
サーラコーポレーション	100	759.00	75,900	
ＪＰホールディングス	200	331.00	66,200	
ひらまつ	200	235.00	47,000	
円谷フィールズホールディングス	100	1,863.00	186,300	
双日	600	2,885.00	1,731,000	
アルフレッサ　ホールディングス	600	1,877.00	1,126,200	
ハニーズホールディングス	100	1,527.00	152,700	
キッコーマン	400	7,310.00	2,924,000	
味の素	1,200	4,859.00	5,830,800	
キユーピー	300	2,242.00	672,600	
ハウス食品グループ本社	200	2,897.00	579,400	
カゴメ	300	3,170.00	951,000	
ニチレイ	200	2,735.00	547,000	
横浜冷凍	200	1,044.00	208,800	
東洋水産	300	5,710.00	1,713,000	
日清食品ホールディングス	200	12,320.00	2,464,000	
フジッコ	100	1,888.00	188,800	
ロック・フィールド	100	1,540.00	154,000	
日本たばこ産業	3,500	2,879.50	10,078,250	
ケンコーマヨネーズ	100	1,225.00	122,500	
ファーマフーズ	100	1,678.00	167,800	
北の達人コーポレーション	300	336.00	100,800	
ユーグレナ	400	890.00	356,000	
紀文食品	100	1,059.00	105,900	
片倉工業	100	1,790.00	179,000	
ヒューリック	1,200	1,133.00	1,359,600	
アルペン	100	2,032.00	203,200	
クオールホールディングス	100	1,223.00	122,300	
アルコニックス	100	1,382.00	138,200	
神戸物産	500	3,740.00	1,870,000	
ビックカメラ	400	1,129.00	451,600	
ＤＣＭホールディングス	400	1,423.00	569,200	
ペッパーフードサービス	100	164.00	16,400	

ＭｏｎｏｔａＲＯ	800	1,885.00	1,508,000	
あい　ホールディングス	100	2,325.00	232,500	
Ｊ．フロント　リテイリング	800	1,423.00	1,138,400	
ドトール・日レスホールディングス	100	2,150.00	215,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	400	7,190.00	2,876,000	
ＺＯＺＯ	400	3,045.00	1,218,000	
物語コーポレーション	100	2,809.00	280,900	
三越伊勢丹ホールディングス	1,000	1,502.00	1,502,000	
東洋紡	300	1,019.00	305,700	
日清紡ホールディングス	500	1,019.00	509,500	
倉敷紡績	100	2,471.00	247,100	
ダイワボウホールディングス	200	2,468.00	493,600	
日東紡績	100	1,882.00	188,200	
トヨタ紡織	200	2,096.00	419,200	
マクニカホールディングス	100	3,680.00	368,000	
ウエルシアホールディングス	300	2,805.00	841,500	
クリエイトＳＤホールディングス	100	3,310.00	331,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	100	945.00	94,500	
八洲電機	100	1,306.00	130,600	
ＴＯＫＡＩホールディングス	300	875.00	262,500	
三洋貿易	100	1,266.00	126,600	
オイシックス・ラ・大地	100	2,460.00	246,000	
ウイン・パートナーズ	100	1,005.00	100,500	
ネクステージ	100	2,322.00	232,200	
ジョイフル本田	200	1,795.00	359,000	
ホットランド	100	1,533.00	153,300	
すかいらーくホールディングス	800	1,791.00	1,432,800	
綿半ホールディングス	100	1,409.00	140,900	
日本毛織	200	993.00	198,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	200	1,116.00	223,200	
野村不動産ホールディングス	300	3,055.00	916,500	
三重交通グループホールディングス	100	568.00	56,800	
サムティ	100	2,133.00	213,300	
ディア・ライフ	100	689.00	68,900	
地主	100	1,917.00	191,700	
プレサンスコーポレーション	100	1,870.00	187,000	
フージャースホールディングス	100	829.00	82,900	
オープンハウスグループ	200	5,160.00	1,032,000	
東急不動産ホールディングス	1,500	658.00	987,000	
飯田グループホールディングス	500	2,280.00	1,140,000	
帝国繊維	100	1,717.00	171,700	
あさひ	100	1,306.00	130,600	
日本調剤	100	1,183.00	118,300	
コスモス薬品	100	12,660.00	1,266,000	
シップヘルスケアホールディングス	200	2,390.00	478,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	1,900	6,009.00	11,417,100	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	400	992.00	396,800	

ツルハホールディングス	100	8,770.00	877,000	
サンマルクホールディングス	100	1,841.00	184,100	
トリドールホールディングス	100	2,875.00	287,500	
帝人	500	1,478.00	739,000	
東レ	3,500	752.10	2,632,350	
クラレ	900	1,249.00	1,124,100	
旭化成	3,400	948.70	3,225,580	
トーカロ	200	1,256.00	251,200	
ＳＵＭＣＯ	1,000	1,919.00	1,919,000	
ＪＭホールディングス	100	1,945.00	194,500	
コメダホールディングス	100	2,613.00	261,300	
アレンザホールディングス	100	984.00	98,400	
クスリのアオキホールディングス	100	6,420.00	642,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	300	3,285.00	985,500	
セーレン	100	2,251.00	225,100	
小松マテーレ	100	683.00	68,300	
ワコールホールディングス	100	2,569.00	256,900	
ホギメディカル	100	3,260.00	326,000	
ＴＳＩホールディングス	200	626.00	125,200	
ワールド	100	1,490.00	149,000	
ＴＩＳ	600	3,675.00	2,205,000	
グリー	200	693.00	138,600	
コーエーテクモホールディングス	300	2,309.00	692,700	
ＫＬａｂ	100	390.00	39,000	
ポールトゥウィンホールディングス	100	869.00	86,900	
ネクソン	1,300	3,215.00	4,179,500	
アイスタイル	200	563.00	112,600	
エムアップホールディングス	100	1,226.00	122,600	
コロプラ	300	626.00	187,800	
オルトプラス	100	199.00	19,900	
ブロードリーフ	400	430.00	172,000	
じげん	200	475.00	95,000	
フィックスターズ	100	1,431.00	143,100	
オプティム	100	925.00	92,500	
ティーガイア	100	1,655.00	165,500	
テクマトリックス	100	1,580.00	158,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	2,560.00	512,000	
GMOペイメントゲートウェイ	100	10,690.00	1,069,000	
インターネットイニシアティブ	300	2,738.00	821,400	
朝日ネット	100	586.00	58,600	
ｅＢＡＳＥ	100	667.00	66,700	
アバントグループ	100	1,414.00	141,400	
コムチュア	100	2,000.00	200,000	
王子ホールディングス	2,200	531.00	1,168,200	
日本製紙	300	1,054.00	316,200	
北越コーポレーション	400	901.00	360,400	
大王製紙	300	1,067.00	320,100	
メディカル・データ・ビジョン	100	879.00	87,900	

ｇｕｍｉ	100	707.00	70,700	
ラクス	300	2,072.00	621,600	
オープンドア	100	1,505.00	150,500	
レンゴー	500	868.00	434,000	
チェンジホールディングス	100	2,486.00	248,600	
マクロミル	100	889.00	88,900	
マネーフォワード	100	5,850.00	585,000	
レゾナック・ホールディングス	500	2,200.00	1,100,000	
住友化学	3,800	461.00	1,751,800	
日産化学	300	5,990.00	1,797,000	
テイカ	100	1,198.00	119,800	
石原産業	100	1,159.00	115,900	
日本曹達	100	4,625.00	462,500	
東ソー	700	1,802.00	1,261,400	
トクヤマ	200	2,149.00	429,800	
セントラル硝子	100	2,930.00	293,000	
東亞合成	300	1,227.00	368,100	
関東電化工業	100	1,006.00	100,600	
デンカ	200	2,724.00	544,800	
イビデン	300	5,130.00	1,539,000	
信越化学工業	4,300	4,046.00	17,397,800	
堺化学工業	100	1,812.00	181,200	
第一稀元素化学工業	100	1,007.00	100,700	
エア・ウォーター	500	1,671.00	835,500	
日本酸素ホールディングス	500	2,358.00	1,179,000	
日本パーカライジング	300	1,023.00	306,900	
高圧ガス工業	100	728.00	72,800	
四国化成ホールディングス	100	1,370.00	137,000	
日本触媒	100	5,420.00	542,000	
大日精化工業	100	1,827.00	182,700	
カネカ	100	3,510.00	351,000	
協和キリン	700	3,080.00	2,156,000	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	200	1,608.00	321,600	
三菱瓦斯化学	400	1,958.00	783,200	
三井化学	400	3,425.00	1,370,000	
ＪＳＲ	500	3,065.00	1,532,500	
東京応化工業	100	7,030.00	703,000	
大阪有機化学工業	100	1,999.00	199,900	
三菱ケミカルグループ	3,500	799.40	2,797,900	
ＫＨネオケム	100	2,306.00	230,600	
ダイセル	800	1,029.00	823,200	
住友ベークライト	100	5,060.00	506,000	
積水化学工業	1,100	1,885.00	2,073,500	
日本ゼオン	300	1,427.00	428,100	
アイカ工業	100	3,060.00	306,000	
ＵＢＥ	300	2,150.00	645,000	
積水樹脂	100	2,079.00	207,900	
タキロンシーアイ	100	499.00	49,900	
リケンテクノス	200	597.00	119,400	
積水化成品工業	200	418.00	83,600	

ダイキョーニシカワ	200	657.00	131,400	
日本化薬	500	1,237.00	618,500	
プレステージ・インターナショナル	300	584.00	175,200	
プロトコーポレーション	100	1,186.00	118,600	
野村総合研究所	1,100	3,275.00	3,602,500	
クイック	100	1,776.00	177,600	
電通グループ	600	4,780.00	2,868,000	
インテージホールディングス	100	1,550.00	155,000	
ソースネクスト	300	218.00	65,400	
シーティーエス	100	780.00	78,000	
インフォコム	100	2,353.00	235,300	
扶桑化学工業	100	3,670.00	367,000	
トリケミカル研究所	100	2,282.00	228,200	
シンプレクス・ホールディングス	100	2,350.00	235,000	
ラクスル	200	1,346.00	269,200	
メルカリ	300	2,240.00	672,000	
ＡＤＥＫＡ	200	2,274.00	454,800	
日油	200	6,180.00	1,236,000	
アルテリア・ネットワークス	100	1,279.00	127,900	
ウイングアーク１ｓｔ	100	2,006.00	200,600	
Ｓａｎｓａｎ	200	1,865.00	373,000	
ギフティ	100	2,163.00	216,300	
花王	1,200	5,350.00	6,420,000	
メドレー	100	3,720.00	372,000	
ＪＭＤＣ	100	4,870.00	487,000	
武田薬品工業	4,700	4,482.00	21,065,400	
アステラス製薬	5,100	2,000.00	10,200,000	
住友ファーマ	400	836.00	334,400	
塩野義製薬	700	6,030.00	4,221,000	
日本新薬	100	6,070.00	607,000	
中外製薬	1,600	3,268.00	5,228,800	
科研製薬	100	3,710.00	371,000	
エーザイ	700	7,621.00	5,334,700	
理研ビタミン	100	2,007.00	200,700	
ロート製薬	500	2,804.00	1,402,000	
小野薬品工業	1,100	2,682.00	2,950,200	
久光製薬	100	3,710.00	371,000	
持田製薬	100	3,480.00	348,000	
参天製薬	1,000	1,071.00	1,071,000	
ツムラ	200	2,719.00	543,800	
テルモ	1,600	3,953.00	6,324,800	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	200	2,683.00	536,600	
キッセイ薬品工業	100	2,690.00	269,000	
生化学工業	100	826.00	82,600	
栄研化学	100	1,568.00	156,800	
ＪＣＲファーマ	200	1,467.00	293,400	
東和薬品	100	1,910.00	191,000	
ゼリア新薬工業	100	2,351.00	235,100	
第一三共	4,600	4,765.00	21,919,000	
杏林製薬	100	1,731.00	173,100	

大塚ホールディングス	1,200	4,432.00	5,318,400	
大正製薬ホールディングス	100	5,740.00	574,000	
ペプチドリーム	300	1,881.00	564,300	
大日本塗料	100	842.00	84,200	
日本ペイントホールディングス	2,300	1,237.00	2,845,100	
関西ペイント	500	1,857.00	928,500	
中国塗料	100	1,104.00	110,400	
藤倉化成	200	438.00	87,600	
太陽ホールディングス	100	2,442.00	244,200	
ＤＩＣ	200	2,454.00	490,800	
サカタインクス	100	1,076.00	107,600	
東洋インキＳＣホールディングス	100	2,130.00	213,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	100	1,121.00	112,100	
アルプス技研	100	2,471.00	247,100	
サニックス	100	280.00	28,000	
日本空調サービス	100	726.00	72,600	
オリエンタルランド	2,900	4,885.00	14,166,500	
フォーカスシステムズ	100	1,024.00	102,400	
ダスキン	100	3,235.00	323,500	
パーク２４	400	2,100.00	840,000	
明光ネットワークジャパン	200	651.00	130,200	
クレスコ	100	1,798.00	179,800	
フジ・メディア・ホールディングス	500	1,237.00	618,500	
ラウンドワン	500	546.00	273,000	
リゾートトラスト	200	2,214.00	442,800	
オービック	200	21,310.00	4,262,000	
ジャストシステム	100	3,545.00	354,500	
ＴＤＣソフト	100	1,465.00	146,500	
Ｚホールディングス	7,600	376.30	2,859,880	
ビー・エム・エル	100	2,961.00	296,100	
トレンドマイクロ	300	6,700.00	2,010,000	
ＩＤホールディングス	100	1,018.00	101,800	
リソー教育	300	321.00	96,300	
日本オラクル	100	9,190.00	919,000	
フューチャー	100	1,893.00	189,300	
ユー・エス・エス	600	2,221.00	1,332,600	
オービックビジネスコンサルタント	100	5,000.00	500,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	300	3,315.00	994,500	
アイティフォー	100	860.00	86,000	
東京個別指導学院	100	540.00	54,000	
サイバーエージェント	1,300	1,182.00	1,536,600	
楽天グループ	2,600	687.00	1,786,200	
テー・オー・ダブリュー	300	318.00	95,400	
大塚商会	300	4,820.00	1,446,000	
サイボウズ	100	2,763.00	276,300	
電通国際情報サービス	100	5,130.00	513,000	
ＡＣＣＥＳＳ	100	842.00	84,200	
デジタルガレージ	100	4,550.00	455,000	
イーエムシステムズ	100	797.00	79,700	
ＣＩＪ	200	548.00	109,600	

WOWOW	100	1,257.00	125,700	
スカラ	200	752.00	150,400	
フルキャストホールディングス	100	2,425.00	242,500	
エン・ジャパン	100	2,381.00	238,100	
あすか製薬ホールディングス	100	1,211.00	121,100	
サワイグループホールディングス	100	3,830.00	383,000	
富士フイルムホールディングス	1,100	6,851.00	7,536,100	
コニカミノルタ	1,200	552.00	662,400	
資生堂	1,200	6,703.00	8,043,600	
ライオン	700	1,445.00	1,011,500	
マンダム	100	1,569.00	156,900	
ミルボン	100	5,590.00	559,000	
ファンケル	200	2,458.00	491,600	
コーセー	100	16,150.00	1,615,000	
コタ	100	1,648.00	164,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	300	1,822.00	546,600	
エステー	100	1,587.00	158,700	
コニシ	100	1,931.00	193,100	
長谷川香料	100	3,165.00	316,500	
小林製薬	200	8,390.00	1,678,000	
荒川化学工業	100	997.00	99,700	
メック	100	2,479.00	247,900	
タカラバイオ	100	1,746.00	174,600	
ＪＣＵ	100	3,240.00	324,000	
デクセリアルズ	200	2,553.00	510,600	
北興化学工業	100	922.00	92,200	
クミアイ化学工業	200	883.00	176,600	
日本農薬	100	679.00	67,900	
ニチレキ	100	1,610.00	161,000	
出光興産	600	2,845.00	1,707,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	9,100	473.90	4,312,490	
コスモエネルギーホールディングス	200	4,320.00	864,000	
テスホールディングス	100	1,147.00	114,700	
インフロニア・ホールディングス	600	1,031.00	618,600	
横浜ゴム	300	2,910.00	873,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	300	1,570.00	471,000	
ブリヂストン	1,700	5,336.00	9,071,200	
住友ゴム工業	500	1,201.00	600,500	
アキレス	100	1,438.00	143,800	
ニッタ	100	3,010.00	301,000	
住友理工	100	678.00	67,800	
三ツ星ベルト	100	3,870.00	387,000	
バンドー化学	100	1,063.00	106,300	
ＡＧＣ	600	5,010.00	3,006,000	
日本板硝子	300	673.00	201,900	
有沢製作所	100	1,250.00	125,000	
日本電気硝子	200	2,586.00	517,200	
住友大阪セメント	100	3,725.00	372,500	
太平洋セメント	400	2,438.00	975,200	
アジアパイルホールディングス	100	712.00	71,200	

東海カーボン	500	1,215.00	607,500	
ＴＯＴＯ	400	4,555.00	1,822,000	
日本碍子	700	1,769.00	1,238,300	
日本特殊陶業	400	2,730.00	1,092,000	
ニチアス	100	2,618.00	261,800	
日本製鉄	2,400	3,020.00	7,248,000	
神戸製鋼所	1,100	1,050.00	1,155,000	
中山製鋼所	100	911.00	91,100	
ＪＦＥホールディングス	1,400	1,654.00	2,315,600	
東京製鐵	200	1,414.00	282,800	
共英製鋼	100	1,674.00	167,400	
大和工業	100	5,440.00	544,000	
東京鐵鋼	100	1,846.00	184,600	
淀川製鋼所	100	2,800.00	280,000	
中部鋼鈑	200	2,164.00	432,800	
大同特殊鋼	100	5,330.00	533,000	
山陽特殊製鋼	100	2,393.00	239,300	
新日本電工	400	345.00	138,000	
日本製鋼所	200	2,457.00	491,400	
三菱製鋼	100	1,149.00	114,900	
大紀アルミニウム工業所	100	1,401.00	140,100	
日本軽金属ホールディングス	100	1,443.00	144,300	
三井金属鉱業	200	3,265.00	653,000	
三菱マテリアル	400	2,255.00	902,000	
住友金属鉱山	700	5,282.00	3,697,400	
ＤＯＷＡホールディングス	100	4,355.00	435,500	
古河機械金属	100	1,310.00	131,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	3,045.00	304,500	
東邦チタニウム	100	2,020.00	202,000	
ＵＡＣＪ	100	2,743.00	274,300	
古河電気工業	200	2,460.00	492,000	
住友電気工業	1,900	1,688.50	3,208,150	
フジクラ	600	908.00	544,800	
ＳＷＣＣ	100	1,724.00	172,400	
タツタ電線	100	712.00	71,200	
いよぎんホールディングス	700	793.00	555,100	
しずおかフィナンシャルグループ	1,200	1,018.00	1,221,600	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	500	928.00	464,000	
リョービ	100	1,537.00	153,700	
アサヒホールディングス	200	2,027.00	405,400	
東洋製罐グループホールディングス	400	1,870.00	748,000	
ホッカンホールディングス	100	1,396.00	139,600	
横河ブリッジホールディングス	100	2,141.00	214,100	
三和ホールディングス	500	1,429.00	714,500	
文化シヤッター	200	1,111.00	222,200	
三協立山	100	693.00	69,300	
アルインコ	100	1,017.00	101,700	
ＬＩＸＩＬ	800	2,050.00	1,640,000	
日本フイルコン	200	466.00	93,200	
ノーリツ	100	1,794.00	179,400	

長府製作所	100	2,338.00	233,800	
リンナイ	300	3,275.00	982,500	
ユニプレス	100	911.00	91,100	
日東精工	200	595.00	119,000	
岡部	100	809.00	80,900	
ジーテクト	100	1,426.00	142,600	
東プレ	100	1,295.00	129,500	
高周波熱錬	100	710.00	71,000	
東京製綱	100	1,191.00	119,100	
パイオラックス	100	1,955.00	195,500	
エイチワン	100	654.00	65,400	
日本発条	500	962.00	481,000	
三浦工業	200	3,380.00	676,000	
タクマ	200	1,318.00	263,600	
テクノプロ・ホールディングス	300	3,615.00	1,084,500	
ジャパンマテリアル	200	2,049.00	409,800	
ベクトル	100	1,284.00	128,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,090.00	109,000	
アサンテ	100	1,650.00	165,000	
バリューＨＲ	100	1,513.00	151,300	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	100	3,745.00	374,500	
シグマクシス・ホールディングス	100	1,073.00	107,300	
ウィルグループ	100	1,049.00	104,900	
メドピア	100	1,106.00	110,600	
リクルートホールディングス	4,000	3,791.00	15,164,000	
エラン	100	985.00	98,500	
ツガミ	100	1,347.00	134,700	
オークマ	100	5,930.00	593,000	
芝浦機械	100	3,045.00	304,500	
アマダ	900	1,237.00	1,113,300	
アイダエンジニアリング	100	831.00	83,100	
ＦＵＪＩ	200	2,233.00	446,600	
牧野フライス製作所	100	4,810.00	481,000	
オーエスジー	300	1,909.00	572,700	
旭ダイヤモンド工業	200	885.00	177,000	
ＤＭＧ森精機	300	2,137.00	641,100	
ソディック	200	754.00	150,800	
ディスコ	300	14,590.00	4,377,000	
日進工具	100	1,102.00	110,200	
日本郵政	7,100	1,115.50	7,920,050	
ベルシステム２４ホールディングス	100	1,378.00	137,800	
鎌倉新書	100	958.00	95,800	
ソラスト	200	603.00	120,600	
インソース	100	1,226.00	122,600	
豊田自動織機	400	7,540.00	3,016,000	
島精機製作所	100	1,835.00	183,500	
オプトラン	100	2,084.00	208,400	
フリュー	100	1,144.00	114,400	
日阪製作所	100	887.00	88,700	
やまびこ	100	1,328.00	132,800	

ナブテスコ	300	3,170.00	951,000	
三井海洋開発	100	1,400.00	140,000	
レオン自動機	100	1,269.00	126,900	
ＳＭＣ	200	68,570.00	13,714,000	
オイレス工業	100	1,694.00	169,400	
サトーホールディングス	100	2,230.00	223,000	
技研製作所	100	2,150.00	215,000	
日精樹脂工業	100	995.00	99,500	
小松製作所	2,500	3,288.00	8,220,000	
住友重機械工業	300	3,205.00	961,500	
日立建機	200	3,145.00	629,000	
日工	100	636.00	63,600	
井関農機	100	1,186.00	118,600	
クボタ	2,800	2,000.50	5,601,400	
東洋エンジニアリング	100	559.00	55,900	
月島ホールディングス	100	1,107.00	110,700	
新東工業	100	960.00	96,000	
アイチコーポレーション	100	794.00	79,400	
小森コーポレーション	100	966.00	96,600	
荏原製作所	200	6,000.00	1,200,000	
酉島製作所	100	1,591.00	159,100	
北越工業	100	1,333.00	133,300	
ダイキン工業	700	23,235.00	16,264,500	
オルガノ	100	3,225.00	322,500	
栗田工業	300	6,050.00	1,815,000	
椿本チエイン	100	3,275.00	327,500	
日機装	100	941.00	94,100	
レイズネクスト	100	1,386.00	138,600	
アネスト岩田	100	1,005.00	100,500	
ダイフク	900	2,440.00	2,196,000	
タダノ	300	1,052.00	315,600	
フジテック	200	3,525.00	705,000	
ＣＫＤ	200	2,044.00	408,800	
平和	200	2,658.00	531,600	
ＳＡＮＫＹＯ	100	5,910.00	591,000	
日本金銭機械	100	1,268.00	126,800	
竹内製作所	100	3,610.00	361,000	
アマノ	100	2,659.00	265,900	
ＪＵＫＩ	100	615.00	61,500	
サンデン	100	211.00	21,100	
ブラザー工業	700	2,071.00	1,449,700	
マックス	100	2,133.00	213,300	
モリタホールディングス	100	1,335.00	133,500	
グローリー	100	2,894.00	289,400	
新晃工業	100	1,742.00	174,200	
大和冷機工業	100	1,408.00	140,800	
セガサミーホールディングス	400	2,520.00	1,008,000	
ＴＰＲ	100	1,342.00	134,200	
ホシザキ	400	4,715.00	1,886,000	
日本精工	1,000	759.00	759,000	

ＮＴＮ	1,100	330.00	363,000	
ジェイテクト	500	1,032.00	516,000	
ミネベアミツミ	1,000	2,427.00	2,427,000	
日本トムソン	200	585.00	117,000	
ＴＨＫ	300	3,010.00	903,000	
イーグル工業	100	1,285.00	128,500	
日本ピラー工業	100	3,610.00	361,000	
キッツ	200	896.00	179,200	
日立製作所	2,600	7,683.00	19,975,800	
東芝	1,100	4,402.00	4,842,200	
三菱電機	5,600	1,617.00	9,055,200	
富士電機	300	5,120.00	1,536,000	
安川電機	700	5,490.00	3,843,000	
シンフォニア　テクノロジー	100	1,588.00	158,800	
明電舎	100	1,815.00	181,500	
デンヨー	100	1,747.00	174,700	
ＰＨＣホールディングス	100	1,445.00	144,500	
ソシオネクスト	100	11,570.00	1,157,000	
ベイカレント・コンサルティング	400	4,915.00	1,966,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	200	2,072.00	414,400	
三櫻工業	100	661.00	66,100	
マキタ	700	3,205.00	2,243,500	
東芝テック	100	3,860.00	386,000	
マブチモーター	100	3,885.00	388,500	
ニデック	1,300	6,632.00	8,621,600	
ダイヘン	100	4,395.00	439,500	
ヤーマン	100	1,185.00	118,500	
ＪＶＣケンウッド	500	389.00	194,500	
大崎電気工業	200	543.00	108,600	
オムロン	500	7,643.00	3,821,500	
日東工業	100	2,669.00	266,900	
ＩＤＥＣ	100	3,210.00	321,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	200	2,284.00	456,800	
日本電気	800	5,130.00	4,104,000	
富士通	600	18,205.00	10,923,000	
沖電気工業	300	738.00	221,400	
サンケン電気	100	11,520.00	1,152,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,500	1,858.50	6,504,750	
セイコーエプソン	700	1,981.00	1,386,700	
ワコム	500	664.00	332,000	
アルバック	100	5,480.00	548,000	
ジャパンディスプレイ	2,200	44.00	96,800	
日本信号	100	1,117.00	111,700	
京三製作所	200	423.00	84,600	
能美防災	100	1,692.00	169,200	
ホーチキ	100	1,557.00	155,700	
エレコム	100	1,257.00	125,700	
パナソニック　ホールディングス	6,300	1,283.00	8,082,900	
シャープ	700	961.00	672,700	

アンリツ	400	1,222.00	488,800	
富士通ゼネラル	200	3,885.00	777,000	
ソニーグループ	3,700	12,325.00	45,602,500	
ＴＤＫ	900	4,645.00	4,180,500	
帝国通信工業	100	1,543.00	154,300	
タムラ製作所	300	795.00	238,500	
アルプスアルパイン	500	1,222.00	611,000	
日本電波工業	100	1,199.00	119,900	
メイコー	100	2,726.00	272,600	
フォスター電機	100	1,158.00	115,800	
ヨコオ	100	1,996.00	199,600	
ホシデン	100	1,708.00	170,800	
ヒロセ電機	100	17,850.00	1,785,000	
日本航空電子工業	100	2,388.00	238,800	
ＴＯＡ	100	834.00	83,400	
マクセル	100	1,485.00	148,500	
古野電気	100	905.00	90,500	
スミダコーポレーション	100	1,650.00	165,000	
横河電機	600	2,178.00	1,306,800	
アズビル	400	3,665.00	1,466,000	
日本光電工業	300	3,700.00	1,110,000	
堀場製作所	100	7,520.00	752,000	
アドバンテスト	400	11,620.00	4,648,000	
エスペック	100	2,008.00	200,800	
キーエンス	500	62,530.00	31,265,000	
シスメックス	500	8,920.00	4,460,000	
日本マイクロニクス	100	1,286.00	128,600	
デンソー	1,100	7,458.00	8,203,800	
コーセル	100	1,072.00	107,200	
イリソ電子工業	100	4,700.00	470,000	
オプテックスグループ	100	1,973.00	197,300	
レーザーテック	300	20,720.00	6,216,000	
スタンレー電気	400	2,950.00	1,180,000	
ウシオ電機	300	1,652.00	495,600	
日本セラミック	100	2,706.00	270,600	
古河電池	100	1,110.00	111,000	
山一電機	100	1,853.00	185,300	
図研	100	3,490.00	349,000	
日本電子	100	3,980.00	398,000	
カシオ計算機	400	1,293.00	517,200	
ファナック	2,400	4,664.00	11,193,600	
大真空	100	702.00	70,200	
ローム	200	10,630.00	2,126,000	
浜松ホトニクス	400	7,120.00	2,848,000	
三井ハイテック	100	8,390.00	839,000	
新光電気工業	200	4,005.00	801,000	
京セラ	900	7,022.00	6,319,800	
太陽誘電	300	4,230.00	1,269,000	
村田製作所	1,600	7,862.00	12,579,200	
双葉電子工業	200	526.00	105,200	

日東電工	400	8,440.00	3,376,000	
東海理化電機製作所	200	1,639.00	327,800	
ニチコン	100	1,298.00	129,800	
日本ケミコン	100	2,045.00	204,500	
ＫＯＡ	100	1,756.00	175,600	
三井Ｅ＆Ｓ	300	431.00	129,300	
日立造船	500	867.00	433,500	
三菱重工業	1,000	5,090.00	5,090,000	
川崎重工業	400	2,908.00	1,163,200	
ＩＨＩ	400	3,350.00	1,340,000	
カーブスホールディングス	200	799.00	159,800	
三菱ロジスネクスト	100	942.00	94,200	
フルサト・マルカホールディングス	100	2,598.00	259,800	
ＦＰＧ	200	1,223.00	244,600	
全国保証	100	4,930.00	493,000	
めぶきフィナンシャルグループ	2,500	344.00	860,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	100	1,112.00	111,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	2,816.00	281,600	
九州フィナンシャルグループ	1,000	497.00	497,000	
かんぽ生命保険	600	2,219.00	1,331,400	
ゆうちょ銀行	1,400	1,109.00	1,552,600	
富山第一銀行	100	617.00	61,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,800	523.00	1,464,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	300	1,147.00	344,100	
アルヒ	100	1,088.00	108,800	
プレミアグループ	100	1,619.00	161,900	
日産自動車	7,600	500.20	3,801,520	
いすゞ自動車	1,500	1,546.00	2,319,000	
トヨタ自動車	29,000	1,813.50	52,591,500	
日野自動車	700	558.00	390,600	
三菱自動車工業	2,100	513.00	1,077,300	
武蔵精密工業	100	1,786.00	178,600	
日産車体	100	902.00	90,200	
新明和工業	200	1,164.00	232,800	
極東開発工業	100	1,661.00	166,100	
トピー工業	100	1,887.00	188,700	
曙ブレーキ工業	400	145.00	58,000	
タチエス	100	1,176.00	117,600	
ＮＯＫ	200	1,779.00	355,800	
フタバ産業	200	436.00	87,200	
ＫＹＢ	100	4,135.00	413,500	
市光工業	100	500.00	50,000	
大同メタル工業	200	510.00	102,000	
プレス工業	300	526.00	157,800	
太平洋工業	100	1,131.00	113,100	
アイシン	400	3,650.00	1,460,000	
マツダ	1,700	1,204.00	2,046,800	

本田技研工業	4,300	3,538.00	15,213,400	
スズキ	1,000	4,660.00	4,660,000	
ＳＵＢＡＲＵ	1,600	2,121.50	3,394,400	
ヤマハ発動機	900	3,440.00	3,096,000	
小糸製作所	700	2,426.00	1,698,200	
エクセディ	100	1,845.00	184,500	
豊田合成	200	2,198.00	439,600	
愛三工業	100	851.00	85,100	
ヨロズ	100	873.00	87,300	
エフ・シー・シー	100	1,639.00	163,900	
シマノ	200	23,090.00	4,618,000	
テイ・エス　テック	300	1,684.00	505,200	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,622.00	162,200	
第四北越フィナンシャルグループ	100	3,055.00	305,500	
ひろぎんホールディングス	700	680.00	476,000	
おきなわフィナンシャルグループ	100	2,129.00	212,900	
ダイレクトマーケティングミックス	100	1,245.00	124,500	
十六フィナンシャルグループ	100	3,040.00	304,000	
ネットプロテクションズホールディングス	200	502.00	100,400	
プロクレアホールディングス	100	2,183.00	218,300	
あいちフィナンシャルグループ	100	2,177.00	217,700	
小野建	100	1,505.00	150,500	
ノジマ	200	1,436.00	287,200	
カッパ・クリエイト	100	1,466.00	146,600	
コンドーテック	100	1,007.00	100,700	
ナガイレーベン	100	2,080.00	208,000	
三菱食品	100	3,350.00	335,000	
良品計画	800	1,440.00	1,152,000	
第一興商	200	2,374.00	474,800	
メディパルホールディングス	500	2,027.00	1,013,500	
アドヴァングループ	100	940.00	94,000	
アズワン	100	5,500.00	550,000	
シモジマ	100	1,116.00	111,600	
ドウシシャ	100	2,049.00	204,900	
Ｇ－７ホールディングス	100	1,415.00	141,500	
イオン北海道	100	830.00	83,000	
コジマ	100	559.00	55,900	
コーナン商事	100	3,590.00	359,000	
ネットワンシステムズ	200	3,140.00	628,000	
ワタミ	100	926.00	92,600	
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	1,200	2,560.00	3,072,000	
丸文	100	1,238.00	123,800	
西松屋チェーン	100	1,635.00	163,500	
ゼンショーホールディングス	300	4,205.00	1,261,500	
ハピネット	100	1,899.00	189,900	
幸楽苑ホールディングス	100	1,065.00	106,500	
日本ライフライン	200	919.00	183,800	
サイゼリヤ	100	3,315.00	331,500	

ＶＴホールディングス	200	524.00	104,800	
アルゴグラフィックス	100	3,785.00	378,500	
ＩＤＯＭ	200	792.00	158,400	
フジ・コーポレーション	100	1,286.00	128,600	
ユナイテッドアローズ	100	1,957.00	195,700	
進和	100	2,108.00	210,800	
ハイデイ日高	100	2,286.00	228,600	
シークス	100	1,371.00	137,100	
コロワイド	300	2,042.00	612,600	
スギホールディングス	100	5,830.00	583,000	
島津製作所	700	4,210.00	2,947,000	
ＪＭＳ	200	525.00	105,000	
長野計器	100	1,289.00	128,900	
スター精密	100	1,745.00	174,500	
東京計器	100	1,213.00	121,300	
東京精密	100	5,010.00	501,000	
マニー	200	1,799.00	359,800	
ニコン	900	1,324.00	1,191,600	
トプコン	300	1,893.00	567,900	
オリンパス	3,300	2,450.50	8,086,650	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	100	10,850.00	1,085,000	
キヤノン電子	100	1,845.00	184,500	
ＨＯＹＡ	1,200	14,230.00	17,076,000	
ノーリツ鋼機	100	2,232.00	223,200	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	100	1,351.00	135,100	
朝日インテック	600	2,416.00	1,449,600	
キヤノン	2,900	2,985.50	8,657,950	
リコー	1,300	1,044.00	1,357,200	
シチズン時計	600	744.00	446,400	
メニコン	200	2,796.00	559,200	
スノーピーク	100	2,078.00	207,800	
パラマウントベッドホールディングス	100	2,350.00	235,000	
トランザクション	100	1,624.00	162,400	
ニホンフラッシュ	100	998.00	99,800	
前田工繊	100	3,235.00	323,500	
バンダイナムコホールディングス	1,400	2,990.00	4,186,000	
ＳＨＯＥＩ	200	2,499.00	499,800	
フランスベッドホールディングス	100	1,060.00	106,000	
マーベラス	100	671.00	67,100	
パイロットコーポレーション	100	4,415.00	441,500	
萩原工業	100	1,332.00	133,200	
エイベックス	100	1,540.00	154,000	
フジシールインターナショナル	100	1,485.00	148,500	
タカラトミー	300	1,445.00	433,500	
レック	100	858.00	85,800	
三光合成	100	516.00	51,600	
凸版印刷	700	2,755.00	1,928,500	
大日本印刷	700	3,820.00	2,674,000	
ＮＩＳＳＨＡ	100	1,846.00	184,600	
アシックス	500	3,850.00	1,925,000	

ＪＳＰ	100	1,558.00	155,800	
ニチハ	100	2,729.00	272,900	
エフピコ	100	3,270.00	327,000	
ヤマハ	300	5,250.00	1,575,000	
ピジョン	400	2,060.00	824,000	
天馬	100	2,319.00	231,900	
象印マホービン	200	1,709.00	341,800	
リンテック	100	2,202.00	220,200	
信越ポリマー	100	1,471.00	147,100	
イトーキ	100	779.00	77,900	
任天堂	3,400	5,516.00	18,754,400	
三菱鉛筆	100	1,683.00	168,300	
タカラスタンダード	100	1,561.00	156,100	
コクヨ	300	1,874.00	562,200	
ニフコ	200	3,750.00	750,000	
オカムラ	200	1,367.00	273,400	
バルカー	100	3,400.00	340,000	
伊藤忠商事	3,500	4,469.00	15,641,500	
丸紅	4,400	1,934.50	8,511,800	
スクロール	100	779.00	77,900	
ヨンドシーホールディングス	100	1,782.00	178,200	
長瀬産業	300	2,060.00	618,000	
豊田通商	500	5,720.00	2,860,000	
オンワードホールディングス	400	376.00	150,400	
三共生興	100	553.00	55,300	
兼松	200	1,725.00	345,000	
美津濃	100	3,215.00	321,500	
三井物産	4,100	4,242.00	17,392,200	
東京エレクトロン	1,200	15,395.00	18,474,000	
カメイ	100	1,493.00	149,300	
スターゼン	100	2,280.00	228,000	
セイコーグループ	100	2,871.00	287,100	
山善	100	1,021.00	102,100	
住友商事	3,500	2,449.00	8,571,500	
ＢＩＰＲＯＧＹ	200	3,255.00	651,000	
三菱商事	3,500	4,992.00	17,472,000	
キヤノンマーケティングジャパン	100	3,135.00	313,500	
佐藤商事	100	1,400.00	140,000	
東京産業	100	822.00	82,200	
ユアサ商事	100	3,800.00	380,000	
阪和興業	100	4,140.00	414,000	
カナデン	100	1,208.00	120,800	
ＲＹＯＤＥＮ	100	1,980.00	198,000	
ニプロ	500	1,011.00	505,500	
岩谷産業	100	6,430.00	643,000	
アステナホールディングス	200	438.00	87,600	
三愛オブリ	200	1,367.00	273,400	
稲畑産業	100	2,722.00	272,200	
明和産業	100	697.00	69,700	
ゴールドウイン	100	12,230.00	1,223,000	

ユニ・チャーム	1,200	5,409.00	6,490,800	
デサント	100	4,345.00	434,500	
ワキタ	100	1,327.00	132,700	
東邦ホールディングス	100	2,604.00	260,400	
サンゲツ	100	2,224.00	222,400	
ミツウロコグループホールディングス	100	1,307.00	130,700	
伊藤忠エネクス	100	1,118.00	111,800	
サンリオ	200	6,230.00	1,246,000	
リョーサン	100	3,190.00	319,000	
新光商事	100	1,194.00	119,400	
東陽テクニカ	100	1,383.00	138,300	
モスフードサービス	100	3,090.00	309,000	
立花エレテック	100	2,018.00	201,800	
木曽路	100	2,308.00	230,800	
ＳＲＳホールディングス	100	993.00	99,300	
千趣会	200	409.00	81,800	
リテールパートナーズ	100	1,440.00	144,000	
ケーヨー	100	827.00	82,700	
上新電機	100	1,985.00	198,500	
日本瓦斯	300	1,709.00	512,700	
ロイヤルホールディングス	100	2,802.00	280,200	
いなげや	100	1,282.00	128,200	
チヨダ	100	836.00	83,600	
ライフコーポレーション	100	2,838.00	283,800	
リンガーハット	100	2,387.00	238,700	
ＭｒＭａｘＨＤ	100	615.00	61,500	
テンアライド	100	256.00	25,600	
ＡＯＫＩホールディングス	100	940.00	94,000	
オークワ	100	867.00	86,700	
コメリ	100	2,919.00	291,900	
青山商事	200	909.00	181,800	
しまむら	100	12,650.00	1,265,000	
高島屋	500	2,068.00	1,034,000	
松屋	100	1,175.00	117,500	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	300	1,601.00	480,300	
丸井グループ	400	2,126.00	850,400	
クレディセゾン	300	1,870.00	561,000	
イオン	1,900	2,719.50	5,167,050	
イズミ	100	3,155.00	315,500	
平和堂	100	2,054.00	205,400	
フジ	100	1,761.00	176,100	
ヤオコー	100	7,020.00	702,000	
ゼビオホールディングス	100	1,155.00	115,500	
ケーズホールディングス	500	1,177.00	588,500	
ＰＡＬＴＡＣ	100	5,150.00	515,000	
三谷産業	200	319.00	63,800	
ＳＢＩ新生銀行	200	2,495.00	499,000	
あおぞら銀行	300	2,479.00	743,700	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	32,500	886.40	28,808,000	
りそなホールディングス	6,600	679.50	4,484,700	

三井住友トラスト・ホールディングス	1,000	4,912.00	4,912,000	
三井住友フィナンシャルグループ	3,800	5,728.00	21,766,400	
千葉銀行	1,400	896.00	1,254,400	
群馬銀行	1,100	468.00	514,800	
武蔵野銀行	100	2,271.00	227,100	
千葉興業銀行	100	565.00	56,500	
筑波銀行	400	218.00	87,200	
七十七銀行	200	2,251.00	450,200	
山形銀行	100	1,085.00	108,500	
東邦銀行	400	225.00	90,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	400	2,607.00	1,042,800	
スルガ銀行	500	519.00	259,500	
八十二銀行	1,200	602.00	722,400	
山梨中央銀行	100	1,150.00	115,000	
大垣共立銀行	100	1,875.00	187,500	
福井銀行	100	1,508.00	150,800	
滋賀銀行	100	2,826.00	282,600	
南都銀行	100	2,479.00	247,900	
百五銀行	500	397.00	198,500	
京都銀行	200	6,610.00	1,322,000	
紀陽銀行	200	1,573.00	314,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	400	992.00	396,800	
山陰合同銀行	300	781.00	234,300	
四国銀行	100	897.00	89,700	
阿波銀行	100	2,075.00	207,500	
佐賀銀行	100	1,655.00	165,500	
琉球銀行	100	942.00	94,200	
セブン銀行	1,700	280.00	476,000	
みずほフィナンシャルグループ	7,500	2,055.50	15,416,250	
山口フィナンシャルグループ	600	845.00	507,000	
みずほリース	100	3,755.00	375,500	
東京センチュリー	100	4,545.00	454,500	
ＳＢＩホールディングス	800	2,694.00	2,155,200	
日本証券金融	200	997.00	199,400	
アイフル	900	367.00	330,300	
北洋銀行	800	295.00	236,000	
愛媛銀行	100	869.00	86,900	
京葉銀行	300	579.00	173,700	
栃木銀行	300	288.00	86,400	
東和銀行	200	566.00	113,200	
リコーリース	100	3,870.00	387,000	
イオンフィナンシャルサービス	300	1,218.00	365,400	
アコム	900	328.00	295,200	
ジャックス	100	4,515.00	451,500	
オリエントコーポレーション	100	1,130.00	113,000	
オリックス	3,500	2,316.00	8,106,000	
三菱ＨＣキャピタル	2,000	701.00	1,402,000	
ジャフコ　グループ	200	1,890.00	378,000	
トモニホールディングス	500	372.00	186,000	
大和証券グループ本社	3,500	631.00	2,208,500	

野村ホールディングス	9,700	526.10	5,103,170	
岡三証券グループ	500	467.00	233,500	
丸三証券	200	431.00	86,200	
東洋証券	200	320.00	64,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	600	380.00	228,000	
水戸証券	200	298.00	59,600	
いちよし証券	100	600.00	60,000	
松井証券	200	784.00	156,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	900	5,612.00	5,050,800	
日本取引所グループ	1,400	2,134.00	2,987,600	
マネックスグループ	600	489.00	293,400	
極東証券	100	606.00	60,600	
岩井コスモホールディングス	100	1,380.00	138,000	
アイザワ証券グループ	100	704.00	70,400	
フィデアホールディングス	100	1,382.00	138,200	
池田泉州ホールディングス	700	249.00	174,300	
アニコム　ホールディングス	200	531.00	106,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	1,100	4,433.00	4,876,300	
スパークス・グループ	100	1,447.00	144,700	
第一生命ホールディングス	2,700	2,561.00	6,914,700	
東京海上ホールディングス	5,300	2,707.50	14,349,750	
イー・ギャランティ	100	2,178.00	217,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	1,400	1,710.00	2,394,000	
三井不動産	2,300	2,524.50	5,806,350	
三菱地所	3,200	1,619.50	5,182,400	
平和不動産	100	3,825.00	382,500	
東京建物	500	1,642.00	821,000	
京阪神ビルディング	100	1,232.00	123,200	
住友不動産	1,000	3,046.00	3,046,000	
テーオーシー	100	644.00	64,400	
レオパレス２１	600	354.00	212,400	
スターツコーポレーション	100	2,453.00	245,300	
フジ住宅	100	696.00	69,600	
空港施設	100	568.00	56,800	
ゴールドクレスト	100	1,750.00	175,000	
リログループ	300	2,018.00	605,400	
日神グループホールディングス	200	456.00	91,200	
日本エスコン	100	850.00	85,000	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	300	377.00	113,100	
イオンモール	300	1,805.00	541,500	
カチタス	100	2,576.00	257,600	
東祥	100	1,247.00	124,700	
トーセイ	100	1,516.00	151,600	
サンフロンティア不動産	100	1,273.00	127,300	
ＦＪネクストホールディングス	100	1,011.00	101,100	
東武鉄道	600	3,400.00	2,040,000	
相鉄ホールディングス	200	2,351.00	470,200	
東急	1,400	1,861.00	2,605,400	

京浜急行電鉄	600	1,313.00	787,800	
小田急電鉄	800	1,853.00	1,482,400	
京王電鉄	300	5,020.00	1,506,000	
京成電鉄	400	4,685.00	1,874,000	
富士急行	100	4,945.00	494,500	
東日本旅客鉄道	900	7,635.00	6,871,500	
西日本旅客鉄道	700	5,802.00	4,061,400	
東海旅客鉄道	400	16,460.00	6,584,000	
西武ホールディングス	700	1,500.00	1,050,000	
鴻池運輸	100	1,560.00	156,000	
西日本鉄道	200	2,456.00	491,200	
近鉄グループホールディングス	500	4,485.00	2,242,500	
阪急阪神ホールディングス	700	4,170.00	2,919,000	
南海電気鉄道	300	3,045.00	913,500	
京阪ホールディングス	200	3,720.00	744,000	
名古屋鉄道	600	2,137.00	1,282,200	
ヤマトホールディングス	700	2,291.00	1,603,700	
山九	100	4,745.00	474,500	
センコーグループホールディングス	200	952.00	190,400	
ニッコンホールディングス	200	2,532.00	506,400	
セイノーホールディングス	300	1,478.00	443,400	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	100	1,959.00	195,900	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	100	1,279.00	127,900	
日本郵船	1,400	3,409.00	4,772,600	
商船三井	1,000	3,495.00	3,495,000	
川崎汽船	500	3,380.00	1,690,000	
飯野海運	200	1,048.00	209,600	
九州旅客鉄道	400	3,040.00	1,216,000	
ＳＧホールディングス	1,000	1,911.00	1,911,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	200	7,830.00	1,566,000	
日本航空	1,200	2,586.00	3,103,200	
ＡＮＡホールディングス	1,400	2,859.00	4,002,600	
ＴＲＥホールディングス	100	1,228.00	122,800	
ＫＰＰグループホールディングス	100	650.00	65,000	
三菱倉庫	100	3,240.00	324,000	
三井倉庫ホールディングス	100	3,960.00	396,000	
住友倉庫	100	2,247.00	224,700	
乾汽船	100	1,770.00	177,000	
日本トランスシティ	200	665.00	133,000	
安田倉庫	100	1,045.00	104,500	
大栄環境	100	1,823.00	182,300	
日本管財ホールディングス	100	2,498.00	249,800	
上組	300	2,839.00	851,700	
ＴＢＳホールディングス	300	1,988.00	596,400	
日本テレビホールディングス	500	1,181.00	590,500	
朝日放送グループホールディングス	100	663.00	66,300	
テレビ朝日ホールディングス	100	1,529.00	152,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	500	534.00	267,000	
ビジョン	100	1,572.00	157,200	

ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	100	2,794.00	279,400	
日本通信	600	250.00	150,000	
日本電信電話	6,800	4,024.00	27,363,200	
ＫＤＤＩ	4,100	4,125.00	16,912,500	
ソフトバンク	8,400	1,527.50	12,831,000	
光通信	100	17,970.00	1,797,000	
GMOインターネットグループ	200	2,632.00	526,400	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	300	2,863.00	858,900	
学研ホールディングス	100	869.00	86,900	
ゼンリン	100	849.00	84,900	
東京電力ホールディングス	4,800	489.00	2,347,200	
中部電力	1,900	1,456.00	2,766,400	
関西電力	2,000	1,330.00	2,660,000	
中国電力	900	692.00	622,800	
北陸電力	500	623.00	311,500	
東北電力	1,200	686.00	823,200	
四国電力	500	780.00	390,000	
九州電力	1,200	783.00	939,600	
北海道電力	600	509.00	305,400	
沖縄電力	100	1,083.00	108,300	
電源開発	400	2,174.00	869,600	
イーレックス	100	1,786.00	178,600	
レノバ	100	1,993.00	199,300	
東京瓦斯	1,200	2,550.00	3,060,000	
大阪瓦斯	1,100	2,166.00	2,382,600	
東邦瓦斯	200	2,463.00	492,600	
広島ガス	200	359.00	71,800	
西部ガスホールディングス	100	1,801.00	180,100	
静岡ガス	100	1,144.00	114,400	
メタウォーター	100	1,790.00	179,000	
アイネット	100	1,307.00	130,700	
東宝	300	5,230.00	1,569,000	
エイチ・アイ・エス	200	2,021.00	404,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,600	1,845.00	2,952,000	
共立メンテナンス	100	5,320.00	532,000	
イチネンホールディングス	100	1,335.00	133,500	
スペース	100	928.00	92,800	
アインホールディングス	100	5,570.00	557,000	
東京都競馬	100	4,310.00	431,000	
カナモト	100	2,260.00	226,000	
ＤＴＳ	100	3,205.00	320,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	300	6,370.00	1,911,000	
シーイーシー	100	1,345.00	134,500	
カプコン	500	4,950.00	2,475,000	
ニシオホールディングス	100	3,120.00	312,000	
日本空港ビルデング	200	6,650.00	1,330,000	
トランス・コスモス	100	3,095.00	309,500	
乃村工藝社	300	893.00	267,900	

ジャステック	100	1,242.00	124,200	
ＳＣＳＫ	400	1,975.00	790,000	
セコム	600	8,496.00	5,097,600	
アイネス	100	1,337.00	133,700	
丹青社	100	787.00	78,700	
メイテック	200	2,317.00	463,400	
ＴＫＣ	100	3,640.00	364,000	
富士ソフト	100	7,810.00	781,000	
応用地質	100	2,070.00	207,000	
船井総研ホールディングス	100	2,581.00	258,100	
ＮＳＤ	200	2,456.00	491,200	
コナミグループ	200	6,360.00	1,272,000	
ベネッセホールディングス	200	1,927.00	385,400	
イオンディライト	100	2,977.00	297,700	
ダイセキ	100	3,655.00	365,500	
トラスコ中山	100	2,229.00	222,900	
ヤマダホールディングス	2,300	466.00	1,071,800	
オートバックスセブン	200	1,499.00	299,800	
アークランズ	100	1,497.00	149,700	
ニトリホールディングス	200	17,485.00	3,497,000	
グルメ杵屋	100	1,043.00	104,300	
吉野家ホールディングス	200	2,477.00	495,400	
加藤産業	100	3,510.00	351,000	
イノテック	100	1,353.00	135,300	
イエローハット	100	1,852.00	185,200	
ＪＫホールディングス	100	1,046.00	104,600	
サガミホールディングス	100	1,312.00	131,200	
関西フードマーケット	100	1,517.00	151,700	
ミロク情報サービス	100	1,675.00	167,500	
因幡電機産業	100	2,991.00	299,100	
アークス	100	2,416.00	241,600	
バローホールディングス	100	1,999.00	199,900	
ミスミグループ本社	900	3,295.00	2,965,500	
ファーストリテイリング	300	32,550.00	9,765,000	
ソフトバンクグループ	3,100	5,094.00	15,791,400	
スズケン	200	3,690.00	738,000	
サンドラッグ	200	3,675.00	735,000	
サックスバー　ホールディングス	100	853.00	85,300	
ベルーナ	200	712.00	142,400	
合計	627,500		1,565,032,540	

（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）

	2023年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,901,596
国債証券	8,609,861,200
地方債証券	669,029,800
特殊債券	611,141,000
社債券	396,764,000
未収利息	13,167,054
前払費用	580,790
流動資産合計	10,350,445,440
資産合計	10,350,445,440
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,214,000
流動負債合計	3,214,000
負債合計	3,214,000
純資産の部	
元本等	
元本	8,366,977,587
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,980,253,853
元本等合計	10,347,231,440
純資産合計	10,347,231,440
負債純資産合計	10,350,445,440

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10月21日 至　2023年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,205,666,929円
同期中追加設定元本額	799,170,390円
同期中一部解約元本額	637,859,732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	3,367,693,282円
新光７資産バランスファンド	479,625,172円
日本債券ファンド	3,966,600,570円
世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	457,117,810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）	20,386,040円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	48,290,813円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	27,263,900円
計	8,366,977,587円
２．　受益権の総数	8,366,977,587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10月21日 至　2023年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月20日現在

１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年4月20日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△6,824,300
地方債証券	△5,933,800
特殊債券	△5,122,000
社債券	△2,431,000
合計	△20,311,100

（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11月11日から2023年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2367円 (12,367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

2023年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４３６回　利付国庫債券（２年）	90,000,000	90,115,200	

４３９回　利付国庫債券（２年）	100,000,000	100,128,000	
４４１回　利付国庫債券（２年）	60,000,000	60,073,800	
４４２回　利付国庫債券（２年）	80,000,000	80,097,600	
４４５回　利付国庫債券（２年）	20,000,000	20,023,200	
１４０回　利付国庫債券（５年）	70,000,000	70,170,800	
１４１回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,102,000	
１４２回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	60,165,000	
１４３回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	50,148,000	
１４４回　利付国庫債券（５年）	80,000,000	80,251,200	
１４５回　利付国庫債券（５年）	80,000,000	80,270,400	
１４６回　利付国庫債券（５年）	150,000,000	150,540,000	
１４７回　利付国庫債券（５年）	120,000,000	120,104,400	
１４８回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,012,400	
１４９回　利付国庫債券（５年）	80,000,000	79,972,000	
１５０回　利付国庫債券（５年）	50,000,000	49,935,500	
１５１回　利付国庫債券（５年）	30,000,000	29,923,800	
１５３回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	59,775,600	
１５４回　利付国庫債券（５年）	60,000,000	59,960,400	
１５６回　利付国庫債券（５年）	40,000,000	40,111,200	
１回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	12,432,600	
２回　利付国庫債券（４０年）	10,000,000	11,988,400	
３回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	23,946,600	
４回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	23,981,200	
５回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	23,111,800	
６回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	22,682,000	
７回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	21,692,200	
８回　利付国庫債券（４０年）	20,000,000	20,133,200	
９回　利付国庫債券（４０年）	40,000,000	29,683,200	
１０回　利付国庫債券（４０年）	40,000,000	34,761,200	
１１回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	25,130,400	

１２回　利付国庫債券（４０年）	30,000,000	22,447,800	
１３回　利付国庫債券（４０年）	40,000,000	29,685,600	
１４回　利付国庫債券（４０年）	40,000,000	31,691,600	
１５回　利付国庫債券（４０年）	40,000,000	34,744,000	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	60,496,200	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	90,000,000	90,739,800	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	30,000,000	30,282,600	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	80,486,400	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	80,696,800	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	120,000,000	121,156,800	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	80,851,200	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,625,100	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	80,291,200	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,232,400	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	80,232,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	60,131,400	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,081,900	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	70,014,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	90,000,000	89,940,600	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	100,000,000	99,837,000	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	120,000,000	119,648,400	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	120,000,000	119,569,200	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	79,635,200	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	110,000,000	109,413,700	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	79,485,600	

３５５回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	79,367,200	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	79,267,200	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,243,300	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	69,145,300	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	78,822,400	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	90,000,000	88,469,100	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	78,448,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	78,279,200	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	80,000,000	78,102,400	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	58,486,200	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	68,155,500	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	68,677,000	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	60,000,000	58,783,200	
３６８回　利付国庫債券（１０年）	70,000,000	68,604,900	
３６９回　利付国庫債券（１０年）	20,000,000	20,139,200	
１０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,143,200	
１１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	11,160,700	
１２回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	11,572,600	
１５回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,038,400	
１７回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	11,968,900	
１９回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	11,880,100	
２０回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,132,400	
２１回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	11,909,900	
２２回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,167,500	
２３回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,184,300	

２６回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,101,500	
２７回　利付国庫債券（３０年）	10,000,000	12,260,700	
２８回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	24,578,800	
２９回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	24,324,800	
３０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	24,047,800	
３１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	23,752,600	
３２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	36,111,600	
３３回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	34,681,200	
３４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	35,658,300	
３５回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	34,719,600	
３６回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	34,716,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	60,000,000	68,390,400	
３８回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,414,800	
３９回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	34,129,800	
４０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,390,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,020,400	
４２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,021,400	
４３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	22,022,200	
４４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	33,033,900	
４５回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	31,876,200	
４６回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	31,865,400	
４７回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	32,412,900	
４８回　利付国庫債券（３０年）	40,000,000	41,633,600	
４９回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	31,208,100	
５０回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,595,200	

５１回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	24,528,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	25,668,300	
５３回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	26,199,300	
５４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,363,300	
５５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	18,194,600	
５６回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	18,146,600	
５７回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,147,600	
５８回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,075,300	
５９回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	26,361,900	
６０回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	18,366,400	
６１回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	17,455,400	
６２回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	16,514,600	
６３回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	16,001,400	
６４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	23,892,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	15,900,400	
６６回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	15,812,200	
６７回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	25,005,900	
６８回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	24,948,300	
６９回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	25,582,500	
７０回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	25,529,100	
７１回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	25,500,300	
７２回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	25,471,800	
７３回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	25,418,100	
７４回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	27,501,900	
７５回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	29,624,100	

７６回　利付国庫債券（３０年）	30,000,000	30,379,500	
７７回　利付国庫債券（３０年）	20,000,000	21,216,400	
７０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	20,585,200	
７２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	20,618,200	
８１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,493,400	
８４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,542,900	
８８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,729,500	
９０回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,746,100	
９２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,508,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,833,600	
９９回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,740,800	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,065,600	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,961,500	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,110,200	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,204,200	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,286,600	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	33,547,200	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,212,900	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,313,400	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,491,000	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,200,100	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,831,200	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,297,200	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,076,100	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,629,800	

１２４回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,240,100	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,419,900	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,261,600	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,184,700	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,416,000	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,128,800	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,307,000	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,072,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,093,400	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,354,400	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,399,800	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,113,900	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	33,083,700	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	22,249,200	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,844,600	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	44,145,600	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	66,805,200	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	44,590,000	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	44,960,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	33,163,500	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	20,000,000	21,919,800	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	55,803,500	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	44,663,600	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	55,345,000	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	43,844,000	

１４９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	54,794,500	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	54,244,500	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,097,000	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	63,648,000	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,573,000	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,946,500	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,685,000	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	38,351,600	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	46,537,500	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	48,270,000	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	48,798,000	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	39,474,400	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	38,858,400	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	48,425,500	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	48,306,500	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	56,956,800	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	37,864,800	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	48,613,000	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	37,596,400	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	27,661,800	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	36,154,000	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	27,000,600	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	35,872,000	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	27,258,000	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	36,218,400	

	１７４回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	45,081,500	
	１７５回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	45,731,500	
	１７６回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	36,463,200	
	１７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	35,706,800	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	36,268,800	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	27,107,400	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	28,568,400	
	１８１回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	29,027,100	
	１８２回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	40,000,000	
	１８３回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	31,506,000	
国債証券　合計		8,580,000,000	8,609,861,200	
地方債証券	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,638,000	
	２１８回　神奈川県公募公債	100,000,000	100,225,000	
	４１２回　大阪府公募公債　１０年	50,000,000	49,803,000	
	１９０回　大阪府公募公債　５年	100,000,000	99,272,000	
	１２回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	101,543,000	
	令和３年度１１回　愛知県公募公債	100,000,000	96,077,000	
	２４年度１回　福岡県公募公債　３０年	10,000,000	11,531,800	
	１６９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,940,000	
地方債証券　合計		660,000,000	669,029,800	
特殊債券	１４７回　高速道路機構債	100,000,000	100,527,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,148,000	
	２４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,907,000	
	３２７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,708,000	
	２５０回　住宅金融支援機構	100,000,000	99,285,000	
	８７回　中日本高速道路債券	100,000,000	99,566,000	
特殊債券　合計		600,000,000	611,141,000	
社債券	５０回　西日本高速道路債券	100,000,000	99,976,000	
	１１回　ブリヂストン社債	100,000,000	99,548,000	
	３６回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,142,000	
	４９４回　九州電力社債	100,000,000	94,098,000	

社債券　合計	400,000,000	396,764,000	
合計		10,286,796,000	

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）

	2023年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,456,605,502
投資証券	81,370,919,742
派生商品評価勘定	33,251,400
未収入金	113,916,319
未収配当金	857,240,053
差入委託証拠金	138,866,000
流動資産合計	83,970,799,016
資産合計	83,970,799,016
負債の部	
流動負債	
前受金	30,206,540
未払解約金	92,526,000
流動負債合計	122,732,540
負債合計	122,732,540
純資産の部	
元本等	
元本	39,020,847,590
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	44,827,218,886
元本等合計	83,848,066,476
純資産合計	83,848,066,476
負債純資産合計	83,970,799,016

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10月21日 至　2023年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,205,375,103円
同期中追加設定元本額	486,710,503円
同期中一部解約元本額	3,671,238,016円
元本の内訳	
ファンド名	
Ｊ－ＲＥＩＴパッケージ	2,154,847,365円
新光Ｊ－ＲＥＩＴオープン	34,529,340,333円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内リートインデックスファンド	1,372,236,957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）	686,942,978円
計	39,020,847,590円
２．　受益権の総数	39,020,847,590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10月21日 至　2023年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年4月20日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△1,430,243,963
合計	△1,430,243,963

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2023年4月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）

市場取引 先物取引 買建	2,296,754,460	－	2,330,146,000	33,391,540
合計	2,296,754,460	－	2,330,146,000	33,391,540

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

１．原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1488円 (21,488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

2023年4月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	3,372	615,390,000	
	ＧＬＰ投資法人	25,406	3,874,415,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	7,567	1,005,654,300	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,373	324,165,300	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	3,915	522,261,000	
	いちごオフィスリート投資法人	6,450	623,715,000	
	いちごホテルリート投資法人	1,304	134,703,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,156	1,643,698,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	7,870	2,660,060,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,431	462,155,700	
	イオンリート投資法人	9,036	1,378,893,600	
	インヴィンシブル投資法人	34,645	1,874,294,500	
	エスコンジャパンリート投資法人	1,600	174,240,000	
	オリックス不動産投資法人	15,684	2,681,964,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	5,792	607,580,800	

ケネディクス・オフィス投資法人	4,580	1,387,740,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	5,773	1,206,557,000	
ケネディクス商業リート投資法人	3,422	811,698,400	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,764	1,240,238,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,046	231,198,000	
サンケイリアルエステート投資法人	2,522	207,812,800	
ザイマックス・リート投資法人	1,277	137,788,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	25,384	1,898,723,200	
ジャパンエクセレント投資法人	7,221	846,301,200	
ジャパンリアルエステイト投資法人	8,072	4,278,160,000	
スターアジア不動産投資法人	9,828	551,350,800	
スターツプロシード投資法人	1,364	310,582,800	
タカラレーベン不動産投資法人	3,710	334,642,000	
トーセイ・リート投資法人	1,746	232,218,000	
ヒューリックリート投資法人	7,365	1,140,102,000	
フロンティア不動産投資法人	2,921	1,415,224,500	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,941	314,247,900	
マリモ地方創生リート投資法人	1,202	152,173,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	17,608	2,604,223,200	
ラサールロジポート投資法人	9,636	1,531,160,400	
阪急阪神リート投資法人	3,555	515,475,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,109	1,557,609,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,704	1,101,880,000	
産業ファンド投資法人	12,010	1,836,329,000	
森トラストリート投資法人	14,650	1,031,393,792	
森ヒルズリート投資法人	9,256	1,423,572,800	
星野リゾート・リート投資法人	1,377	981,801,000	
積水ハウス・リート投資法人	23,653	1,816,550,400	
大江戸温泉リート投資法人	1,270	81,280,000	
大和ハウスリート投資法人	11,865	3,357,795,000	
大和証券オフィス投資法人	1,631	967,183,000	
大和証券リビング投資法人	10,908	1,239,148,800	
投資法人みらい	9,563	442,288,750	
東海道リート投資法人	1,309	151,058,600	
東急リアル・エステート投資法人	5,277	944,583,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	2,718	1,715,058,000	
日本ビルファンド投資法人	9,183	5,105,748,000	

	日本プライムリアルティ投資法人	5,383	1,884,050,000	
	日本プロロジスリート投資法人	13,268	4,079,910,000	
	日本リート投資法人	2,557	814,404,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	5,307	1,647,823,500	
	日本都市ファンド投資法人	39,716	3,820,679,200	
	福岡リート投資法人	4,071	657,873,600	
	平和不動産リート投資法人	5,379	841,813,500	
	野村不動産マスターファンド投資法人	25,454	3,940,279,200	
投資証券　合計		478,156	81,370,919,742	
合計			81,370,919,742	

（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）

	2023年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	65,895,408
コール・ローン	5,471,386
株式	1,510,399,737
投資信託受益証券	2,432,865
投資証券	30,583,603
派生商品評価勘定	7,967,732
未収入金	616,327
未収配当金	1,720,270
差入委託証拠金	83,016,427
流動資産合計	1,708,103,755
資産合計	1,708,103,755
負債の部	
流動負債	
未払金	613,896
未払解約金	20,000
流動負債合計	633,896
負債合計	633,896
純資産の部	
元本等	
元本	407,556,522
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,299,913,337
元本等合計	1,707,469,859
純資産合計	1,707,469,859
負債純資産合計	1,708,103,755

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10月21日 至　2023年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2023年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	447,877,147円
同期中追加設定元本額	4,094,334円
同期中一部解約元本額	44,414,959円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	146,523,768円
新光外国株式インデックスＶＡ	172,464,234円
世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家私募）	73,448,065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）	2,097,118円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家私募）	7,799,813円
ワールドバランスファンド３０ＶＡ２（適格機関投資家私募）	5,223,524円
計	407,556,522円

２．　受益権の総数	407,556,522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10月21日 至　2023年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年4月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）

株式	149,502,047
投資信託受益証券	149,574
投資証券	1,127,447
合計	150,779,068

（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11月11日から2023年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年4月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	150,100,976	－	158,068,708	7,967,732
合計	150,100,976	－	158,068,708	7,967,732

（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）

	2023年4月20日現在
1口当たり純資産額	4.1895円
（1万口当たり純資産額）	(41,895円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年4月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	2,059	104.300	214,753.700	
	ABBOTT LABORATORIES	392	112.290	44,017.680	
	AES CORP	157	24.500	3,846.500	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	203	126.320	25,642.960	
	ADVANCED MICRO DEVICES	359	89.940	32,288.460	
	ADOBE INC	104	380.110	39,531.440	
	CHUBB LTD	96	204.500	19,632.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	49	290.500	14,234.500	
	ALLSTATE CORP	63	116.510	7,340.130	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	151	197.810	29,869.310	
AMGEN INC	119	246.210	29,298.990	
HESS CORP	60	144.940	8,696.400	
AMERICAN EXPRESS CO	140	164.950	23,093.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	112	93.540	10,476.480	
AFLAC INC	124	66.940	8,300.560	
AMERICAN INTL GROUP	174	53.170	9,251.580	
ANALOG DEVICES	116	188.550	21,871.800	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	164	58.870	9,654.680	
VALERO ENERGY CORP	84	124.400	10,449.600	
ANSYS INC	19	324.380	6,163.220	
APPLE INC	3,571	167.630	598,606.730	
APPLIED MATERIALS INC	192	110.340	21,185.280	
ALBEMARLE CORP	28	203.780	5,705.840	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	119	81.950	9,752.050	
AMEREN CORP	58	89.290	5,178.820	
ARROW ELECTRONICS INC	10	113.860	1,138.600	
AUTODESK INC	49	196.560	9,631.440	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	95	217.040	20,618.800	
AUTOZONE INC	4	2,663.160	10,652.640	
AVERY DENNISON CORP	17	180.010	3,060.170	
BALL CORP	79	52.220	4,125.380	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	293	323.090	94,665.370	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	173	45.240	7,826.520	
BAXTER INTERNATIONAL INC	100	43.620	4,362.000	
BECTON DICKINSON & CO	66	258.850	17,084.100	
AMETEK INC	50	137.570	6,878.500	
VERIZON COMM INC	929	38.600	35,859.400	
WR BERKLEY CORP	45	62.830	2,827.350	
BEST BUY CO INC	52	72.710	3,780.920	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	6	486.400	2,918.400	
YUM! BRANDS INC	66	137.120	9,049.920	
FIRSTENERGY CORP	109	40.800	4,447.200	
BOEING CO	126	208.710	26,297.460	
ROBERT HALF INTL INC	25	75.550	1,888.750	
BORGWARNER INC	49	48.810	2,391.690	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	326	52.890	17,242.140	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	30	96.000	2,880.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	42	123.350	5,180.700	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	5	1,598.990	7,994.950	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	476	69.860	33,253.360	
ONEOK INC	95	66.350	6,303.250	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	17	123.910	2,106.470	
UNITED RENTALS INC	16	378.570	6,057.120	
SEMPRA ENERGY	73	157.990	11,533.270	
FEDEX CORP	54	229.490	12,392.460	
VERISIGN INC	20	215.620	4,312.400	
AMPHENOL CORP	133	77.350	10,287.550	
BROWN-FORMAN CORP	63	64.150	4,041.450	
QUANTA SERVICES INC	33	166.010	5,478.330	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	218	3.930	856.740	
CSX CORP	453	30.560	13,843.680	
COTERRA ENERGY INC	164	25.700	4,214.800	
CAMPBELL SOUP CO	55	54.230	2,982.650	
CONSTELLATION BRANDS INC	36	227.870	8,203.320	
CARDINAL HEALTH INC	64	78.990	5,055.360	
CARLISLE COS INC	11	220.770	2,428.470	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	204	9.800	1,999.200	
CATERPILLAR INC	115	224.650	25,834.750	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	26	131.630	3,422.380	
JPMORGAN CHASE & CO	659	141.220	93,063.980	
CHURCH & DWIGHT CO INC	50	89.520	4,476.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32	108.320	3,466.240	
CINTAS CORP	21	454.330	9,540.930	
CISCO SYSTEMS INC	916	48.040	44,004.640	
CLEVELAND-CLIFFS INC	128	16.900	2,163.200	
CLOROX COMPANY	28	160.540	4,495.120	
COCA-COLA CO/THE	929	63.680	59,158.720	
COPART INC	98	78.080	7,651.840	
COGNEX CORP	46	48.680	2,239.280	
COLGATE-PALMOLIVE CO	175	75.590	13,228.250	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	58	173.710	10,075.180	
MOLINA HEALTHCARE INC	11	277.470	3,052.170	
NRG ENERGY, INC.	63	34.840	2,194.920	
COMCAST CORP-CL A	957	38.250	36,605.250	
CONAGRA BRANDS INC	103	37.350	3,847.050	
CONSOLIDATED EDISON INC	80	98.140	7,851.200	
CMS ENERGY CORP	63	61.610	3,881.430	
COOPER COS INC	10	385.540	3,855.400	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	39	57.430	2,239.770	
CORNING INC	181	34.000	6,154.000	
WOLFSPEED INC	27	57.150	1,543.050	

SEALED AIR CORP	32	47.260	1,512.320	
HEICO CORP-CL A	14	135.000	1,890.000	
CUMMINS INC	33	234.450	7,736.850	
DARLING INTERNATIONAL INC	36	57.980	2,087.280	
DR HORTON INC	78	101.860	7,945.080	
DANAHER CORP	155	254.760	39,487.800	
MOODY'S CORP	37	303.140	11,216.180	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	114	60.250	6,868.500	
TARGET CORP	101	162.510	16,413.510	
DEERE & CO	63	392.770	24,744.510	
MORGAN STANLEY	284	90.450	25,687.800	
REPUBLIC SERVICES INC	48	137.540	6,601.920	
COSTAR GROUP INC	93	69.690	6,481.170	
THE WALT DISNEY CO	405	98.750	39,993.750	
DOLLAR TREE INC	52	148.490	7,721.480	
DOVER CORP	28	147.540	4,131.120	
OMNICOM GROUP	49	92.160	4,515.840	
DTE ENERGY CO	46	112.810	5,189.260	
DUKE ENERGY CORP	178	98.400	17,515.200	
DARDEN RESTAURANTS INC	30	151.550	4,546.500	
EBAY INC	110	43.710	4,808.100	
BANK OF AMERICA CORP	1,605	30.060	48,246.300	
CITIGROUP INC	441	50.400	22,226.400	
EASTMAN CHEMICAL CO	25	82.600	2,065.000	
EATON CORP PLC	88	163.400	14,379.200	
CADENCE DESIGN SYS INC	63	213.670	13,461.210	
DISH NETWORK CORP	70	7.830	548.100	
ECOLAB INC	60	164.660	9,879.600	
PERKINELMER INC	32	135.550	4,337.600	
ELECTRONIC ARTS INC	64	128.180	8,203.520	
SALESFORCE INC	224	198.920	44,558.080	
ERIE INDEMNITY CO	6	237.010	1,422.060	
EMERSON ELECTRIC CO	129	86.370	11,141.730	
ATMOS ENERGY CORP	31	114.740	3,556.940	
ENTERGY CORP	50	109.400	5,470.000	
EOG RESOURCES INC	129	118.800	15,325.200	
EQUIFAX INC	29	194.910	5,652.390	
EQT CORP	86	33.220	2,856.920	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	51	256.630	13,088.130	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	37	111.840	4,138.080	
EXXON MOBIL CORP	926	116.570	107,943.820	
FMC CORP	28	123.750	3,465.000	
NEXTERA ENERGY INC	445	78.940	35,128.300	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	7	416.530	2,915.710	
FAIR ISAAC CORP	6	695.310	4,171.860	
ASSURANT INC	9	118.910	1,070.190	

FASTENAL CO	120	54.010	6,481.200	
FIFTH THIRD BANCORP	168	28.020	4,707.360	
M&T BANK CORP	34	129.610	4,406.740	
FIRST HORIZON CORP	128	18.590	2,379.520	
FISERV INC	134	117.080	15,688.720	
FORD MOTOR CO	923	12.220	11,279.060	
FRANKLIN RESOURCES INC	72	27.130	1,953.360	
FREEPORT-MCMORAN INC	307	41.890	12,860.230	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2	1,063.400	2,126.800	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	48	204.150	9,799.200	
DENTSPLY SIRONA INC	34	40.590	1,380.060	
GENERAL DYNAMICS CORP	52	228.800	11,897.600	
GENERAL MILLS INC	131	87.130	11,414.030	
GENUINE PARTS CO	35	166.500	5,827.500	
GILEAD SCIENCES INC	283	84.110	23,803.130	
GARTNER INC	16	307.240	4,915.840	
MCKESSON CORP	32	355.550	11,377.600	
NVIDIA CORP	552	279.310	154,179.120	
GRACO INC	36	70.430	2,535.480	
GENERAL ELECTRIC CO	245	99.030	24,262.350	
WW GRAINGER INC	11	665.430	7,319.730	
HALLIBURTON CO	200	34.110	6,822.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	188	52.490	9,868.120	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	76	336.890	25,603.640	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	45	203.540	9,159.300	
HASBRO INC	25	52.500	1,312.500	
HENRY SCHEIN INC	24	82.950	1,990.800	
HEICO CORP	13	170.270	2,213.510	
HERSHEY FOODS CORP	34	257.300	8,748.200	
HP INC	227	30.210	6,857.670	
F5 INC	14	137.050	1,918.700	
CROWN HOLDINGS INC NPR	22	79.740	1,754.280	
UNITED THERAPEUTICS CORP	10	226.680	2,266.800	
JUNIPER NETWORKS INC	73	31.760	2,318.480	
HOLOGIC INC	54	83.990	4,535.460	
HOME DEPOT INC	228	296.910	67,695.480	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	41	99.060	4,061.460	
HORMEL FOODS CORP	67	39.830	2,668.610	
CENTERPOINT ENERGY INC	142	30.510	4,332.420	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6	258.860	1,553.160	
HUBBELL INC	12	232.130	2,785.560	
HUMANA INC	29	492.900	14,294.100	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	20	178.410	3,568.200	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	316	11.840	3,741.440	

BIOGEN INC	31	292.270	9,060.370	
IDEX CORP	18	217.840	3,921.120	
ILLINOIS TOOL WORKS	68	233.170	15,855.560	
INTUIT INC	59	445.490	26,283.910	
IDEXX LABORATORIES INC	18	487.700	8,778.600	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	54	176.440	9,527.760	
INTEL CORP	918	31.150	28,595.700	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	56	96.540	5,406.240	
INTERNATIONAL PAPER CO	80	36.570	2,925.600	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	96	37.490	3,599.040	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19	153.990	2,925.810	
INCYTE CORP	42	73.810	3,100.020	
JOHNSON & JOHNSON	587	162.530	95,405.110	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	76	70.700	5,373.200	
KLA CORPORATION	31	361.260	11,199.060	
DEVON ENERGY CORP	144	54.850	7,898.400	
KELLOGG CO	50	67.350	3,367.500	
KEYCORP	195	12.380	2,414.100	
KIMBERLY-CLARK CORP	76	138.400	10,518.400	
BLACKROCK INC/NEW YORK	33	695.240	22,942.920	
KROGER CO	150	47.450	7,117.500	
LAM RESEARCH CORP	31	491.020	15,221.620	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	11	427.640	4,704.040	
PACKAGING CORP OF AMERICA	23	142.370	3,274.510	
AKAMAI TECHNOLOGIES	29	82.200	2,383.800	
PLUG POWER INC	130	9.000	1,170.000	
LENNAR CORP	59	109.300	6,448.700	
ELI LILLY & CO	181	370.470	67,055.070	
BATH & BODY WORKS INC	45	35.600	1,602.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	162	196.030	31,756.860	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	69	138.930	9,586.170	
LOCKHEED MARTIN CORP	53	495.160	26,243.480	
LOEWS CORP	35	57.490	2,012.150	
LOWE'S COS INC	134	208.830	27,983.220	
DOMINION ENERGY INC	187	57.430	10,739.410	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	81	44.640	3,615.840	
MCCORMICK & CO INC	61	85.260	5,200.860	
MCDONALD'S CORPORATION	166	291.270	48,350.820	
S&P GLOBAL INC	74	352.030	26,050.220	
EVEREST RE GROUP LTD	9	374.340	3,369.060	
MARKEL CORPORATION	3	1,357.260	4,071.780	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	137	86.500	11,850.500	
MARSH & MCLENNAN COS	111	173.560	19,265.160	
MASCO CORP	39	50.270	1,960.530	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	13	356.800	4,638.400	
METLIFE INC	152	61.810	9,395.120	
MEDTRONIC PLC	298	84.870	25,291.260	
ACTIVISION BLIZZARD INC	173	85.500	14,791.500	
CVS HEALTH CORP	291	74.210	21,595.110	
MERCK & CO.INC.	571	114.130	65,168.230	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	94	76.920	7,230.480	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	19	231.290	4,394.510	
MICROSOFT CORP	1,590	288.450	458,635.500	
MICRON TECH INC	250	60.650	15,162.500	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	126	79.380	10,001.880	
3M CO	129	106.080	13,684.320	
MOHAWK INDUSTRIES INC	17	98.620	1,676.540	
ENTEGRIS INC	35	71.610	2,506.350	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	12	202.870	2,434.440	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	39	288.870	11,265.930	
ILLUMINA INC	33	231.610	7,643.130	
XCEL ENERGY INC	117	70.590	8,259.030	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19	104.870	1,992.530	
NETAPP INC	48	66.150	3,175.200	
NEWELL BRANDS INC	74	12.530	927.220	
NEWMONT CORP	175	48.260	8,445.500	
NVR INC	1	5,861.130	5,861.130	
NIKE INC-CL B	280	125.670	35,187.600	
NORDSON CORP	10	217.290	2,172.900	
NORFOLK SOUTHERN CORP	54	209.840	11,331.360	
EVERSOURCE ENERGY	74	78.990	5,845.260	
NISOURCE INC	72	28.550	2,055.600	
NORTHERN TRUST CORP	48	86.990	4,175.520	
NORTHROP GRUMMAN CORP	32	477.070	15,266.240	
WELLS FARGO & CO	851	42.240	35,946.240	
NUCOR CORP	55	147.610	8,118.550	
CHENIERE ENERGY INC	53	150.830	7,993.990	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	80	99.300	7,944.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	166	62.470	10,370.020	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	22	346.010	7,612.220	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	14	899.140	12,587.960	

ORACLE CORP	363	95.810	34,779.030	
PACCAR INC	123	72.910	8,967.930	
PTC INC	27	126.160	3,406.320	
EXELON CORP	219	43.040	9,425.760	
PARKER HANNIFIN CORP	30	323.430	9,702.900	
PAYCHEX INC	76	109.770	8,342.520	
ALIGN TECHNOLOGY INC	16	356.370	5,701.920	
PPL CORPORATION	180	28.700	5,166.000	
PEPSICO INC	312	184.720	57,632.640	
PENTAIR PLC	28	52.810	1,478.680	
PFIZER INC	1,253	40.240	50,420.720	
ESSENTIAL UTILITIES INC	61	43.370	2,645.570	
CONOCOPHILLIPS	278	105.260	29,262.280	
PG&E CORP	345	16.890	5,827.050	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	52	227.310	11,820.120	
ALTRIA GROUP INC	398	46.460	18,491.080	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	86	128.370	11,039.820	
BROWN & BROWN INC	58	60.390	3,502.620	
GARMIN LTD	39	98.150	3,827.850	
PPG INDUSTRIES INC	53	140.550	7,449.150	
COSTCO WHOLESALE CORP	99	496.030	49,106.970	
T ROWE PRICE GROUP INC	45	112.770	5,074.650	
QUEST DIAGNOSTICS	28	143.550	4,019.400	
PROCTER & GAMBLE CO	534	151.240	80,762.160	
PROGRESSIVE CORP	129	138.910	17,919.390	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	105	64.050	6,725.250	
PULTE GROUP INC	47	62.440	2,934.680	
GLOBAL PAYMENTS INC	64	109.990	7,039.360	
QUALCOMM INC	249	118.540	29,516.460	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	48	96.890	4,650.720	
EXACT SCIENCES CORP	37	68.680	2,541.160	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	12	248.440	2,981.280	
REGENERON PHARMACEUTICALS	24	808.860	19,412.640	
REPLIGEN CORP	11	171.420	1,885.620	
RESMED INC	32	222.370	7,115.840	
US BANCORP	326	36.010	11,739.260	
SEAGEN INC	33	205.000	6,765.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	84	72.130	6,058.920	
ROSS STORES INC	84	104.260	8,757.840	
ROLLINS INC	46	39.150	1,800.900	
ROPER TECHNOLOGIES INC	24	443.060	10,633.440	
ROCKWELL AUTOMATION INC	25	274.320	6,858.000	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	54	64.470	3,481.380	
RPM INTERNATIONAL INC	29	82.960	2,405.840	
ACCENTURE PLC-CL A	141	279.900	39,465.900	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	319	70.360	22,444.840	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	25	237.850	5,946.250	
AXON ENTERPRISE INC	15	226.340	3,395.100	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	55	182.570	10,041.350	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	135	56.010	7,561.350	
BOOKING HOLDINGS INC	9	2,676.280	24,086.520	
SCHLUMBERGER LTD	325	52.630	17,104.750	
SCHWAB (CHARLES) CORP	336	55.550	18,664.800	
POOL CORP	10	338.670	3,386.700	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	48	138.120	6,629.760	
BUNGE LTD	34	96.750	3,289.500	
SEI INVESTMENTS CO	33	59.420	1,960.860	
ELEVANCE HEALTH INC	53	457.330	24,238.490	
AMERISOURCEBERGEN CORP	34	164.480	5,592.320	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	56	77.110	4,318.160	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	56	233.590	13,081.040	
CENTENE CORP	129	66.780	8,614.620	
SMITH (A.O.) CORP	26	67.880	1,764.880	
SNAP-ON INC	12	239.770	2,877.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	85	87.850	7,467.250	
ADVANCE AUTO PARTS	14	128.110	1,793.540	
EDISON INTERNATIONAL	94	72.740	6,837.560	
SOUTHERN CO	250	72.810	18,202.500	
TRUIST FINANCIAL CORP	301	34.790	10,471.790	
SOUTHWEST AIRLINES	29	32.450	941.050	
AT&T INC	1,592	19.700	31,362.400	
CHEVRON CORP	413	170.680	70,490.840	
STANLEY BLACK & DECKER INC	39	80.300	3,131.700	
STATE STREET CORP	81	75.290	6,098.490	
STARBUCKS CORP	258	107.160	27,647.280	
STEEL DYNAMICS INC	42	106.220	4,461.240	
STRYKER CORP	77	299.310	23,046.870	
NETFLIX INC	99	323.120	31,988.880	
GEN DIGITAL INC	130	17.870	2,323.100	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30	56.800	1,704.000	
SYNOPSYS INC	34	378.770	12,878.180	
SYSCO CORP	109	74.760	8,148.840	

INTUITIVE SURGICAL INC	79	298.570	23,587.030	
TELEFLEX INC	12	268.490	3,221.880	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	278	8.490	2,360.220	
TERADYNE INC	34	98.560	3,351.040	
TEXAS INSTRUMENTS INC	205	177.080	36,301.400	
TEXTRON INC	45	68.910	3,100.950	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	88	579.920	51,032.960	
GLOBE LIFE INC	21	109.730	2,304.330	
TORO CO	22	104.510	2,299.220	
DAVITA INC	16	83.600	1,337.600	
TRACTOR SUPPLY CO	24	246.820	5,923.680	
BIO-TECHNE CORP	40	84.980	3,399.200	
TRIMBLE INC	44	47.600	2,094.400	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8	377.970	3,023.760	
TYSON FOODS INC	60	61.620	3,697.200	
UGI CORP	40	34.920	1,396.800	
MARATHON OIL CORP	142	24.660	3,501.720	
UNION PACIFIC CORP	135	202.000	27,270.000	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	331	104.090	34,453.790	
UNITEDHEALTH GROUP INC	210	486.200	102,102.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	18	137.160	2,468.880	
VF CORP	73	22.880	1,670.240	
PARAMOUNT GLOBAL	149	22.560	3,361.440	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	57	328.450	18,721.650	
VULCAN MATERIALS CO	32	173.540	5,553.280	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	168	34.830	5,851.440	
WALMART INC	336	150.010	50,403.360	
WASTE MANAGEMENT INC	91	165.100	15,024.100	
WATERS CORP	14	308.450	4,318.300	
WEBSTER FINANCIAL CORP	36	39.710	1,429.560	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	16	367.640	5,882.240	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	26	152.170	3,956.420	
VAIL RESORTS INC	8	246.440	1,971.520	
WESTERN DIGITAL CORP	78	34.620	2,700.360	
WABTEC CORP	43	100.120	4,305.160	
WHIRLPOOL CORP	14	139.540	1,953.560	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	40	109.260	4,370.400	
WYNN RESORTS LTD	23	112.120	2,578.760	
NASDAQ INC	67	57.360	3,843.120	
CME GROUP INC	80	192.270	15,381.600	
WILLIAMS COS INC	280	30.080	8,422.400	
LKQ CORP	50	55.900	2,795.000	

ALLIANT ENERGY CORP	56	55.290	3,096.240	
WEC ENERGY GROUP INC	67	96.740	6,481.580	
CARMAX INC	38	68.120	2,588.560	
TJX COMPANIES INC	262	78.010	20,438.620	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	11	292.760	3,220.360	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	343	4.420	1,516.060	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	100	49.150	4,915.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	30	202.300	6,069.000	
CBRE GROUP INC	70	72.250	5,057.500	
LIBERTY GLOBAL PLC	59	18.830	1,110.970	
REGIONS FINANCIAL CORP	213	19.220	4,093.860	
DOMINO'S PIZZA INC	7	325.660	2,279.620	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	11	463.500	5,098.500	
WESTLAKE CORP	12	118.230	1,418.760	
T-MOBILE US INC	143	148.780	21,275.540	
LAS VEGAS SANDS CORP	74	59.360	4,392.640	
MOSAIC CO/THE	88	45.440	3,998.720	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	9	335.810	3,022.290	
CELANESE CORP	21	109.110	2,291.310	
DEXCOM INC	87	124.120	10,798.440	
EXPEDIA GROUP INC	36	95.330	3,431.880	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	44	74.400	3,273.600	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	22	315.970	6,951.340	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34	19.710	670.140	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	122	108.340	13,217.480	
LIVE NATION	45	67.750	3,048.750	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	1,805.000	10,830.000	
TRANSDIGM GROUP INC	12	760.640	9,127.680	
MASTERCARD INC	193	372.800	71,950.400	
OWENS CORNING	19	101.020	1,919.380	
LEIDOS HOLDINGS INC	31	92.440	2,865.640	
AERCAP HOLDINGS NV	25	55.810	1,395.250	
FIRST SOLAR INC	22	218.190	4,800.180	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	28	144.270	4,039.560	
AECOM TECHNOLOGY CORP	27	82.620	2,230.740	
DELTA AIR LINES INC	27	35.930	970.110	
INSULET CORP	15	326.140	4,892.100	
DISCOVER FINANCIAL	61	105.760	6,451.360	
TE CONNECTIVITY LTD	73	128.250	9,362.250	
MASIMO CORP	9	196.470	1,768.230	

LULULEMON ATHLETICA INC	27	370.120	9,993.240	
VMWARE INC	51	127.940	6,524.940	
MERCADOLIBRE INC	10	1,308.290	13,082.900	
ULTA BEAUTY INC	12	542.030	6,504.360	
INVESCO LTD	75	17.470	1,310.250	
MSCI INC	18	545.480	9,818.640	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	348	101.510	35,325.480	
VISA INC	366	232.570	85,120.620	
KEURIG DR PEPPER INC	195	35.350	6,893.250	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40	149.010	5,960.400	
MARATHON PETROLEUM CORP	105	126.390	13,270.950	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	23	60.510	1,391.730	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	492	17.600	8,659.200	
XYLEM INC	46	103.740	4,772.040	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	57	96.380	5,493.660	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	8	211.030	1,688.240	
SPLUNK INC	39	92.510	3,607.890	
EPAM SYSTEMS INC	13	288.840	3,754.920	
HCA HEALTHCARE INC	49	272.990	13,376.510	
VERISK ANALYTICS INC	38	192.820	7,327.160	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	145.100	2,321.600	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13	219.740	2,856.620	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	41	14.140	579.740	
NXP SEMICONDUCTOR NV	60	172.790	10,367.400	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	28	98.270	2,751.560	
TARGA RESOURCES CORP	55	76.230	4,192.650	
LEAR CORP	13	135.890	1,766.570	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	23	137.980	3,173.540	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	57	57.700	3,288.900	
DOLLAR GENERAL CORP	52	216.510	11,258.520	
FORTINET INC	156	67.320	10,501.920	
HORIZON PHARMA PLC	46	111.860	5,145.560	
TESLA INC	601	180.590	108,534.590	
GENERAC HOLDINGS INC	15	103.360	1,550.400	
ENPHASE ENERGY INC	31	224.270	6,952.370	
GENERAL MOTORS CO	314	34.580	10,858.120	
ALLY FINANCIAL INC	84	27.450	2,305.800	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	19	206.780	3,928.820	

APTIV PLC	60	107.410	6,444.600	
PHILLIPS 66	106	103.060	10,924.360	
META PLATFORMS INC	504	215.700	108,712.800	
IQVIA HOLDINGS INC	42	201.860	8,478.120	
DIAMONDBACK ENERGY INC	36	143.670	5,172.120	
SERVICENOW INC	45	475.590	21,401.550	
PALO ALTO NETWORKS INC	69	195.320	13,477.080	
WORKDAY INC	43	192.030	8,257.290	
ABBVIE INC	398	161.210	64,161.580	
ZOETIS INC	108	174.980	18,897.840	
NEWS CORP/NEW-CL A	90	17.400	1,566.000	
CDW CORP	30	165.120	4,953.600	
HOWMET AEROSPACE INC	90	43.280	3,895.200	
TWILIO INC	45	58.960	2,653.200	
SNAP INC	283	10.980	3,107.340	
TRADE DESK INC A	98	61.610	6,037.780	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	39	73.750	2,876.250	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	9	28.910	260.190	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	36	28.780	1,036.080	
OKTA INC	35	76.910	2,691.850	
BLACK KNIGHT INC	39	56.500	2,203.500	
BAKER HUGHES CO	242	30.560	7,395.520	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	35	108.950	3,813.250	
BROADCOM INC	94	634.500	59,643.000	
ARES MANAGEMENT CORP	35	86.890	3,041.150	
MONGODB INC	16	230.260	3,684.160	
BURLINGTON STORES INC	14	188.090	2,633.260	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	107	9.460	1,012.220	
VEEVA SYSTEMS INC	30	181.750	5,452.500	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	31	48.020	1,488.620	
EVERGY INC	57	62.490	3,561.930	
ALLEGION PLC	20	104.180	2,083.600	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	30	69.010	2,070.300	
STERIS PLC	25	186.750	4,668.750	
DOCUSIGN INC	51	53.050	2,705.550	
WIX.COM LTD	14	90.860	1,272.040	
DROPBOX INC	57	21.910	1,248.870	
KKR & CO INC	114	53.920	6,146.880	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	16	49.030	784.480	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	51	67.750	3,455.250	
MODERNA INC	71	142.820	10,140.220	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	57	146.990	8,378.430	
ARAMARK	53	35.120	1,861.360	
CIGNA GROUP	68	256.100	17,414.800	
DELL TECHNOLOGIES INC	58	43.830	2,542.140	

DOW INC	161	56.440	9,086.840	
OVINTIV INC	50	37.920	1,896.000	
AMCOR PLC	318	11.080	3,523.440	
PINTEREST INC	117	28.220	3,301.740	
FOX CORP-A	71	33.840	2,402.640	
FOX CORP-B	24	31.060	745.440	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	105	9.220	968.100	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	42	132.830	5,578.860	
CHEWY INC	26	32.950	856.700	
AVANTOR INC	134	20.670	2,769.780	
DYNATRACE INC	38	42.890	1,629.820	
CLOUDFLARE INC	65	62.870	4,086.550	
TRADEWEB MARKETS INC	24	73.860	1,772.640	
CARRIER GLOBAL CORP	200	44.980	8,996.000	
OTIS WORLDWIDE CORP	100	82.500	8,250.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	341	32.040	10,925.640	
CORTEVA INC	154	62.250	9,586.500	
MATCH GROUP INC	66	35.120	2,317.920	
FERGUSON PLC	45	133.440	6,004.800	
BILL HOLDINGS INC	19	77.650	1,475.350	
BLACKSTONE INC	162	92.550	14,993.100	
PAYLOCITY HOLDING CORP	9	198.630	1,787.670	
CARLYLE GROUP INC	43	31.490	1,354.070	
DATADOG INC	57	69.555	3,964.630	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	50	62.860	3,143.000	
INGERSOLL RAND INC	92	55.610	5,116.120	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	86	85.750	7,374.500	
PAYCOM SOFTWARE INC	12	304.960	3,659.520	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	82	12.820	1,051.240	
UNITY SOFTWARE INC	51	29.520	1,505.520	
AON PLC	45	329.070	14,808.150	
WARNER BROS DISCOVERY INC	550	14.290	7,859.500	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1	1,577.560	1,577.560	
BENTLEY SYSTEMS INC	54	43.230	2,334.420	
COINBASE GLOBAL INC	30	64.440	1,933.200	
AIRBNB INC	90	120.100	10,809.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP	77	74.750	5,755.750	
ROYALTY PHARMA PLC	75	36.240	2,718.000	
ROBLOX CORP	91	41.090	3,739.190	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	69	21.920	1,512.480	
VIATRIS INC	263	9.830	2,585.290	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	48	44.870	2,153.760	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	22	80.930	1,780.460	

HF SINCLAIR CORP	37	45.250	1,674.250	
SNOWFLAKE INC	49	144.550	7,082.950	
DOORDASH INC	48	61.730	2,963.040	
ARISTA NETWORKS INC	56	158.090	8,853.040	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	96	65.800	6,316.800	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	385	8.490	3,268.650	
FNF GROUP	57	35.870	2,044.590	
JACOBS SOLUTIONS INC	23	115.000	2,645.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	177	41.030	7,262.310	
APA CORP	57	38.790	2,211.030	
LINDE PLC	111	365.310	40,549.410	
LUCID GROUP INC	101	7.620	769.620	
U-HAUL HOLDING CO	18	54.060	973.080	
ASPEN TECHNOLOGY INC	6	228.080	1,368.480	
TOAST INC	48	18.050	866.400	
GRAB HOLDINGS LTD	153	3.050	466.650	
CATALENT INC	39	43.070	1,679.730	
SYNCHRONY FINANCIAL	104	30.790	3,202.160	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	111	30.500	3,385.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	130.410	1,043.280	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	43	148.630	6,391.090	
HUBSPOT INC	11	419.270	4,611.970	
QORVO INC	25	92.600	2,315.000	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	20	78.060	1,561.200	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	13	314.360	4,086.680	
GODADDY INC	39	75.750	2,954.250	
ETSY INC	26	102.380	2,661.880	
TRANSUNION	39	63.310	2,469.090	
ALCOA CORP	46	41.220	1,896.120	
BLOCK INC	125	62.870	7,858.750	
DUPONT DE NEMOURS INC	113	71.210	8,046.730	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	52	61.060	3,175.120	
WESTROCK CO	54	30.830	1,664.820	
KRAFT HEINZ CO	163	39.470	6,433.610	
NOVOCURE LTD	28	63.820	1,786.960	
FORTIVE CORP	72	66.530	4,790.160	
WASTE CONNECTIONS INC	56	142.970	8,006.320	
ALPHABET INC-CL A	1,337	104.180	139,288.660	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	295	14.960	4,413.200	
PAYPAL HOLDINGS INC	248	75.320	18,679.360	
SEA LTD ADR	78	81.490	6,356.220	

	EQUITABLE HOLDINGS INC	94	26.410	2,482.540	
	ZILLOW GROUP INC-C	29	45.790	1,327.910	
	ALPHABET INC-CL C	1,229	105.020	129,069.580	
	ZSCALER INC	22	102.960	2,265.120	
	ATLASSIAN CORP PLC	33	162.770	5,371.410	
	ROKU INC	35	61.740	2,160.900	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	24	343.670	8,248.080	
	VISTRA CORP	95	24.260	2,304.700	
アメリカ・ドル　小計		76,286		8,057,493.390 (1,087,117,005)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	69	16.145	1,114.000	
	ASHTEAD GROUP	88	47.100	4,144.800	
	SEVERN TRENT PLC	53	28.930	1,533.290	
	BARCLAYS PLC	3,262	1.554	5,069.140	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	208	4.868	1,012.540	
	BT GROUP PLC	1,778	1.576	2,802.120	
	BUNZL PLC	65	31.370	2,039.050	
	AVIVA PLC	690	4.232	2,920.080	
	CRODA INTERNATIONAL	30	68.900	2,067.000	
	DIAGEO PLC	507	36.750	18,632.250	
	SCHRODERS PLC	229	4.835	1,107.210	
	DCC PLC	22	48.120	1,058.640	
	NATIONAL GRID PLC	791	11.235	8,886.880	
	KINGFISHER PLC	413	2.581	1,065.950	
	BAE SYSTEMS PLC	715	10.200	7,293.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	476	29.305	13,949.180	
	HALMA PLC	74	21.970	1,625.780	
	NEXT PLC	27	65.340	1,764.180	
	IMPERIAL BRANDS PLC	220	19.380	4,263.600	
	JOHNSON MATTHEY PLC	52	19.735	1,026.220	
	ANGLO AMERICAN PLC	288	27.615	7,953.120	
	COMPASS GROUP PLC	410	20.380	8,355.800	
	HSBC HOLDINGS PLC	4,502	5.734	25,814.460	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,460	2.533	3,698.180	
	UNILEVER PLC	590	43.415	25,614.850	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	165	10.710	1,767.150	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	76	20.450	1,554.200	
	PEARSON PLC	156	8.384	1,307.900	
	PERSIMMON PLC	64	12.730	814.720	
	PRUDENTIAL PLC	649	11.660	7,567.340	
	RIO TINTO PLC	246	55.300	13,603.800	
	VODAFONE GROUP PLC	6,068	0.907	5,503.670	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	163	63.660	10,376.580	
RELX PLC	428	26.430	11,312.040	
RENTOKIL INITIAL PLC	537	6.006	3,225.220	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	2,163	1.553	3,359.130	
NATWEST GROUP PLC	1,183	2.737	3,237.870	
ST JAMES'S PLACE PLC	100	12.110	1,211.000	
SSE PLC	234	18.185	4,255.290	
BP PLC	4,059	5.354	21,731.880	
SAGE GROUP PLC(THE)	255	7.936	2,023.680	
SMITHS GROUP PLC	80	16.500	1,320.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14	115.900	1,622.600	
STANDARD CHARTERED PLC	516	6.522	3,365.350	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	15,801	0.492	7,774.090	
TAYLOR WIMPLEY PLC	400	1.230	492.000	
TESCO PLC	1,495	2.759	4,124.700	
3I GROUP PLC	238	16.975	4,040.050	
SMITH & NEPHEW PLC	195	12.230	2,384.850	
GSK PLC	942	14.858	13,996.230	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	81	79.300	6,423.300	
WPP PLC	274	9.544	2,615.050	
ASTRAZENECA PLC	348	119.920	41,732.160	
WHITBREAD PLC	39	31.280	1,219.920	
INTERTEK GROUP PLC	29	41.120	1,192.480	
BURBERRY GROUP PLC	83	25.890	2,148.870	
INTERCONTINENTAL HOTELS	44	56.240	2,474.560	
SAINSBURY (J) PLC	302	2.822	852.240	
ADMIRAL GROUP PLC	59	22.720	1,340.480	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	34	43.390	1,475.260	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	43	18.210	783.030	
ABRDN PLC	388	2.031	788.020	
EXPERIAN PLC	211	27.210	5,741.310	
MONDI PLC	125	13.090	1,636.250	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	117	7.946	929.680	
OCADO GROUP PLC	126	5.196	654.690	
INFORMA PLC	294	7.010	2,060.940	
GLENCORE PLC	2,314	4.943	11,438.100	
ENTAIN PLC	153	13.875	2,122.870	
COCA-COLA HBC AG	32	23.720	759.040	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	130	5.734	745.420	
M&G PLC	703	1.996	1,403.180	
JD SPORTS FASHION PLC	595	1.636	973.420	
HALEON PLC	1,081	3.436	3,714.310	
SHELL PLC	1,584	24.575	38,926.800	

	AUTO TRADER GROUP PLC	134	6.206	831.600	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	672	1.619	1,087.960	
イギリス・ポンド　小計		63,241		422,853.600 (70,908,320)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	318	29.500	9,381.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	429	27.150	11,647.350	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	171	4.851	829.520	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5	648.500	3,242.500	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	25	162.500	4,062.500	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	247	17.250	4,260.750	
	ICL GROUP LTD	193	23.300	4,496.900	
	NICE LTD	16	792.000	12,672.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48	113.700	5,457.600	
	AZRIELI GROUP	17	203.500	3,459.500	
イスラエル・シュケル　小計		1,469		59,509.620 (2,201,999)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	50	66.040	3,302.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	770	22.230	17,117.100	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	349	22.620	7,894.380	
	TELSTRA GROUP LTD	956	4.270	4,082.120	
	ASX LTD	48	68.500	3,288.000	
	BHP GROUP LTD	1,174	47.270	55,494.980	
	AMPOL LTD	49	30.280	1,483.720	
	COMPUTERSHARE LT	150	22.790	3,418.500	
	CSL LIMITED	110	299.700	32,967.000	
	REA GROUP LTD	17	140.890	2,395.130	
	TRANSURBAN GROUP	640	14.740	9,433.600	
	COCHLEAR LTD	14	247.960	3,471.440	
	ORIGIN ENERGY LTD	315	8.270	2,605.050	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	387	99.370	38,456.190	
	RIO TINTO LIMITED	80	123.190	9,855.200	
	APA GROUP	248	10.430	2,586.640	
	ARISTOCRAT LEISU	148	36.960	5,470.080	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	522	4.960	2,589.120	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	119	33.050	3,932.950	
	IGO LTD	118	14.450	1,705.100	
	ORICA LTD	100	16.050	1,605.000	
	LEND LEASE CORP LTD	207	7.700	1,593.900	
	BLUESCOPE STEEL LTD	133	20.720	2,755.760	
	MACQUARIE GROUP LTD	78	180.290	14,062.620	

	SUNCORP GROUP LTD	321	12.390	3,977.190	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	688	28.610	19,683.680	
	NEWCREST MINING LTD	195	29.150	5,684.250	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	136	6.550	890.800	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	288	14.890	4,288.320	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	244	14.230	3,472.120	
	REECE LTD	3	17.880	53.640	
	SANTOS LTD	759	7.120	5,404.080	
	SONIC HEALTHCARE	85	35.730	3,037.050	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	40	31.210	1,248.400	
	WESFARMERS LTD	249	51.600	12,848.400	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	437	33.860	14,796.820	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	273	38.480	10,505.040	
	SEEK LTD	81	24.650	1,996.650	
	MINERAL RESOURCES LTD	45	84.310	3,793.950	
	BRAMBLES LTD	288	13.910	4,006.080	
	PILBARA MINERALS LTD	512	4.090	2,094.080	
	AURIZON HOLDINGS LTD	267	3.370	899.790	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	186	14.000	2,604.000	
	XERO LTD	21	92.000	1,932.000	
	IDP EDUCATION LTD	49	27.230	1,334.270	
	LOTTERY CORP LTD	433	4.940	2,139.020	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	402	6.840	2,749.680	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	646	24.140	15,594.440	
	MEDIBANK PVT LTD	807	3.580	2,889.060	
	SOUTH32 LTD(AUD)	1,072	4.500	4,824.000	
	COLES GROUP LTD	269	18.030	4,850.070	
	WISETECH GLOBAL LTD	39	67.990	2,651.610	
オーストラリア・ドル　小計		15,617		371,814.070 (33,649,173)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	97	75.780	7,350.660	
	BARRICK GOLD CORP	421	25.890	10,899.690	
	BANK OF MONTREAL	157	123.870	19,447.590	
	BANK OF NOVA SCOTIA	268	69.010	18,494.680	
	NATIONAL BANK OF CANADA	72	98.860	7,117.920	
	BCE INC	8	63.800	510.400	
	BROOKFIELD CORP	323	44.600	14,405.800	
	SAPUTO INC	38	35.600	1,352.800	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	122	10.840	1,322.480	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17	106.410	1,808.970	

CGI INC	46	132.380	6,089.480	
CCL INDUSTRIES INC	36	64.490	2,321.640	
CAE INC	67	31.740	2,126.580	
CAMECO CORP	90	34.370	3,093.300	
ROGERS COMM-CL B	73	65.270	4,764.710	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	208	58.440	12,155.520	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	253	81.900	20,720.700	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	11	183.820	2,022.020	
CANADIAN UTILITIES LTD	43	38.500	1,655.500	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	132	164.790	21,752.280	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	53	43.360	2,298.080	
OPEN TEXT CORP	50	51.360	2,568.000	
EMPIRE CO LTD	48	36.140	1,734.720	
KINROSS GOLD CORP	311	6.820	2,121.020	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	33	78.740	2,598.420	
FORTIS INC	102	59.730	6,092.460	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	146	34.260	5,001.960	
TELUS CORP	88	28.500	2,508.000	
GREAT WEST LIFECO INC	70	37.580	2,630.600	
IMPERIAL OIL LTD	39	72.470	2,826.330	
ENBRIDGE INC	469	53.520	25,100.880	
IGM FINANCIAL INC	35	41.360	1,447.600	
MANULIFE FINANCIAL CORP	422	26.220	11,064.840	
LOBLAW CO LTD	33	123.080	4,061.640	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	186	66.620	12,391.320	
MAGNA INTERNATIONAL INC	55	72.260	3,974.300	
SUN LIFE FINANCIAL INC	143	65.140	9,315.020	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	930.000	5,580.000	
METRO INC	56	75.280	4,215.680	
EMERA INC	58	57.900	3,358.200	
ONEX CORP	13	64.200	834.600	
PAN AMERICAN SILVER CORP	73	23.570	1,720.610	
POWER CORP OF CANADA	133	35.660	4,742.780	
QUEBECOR INC-B	38	34.880	1,325.440	
ROYAL BANK OF CANADA	316	134.690	42,562.040	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	206	107.910	22,229.460	
SUNCOR ENERGY INC	310	41.550	12,880.500	
LUNDIN MINING CORP	208	10.580	2,200.640	
TECK RESOURCES LTD-CL B	114	64.210	7,319.940	
THOMSON REUTERS CORP	36	175.110	6,303.960	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	19	108.010	2,052.190	

	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	419	83.530	34,999.070	
	TC ENERGY CORP	215	56.040	12,048.600	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	19	102.810	1,953.390	
	WESTON (GEORGE) LTD	16	177.230	2,835.680	
	INTACT FINANCIAL CORP	43	199.250	8,567.750	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	92	66.170	6,087.640	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	2,601.330	10,405.320	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	42	204.840	8,603.280	
	TOURMALINE OIL CORP	84	60.600	5,090.400	
	KEYERA CORP	42	31.690	1,330.980	
	PARKLAND CORP	41	31.910	1,308.310	
	ALTAGAS LTD	79	22.690	1,792.510	
	PEMBINA PIPELINE CORP	110	44.580	4,903.800	
	DOLLARAMA INC	67	83.410	5,588.470	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	297	23.910	7,101.270	
	ARC RESOURCES LTD	171	16.610	2,840.310	
	NORTHLAND POWER INC	57	33.650	1,918.050	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	70	17.500	1,225.000	
	TMX GROUP LTD	17	136.860	2,326.620	
	BRP INC	7	103.750	726.250	
	IVANHOE MINES LTD	91	12.630	1,149.330	
	NUTRIEN LTD	109	98.420	10,727.780	
	TFI INTERNATIONAL INC	19	159.030	3,021.570	
	WSP GLOBAL INC	32	177.180	5,669.760	
	IA FINANCIAL CORP INC	17	88.080	1,497.360	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	31	46.760	1,449.560	
	NUVEI CORP	14	56.680	793.520	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	18	45.310	815.580	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	80	44.340	3,547.200	
	AIR CANADA	21	19.640	412.440	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	61	92.030	5,613.830	
	SHOPIFY INC	258	66.010	17,030.580	
	FIRSTSERVICE CORP	9	195.360	1,758.240	
	HYDRO ONE LTD	74	39.950	2,956.300	
カナダ・ドル　小計		9,077		552,569.700 (55,373,010)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	300	3.690	1,107.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	500	32.950	16,475.000	
	SEMBCORP MARINE	5,725	0.118	675.550	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	200	9.510	1,902.000	

	GENTING SINGAPORE LTD	1,900	1.130	2,147.000	
	KEPPEL CORP LTD	300	6.190	1,857.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	800	12.890	10,312.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,100	2.540	5,334.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	400	5.800	2,320.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	300	30.100	9,030.000	
	UOL GROUP LIMITED	100	7.100	710.000	
	VENTURE CORP LTD	100	17.570	1,757.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	300	4.100	1,230.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	600	3.800	2,280.000	
シンガポール・ドル　小計		13,625		57,136.550 (5,776,505)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	39	51.660	2,014.740	
	NESTLE SA-REGISTERED	651	114.300	74,409.300	
	CIE FINANC RICHEMONT	120	149.550	17,946.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	156	275.200	42,931.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7	195.000	1,365.000	
	SIKA INHABER	31	250.600	7,768.600	
	SGS SA-REG	50	83.620	4,181.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	500	88.240	44,120.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	8	148.900	1,191.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	1	1,879.000	1,879.000	
	CLARIANT AG-REG	69	15.010	1,035.690	
	SWISSCOM AG-REG	6	602.800	3,616.800	
	ABB LTD	359	31.580	11,337.220	
	ADECCO GROUP AG-REG	44	31.250	1,375.000	
	GEBERIT AG	7	502.800	3,519.600	
	LONZA GROUP AG-REG	16	580.200	9,283.200	
	GIVAUDAN-REG	2	3,108.000	6,216.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	33	427.100	14,094.300	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	7	294.200	2,059.400	
	HOLCIM LTD	133	58.640	7,799.120	
	TEMENOS GROUP	21	65.200	1,369.200	
	BACHEM HOLDING AG	5	95.050	475.250	
	SONOVA HOLDING AG	13	285.900	3,716.700	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	14	271.200	3,796.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	23	136.800	3,146.400	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6	295.000	1,770.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	54.700	547.000	
	SCHINDLER NAMEN	6	189.200	1,135.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	6	600.400	3,602.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	8	91.000	728.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	2	774.000	1,548.000	

	SWISS PRIME SITE AG	12	78.650	943.800	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	5	856.200	4,281.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	42	64.080	2,691.360	
	SWISS RE LTD	69	89.080	6,146.520	
	BKW AG	7	150.200	1,051.400	
	SIG GROUP AG	50	24.200	1,210.000	
	ALCON INC	113	63.460	7,170.980	
	UBS GROUP AG	729	18.580	13,544.820	
	VAT GROUP AG	7	301.200	2,108.400	
スイス・フラン　小計		3,387		319,125.600 (47,942,239)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	624	129.200	80,620.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	375	116.950	43,856.250	
	ERICSSON LM-B SHS	714	56.300	40,198.200	
	GETINGE AB-B SHS	49	258.000	12,642.000	
	INVESTOR AB-A SHS	102	216.700	22,103.400	
	LUNDBERGS B	9	482.200	4,339.800	
	SKF AB-B SHS	67	202.400	13,560.800	
	SANDVIK AB	223	224.600	50,085.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	379	113.650	43,073.350	
	SKANSKA AB-B SHS	48	167.900	8,059.200	
	SWEDBANK AB	230	185.100	42,573.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	143	131.500	18,804.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	265	94.640	25,079.600	
	VOLVO AB-A SHS	47	217.400	10,217.800	
	VOLVO AB-B SHS	362	209.100	75,694.200	
	HOLMEN AB-B SHS	28	382.800	10,718.400	
	TELE2 AB-B SHS	145	106.500	15,442.500	
	INDUSTRIVARDEN A	19	292.300	5,553.700	
	INDUSTRIVARDEN C	40	292.100	11,684.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	58	135.150	7,838.700	
	SECURITAS AB-B SHS	101	92.900	9,382.900	
	INVESTOR AB-B SHS	403	209.350	84,368.050	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	125	155.040	19,380.000	
	ASSA ABLOY AB-B	244	239.100	58,340.400	
	TELIA CO AB	640	26.900	17,216.000	
	BOLIDEN AB	46	409.100	18,818.600	
	ALFA LAVAL AB	73	369.000	26,937.000	
	KINNEVIK AB-B	83	161.250	13,383.750	
	FASTIGHETS AB BALDER	144	47.670	6,864.480	
	INDUTRADE AB	76	228.100	17,335.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	141	90.000	12,690.000	
	NIBE INDUSTRIER AB	342	122.600	41,929.200	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	41	268.600	11,012.600	
	HEXAGON AB-B SHS	473	117.400	55,530.200	
	SAGAX AB	60	250.000	15,000.000	
	EPIROC AB-A	166	212.700	35,308.200	
	EPIROC AB-B	56	184.000	10,304.000	
	ESSITY AB-B	122	307.600	37,527.200	
	EQT AB	78	208.800	16,286.400	
	EMBRACER GROUP AB	154	44.835	6,904.590	
	VOLVO CAR AB	144	41.710	6,006.240	
	LIFCO AB	43	229.100	9,851.300	
	EVOLUTION AB	41	1,388.000	56,908.000	
	NORDEA BANK ABP	704	117.900	83,001.600	
	INVESTMENT AB LATOUR	23	211.000	4,853.000	
スウェーデン・クローナ　小計		8,450		1,217,285.310 (15,849,055)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	20	1,102.000	22,040.000	
	A P MOLLER A/S	1	13,095.000	13,095.000	
	AP MOLLER MAERSK A	1	12,820.000	12,820.000	
	DANSKE BANK A/S	174	148.300	25,804.200	
	GENMAB A/S	16	2,771.000	44,336.000	
	NOVOZYMES-B SHS	48	364.600	17,500.800	
	ROCKWOOL AS	2	1,648.500	3,297.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	371	1,122.200	416,336.200	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	208	193.040	40,152.320	
	COLOPLAST-B	23	936.800	21,546.400	
	DSV A/S	44	1,275.500	56,122.000	
	DEMANT A/S	3	283.000	849.000	
	TRYG A/S	84	149.350	12,545.400	
	PANDORA A/S	24	641.800	15,403.200	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	27	544.200	14,693.400	
	ORSTED A/S	47	592.200	27,833.400	
デンマーク・クローネ　小計		1,093		744,374.320 (14,760,943)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	345	8.570	2,956.650	
	EBOS GROUP LTD	18	45.140	812.520	
	FISHER & PAYKEL	148	26.950	3,988.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	595	5.120	3,046.400	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	87	6.160	535.920	
	MERIDIAN ENERGY LTD	456	5.175	2,359.800	
ニュージーランド・ドル　小計		1,649		13,699.890 (1,139,283)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	113	201.900	22,814.700	
	NORSK HYDRO ASA	358	81.160	29,055.280	
	TELENOR ASA	162	129.700	21,011.400	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	26	462.600	12,027.600	
	ORKLA ASA	236	74.780	17,648.080	
	EQUINOR ASA	195	300.100	58,519.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33	454.900	15,011.700	
	AKER BP ASA	61	255.700	15,597.700	
	SALMAR ASA	11	467.500	5,142.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24	179.000	4,296.000	
	ADEVINTA ASA	72	83.550	6,015.600	
	DNB BANK ASA	229	201.300	46,097.700	
ノルウェー・クローネ　小計		1,520		253,237.760 (3,226,249)	
ユーロ	CRH PLC	174	45.370	7,894.380	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	36	178.700	6,433.200	
	KERRY GROUP PLC-A	33	98.700	3,257.100	
	KINGSPAN GROUP PLC	39	60.980	2,378.220	
	UMICORE	47	30.490	1,433.030	
	AIR LIQUIDE	121	161.680	19,563.280	
	AIRBUS SE	131	128.520	16,836.120	
	AXA SA	406	29.280	11,887.680	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	150	29.260	4,389.000	
	ADIDAS AG	35	162.240	5,678.400	
	ASSICURAZIONI GENERALI	232	19.065	4,423.080	
	DASSAULT AVIATION SA	4	181.800	727.200	
	DANONE	153	59.460	9,097.380	
	SAFRAN SA	77	142.360	10,961.720	
	INTESA SANPAOLO	3,428	2.498	8,563.140	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	76	103.780	7,887.280	
	ACCOR SA	21	31.560	662.760	
	BOUYGUES	48	33.150	1,591.200	
	BNP PARIBAS	254	59.600	15,138.400	
	THALES SA	26	141.750	3,685.500	
	CAPGEMINI SA	37	163.900	6,064.300	
	UNICREDIT SPA	403	19.784	7,972.950	
	D'IETEREN TRDG	6	172.800	1,036.800	
	COMMERZBANK AG	231	10.800	2,494.800	
	EIFFAGE	18	105.000	1,890.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	76	25.930	1,970.680	
	UNITED INTERNET	42	15.360	645.120	
	PUBLICIS GROUPE	51	76.780	3,915.780	
	IBERDROLA SA	1,392	11.700	16,286.400	
	ENI SPA	573	13.754	7,881.040	
	JERONIMO MARTINS	86	22.180	1,907.480	
	KESKO OYJ-B	72	20.100	1,447.200	
	KBC GROUPE	54	66.460	3,588.840	
	HANNOVER RUECK SE	14	184.400	2,581.600	
	WARTSILA OYJ	111	8.830	980.130	

L'OREAL	55	422.300	23,226.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	62	885.000	54,870.000	
GEA GROUP AG	28	43.730	1,224.440	
BOLLORE	224	6.185	1,385.440	
MEDIOBANCA SPA	115	9.786	1,125.390	
MICHELIN(CGDE)-B	164	29.630	4,859.320	
CONTINENTAL AG	25	69.100	1,727.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	225	43.560	9,801.000	
OMV AG	35	42.330	1,481.550	
VERBUND AG	13	80.500	1,046.500	
PERNOD-RICARD	46	210.000	9,660.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	27	52.360	1,413.720	
RENAULT SA	42	36.620	1,538.040	
REPSOL SA	291	13.535	3,938.680	
REMY COINTREAU	3	174.000	522.000	
MERCK KGAA	31	162.700	5,043.700	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	115	51.860	5,963.900	
RWE AG	143	40.930	5,852.990	
SEB SA	9	105.600	950.400	
SOCIETE GENERALE-A	176	22.610	3,979.360	
VINCI S.A.	126	110.820	13,963.320	
SODEXO	15	98.840	1,482.600	
SOFINA	3	207.200	621.600	
SOLVAY SA	18	108.750	1,957.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	120	152.620	18,314.400	
VIVENDI SE	106	9.902	1,049.610	
SAP SE	241	116.020	27,960.820	
TELEFONICA S.A	1,040	4.111	4,275.440	
TOTALENERGIES SE	562	58.070	32,635.340	
VALEO	32	19.230	615.360	
E.ON SE	505	11.955	6,037.270	
VOEST-ALPINE AG	26	30.680	797.680	
HENKEL AG & CO KGAA	16	69.400	1,110.400	
SIEMENS AG-REG	168	146.580	24,625.440	
UPM-KYMMENE OYJ	107	29.970	3,206.790	
ING GROEP NV-CVA	849	12.102	10,274.590	
PUMA AG	14	55.740	780.360	
BAYER AG	226	61.290	13,851.540	
STORA ENSO OYJ-R SHS	80	11.635	930.800	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	45	76.040	3,421.800	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	172	70.610	12,144.920	
BASF SE	209	50.830	10,623.470	
BEIERSDORF AG	20	123.300	2,466.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	37	70.640	2,613.680	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	58	40.800	2,366.400	
ASM INTERNATIONAL NV	10	339.250	3,392.500	
ORANGE	477	11.464	5,468.320	
SAMPO OYJ-A SHS	114	44.730	5,099.220	
RANDSTAD NV	32	51.880	1,660.160	
ALLIANZ SE	88	221.750	19,514.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	651	5.140	3,346.140	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	241	31.160	7,509.560	
HERMES INTL	7	1,964.200	13,749.400	
ENDESA S.A.	49	19.975	978.770	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	81	9.814	794.930	
ERSTE GROUP BANK AG	69	32.700	2,256.300	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	32	332.200	10,630.400	
ARCELOR MITTAL (NL)	120	26.900	3,228.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	140	37.480	5,247.200	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	61	31.390	1,914.790	
RHEINMETALL STAMM	11	270.200	2,972.200	
HEINEKEN NV	57	103.850	5,919.450	
AKZO NOBEL	41	74.740	3,064.340	
ASML HOLDING NV	90	566.900	51,021.000	
AEGON NV	404	4.168	1,683.870	
VOLKSWAGEN AG	5	154.050	770.250	
VOLKSWAGEN AG PFD	45	125.460	5,645.700	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,334	6.918	9,228.610	
KERING	16	572.000	9,152.000	
ACCIONA S.A.	4	175.450	701.800	
FORTUM OYJ	90	13.900	1,251.000	
AGEAS	25	40.700	1,017.500	
UCB SA	23	86.180	1,982.140	
NEMETSCHEK SE	12	65.700	788.400	
CARREFOUR SA	136	18.850	2,563.600	
NATURGY ENERGY GROUP SA	45	28.320	1,274.400	
NOKIA OYJ	1,278	4.270	5,457.060	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	181	16.998	3,076.630	
WOLTERS KLUWER-CVA	59	119.450	7,047.550	
SANOFI	255	101.960	25,999.800	
STMICROELECTRONICS NV	149	45.055	6,713.190	
ELISA OYJ	33	54.680	1,804.440	
BANCO SANTANDER SA	3,807	3.637	13,846.050	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	72	16.430	1,182.960	
QIAGEN N.V.	53	41.270	2,187.310	
DEUTSCHE BANK AG-REG	482	10.006	4,822.890	
BMW VORZUG	8	97.350	778.800	

ENEL SPA	1,798	5.809	10,444.580	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	744	22.505	16,743.720	
SARTORIUS AG	5	386.300	1,931.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	279	35.770	9,979.830	
RATIONAL AG	1	643.500	643.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG	12	119.350	1,432.200	
BECHTLE AG	21	42.450	891.450	
KONINKLIJKE KPN NV	888	3.270	2,903.760	
EUROFINS SCIENTIFIC	25	60.800	1,520.000	
TELEPERFORMANCE	14	210.500	2,947.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	40	180.300	7,212.000	
EURAZEO	11	66.600	732.600	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	27	80.840	2,182.680	
HEINEKEN HOLDING NV-A	24	87.950	2,110.800	
INDITEX	258	31.500	8,127.000	
ESSILORLUXOTTICA	66	175.620	11,590.920	
SNAM SPA	513	5.028	2,579.360	
CREDIT AGRICOLE SA	292	11.018	3,217.250	
ENAGAS	51	18.195	927.940	
WENDEL	6	100.200	601.200	
TENARIS SA	138	13.125	1,811.250	
TELECOM ITALIA SPA	1,698	0.286	485.620	
TERNA SPA	287	7.718	2,215.060	
BIOMERIEUX	11	96.280	1,059.080	
GRIFOLS SA	92	9.422	866.820	
FERROVIAL SA	111	28.190	3,129.090	
NESTE OYJ	100	43.580	4,358.000	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	33	40.240	1,327.920	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	89	11.620	1,034.180	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	11	240.200	2,642.200	
KONE OYJ	74	49.350	3,651.900	
ELIA GROUP	4	123.200	492.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	8	279.000	2,232.000	
ENGIE	418	15.440	6,453.920	
ALSTOM	87	22.430	1,951.410	
IPSEN SA	5	105.900	529.500	
ARKEMA SA	14	90.180	1,262.520	
LEGRAND SA	66	84.360	5,567.760	
AMPLIFON SPA	27	33.020	891.540	
ADP	10	136.300	1,363.000	
ORION OYJ	14	46.280	647.920	
METSO OUTOTEC OYJ	125	10.715	1,339.370	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	92	10.835	996.820	
SYMRISE AG	30	106.100	3,183.000	

SMURFIT KAPPA GROUP PLC	60	34.500	2,070.000	
PRYSMIAN SPA	62	38.250	2,371.500	
DIASORIN ITALIA SPA	3	97.380	292.140	
CAIXABANK	931	3.660	3,407.460	
BUREAU VERITAS SA	49	25.870	1,267.630	
GETLINK	123	15.240	1,874.520	
EDP RENOVAVEIS SA	78	20.230	1,577.940	
AMADEUS IT GROUP SA	100	62.600	6,260.000	
BRENNTAG SE	39	73.700	2,874.300	
EVONIK INDUSTRIES AG	66	19.775	1,305.150	
EDENRED	51	57.680	2,941.680	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	239	3.022	722.250	
LEG IMMOBILIEN SE	19	55.360	1,051.840	
VONOVIA SE	159	19.315	3,071.080	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	237	9.876	2,340.610	
KNORR-BREMSE AG	22	63.000	1,386.000	
OCI NV	29	29.860	865.940	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65	53.940	3,506.100	
FERRARI NV	30	254.500	7,635.000	
CNH INDUSTRIAL NV	269	13.305	3,579.040	
AROUNDTOWN SA	287	1.263	362.480	
AIB GROUP PLC	250	3.892	973.000	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	25	39.580	989.500	
MONCLER SPA	43	65.920	2,834.560	
NEXI SPA	160	7.666	1,226.560	
PROSUS NV	177	70.250	12,434.250	
DR ING HC F PORSCHE AG	28	116.100	3,250.800	
JDE PEET'S BV	9	27.400	246.600	
EXOR NV	29	77.900	2,259.100	
SIEMENS ENERGY AG	92	21.360	1,965.120	
EURONEXT NV	16	71.450	1,143.200	
IMCD NV	12	146.500	1,758.000	
WORLDLINE SA	47	39.560	1,859.320	
NN GROUP NV	69	34.830	2,403.270	
FINECOBANK SPA	147	14.425	2,120.470	
ARGENX SE	12	344.700	4,136.400	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	169	20.930	3,537.170	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	117	29.930	3,501.810	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	20	33.200	664.000	
DSM-FIRMENICH AG	35	119.640	4,187.400	
ZALANDO SE	43	37.540	1,614.220	
STELLANTIS NV	540	16.968	9,162.720	
AENA SME SA	17	154.900	2,633.300	
CELLNEX TELECOM SAU	134	38.340	5,137.560	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	60	16.304	978.240	

	ABN AMRO BANK NV	70	15.650	1,095.500	
	SCOUT24 SE	20	55.940	1,118.800	
	COVESTRO AG	43	37.800	1,625.400	
	HELLOFRESH SE	52	24.600	1,279.200	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	202	60.200	12,160.400	
	POSTE ITALIANE SPA	150	9.564	1,434.600	
	AMUNDI SA	10	59.850	598.500	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	59	12.260	723.340	
	ADYEN NV	5	1,452.200	7,261.000	
	DELIVERY HERO SE	49	33.530	1,642.970	
ユーロ　小計		49,616		1,086,562.290 (160,615,638)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	864	14.260	12,320.640	
	CLP HOLDINGS LTD	235	57.600	13,536.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	43.850	21,925.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	266	339.400	90,280.400	
	MTR CORP	403	38.850	15,656.550	
	HANG SENG BANK LTD	200	114.400	22,880.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	86	26.400	2,270.400	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	67	43.500	2,914.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,515	6.810	10,317.150	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	57.950	31,119.150	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	684	25.300	17,305.200	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	890	20.450	18,200.500	
	SINO LAND CO	576	10.680	6,151.680	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	106.200	53,100.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	273	82.800	22,604.400	
	AIA GROUP LTD	2,751	85.000	233,835.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	1,080	10.180	10,994.400	
	SANDS CHINA LTD	574	28.750	16,502.500	
	SWIRE PROPERTIES LTD	432	20.000	8,640.000	
	ESR GROUP LTD	600	12.780	7,668.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	500	23.850	11,925.000	
	WH GROUP LTD	1,500	4.600	6,900.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	534	50.650	27,047.100	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	534	46.250	24,697.500	
香港・ドル　小計		16,101		688,791.070 (11,840,318)	
合計		261,131		1,510,399,737	

				(1,510,399,737)	

（２）株式以外の有価証券

2023年4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	2,199.340	
		GOODMAN GROUP	410.000	7,740.800	
		GPT GROUP	525.000	2,278.500	
		MIRVAC GROUP	1,078.000	2,436.280	
		SCENTRE GROUP	1,109.000	3,094.110	
		STOCKLAND	473.000	1,996.060	
		VICINITY CENTRES	700.000	1,407.000	
	オーストラリア・ドル　小計		4,581.000	21,152.090 (1,914,264)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,079.000	2,179.580	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	600.000	1,710.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	500.000	880.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	200.000	360.000	
	シンガポール・ドル　小計		2,379.000	5,129.580 (518,601)	
投資信託受益証券　合計			6,960	2,432,865 (2,432,865)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	37.000	4,633.880	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	82.000	2,728.960	
		AMERICAN TOWER CORP	107.000	22,268.840	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	130.000	2,497.300	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28.000	4,907.280	
		BOSTON PROPERTIES INC	41.000	2,209.900	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	24.000	2,565.840	
		CROWN CASTLE INC	93.000	12,420.150	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	65.000	6,273.150	
		EQUINIX INC	20.000	14,139.200	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	45.000	3,058.650	
		EQUITY RESIDENTIAL	80.000	4,968.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	13.000	2,800.200	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	30.000	4,592.100	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	50.000	2,579.500	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	96.000	1,896.960	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	139.000	2,970.430	

		HOST HOTELS & RESORTS INC	154.000	2,536.380	
		INVITATION HOMES INC	119.000	3,961.510	
		IRON MOUNTAIN INC	60.000	3,223.200	
		KIMCO REALTY	151.000	2,899.200	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	125.000	1,060.000	
		MID AMERICA	29.000	4,366.820	
		PROLOGIS INC	203.000	25,407.480	
		PUBLIC STORAGE	36.000	10,408.680	
		REALTY INCOME CORP	148.000	9,122.720	
		REGENCY CENTERS CORP	38.000	2,312.680	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	25.000	6,633.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	69.000	7,732.140	
		SUN COMMUNITIES INC	31.000	4,319.540	
		UDR INC	65.000	2,705.950	
		VENTAS INC	95.000	4,249.350	
		VICI PROPERTIES INC	229.000	7,538.680	
		WELLTOWER INC	111.000	8,463.750	
		WEYERHAEUSER CO	146.000	4,594.620	
		WP CAREY INC	53.000	3,837.200	
	アメリカ・ドル　小計		2,967.000	212,883.240 (28,722,205)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	255.000	983.530	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	134.000	854.110	
		SEGRO PLC	297.000	2,292.240	
	イギリス・ポンド　小計		686.000	4,129.880 (692,540)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	10.000	477.700	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15.000	320.250	
	カナダ・ドル　小計		25.000	797.950 (79,963)	
	ユーロ	COVIVIO	4.000	216.800	
		GECINA SA	7.000	678.650	
		KLEPIERRE	31.000	676.730	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	33.000	1,642.410	
		WAREHOUSES DE PAUW	41.000	1,124.220	
	ユーロ　小計		116.000	4,338.810 (641,363)	
	香港・ドル	LINK REIT	507.000	26,034.450	
	香港・ドル　小計		507.000	26,034.450 (447,532)	
投資証券　合計			4,301	30,583,603 (30,583,603)	
合計				33,016,468 (33,016,468)	

（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	601銘柄	63.67	－	－	72.30
	投資証券	36銘柄	－	－	1.68	
イギリス・ポンド	株式	77銘柄	4.15	－	－	4.64
	投資証券	3銘柄	－	－	0.04	
イスラエル・シュケル	株式	10銘柄	0.13	－	－	0.14
オーストラリア・ドル	株式	52銘柄	1.97	－	－	2.30
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.11	－	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.24	－	－	3.59
	投資証券	2銘柄	－	－	0.00	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.34	－	－	0.41
	投資信託受益証券	4銘柄	－	0.03	－	
スイス・フラン	株式	40銘柄	2.81	－	－	3.11
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	0.93	－	－	1.03
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.86	－	－	0.96
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.07	－	－	0.07
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.19	－	－	0.21
ユーロ	株式	222銘柄	9.41	－	－	10.45
	投資証券	5銘柄	－	－	0.04	
香港・ドル	株式	24銘柄	0.69	－	－	0.80
	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）

	2023年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	7,622,216
コール・ローン	71,641,370
国債証券	13,300,829,937
派生商品評価勘定	163,177
未収入金	483,075,790
未収利息	80,453,958
前払費用	28,091,826
流動資産合計	13,971,878,274
資産合計	13,971,878,274
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	177,764
未払金	487,881,388
流動負債合計	488,059,152
負債合計	488,059,152
純資産の部	
元本等	
元本	5,227,014,118
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,256,805,004
元本等合計	13,483,819,122
純資産合計	13,483,819,122
負債純資産合計	13,971,878,274

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10月21日 至　2023年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2023年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,485,988,479円
同期中追加設定元本額	14,592,845円
同期中一部解約元本額	273,567,206円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	3,773,736,537円
海外国債ファンド（３ヵ月決算型）	704,453,554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（変額年金）	513,771,966円
計	5,227,014,118円
２．　受益権の総数	5,227,014,118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10月21日 至　2023年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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。
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	2023年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年4月20日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	197,264,668
合計	197,264,668

（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11月5日から2023年4月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年4月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	489,218,236	－	489,396,000	△177,764
アメリカ・ドル	489,218,236	－	489,396,000	△177,764
買建	489,057,284	－	489,220,461	163,177
ユーロ	489,057,284	－	489,220,461	163,177
合計	978,275,520	－	978,616,461	△14,587

（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。

①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。

②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）

	2023年4月20日現在
1口当たり純資産額	2.5796円
（1万口当たり純資産額）	(25,796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

2023年4月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.625 08/15/30	7,000,000.000	5,669,589.860	
		US T N/B 1.25 08/15/31	8,200,000.000	6,834,027.340	
		US T N/B 1.375 11/15/31	7,700,000.000	6,452,208.980	
		US T N/B 1.625 05/15/31	6,700,000.000	5,786,994.140	
		US T N/B 1.875 02/15/32	6,800,000.000	5,921,976.580	
		US T N/B 2.75 08/15/42	800,000.000	672,187.500	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,500,000.000	4,319,912.110	
		US T N/B 2.875 05/15/32	5,300,000.000	5,002,599.610	

		US T N/B 3.5 02/15/33	4,500,000.000	4,463,789.040	
	アメリカ・ドル　小計		51,500,000.000 (6,948,380,000)	45,123,285.160 (6,088,033,636)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 01/31/29	580,000.000	481,458.000	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	3,500,000.000	2,776,361.700	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,100,000.000	1,144,110.000	
	イギリス・ポンド　小計		5,180,000.000 (868,634,200)	4,401,929.700 (738,159,591)	
	カナダ・ドル	CANADA 1.25 06/01/30	1,100,000.000	974,945.400	
		CANADA 1.5 06/01/31	900,000.000	800,770.500	
		CANADA 1.5 12/01/31	3,050,000.000	2,694,418.800	
		CANADA 2.5 12/01/32	1,600,000.000	1,525,523.200	
	カナダ・ドル　小計		6,650,000.000 (666,396,500)	5,995,657.900 (600,824,878)	
	ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,700,000.000	2,233,980.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,500,000.000	2,018,900.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	3,760,000.000	3,075,454.400	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	2,500,000.000	2,455,750.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	400,000.000	464,518.400	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,650,000.000	2,846,627.700	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,000,000.000	1,738,756.000	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,400,000.000	1,952,184.000	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,500,000.000	2,293,486.950	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,700,000.000	4,592,435.800	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,500,000.000	2,854,610.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	2,100,000.000	1,589,523.600	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	3,700,000.000	2,806,080.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	3,000,000.000	2,422,200.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,600,000.000	1,521,516.800	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,000,000.000	1,946,152.000	
		ITALY BTPS 4.4 05/01/33	2,900,000.000	2,924,070.000	
	ユーロ　小計		44,910,000.000 (6,638,596,200)	39,736,245.650 (5,873,811,832)	
国債証券　合計			15,122,006,900 (15,122,006,900)	13,300,829,937 (13,300,829,937)	
合計				13,300,829,937 (13,300,829,937)	

（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　9銘柄	45.15	45.77
イギリス・ポンド	国債証券　3銘柄	5.47	5.55
カナダ・ドル	国債証券　4銘柄	4.46	4.52

ユーロ	国債証券　17銘柄	43.56	44.16

（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）

	2023年4月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	6,098,365
コール・ローン	1,771,718
投資証券	583,211,935
未収配当金	617,421
流動資産合計	591,699,439
資産合計	591,699,439
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	－
負債合計	－
純資産の部	
元本等	
元本	244,032,668
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	347,666,771
元本等合計	591,699,439
純資産合計	591,699,439
負債純資産合計	591,699,439

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10月21日 至　2023年4月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2023年4月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	232,387,351円
同期中追加設定元本額	11,645,317円
同期中一部解約元本額	－円
元本の内訳	
ファンド名	
新光７資産バランスファンド	244,032,668円
計	244,032,668円
２．　受益権の総数	244,032,668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10月21日 至　2023年4月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年4月20日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	36,630,441
合計	36,630,441

（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）

	2023年4月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4247円 (24,247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

2023年4月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	337.000	4,539.390	
		AGREE REALTY CORP	317.000	21,305.570	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	262.000	5,090.660	
		ALEXANDER'S INC.	7.000	1,312.920	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	625.000	78,275.000	

		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	39.000	620.490	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	169.000	3,104.530	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	1,120.000	37,273.600	
		AMERICAN TOWER CORP	1,690.000	351,722.800	
		AMERICOLD REALTY TRUST	978.000	28,802.100	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	545.000	19,750.800	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	542.000	4,395.620	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	778.000	12,191.260	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	226.000	2,700.700	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	115.000	393.300	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	508.000	89,032.080	
		BOSTON PROPERTIES INC	570.000	30,723.000	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	217.000	841.960	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	574.000	2,537.080	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,085.000	22,481.200	
		BROADSTONE NET LEASE INC	626.000	10,084.860	
		BRT APARTMENTS CORP	43.000	804.100	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	377.000	40,305.070	
		CARETRUST REIT INC	358.000	7,045.440	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	89.000	2,235.680	
		CENTERSPACE	51.000	2,878.950	
		CHATHAM LODGING TRUST	162.000	1,722.060	
		CITY OFFICE REIT INC	145.000	906.250	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	790.000	2,765.000	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	81.000	2,895.750	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	408.000	9,494.160	
		COUSINS PROPERTIES INC	550.000	11,951.500	
		CROWN CASTLE INC	1,572.000	209,940.600	
		CTO REALTY GROUTH INC	76.000	1,249.440	
		CUBESMART	813.000	37,568.730	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	759.000	6,254.160	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,044.000	100,756.440	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	803.000	803.000	
		DOUGLAS EMMETT INC	615.000	7,958.100	

		EAST GROUP	150.000	25,083.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	330.000	4,659.600	
		ELME COMMUNITIES	316.000	5,722.760	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	450.000	2,853.000	
		EPR PROPERTIES	269.000	10,881.050	
		EQUINIX INC	336.000	237,538.560	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	646.000	43,908.620	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,348.000	83,710.800	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	509.000	12,394.150	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	234.000	50,403.600	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	482.000	73,779.740	
		FARMLAND PARTNERS INC	181.000	1,927.650	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	292.000	28,610.160	
		FIRST INDUSTRIAL RT	479.000	24,836.150	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	303.000	7,805.280	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	331.000	436.920	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	889.000	45,863.510	
		GETTY REALTY CORP	153.000	5,116.320	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	125.000	1,567.500	
		GLADSTONE LAND CORP	106.000	1,774.440	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	203.000	1,920.380	
		GLOBAL NET LEASE INC	377.000	4,305.340	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,380.000	27,268.800	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,989.000	42,504.930	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	109.000	715.040	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	378.000	8,905.680	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	2,576.000	42,426.720	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	472.000	2,926.400	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	812.000	13,186.880	
		INDUS REALTY TRUST INC	19.000	1,263.880	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	220.000	444.400	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	100.000	6,989.000	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	245.000	5,529.650	

		INVITATION HOMES INC	2,221.000	73,937.090	
		IRON MOUNTAIN INC	1,051.000	56,459.720	
		JBG SMITH PROPERTIES	389.000	5,558.810	
		KILROY REALTY CORP	423.000	13,269.510	
		KIMCO REALTY	2,198.000	42,201.600	
		KITE REALTY GROUP TRUST	788.000	16,571.640	
		LAMAR ADVERTISING CO	315.000	33,068.700	
		LIFE STORAGE INC	306.000	41,224.320	
		LTC PROPERTIES INC	145.000	4,972.050	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	984.000	9,495.600	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,161.000	18,325.280	
		MID AMERICA	418.000	62,942.440	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	151.000	7,569.630	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	659.000	28,521.520	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	309.000	12,131.340	
		NETSTREIT CORP	199.000	3,520.310	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	82.000	3,663.760	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	162.000	1,237.680	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	855.000	22,922.550	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	55.000	1,240.250	
		ORION OFFICE REIT INC	193.000	1,268.010	
		OUTFRONT MEDIA INC	530.000	8,702.600	
		PARAMOUNT GROUP INC	632.000	2,888.240	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	811.000	9,869.870	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	470.000	6,824.400	
		PHILLIPS EDISON & CO INC	424.000	13,381.440	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	825.000	12,036.750	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	420.000	2,830.800	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	136.000	2,756.720	
		POSTAL REALTY TRUST INC	64.000	939.520	
		POTLATCH CORP	288.000	14,126.400	
		PROLOGIS INC	3,135.000	392,376.600	
		PUBLIC STORAGE	569.000	164,514.970	
		RAYONIER INC	530.000	17,490.000	
		REALTY INCOME CORP	2,285.000	140,847.400	
		REGENCY CENTERS CORP	624.000	37,976.640	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	436.000	5,763.920	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	712.000	40,064.240	

		RLJ LODGING TRUST	580.000	6,061.000	
		RPT REALTY	283.000	2,663.030	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	195.000	17,840.550	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	835.000	9,427.150	
		SAFEHOLD INC	137.000	4,036.020	
		SAUL CENTERS INC	40.000	1,473.200	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	388.000	102,944.160	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	594.000	5,654.880	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	1,187.000	133,015.220	
		SITE CENTERS CORP	695.000	8,340.000	
		SL GREEN	233.000	6,051.010	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	506.000	19,268.480	
		STAG INDUSTRIAL INC	653.000	21,934.270	
		STAR HOLDINGS	43.000	737.450	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	351.000	2,355.210	
		SUN COMMUNITIES INC	443.000	61,727.620	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	767.000	7,539.610	
		TANGER FACTORY OUTLET	367.000	7,020.710	
		TERRENO REALTY CORP	292.000	18,238.320	
		THE MACERICH COMPANY	779.000	7,914.640	
		THE NECESSITY RETAIL REIT INC	483.000	2,748.270	
		UDR INC	1,193.000	49,664.590	
		UMH PROPERTIES INC	181.000	2,727.670	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	43.000	2,036.910	
		URBAN EDGE PROPERTIES	414.000	6,110.640	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES	99.000	1,736.460	
		VENTAS INC	1,453.000	64,992.690	
		VERIS RESIDENTIAL INC	312.000	4,898.400	
		VICI PROPERTIES INC	3,649.000	120,125.080	
		VORNADO REALTY TRUST	642.000	10,374.720	
		WELLTOWER INC	1,722.000	131,302.500	
		WEYERHAEUSER CO	2,679.000	84,308.130	
		WHITESTONE REIT	166.000	1,522.220	
		WP CAREY INC	760.000	55,024.000	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	414.000	5,369.580	
	アメリカ・ドル　小計		87,408.000	4,322,649.970 (583,211,935)	
投資証券　合計			87,408	583,211,935 (583,211,935)	
合計				583,211,935 (583,211,935)	

（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　145銘柄	98.57	100.00

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

「フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。
なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

財政状態計算書
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	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	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 Camaroon 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 Muncipality 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】

2023年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	4,368,383,255円
Ⅱ　負債総額	993,452円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,367,389,803円
Ⅳ　発行済数量	4,242,927,914口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0293円

（参考）

ニュー　トピックス　インデックス　マザーファンド

2023年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	1,610,449,322円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,610,449,322円
Ⅳ　発行済数量	533,083,558口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0210円

新光日本債券インデックスマザーファンド

2023年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	10,533,876,668円
Ⅱ　負債総額	57,916,300円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,475,960,368円
Ⅳ　発行済数量	8,393,091,645口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2482円

新光Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド

2023年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	85,583,465,097円
Ⅱ　負債総額	256,884,547円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	85,326,580,550円
Ⅳ　発行済数量	38,875,567,271口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1949円

新光外国株式インデックスマザーファンド

2023年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	1,667,884,210円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,667,884,210円
Ⅳ　発行済数量	402,391,368口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.1449円

海外国債マザーファンド

2023年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	13,519,737,968円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,519,737,968円
Ⅳ　発行済数量	5,227,014,118口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5865円

新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

2023年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	**581,901,852円**
Ⅱ　負債総額	**0円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**581,901,852円**
Ⅳ　発行済数量	**244,032,668口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.3845円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2023年4月28日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2023年4月28日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年4月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,395,036,939,532
追加型株式投資信託	794	14,529,802,864,852
単位型公社債投資信託	23	39,735,249,516
単位型株式投資信託	212	1,119,771,942,422
合計	1,055	17,084,346,996,322

３【委託会社等の経理状況】

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

2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第37期 （2022年3月31日現在）		第38期 （2023年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		31,421		33,770
金銭の信託		30,332		29,184
未収委託者報酬		17,567		16,279
未収運用受託報酬		4,348		3,307
未収投資助言報酬		309		283
未収収益		5		15
前払費用		1,167		1,129
その他		2,673		2,377
流動資産計		87,826		86,346
固定資産				
有形固定資産		1,268		1,127
建物	※1	1,109	※1	1,001
器具備品	※1	158	※1	118
リース資産		-	※1	7
無形固定資産		4,561		5,021
ソフトウエア		3,107		3,367
ソフトウエア仮勘定		1,449		1,651
電話加入権		3		2
投資その他の資産		10,153		9,768
投資有価証券		241		182
関係会社株式		5,349		5,810
長期差入保証金		1,102		775
繰延税金資産		3,092		2,895
その他		367		104
固定資産計		15,983		15,918
資産合計		103,810		102,265

（単位：百万円）

	第37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
（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	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
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	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第37期 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）		第38期 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

（単位：百万円）

	第37期 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）		第38期 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		13		10
受取配当金	※1	559	※1	2,400
時効成立分配金・償還金		0		0
為替差益		7		―
雑収入		19		10
時効後支払損引当金戻入額		10		24
営業外収益計		610		2,446
営業外費用				
為替差損		―		3
金銭の信託運用損		743		1,003
早期割増退職金		20		24
雑損失		―		47
営業外費用計		764		1,079
経常利益		22,694		19,502
特別利益				
固定資産売却益		0		―
投資有価証券売却益		―		4
特別利益計		0		4
特別損失				
固定資産除却損		5		12
投資有価証券売却損		6		9
ゴルフ会員権売却損		3		―
オフィス再編費用	※2	509		―
関係会社株式評価損		―		584
特別損失計		525		606
税引前当期純利益		22,169		18,900
法人税、住民税及び事業税		6,085		4,881
法人税等調整額		584		197
法人税等合計		6,669		5,078
当期純利益		15,499		13,821

（３）【株主資本等変動計算書】

第37期（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							△11,280	△11,280	△11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△0	△0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			△11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	4,219
当期末残高	△0	△0	77,573

第38期（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	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	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			△12,360
当期純利益			13,821
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	1,461
当期末残高	△0	△0	79,034

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物　…　8～18年 器具備品　…　2～20年 (2) 無形固定資産(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エアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (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。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6. 収益及び費用の計上基準	**当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。** **（1）委託者報酬** **委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年１回又は２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。** **（2）運用受託報酬** **運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年１回又は２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。** **（3）投資助言報酬** **投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年２回又は４回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。** **（4）成功報酬** **成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。**
7. 消費税等の会計処理	**消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。**

（会計方針の変更）

「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。）を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、（金融商品会計）注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27－３項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	－	1

（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37期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
受取配当金	543	2,393

※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

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					

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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
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

2023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
2023年6月16日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年3月31日現在）

	貸借対照表計上額（百万円）	時価（百万円）	差額（百万円）
（1）金銭の信託	30,332	30,332	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	－
資産計	30,334	30,334	－

第38期（2023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	29,184	29,184	－
（2）投資有価証券			
その他有価証券	1	1	－
資産計	29,186	29,186	－

（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37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023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	33,770	－	－	－
（2）金銭の信託	29,184	－	－	－
（3）未収委託者報酬	16,279	－	－	－
（4）未収運用受託報酬	3,307	－	－	－
（5）投資有価証券				
その他有価証券(投資信託)	－	1	－	－
合計	82,540	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

第37期（2022年3月31日現在）

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。

第38期（2023年3月31日現在）

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	－	29,184	－	29,184
（2）投資有価証券	－	－	－	－
その他有価証券	－	1	－	1
資産計	－	29,186	－	29,186

（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。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

（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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023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	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）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			
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			
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。

第38期（2023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			
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			
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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（百万円）

	第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△14	31
退職給付の支払額	△185	△191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

（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37期（2022年3月31日現在）	第38期（2023年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	△35	△44
未認識過去勤務費用	△33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	△3	△4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

（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20百万円、当事業年度において24百万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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023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%～3.56%

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97百万円、当事業年度103百万円であります。

（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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額（一括償却資産）	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額（税法上）	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,092	2,895
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	－	－
繰延税金資産の純額	3,092	2,895

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

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
法定実効税率	－	30.62 %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	－	△3.69 %
その他	－	△0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	－	26.87 %

（注）前事業年度は、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が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a.発生したのれんの金額	76,224百万円
b.発生原因	被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c.のれんの償却方法及び償却期間	20年間の均等償却

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a.資産の額	資産合計	40,451百万円
	うち現金・預金	11,605百万円
	うち金銭の信託	11,792百万円
b.負債の額	負債合計	9,256百万円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539百万円

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

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

a.無形固定資産に配分された金額	53,030百万円
b.主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030百万円
c.全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

（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	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

（2）損益計算書項目

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,429百万円	△8,039百万円
経常利益	△8,429百万円	△8,039百万円
税引前当期純利益	△8,429百万円	△8,039百万円
当期純利益	△7,015百万円	△6,744百万円
1株当たり当期純利益	△175,380円68銭	△168,617円97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	4,618百万円	4,228百万円

（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

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）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬（注）	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（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。

（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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

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。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	7,474	未払手数料	1,579
	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	13,932	未払手数料	2,404

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37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19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37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
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	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三にいがた証券株式会社	852	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
三豊証券株式会社	300	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は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（2022年12月末日現在）**
事業の内容	**英国籍の法人であり、内外の有価証券等にかかる投資顧問業務を営んでいます。**

2【関係業務の概要】

「受託会社」は以下の業務を行います。

(1) 委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理

(2) 投資信託財産の計算

(3) その他上記業務に付随する一切の業務

「販売会社」は以下の業務を行います。

(1) 募集・販売の取り扱い

(2) 受益者に対する一部解約事務

(3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い

(4) 受益者に対する収益分配金の再投資

(5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付

(6) 受益者に対する運用報告書の交付

(7) 所得税および地方税の源泉徴収

(8) その他上記業務に付随する一切の業務

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

3【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率５％以上を記載します。

第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

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

・目論見書の使用開始日

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

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

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

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

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

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

２０２３年5月２５日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　京　事　務　所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	丘本　正彦
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

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２０２３年3月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２３年6月２３日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　長　谷　川　　敬

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光７資産バランスファンドの２０２２年１０月２１日から２０２３年４月２０日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光７資産バランスファンドの２０２３年４月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。