

【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】	2024年1月19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公表します。

「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

<https://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

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

（６）【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

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

(7) 【申込期間】

2024年1月20日から2024年7月22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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

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

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

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

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

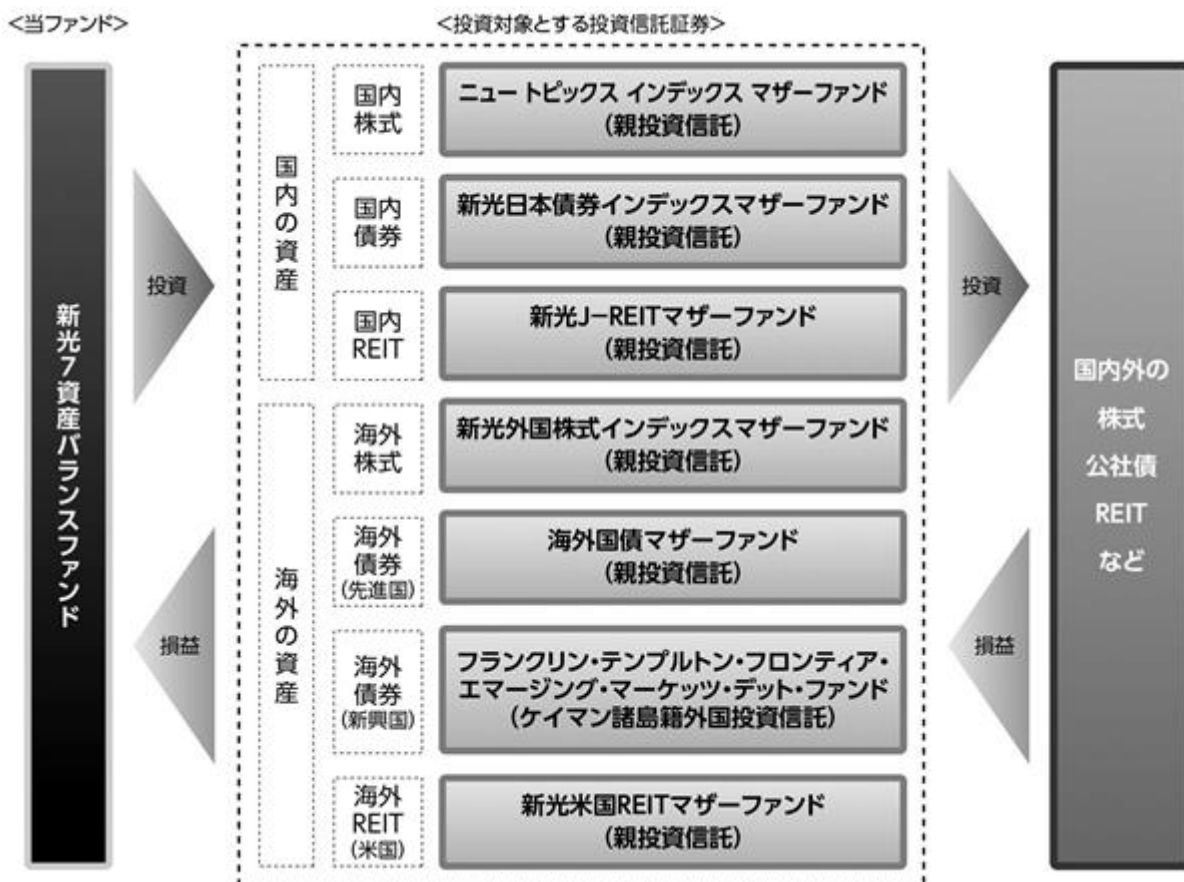
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



b. ファンドの特色

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

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

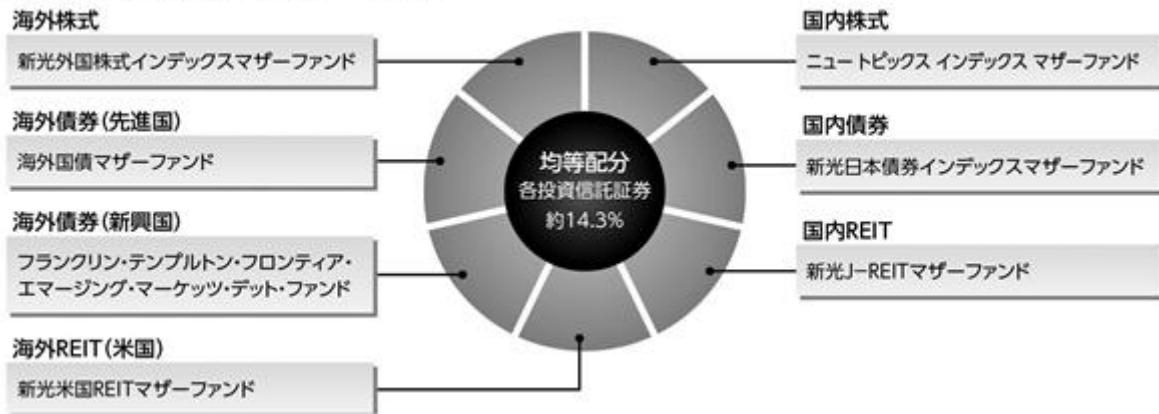


2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

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

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



■ 分配方針

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



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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

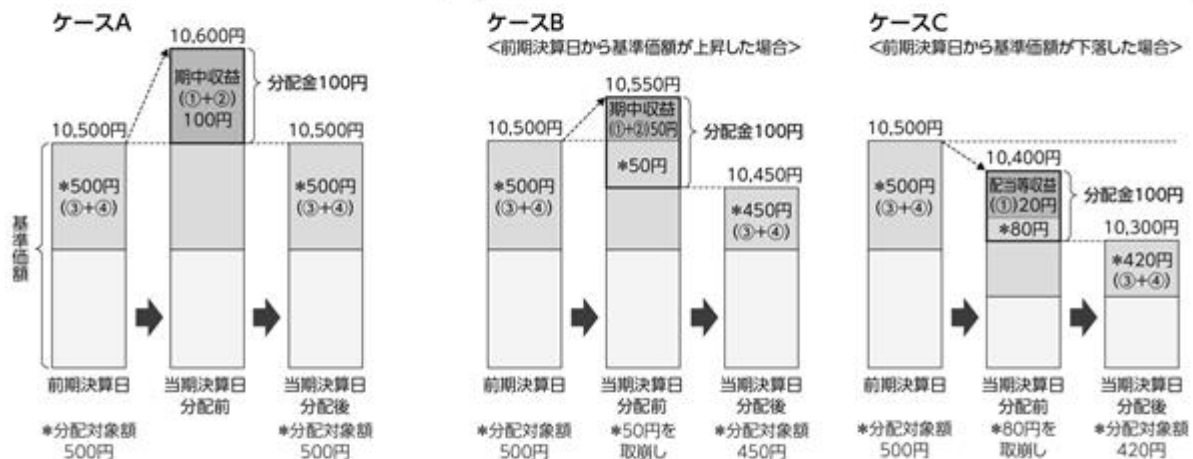
分配金額と基準価額の関係(イメージ)

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

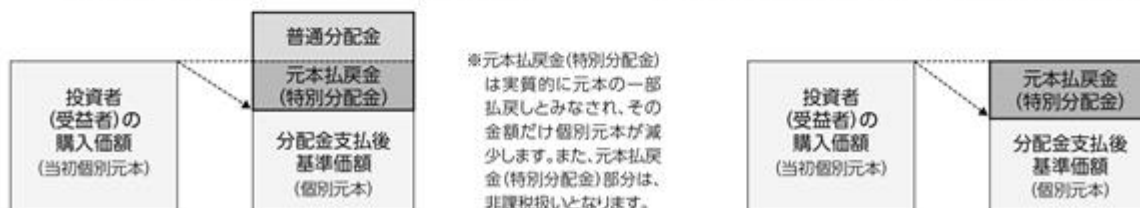
ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
 ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
 ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

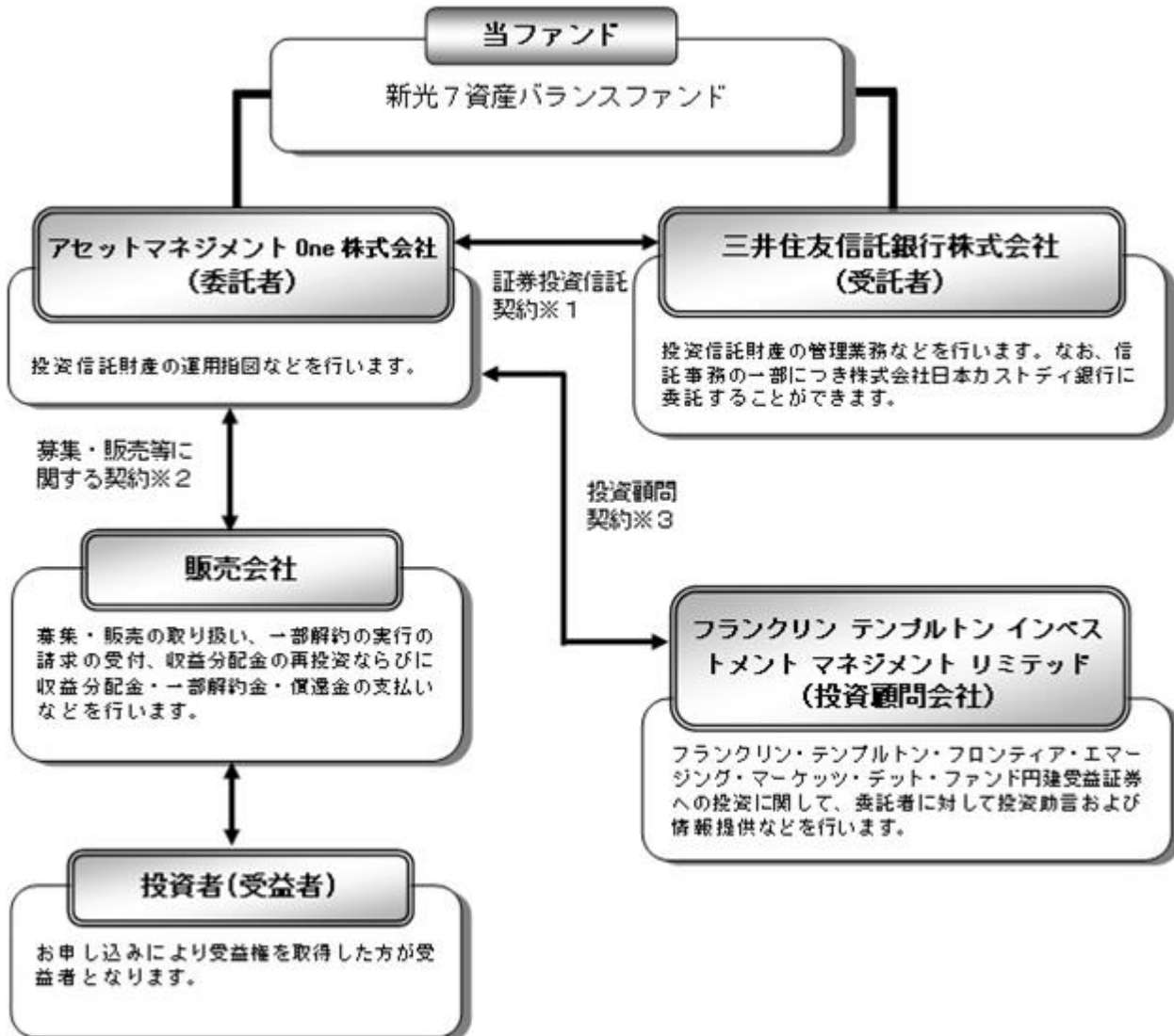
元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み



1 証券投資信託契約

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

2 募集・販売等に関する契約

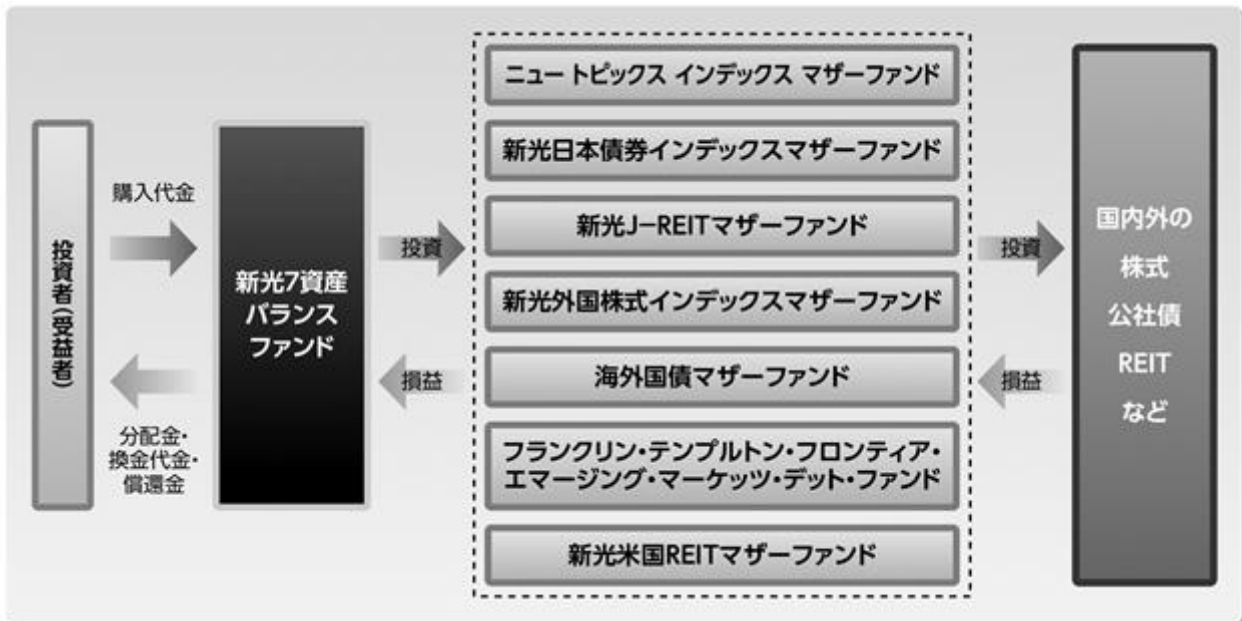
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2023年10月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2023年10月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

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

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

(2) 【投資対象】

a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

b. 運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

8. コマーシャル・ペーパー

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

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

11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none">・ 東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。・ わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を投資対象とします。・ 投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。・ 資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。・ 株式の組入比率は、高位を保ちます。・ 株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none">・ 株式への投資割合には制限を設けません。・ 同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。・ 外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年1月14日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2002年1月15日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

東証株価指数について

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

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

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

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

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

本件商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。

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

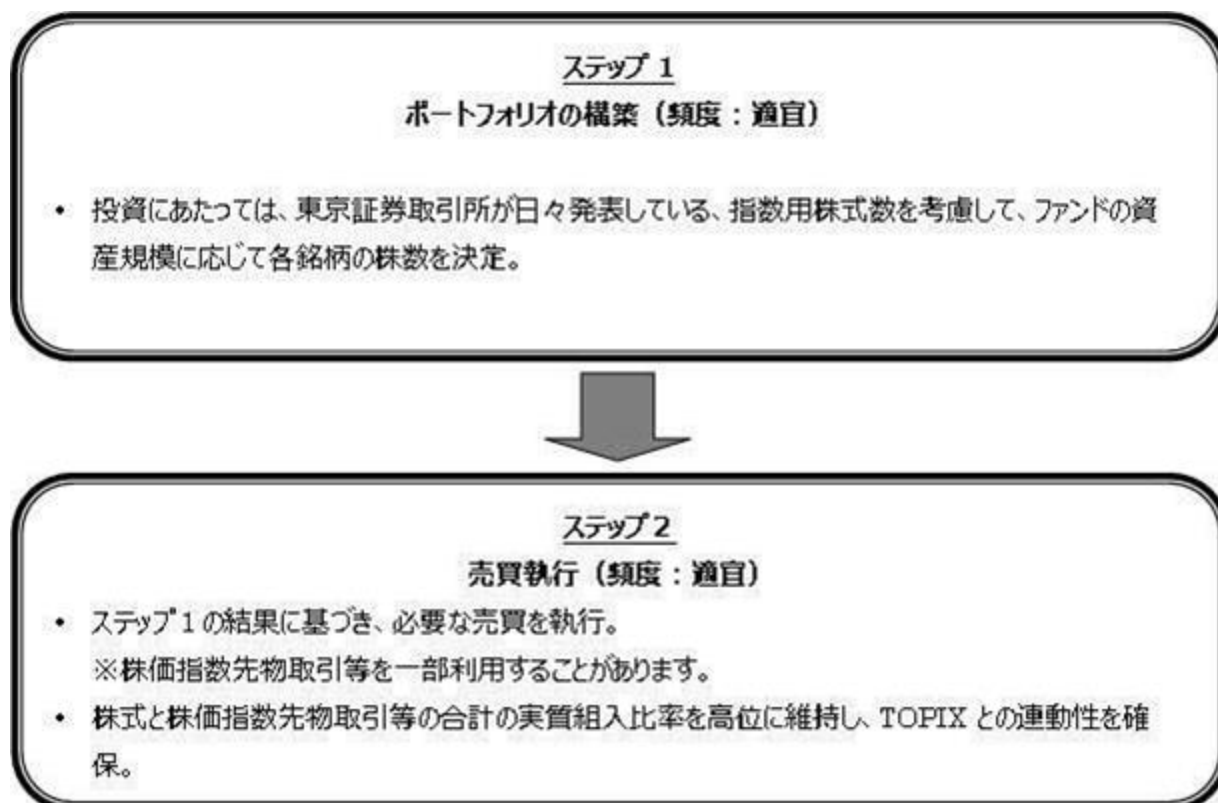
J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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

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

運用プロセス

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



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光日本債券インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得したものに限りません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年8月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

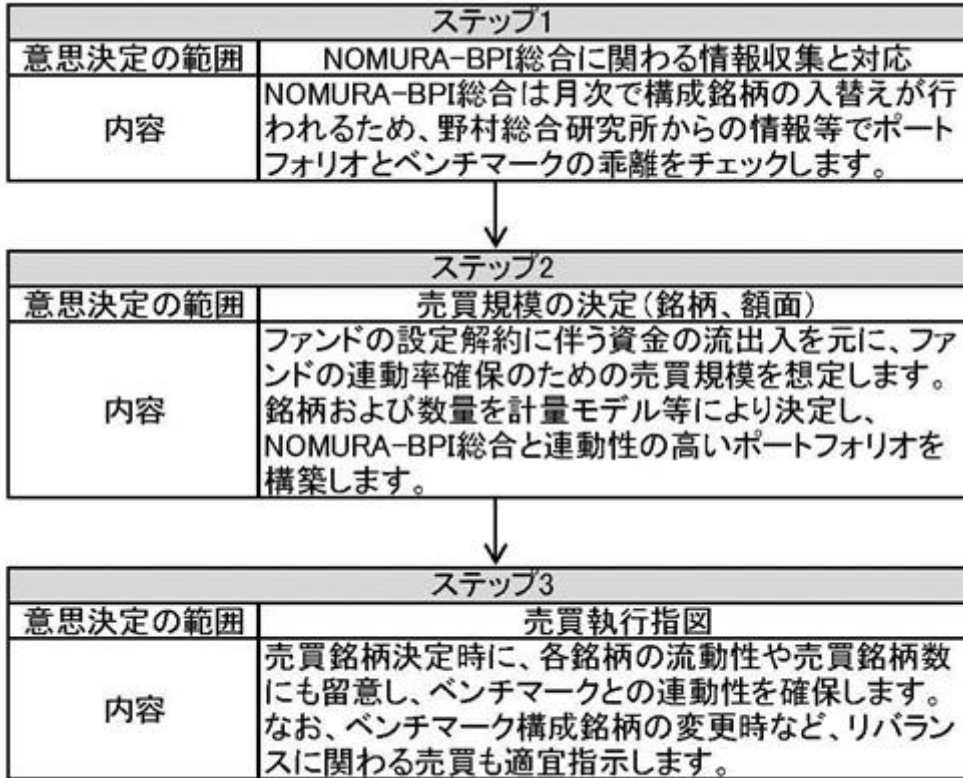
NOMURA - B P I 総合について

NOMURA - B P I 総合とは、野村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 - B P I 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。



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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光J-REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・不動産投資信託証券の実質組入比率を調整するため、不動産投信指数先物取引を活用する場合があります。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）、不動産投信指数先物取引以外には投資を行いません。 ・不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができるものとします。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。 ・デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
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

東証REIT指数（配当込み）について

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

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

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

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

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

本件商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。

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

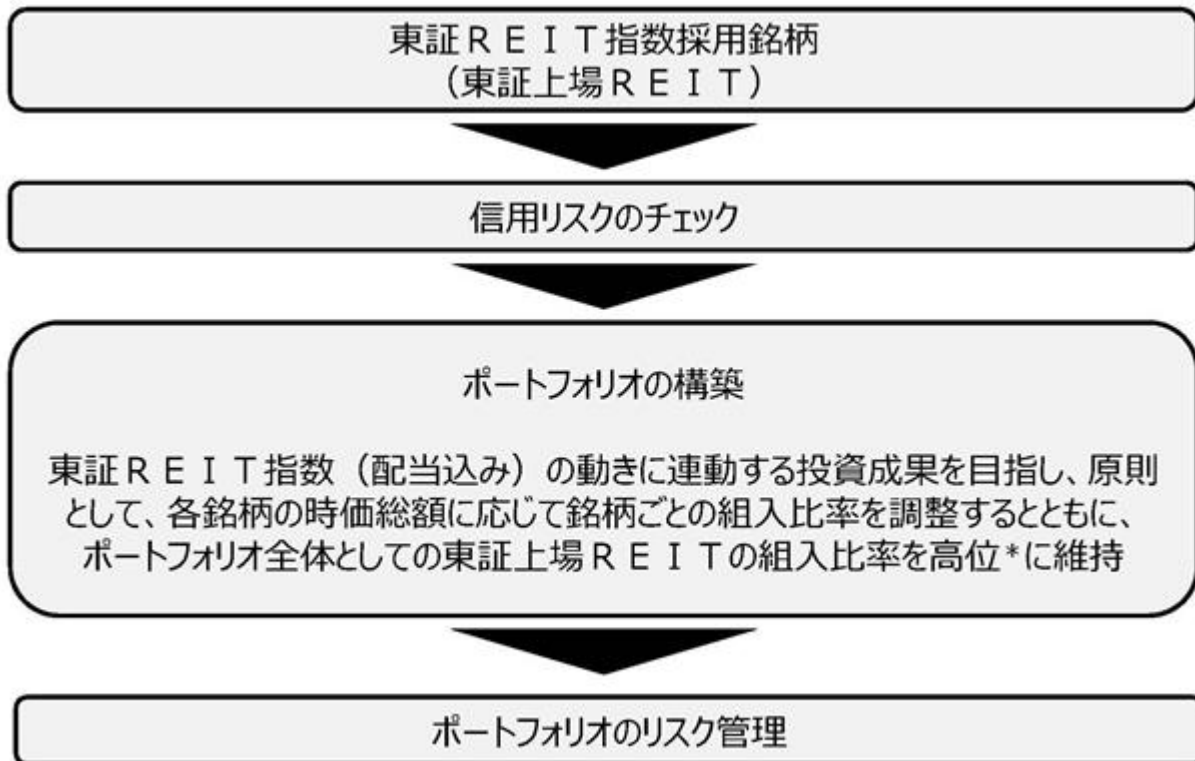
J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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

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

運用プロセス

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



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

*不動産投信指数先物取引を一部利用することがあります。

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

運用プロセスは2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

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

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

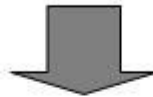
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

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

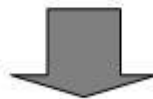
ステップ 1 リスクモニタリング

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



ステップ 2 ポートフォリオの構築

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



ステップ 3 売買執行

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

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ 日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。 ・ 日本を除く、FTSE世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。 ・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。 ・ 債券ポートフォリオは、日本を除くG7構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国）が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。 ・ 運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 通貨アロケーション ・ イールドカーブ戦略 ・ セクターアロケーション ・ デュレーション調整 ・ 外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限りません。 ・ 外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月4日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2001年11月5日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

FTSE世界国債インデックス(除く日本、7~10年、円ベース)について

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

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

運用プロセス

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



運用プロセスは2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

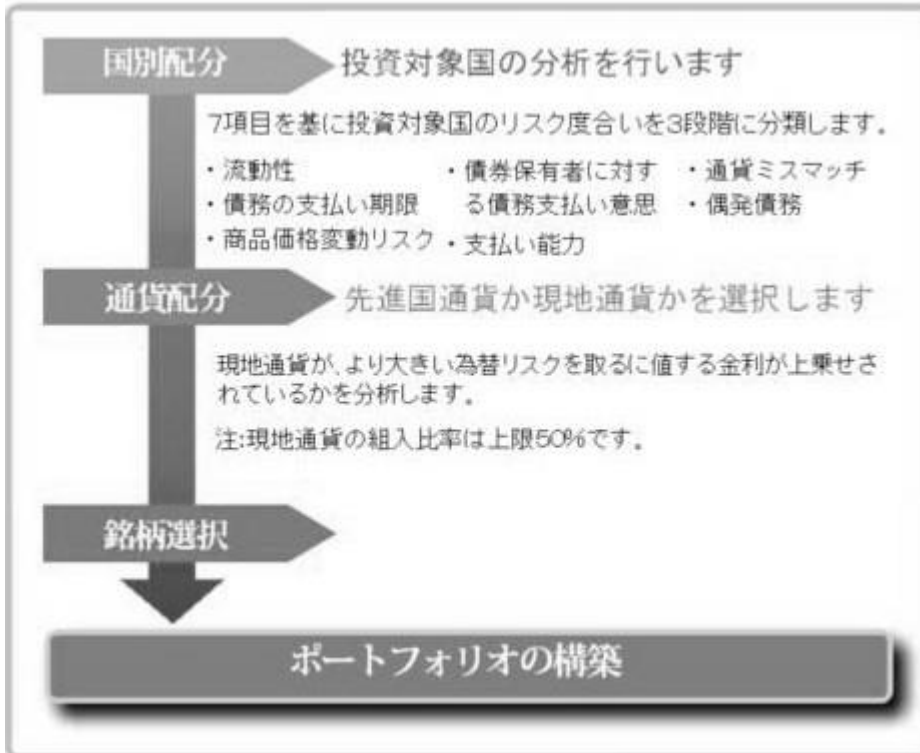
ファンド名	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地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

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

フランクリン テンプレトン インベストメント マネジメント リミテッド (F T I M L 社) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン・テンプレトン (設立 : 1947年、運用総資産 : 約205.6兆円) の一員です。 F T I M L 社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2023年9月末現在、1米ドル = 149.58円で換算

運用プロセス



出所 : F T I M L 社資料を基にアセットマネジメントOne作成

運用プロセスは2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

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

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

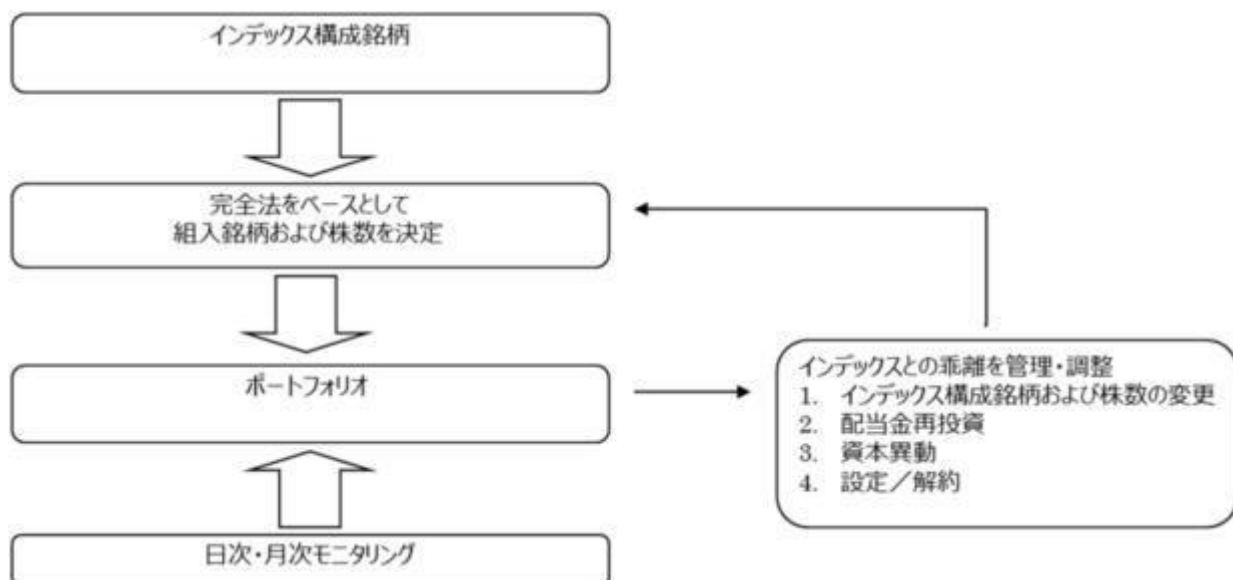
新光米国REITマザーファンド（以下「当マザーファンド」といいます。）は、アセットマネジメントOne株式会社によって単独で開発されたものです。当マザーファンドは、いかなる方法においても、FTSE、London Stock Exchange Group plcおよび、そのグループ企業（以下、総称して「LSE Group」といいます。）またはNareitによって出資、保証、販売または販売促進されることはありません。

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

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

運用プロセス

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



運用プロセスは2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は2024年1月19日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2023年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

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

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

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

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

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

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

（５）【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c．公社債の借り入れ

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

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

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

（ニ）借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d．同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

e．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

f．外国為替予約の指図

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

g．資金の借り入れ

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

- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。
- h. 受託者の自己または利害関係人等との取引
- (イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に定める範囲内での資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。
- (ロ) 上記(イ)の取り扱いは、約款に定める範囲内での委託者の指図による取引についても同様とします。
- i. デリバティブ取引等に係る投資制限
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- j. 信用リスク集中回避のための投資制限
- 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- k. ファンドの投資制限
- 投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

a. 資産配分リスク

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

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

b. 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

c. REITの価格変動リスク

REITの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

d. 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

e. カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

f. 金利変動リスク

金利の上昇(公社債の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

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

g. 信用リスク

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

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

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

h. 流動性リスク

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

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

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

i. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

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

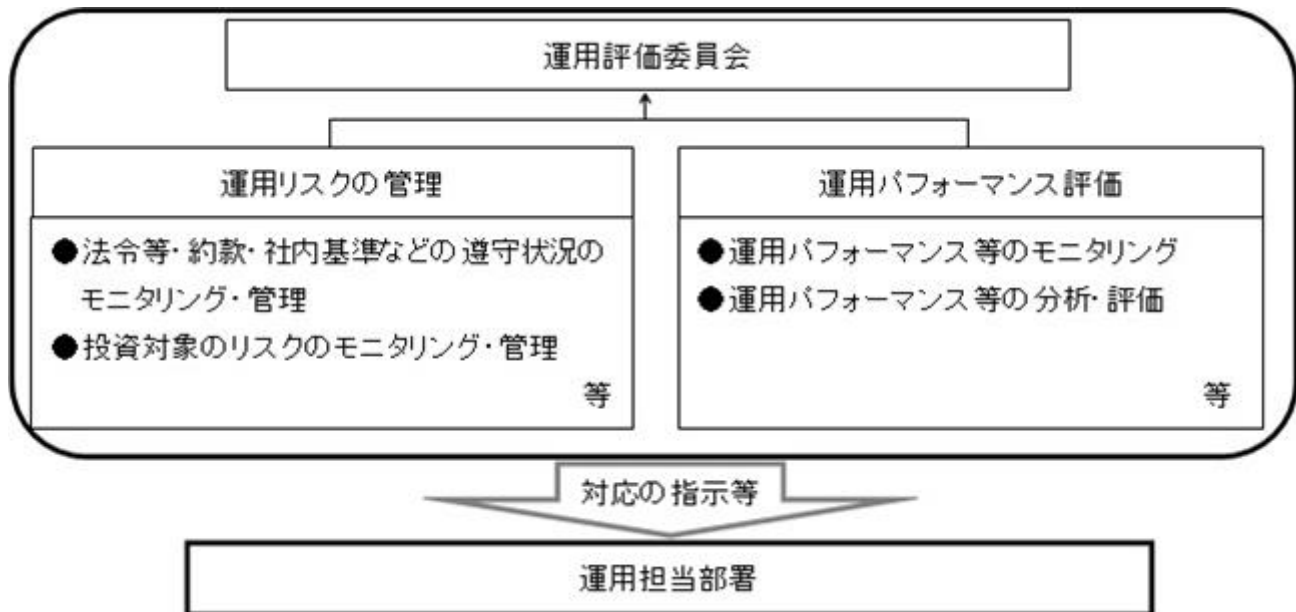
(ハ) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

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

（２）リスク管理体制

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

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

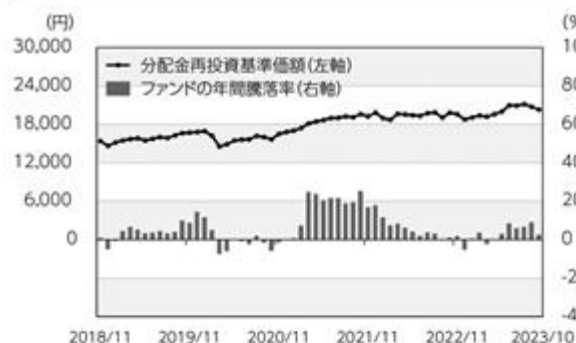


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

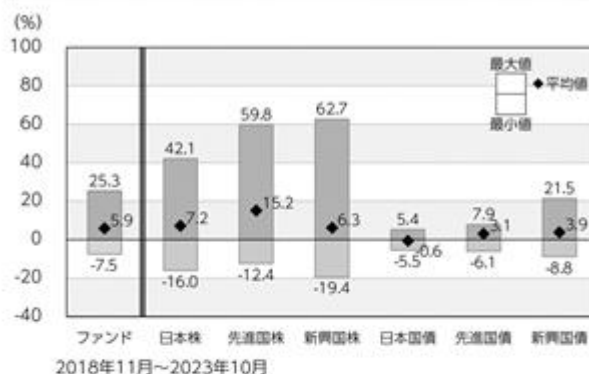
リスク管理体制は2023年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

*すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村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

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

b. 信託財産留保額

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

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

(3) 【信託報酬等】

ファンド	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.045%（税抜0.95%）</p> <p>信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率</p> <p>運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。</p> <p>運用管理費用（信託報酬）の配分は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。</p> <table border="1" data-bbox="416 488 1378 1173"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円未満の部分</td> <td>年率0.42%</td> <td>年率0.45%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>300億円以上 500億円未満の部分</td> <td>年率0.37%</td> <td>年率0.50%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>500億円以上の部分</td> <td>年率0.32%</td> <td>年率0.55%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table> <p>委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド）に対する投資顧問報酬（投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうちファンドにおける保有分に対し年率0.05%）が含まれます。</p>	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）				各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社	300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%	300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%	500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%	主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）																									
各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社																						
300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%																						
300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%																						
500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%																						
主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価																						
投資対象とする外国投資信託	<p>フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865%</p> <p>当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</p>																								
実質的な負担	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.12365%（税抜1.02865%）程度</p> <p>上記は概算の数値です。実際の運用管理費用（信託報酬）は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。</p>																								

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象となります。当ファンドは、NISAの対象ではありません。

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、2024年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

---(参考情報)ファンドの総経費率---

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.35%	1.04%	0.31%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年4月21日~2023年10月20日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※投資対象とする外国投資信託(以下、投資先ファンドといいます。)にかかる費用は、その他費用(②)に含めています。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、当ファンドについては、投資先ファンドも含め入手し得る情報において計算に含まれていない費用は認識しておりません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2023年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	641,563,600	14.57
内 ケイマン諸島	641,563,600	14.57
親投資信託受益証券	3,636,741,352	82.61
内 日本	3,636,741,352	82.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	123,763,082	2.81
純資産総額	4,402,068,034	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,455,020,930	90.83
内 日本	1,455,020,930	90.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	146,841,243	9.17
純資産総額	1,601,862,173	100.00

その他資産の投資状況

2023年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	67,620,000	4.22
内 日本	67,620,000	4.22

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	8,748,959,400	83.66
内 日本	8,748,959,400	83.66
地方債証券	660,233,300	6.31
内 日本	660,233,300	6.31
特殊債券	602,212,000	5.76
内 日本	602,212,000	5.76
社債券	293,591,000	2.81
内 日本	293,591,000	2.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	152,334,371	1.46
純資産総額	10,457,330,071	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	75,952,733,500	97.01
内 日本	75,952,733,500	97.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,341,256,186	2.99
純資産総額	78,293,989,686	100.00

その他資産の投資状況

2023年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	2,213,042,000	2.83
内 日本	2,213,042,000	2.83

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,406,467,322	85.65
内 アメリカ	1,005,737,821	61.24
内 イギリス	59,162,845	3.60
内 カナダ	48,782,662	2.97
内 スイス	45,518,425	2.77
内 フランス	45,079,114	2.75
内 ドイツ	33,748,979	2.06
内 オーストラリア	29,000,868	1.77
内 オランダ	26,342,137	1.60
内 アイルランド	25,880,011	1.58
内 デンマーク	13,902,629	0.85
内 スウェーデン	11,578,933	0.71
内 スペイン	10,463,102	0.64
内 イタリア	7,920,332	0.48
内 香港	7,395,161	0.45
内 シンガポール	5,039,212	0.31
内 ジャージー	4,887,790	0.30
内 フィンランド	4,542,921	0.28
内 バミューダ	3,506,383	0.21
内 ベルギー	3,158,234	0.19
内 ノルウェー	2,873,081	0.17
内 イスラエル	2,650,878	0.16
内 オランダ領キュラソー	2,394,791	0.15
内 ケイマン諸島	2,279,048	0.14
内 ニュージーランド	1,058,682	0.06
内 オーストリア	861,991	0.05
内 ポルトガル	783,161	0.05
内 ルクセンブルグ	777,188	0.05
内 リベリア	539,151	0.03
内 パナマ	347,700	0.02
内 マン島	254,092	0.02

新株予約権証券		0	0.00
	内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		2,296,787	0.14
	内 オーストラリア	1,801,524	0.11
	内 シンガポール	495,263	0.03
投資証券		25,415,263	1.55
	内 アメリカ	24,095,097	1.47
	内 イギリス	411,681	0.03
	内 香港	352,855	0.02
	内 フランス	335,685	0.02
	内 ベルギー	148,575	0.01
	内 カナダ	71,370	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		208,013,704	12.67
純資産総額		1,642,193,076	100.00

その他資産の投資状況

2023年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	145,662,919	8.87
	内 アメリカ	93,871,722
	内 ドイツ	38,449,664
	内 イギリス	13,341,533

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	13,183,686,646	98.27
	内 アメリカ	5,486,675,158
	内 フランス	2,874,058,922
	内 イタリア	1,924,830,560
	内 ドイツ	1,383,289,298
	内 イギリス	963,889,111
	内 カナダ	550,943,597
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	231,722,193	1.73
純資産総額	13,415,408,839	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	570,102,375	98.96
	内 アメリカ	570,102,375
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,999,012	1.04
純資産総額	576,101,387	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2023年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージェンシング・マーケット・デット・ファンド ケイマン諸島	投資信託受益証券	333,800	1,909.0000 637,224,200	1,922.0000 641,563,600	- -	14.57
2	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	2.6742 628,599,726	2.7001 634,664,069	- -	14.42
3	ニュー トピックス インデックス マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	184,139,379	3.3453 616,019,878	3.3430 615,577,943	- -	13.98
4	新光外国株式インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	133,658,339	4.6573 622,500,348	4.5298 605,445,544	- -	13.75
5	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	2.1746 603,435,662	2.1724 602,797,458	- -	13.69
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	504,434,964	1.2026 606,683,931	1.1937 602,144,016	- -	13.68
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	2.4043 586,752,146	2.3608 576,112,322	- -	13.09

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	14.57
親投資信託受益証券	82.61
合計	97.19

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
----	-----------------	----------	----	---------------------	---------------------	------------------	-----------------

1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	25,600	1,815.38 46,473,932	2,590.00 66,304,000	- -	4.14
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	3,300	11,000.29 36,300,960	12,425.00 41,002,500	- -	2.56
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	28,800	976.02 28,109,410	1,257.00 36,201,600	- -	2.26
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	500	55,080.00 27,540,000	58,150.00 29,075,000	- -	1.82
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	138,700	149.60 20,749,520	176.80 24,522,160	- -	1.53
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,300	5,720.00 18,876,000	7,220.00 23,826,000	- -	1.49
7	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,300	4,419.27 14,583,593	6,955.00 22,951,500	- -	1.43
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,300	6,480.00 14,904,000	9,477.00 21,797,100	- -	1.36
9	三井物産 日本	株式 卸売業	3,700	3,856.18 14,267,895	5,417.00 20,042,900	- -	1.25
10	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	1,000	15,030.00 15,030,000	19,755.00 19,755,000	- -	1.23
11	信越化学工業 日本	株式 化学	4,200	3,369.26 14,150,926	4,468.00 18,765,600	- -	1.17
12	任天堂 日本	株式 その他製品	3,000	5,397.00 16,191,000	6,221.00 18,663,000	- -	1.17
13	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	3,300	4,089.78 13,496,295	5,373.00 17,730,900	- -	1.11
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	11,400	1,022.33 11,654,602	1,506.50 17,174,100	- -	1.07
15	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	4,100	4,095.00 16,789,500	4,063.00 16,658,300	- -	1.04
16	KDDI 日本	株式 情報・通信業	3,600	3,885.00 13,986,000	4,487.00 16,153,200	- -	1.01
17	第一三共 日本	株式 医薬品	4,100	4,148.10 17,007,240	3,858.00 15,817,800	- -	0.99
18	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	6,200	2,042.56 12,663,916	2,545.50 15,782,100	- -	0.99
19	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	3,600	4,079.31 14,685,545	4,333.00 15,598,800	- -	0.97
20	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	4,500	2,751.00 12,379,500	3,343.00 15,043,500	- -	0.94

21	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	2,300	5,924.00 13,625,200	6,124.00 14,085,200	- -	0.88
22	HOYA 日本	株式 精密機器	900	13,210.00 11,889,000	14,335.00 12,901,500	- -	0.81
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	7,500	1,461.93 10,964,477	1,705.00 12,787,500	- -	0.80
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービ ス業	2,600	3,789.00 9,851,400	4,857.00 12,628,200	- -	0.79
25	ダイキン工業 日本	株式 機械	500	21,275.00 10,637,500	21,630.00 10,815,000	- -	0.68
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	4,200	2,395.00 10,059,000	2,477.50 10,405,500	- -	0.65
27	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	2,800	2,563.50 7,177,800	3,521.00 9,858,800	- -	0.62
28	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	1,700	6,142.00 10,441,400	5,493.00 9,338,100	- -	0.58
29	丸紅 日本	株式 卸売業	4,100	1,534.38 6,290,998	2,178.00 8,929,800	- -	0.56
30	住友商事 日本	株式 卸売業	3,000	2,195.00 6,585,000	2,938.50 8,815,500	- -	0.55

（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10月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	90.83
合計	90.83

（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10月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	15.17
輸送用機器		7.96
情報・通信業		7.17
銀行業		7.10
卸売業		6.40
化学		5.27
医薬品		4.43
機械		4.32
サービス業		4.16
小売業		3.92
食料品		3.21
陸運業		2.63
保険業		2.32
その他製品		2.09
精密機器		1.96

建設業	1.93
不動産業	1.87
電気・ガス業	1.32
その他金融業	1.07
鉄鋼	0.90
証券、商品先物取引業	0.75
海運業	0.69
非鉄金属	0.63
ゴム製品	0.62
ガラス・土石製品	0.57
金属製品	0.47
石油・石炭製品	0.42
空運業	0.41
繊維製品	0.39
鉱業	0.37
パルプ・紙	0.16
倉庫・運輸関連業	0.08
水産・農林業	0.07
合計	90.83

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	120,000,000	101.13 121,367,400	100.54 120,655,200	0.4 2025/6/20	1.15
2	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	120,000,000	100.48 120,576,000	99.92 119,910,000	0.1 2025/12/20	1.15
3	147回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	120,000,000	100.15 120,188,400	99.63 119,558,400	0.005 2026/3/20	1.14
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	98.75 118,500,000	0.1 2028/3/20	1.13
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	98.52 118,227,600	0.1 2028/6/20	1.13
6	97回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	112.91 112,915,000	108.50 108,509,000	2.1 2029/12/28	1.04
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	108.37 108,372,000	2.22 2029/3/19	1.04
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	98.12 107,932,000	0.1 2028/12/20	1.03

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	102.11 102,110,000	2.11 2024/12/20	0.98
10	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	100.53 100,536,000	0.484 2025/6/30	0.96
11	144回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	100,000,000	100.38 100,388,000	100.05 100,057,000	0.1 2025/6/20	0.96
12	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	99.87 99,872,000	0.195 2025/12/19	0.96
13	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	99.64 99,642,000	0.781 2030/12/6	0.95
14	148回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	100,000,000	100.09 100,099,600	99.52 99,528,000	0.005 2026/6/20	0.95
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	99.32 99,329,000	0.205 2027/4/23	0.95
16	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	99.30 99,303,000	0.06 2026/3/18	0.95
17	349回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	100,000,000	100.12 100,127,000	98.96 98,961,000	0.1 2027/12/20	0.95
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	98.96 98,961,000	0.17 2027/10/29	0.95
19	11回 プリヂストーン社債 日本	社債券	100,000,000	99.93 99,932,000	98.91 98,916,000	0.295 2027/4/21	0.95
20	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	98.84 98,848,000	0.001 2026/12/25	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	98.22 98,223,000	0.289 2028/11/20	0.94
22	147回 高速道路機構債 日本	特殊債券	100,000,000	102.62 102,620,000	96.68 96,680,000	0.955 2034/12/20	0.92
23	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	94.01 94,014,000	0.145 2031/10/29	0.90
24	494回 九州電力社債 日本	社債券	100,000,000	95.44 95,447,000	92.56 92,565,000	0.31 2031/5/23	0.89
25	145回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	90,000,000	100.41 90,372,200	99.99 89,991,000	0.1 2025/9/20	0.86
26	149回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	90,000,000	100.06 90,057,000	99.41 89,470,800	0.005 2026/9/20	0.86

27	150回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	90,000,000	99.97 89,974,800	99.28 89,355,600	0.005 2026/12/20	0.85
28	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	90,000,000	100.05 90,048,300	99.13 89,222,400	0.1 2027/9/20	0.85
29	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	90,000,000	98.81 88,931,700	96.62 86,962,500	0.1 2030/6/20	0.83
30	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	90,000,000	98.90 89,014,700	95.92 86,330,700	0.1 2030/12/20	0.83

(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10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	83.66
地方債証券	6.31
特殊債券	5.76
社債券	2.81
合計	98.54

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

2023年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	8,573	587,012.96 5,032,462,153	607,000.00 5,203,811,000	- -	6.65
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	7,549	563,995.14 4,257,599,328	561,000.00 4,234,989,000	- -	5.41
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	23,766	167,897.28 3,990,246,760	166,900.00 3,966,545,400	- -	5.07
4	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	12,803	272,396.08 3,487,487,106	268,800.00 3,441,446,400	- -	4.40
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	35,227	99,297.67 3,497,959,349	97,500.00 3,434,632,500	- -	4.39
6	GLP投資法人 日本	投資証券	24,825	132,002.07 3,276,951,480	135,500.00 3,363,787,500	- -	4.30
7	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証券	21,149	164,608.27 3,481,300,357	157,600.00 3,333,082,400	- -	4.26

8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	11,078	265,602.71 2,942,346,923	267,600.00 2,964,472,800	- -	3.79
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	14,643	178,494.64 2,613,697,080	173,800.00 2,544,953,400	- -	3.25
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	16,440	150,799.97 2,479,151,566	152,400.00 2,505,456,000	- -	3.20
11	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	7,211	330,997.03 2,386,819,604	328,500.00 2,368,813,500	- -	3.03
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	35,583	57,400.72 2,042,489,981	58,100.00 2,067,372,300	- -	2.64
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	5,026	354,496.76 1,781,700,716	354,000.00 1,779,204,000	- -	2.27
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	22,084	80,999.00 1,788,782,130	79,600.00 1,757,886,400	- -	2.25
15	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	24,602	69,298.85 1,704,890,340	68,700.00 1,690,157,400	- -	2.16
16	アクティブア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	3,856	409,497.32 1,579,021,672	408,500.00 1,575,176,000	- -	2.01
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	2,538	610,995.17 1,550,705,758	609,000.00 1,545,642,000	- -	1.97
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	11,213	136,698.61 1,532,801,557	135,700.00 1,521,604,100	- -	1.94
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	3,057	467,489.60 1,429,115,724	456,500.00 1,395,520,500	- -	1.78
20	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	9,394	147,900.27 1,389,375,190	148,200.00 1,392,190,800	- -	1.78
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	4,708	285,792.47 1,345,510,976	279,900.00 1,317,769,200	- -	1.68
22	イオンリート投資法人 日本	投資証券	9,015	145,299.04 1,309,870,897	144,000.00 1,298,160,000	- -	1.66
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	2,727	444,503.60 1,212,161,320	452,500.00 1,233,967,500	- -	1.58
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	8,642	139,900.78 1,209,022,597	141,500.00 1,222,843,000	- -	1.56
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	10,823	109,702.72 1,187,312,593	111,800.00 1,210,011,400	- -	1.55
26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	3,614	306,007.00 1,105,909,311	321,000.00 1,160,094,000	- -	1.48

27	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	6,876	154,698.14 1,063,704,414	154,200.00 1,060,279,200	- -	1.35
28	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	14,166	72,600.91 1,028,464,620	73,700.00 1,044,034,200	- -	1.33
29	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,522	652,004.51 992,350,869	661,000.00 1,006,042,000	- -	1.28
30	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	2,538	378,999.94 961,901,848	380,500.00 965,709,000	- -	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10月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.01
合計	97.01

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	3,053	20,164.41 61,561,955	25,460.05 77,729,556	- -	4.73
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,371	33,607.22 46,075,511	50,431.21 69,141,200	- -	4.21
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,791	12,914.01 23,129,002	19,841.47 35,536,076	- -	2.16
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	479	20,797.24 9,961,881	61,539.81 29,477,569	- -	1.80
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	1,152	13,072.44 15,059,453	18,608.01 21,436,432	- -	1.31

6	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	429	15,170.77 6,508,264	45,250.69 19,412,548	- -	1.18
7	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	1,025	13,067.17 13,393,853	18,800.88 19,270,904	- -	1.17
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	552	26,773.00 14,778,697	29,507.29 16,288,026	- -	0.99
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	181	80,834.07 14,630,967	79,238.80 14,342,223	- -	0.87
10	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	156	54,312.49 8,472,749	84,579.30 13,194,371	- -	0.80
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	252	43,156.05 10,875,327	50,446.16 12,712,434	- -	0.77
12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	785	16,281.63 12,781,086	15,830.11 12,426,643	- -	0.76
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	567	19,397.42 10,998,341	20,545.66 11,649,391	- -	0.71
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	314	28,994.47 9,104,264	34,847.78 10,942,206	- -	0.67
15	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	467	25,594.65 11,952,702	21,982.45 10,265,806	- -	0.63
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	458	20,405.12 9,345,547	22,315.86 10,220,665	- -	0.62
17	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	80	70,382.91 5,630,633	125,775.28 10,062,023	- -	0.61
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	164	47,191.33 7,739,379	55,680.51 9,131,604	- -	0.56

19	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	631	9,022.74 5,693,351	14,407.90 9,091,386	- -	0.55
20	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	521	18,088.82 9,424,276	16,195.72 8,437,974	- -	0.51
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	195	42,871.98 8,360,038	42,084.07 8,206,394	- -	0.50
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	353	26,602.31 9,390,616	21,841.91 7,710,196	- -	0.47
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	492	15,188.71 7,472,850	15,351.68 7,553,029	- -	0.46
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	342	22,069.89 7,547,904	21,213.97 7,255,179	- -	0.44
25	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	86	73,348.77 6,307,995	82,960.10 7,134,569	- -	0.43
26	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	288	20,852.15 6,005,421	24,373.11 7,019,458	- -	0.43
27	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	88	44,684.04 3,932,196	78,782.79 6,932,886	- -	0.42
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	78	78,679.48 6,137,000	87,580.30 6,831,264	- -	0.42
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	796	8,786.70 6,994,215	8,394.98 6,682,409	- -	0.41
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	266	26,695.00 7,100,872	24,262.48 6,453,820	- -	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	85.65
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.14
投資証券	1.55
合計	87.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年10月31日現在

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

ソフトウェア	外国	7.57
半導体・半導体製造装置		5.13
コンピュータ・周辺機器		4.95
医薬品		4.66
銀行		4.57
石油・ガス・消耗燃料		4.47
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.77
保険		2.87
金融サービス		2.69
資本市場		2.66
大規模小売り		2.53
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.03
ヘルスケア機器・用品		1.88
ホテル・レストラン・レジャー		1.80
バイオテクノロジー		1.69
化学		1.69
機械		1.58
生活必需品流通・小売り		1.56
自動車		1.53
航空宇宙・防衛		1.53
電力		1.50
飲料		1.48
専門小売り		1.37
金属・鉱業		1.37
食品		1.32
情報技術サービス		1.14
繊維・アパレル・贅沢品		1.07
家庭用品		1.01
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.95
陸上運輸		0.91
娯楽		0.88
専門サービス		0.88
各種電気通信サービス		0.88
コングロマリット		0.79
電気設備		0.73
総合公益事業		0.69
通信機器		0.62
メディア		0.61
パーソナルケア用品		0.55
タバコ		0.53
商業サービス・用品		0.51
建設関連製品		0.50
航空貨物・物流サービス		0.43
電子装置・機器・部品		0.43
商社・流通業		0.38
不動産管理・開発		0.30
消費者金融		0.29
エネルギー設備・サービス		0.28
建設・土木		0.28
家庭用耐久財		0.26

建設資材	0.25
無線通信サービス	0.21
容器・包装	0.20
自動車用部品	0.15
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
運送インフラ	0.10
ガス	0.09
紙製品・林産品	0.09
水道	0.08
販売	0.08
海上運輸	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
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	0.01
合計	85.65

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,106,374,000	92.25 1,020,728,924	86.01 951,654,509	2.875 2032/5/15	7.09
2	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,091,423,000	82.58 901,303,219	79.79 870,921,446	1.625 2031/5/15	6.49
3	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	866,283,600	99.31 860,311,447	96.38 834,929,953	2.5 2030/5/25	6.22
4	ITALY BTPS 4.4 05/01/33 イタリア	国債証券	825,032,000	101.97 841,311,309	98.41 811,996,494	4.4 2033/5/1	6.05
5	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	852,207,000	96.87 825,569,686	89.74 764,855,782	3.5 2033/2/15	5.70
6	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	956,864,000	82.75 791,833,665	79.66 762,239,354	1.875 2032/2/15	5.68
7	FRANCE OAT 0.0 11/25/31 フランス	国債証券	809,166,000	79.17 640,636,380	77.26 625,177,834	- 2031/11/25	4.66
8	FRANCE OAT 2.0 11/25/32 フランス	国債証券	634,640,000	91.28 579,360,476	89.68 569,147,690	2 2032/11/25	4.24
9	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	678,775,400	79.07 536,710,118	75.69 513,774,641	0.625 2030/8/15	3.83
10	ITALY BTPS 0.95 06/01/32 イタリア	国債証券	637,813,200	76.16 485,780,904	75.02 478,551,243	0.95 2032/6/1	3.57
11	US T N/B 5.0 08/31/25 アメリカ	国債証券	478,432,000	99.82 477,591,006	99.82 477,591,006	5 2025/8/31	3.56
12	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	517,304,600	94.69 489,849,190	88.64 458,582,446	3.375 2033/5/15	3.42
13	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	493,383,000	81.86 403,898,125	76.76 378,738,906	1.25 2031/8/15	2.82

14	UK TREASURY 3.75 01/29/38 イギリス	国債証券	403,462,800	90.06 363,370,701	88.42 356,766,015	3.75 2038/1/29	2.66
15	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 ドイツ	国債証券	396,650,000	80.93 321,023,917	80.01 317,375,531	- 2032/2/15	2.37
16	DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 ドイツ	国債証券	325,253,000	101.19 329,140,566	96.05 312,431,526	2.3 2033/2/15	2.33
17	UK TREASURY 3.25 01/31/33 イギリス	国債証券	345,306,000	93.21 321,862,630	90.16 311,345,154	3.25 2033/1/31	2.32
18	US T N/B 4.375 08/31/28 アメリカ	国債証券	313,971,000	98.79 310,181,271	98.19 308,317,068	4.375 2028/8/31	2.30
19	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証券	317,320,000	97.45 309,252,139	96.21 305,293,572	3.5 2030/3/1	2.28
20	FRANCE OAT 1.75 06/25/39 フランス	国債証券	380,784,000	81.88 311,824,017	76.97 293,106,944	1.75 2039/6/25	2.18
21	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	317,320,000	88.28 280,135,807	86.99 276,065,861	0.5 2029/5/25	2.06
22	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 ドイツ	国債証券	310,973,600	81.91 254,745,701	81.26 252,718,915	- 2031/8/15	1.88
23	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 ドイツ	国債証券	301,454,000	84.58 254,990,894	83.66 252,214,503	- 2030/8/15	1.88
24	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 ドイツ	国債証券	301,454,000	82.96 250,096,709	82.45 248,548,823	- 2031/2/15	1.85
25	ITALY BTPS 0.95 08/01/30 イタリア	国債証券	285,588,000	79.58 227,299,489	80.61 230,241,045	0.95 2030/8/1	1.72
26	FRANCE OAT 3.0 05/25/33 フランス	国債証券	174,526,000	99.98 174,494,585	96.91 169,142,396	3 2033/5/25	1.26
27	CANADA 2.5 12/01/32 カナダ	国債証券	172,864,000	94.36 163,128,299	88.22 152,504,623	2.5 2032/12/1	1.14
28	CANADA 5.75 06/01/33 カナダ	国債証券	133,969,600	116.46 156,026,700	113.34 151,853,482	5.75 2033/6/1	1.13
29	CANADA 1.5 06/01/31 カナダ	国債証券	151,256,000	88.12 133,298,887	83.33 126,051,216	1.5 2031/6/1	0.94
30	UK TREASURY 1.0 01/31/32 イギリス	国債証券	163,566,000	81.09 132,647,119	76.13 124,530,974	1 2032/1/31	0.93

(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10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.27
合計	98.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

2023年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
----	-----------------	----	----	---------------------	---------------------	------------------	-----------------

1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証 券	3,225	15,336.73 49,460,972	14,783.54 47,676,944	- -	8.28
2	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証 券	1,712	23,836.37 40,807,881	25,811.40 44,189,127	- -	7.67
3	EQUINIX INC アメリカ	投資証 券	343	105,226.63 36,092,735	106,948.98 36,683,502	- -	6.37
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証 券	1,826	12,546.87 22,910,601	12,240.38 22,350,940	- -	3.88
5	CROWN CASTLE INC アメリカ	投資証 券	1,590	12,841.41 20,417,848	13,482.81 21,437,670	- -	3.72
6	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証 券	576	38,648.33 22,261,440	35,705.97 20,566,643	- -	3.57
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	1,097	17,289.33 18,966,402	18,252.18 20,022,642	- -	3.48
8	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証 券	1,193	15,922.81 18,995,918	15,747.88 18,787,230	- -	3.26
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証 券	2,476	7,388.78 18,294,629	6,910.35 17,110,032	- -	2.97
10	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	3,689	4,198.24 15,487,310	4,063.68 14,990,922	- -	2.60
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	521	25,872.70 13,479,679	24,317.80 12,669,574	- -	2.20
12	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証 券	395	28,323.17 11,187,653	30,636.09 12,101,257	- -	2.10
13	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	769	16,819.87 12,934,483	15,538.57 11,949,163	- -	2.07
14	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証 券	2,691	4,385.12 11,800,380	4,268.51 11,486,561	- -	1.99
15	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	1,371	8,744.83 11,989,175	8,142.31 11,163,113	- -	1.94
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	2,246	4,718.53 10,597,830	4,376.15 9,828,850	- -	1.71
17	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証 券	1,064	8,933.22 9,504,948	8,714.93 9,272,693	- -	1.61
18	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	1,468	6,254.00 9,180,876	6,212.14 9,119,422	- -	1.58
19	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証 券	625	14,161.58 8,850,992	13,908.91 8,693,072	- -	1.51
20	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	427	19,570.85 8,356,756	17,568.91 7,501,928	- -	1.30
21	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	452	15,795.73 7,139,670	16,404.23 7,414,715	- -	1.29
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	235	32,039.99 7,529,398	31,403.07 7,379,723	- -	1.28
23	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	651	9,807.85 6,384,914	9,824.30 6,395,620	- -	1.11
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	776	8,001.77 6,209,377	7,886.65 6,120,042	- -	1.06

25	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	924	6,825.13 6,306,421	6,603.85 6,101,963	- -	1.06
26	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証 券	2,589	2,354.78 6,096,531	2,299.46 5,953,311	- -	1.03
27	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証 券	1,223	5,078.85 6,211,439	4,814.22 5,887,793	- -	1.02
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証 券	664	8,849.49 5,876,065	8,702.97 5,778,776	- -	1.00
29	KIMCO REALTY アメリカ	投資証 券	2,212	2,523.72 5,582,488	2,583.53 5,714,774	- -	0.99
30	UDR INC アメリカ	投資証 券	1,205	5,261.25 6,339,814	4,727.50 5,696,644	- -	0.99

(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10月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.96
合計	98.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2023年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0512月	買建	3	66,930,990	67,620,000	4.22

(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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0512月	買建	1,222	2,216,097,000	2,213,042,000	2.83

(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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Dec23	買建	3	100,113,017	93,871,722	5.72
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec23	買建	6	40,390,076	38,449,664	2.34
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec23	買建	1	13,755,900	13,341,533	0.81

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

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

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2023年10月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第34特定期間末 (2023年10月20日)	4,428	4,436	1.0617	1.0637
2022年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	-
5月末日	4,443	-	1.0493	-
6月末日	4,629	-	1.0971	-
7月末日	4,595	-	1.0933	-

8月末日	4,632	-	1.1043	-
9月末日	4,518	-	1.0810	-
10月末日	4,402	-	1.0558	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第34特定期間	0.0120

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第34特定期間	4.4

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

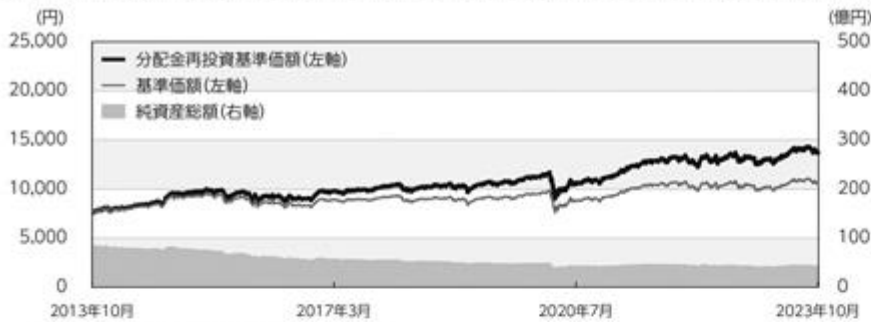
	設定口数	解約口数
第15特定期間	25,208,228	996,341,985
第16特定期間	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	13,815,643	989,033,927
第18特定期間	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	5,348,676	374,412,075
第22特定期間	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	45,095,213	164,575,560
第24特定期間	4,817,074	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
第34特定期間	17,589,380	79,729,532

(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10月31日

基準価額・純資産の推移 (2013年10月31日～2023年10月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

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

分配の推移(税引前)

2023年 6月	20円
2023年 7月	20円
2023年 8月	20円
2023年 9月	20円
2023年10月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	5,120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・テンブルトン・フロンティア・エマーシング・マーケット・デット・ファンド	14.57
2	海外国債マザーファンド	14.42
3	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	13.98
4	新光外国株式インデックスマザーファンド	13.75
5	新光J-REITマザーファンド	13.69
6	新光日本債券インデックスマザーファンド	13.68
7	新光米国REITマザーファンド	13.09

■ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.14
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.56
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.26
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.82
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.53

■新光日本債券インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	1.15
2	146回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/12/20	1.15
3	147回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/3/20	1.14
4	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.13
5	351回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/6/20	1.13

■新光J-REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.65
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.41
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	5.07
4	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.40
5	日本都市ファンド投資法人	日本	4.39

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2023年10月31日

■新光外国株式インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.73
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.21
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.16
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.80
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	1.31

■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 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	7.09
2	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	6.49
3	FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	フランス	2.5	2030/5/25	6.22
4	ITALY BTFS 4.4 05/01/33	国債証券	イタリア	4.4	2033/5/1	6.05
5	US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	アメリカ	3.5	2033/2/15	5.70

■フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド(現地2023年10月13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・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

①組入公社債の上位5通貨

順位	通貨	比率(%)
1	米ドル	45.5
2	ユーロ	7.8
3	メキシコペソ	5.7
4	ウルグアイペソ	4.1
5	南アフリカランド	3.8

②組入公社債の上位5カ国

順位	国/地域	比率(%)
1	その他	13.0
2	メキシコ	8.3
3	南アフリカ	6.2
4	カザフスタン	5.1
5	コロンビア	4.6

■新光米国REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.28
2	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	7.67
3	EQUINIX INC	アメリカ	6.37
4	WELLTOWER INC	アメリカ	3.88
5	CROWN CASTLE INC	アメリカ	3.72

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(<https://www.am-one.co.jp/>)または、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額および一部解約の価額は、前日以前のものとなります。

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

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

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

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

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

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

（５）【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

b. 投資信託約款の変更

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

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

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

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d. 運用報告書

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

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

e. 公告

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

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

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

f. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g. 信託事務処理の再信託

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

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

h. 信託業務の委託等

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

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

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

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

1. 投資信託財産の保存にかかる業務

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

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

4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

i. 関係法人との契約の更改

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

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

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

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2023年4月21日から2023年10月20日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【新光7資産バランスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2023年4月20日現在	当期 2023年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	129,466,790	140,206,851
投資信託受益証券	620,756,400	637,224,200
親投資信託受益証券	3,614,437,445	3,663,991,691
流動資産合計	4,364,660,635	4,441,422,742
資産合計	4,364,660,635	4,441,422,742
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	8,466,220	8,341,940
未払解約金	974,907	1,076,900
未払受託者報酬	317,731	324,866
未払委託者報酬	3,455,373	3,532,988
その他未払費用	14,125	14,442
流動負債合計	13,228,356	13,291,136
負債合計	13,228,356	13,291,136
純資産の部		
元本等		
元本	4,233,110,286	4,170,970,134
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	118,321,993	257,161,472
（分配準備積立金）	543,047,530	562,853,295
元本等合計	4,351,432,279	4,428,131,606
純資産合計	4,351,432,279	4,428,131,606
負債純資産合計	4,364,660,635	4,441,422,742

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2022年10月21日 至 2023年4月20日	当期 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日
営業収益		
受取配当金	33,033,600	32,539,200
有価証券売買等損益	47,912,089	185,561,146
営業収益合計	80,945,689	218,100,346
営業費用		
支払利息	16,286	26,935
受託者報酬	1,900,405	1,990,195
委託者報酬	20,667,355	21,643,812
その他費用	84,472	88,469
営業費用合計	22,668,518	23,749,411
営業利益又は営業損失()	58,277,171	194,350,935
経常利益又は経常損失()	58,277,171	194,350,935
当期純利益又は当期純損失()	58,277,171	194,350,935
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()	380,665	36,783
期首剰余金又は期首欠損金()	112,127,986	118,321,993
剰余金増加額又は欠損金減少額	152,631	756,486
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	152,631	756,486
剰余金減少額又は欠損金増加額	814,436	5,789,638
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	814,436	5,789,638
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	51,040,694	50,441,521
期末剰余金又は期末欠損金()	118,321,993	257,161,472

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2023年4月20日現在	2023年10月20日現在
1. 期首元本額	4,286,397,294円	4,233,110,286円
期中追加設定元本額	7,853,916円	17,589,380円
期中一部解約元本額	61,140,924円	79,729,532円
2. 受益権の総数	4,233,110,286口	4,170,970,134口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2022年10月21日 至 2023年4月20日	自 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2022年10月21日 至2022年11月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p>	<p>(自2023年4月21日 至2023年5月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,499,684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(29,597,448円)及び分配準備積立金(542,313,681円)より分配対象収益は582,410,813円(1万口当たり1,374.13円)であり、うち8,476,743円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>

(自2022年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2023年5月23日 至2023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(12,126,722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(29,620,889円)及び分配準備積立金(542,081,774円)より分配対象収益は583,829,385円(1万口当たり1,382.86円)であり、うち8,443,776円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2023年6月21日 至2023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(11,055,043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(29,646,961円)及び分配準備積立金(543,364,935円)より分配対象収益は584,066,939円(1万口当たり1,389.15円)であり、うち8,408,927円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2023年7月21日 至2023年8月21日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,099,050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(30,024,808円)及び分配準備積立金(545,379,786円)より分配対象収益は582,503,644円(1万口当たり1,386.05円)であり、うち8,405,205円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

	<p>（自2023年2月21日 至2023年3月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,277,553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。</p> <p>（自2023年3月21日 至2023年4月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。</p>	<p>（自2023年8月22日 至2023年9月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（14,016,777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（12,498,921円）、信託約款に規定される収益調整金（29,959,061円）及び分配準備積立金（541,388,726円）より分配対象収益は597,863,485円（1万口当たり1,429.45円）であり、うち8,364,930円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p> <p>（自2023年9月21日 至2023年10月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（13,296,388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（29,980,820円）及び分配準備積立金（557,898,847円）より分配対象収益は601,176,055円（1万口当たり1,441.33円）であり、うち8,341,940円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p>
--	---	---

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 2023年4月20日現在	当期 2023年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 2023年4月20日現在	当期 2023年10月20日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	22,710,600	16,022,400
親投資信託受益証券	152,260,477	133,438,079
合計	174,971,077	149,460,479

(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 2023年4月20日現在	当期 2023年10月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0280円 (10,280円)	1.0617円 (10,617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10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	333,800	637,224,200	
投資信託受益証券 合計		333,800	637,224,200	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	235,052,061	628,599,726	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	184,139,379	616,019,878	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	133,658,339	622,500,348	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	504,434,964	606,683,931	
	新光J-REITマザーファンド	277,479,957	603,435,662	
	新光米国REITマザーファンド	244,032,668	586,752,146	
親投資信託受益証券 合計		1,578,797,368	3,663,991,691	
合計			4,301,215,891	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2023年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	36,475,372
株式	1,557,335,340
未収配当金	15,029,233
前払金	30,000
差入委託証拠金	1,830,000
流動資産合計	1,610,699,945
資産合計	1,610,699,945
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	260,660
流動負債合計	260,660
負債合計	260,660
純資産の部	
元本等	
元本	481,384,413
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,129,054,872
元本等合計	1,610,439,285
純資産合計	1,610,439,285
負債純資産合計	1,610,699,945

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	540,012,065円
同期中追加設定元本額	21,044,349円
同期中一部解約元本額	79,672,001円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	184,139,379円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	44,538,564円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	215,472,536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)	4,985,801円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	13,477,262円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	6,125,772円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	3,553,237円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	8,585,124円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	506,738円
計	481,384,413円
2. 受益権の総数	481,384,413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 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	241,159,720
合計	241,159,720

(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10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年10月20日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	45,280,000	-	45,020,000	260,000
合計	45,280,000	-	45,020,000	260,000

(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10月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,3454円 (33,454円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年10月20日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ニッセイ	700	693.00	485,100	
マルハニチロ	100	2,454.50	245,450	
雪国まいたけ	100	884.00	88,400	
サカタのタネ	100	4,095.00	409,500	
ホクト	100	1,789.00	178,900	
ショーボンドホールディングス	100	5,683.00	568,300	
ミライト・ワン	200	1,937.00	387,400	
I N P E X	2,500	2,230.00	5,575,000	
石油資源開発	100	5,360.00	536,000	
安藤・間	400	1,137.00	454,800	
東急建設	200	736.00	147,200	
コムシスホールディングス	200	3,033.00	606,600	
ビーアールホールディングス	200	364.00	72,800	
ヤマウラ	100	1,212.00	121,200	
オリエンタル白石	300	326.00	97,800	
大成建設	400	4,920.00	1,968,000	
大林組	1,700	1,253.50	2,130,950	
清水建設	1,300	1,032.50	1,342,250	
飛島建設	100	1,261.00	126,100	
長谷工コーポレーション	500	1,849.00	924,500	
松井建設	100	758.00	75,800	

鹿島建設	1,100	2,370.00	2,607,000	
不動テトラ	100	2,010.00	201,000	
西松建設	100	3,516.00	351,600	
三井住友建設	400	387.00	154,800	
奥村組	100	4,400.00	440,000	
東鉄工業	100	2,893.00	289,300	
戸田建設	600	799.40	479,640	
熊谷組	100	3,625.00	362,500	
矢作建設工業	100	1,253.00	125,300	
ピーエス三菱	100	800.00	80,000	
日本ハウスホールディングス	200	367.00	73,400	
大東建託	200	15,465.00	3,093,000	
新日本建設	100	1,194.00	119,400	
日本国土開発	200	590.00	118,000	
東洋建設	200	1,227.00	245,400	
五洋建設	700	841.90	589,330	
世紀東急工業	100	1,573.00	157,300	
住友林業	400	3,492.00	1,396,800	
大和ハウス工業	1,300	3,982.00	5,176,600	
ライト工業	100	1,923.00	192,300	
積水ハウス	1,500	2,866.00	4,299,000	
日特建設	100	1,044.00	104,400	
北陸電気工事	100	979.00	97,900	
ユアテック	100	940.00	94,000	
中電工	100	2,372.00	237,200	
関電工	200	1,320.00	264,000	
きんでん	300	2,101.00	630,300	
東京エネシス	100	963.00	96,300	
日本電設工業	100	2,025.00	202,500	
エクシオグループ	200	2,995.00	599,000	
九電工	100	4,439.00	443,900	
三機工業	100	1,650.00	165,000	
日揮ホールディングス	500	1,835.00	917,500	
高砂熱学工業	100	2,802.00	280,200	
NECネットエスアイ	200	1,977.00	395,400	
明星工業	100	1,009.00	100,900	
大気社	100	4,445.00	444,500	
ニッポン	100	2,145.00	214,500	
日清製粉グループ本社	400	1,810.50	724,200	
中部飼料	100	1,074.00	107,400	
フィード・ワン	100	755.00	75,500	
LIFULL	200	226.00	45,200	
MIXI	100	2,289.00	228,900	
ジェイエイシーリクルートメント	100	2,338.00	233,800	
日本M&Aセンターホールディングス	900	665.30	598,770	
UTグループ	100	1,932.00	193,200	
E・Jホールディングス	100	1,491.00	149,100	
オープンアップグループ	200	1,869.00	373,800	
コシダカホールディングス	200	1,009.00	201,800	
パソナグループ	100	1,362.00	136,200	

リンクアンドモチベーション	200	376.00	75,200	
エス・エム・エス	200	2,275.00	455,000	
パーソルホールディングス	6,000	216.40	1,298,400	
森永製菓	100	5,172.00	517,200	
江崎グリコ	100	4,168.00	416,800	
山崎製パン	300	2,690.00	807,000	
寿スピリッツ	500	2,053.00	1,026,500	
カルビー	200	2,696.00	539,200	
森永乳業	100	5,460.00	546,000	
六甲バター	100	1,360.00	136,000	
ヤクルト本社	600	3,540.00	2,124,000	
明治ホールディングス	600	3,688.00	2,212,800	
雪印メグミルク	100	2,259.00	225,900	
プリマハム	100	2,267.00	226,700	
日本ハム	200	4,273.00	854,600	
丸大食品	100	1,617.00	161,700	
S Foods	100	3,115.00	311,500	
システナ	900	253.00	227,700	
日鉄ソリューションズ	100	4,090.00	409,000	
総合警備保障	900	850.60	765,540	
キューブシステム	100	1,067.00	106,700	
いちご	600	328.00	196,800	
日本駐車場開発	500	207.00	103,500	
コア	100	1,665.00	166,500	
カカクコム	400	1,414.00	565,600	
ルネサンス	100	855.00	85,500	
ディップ	100	2,935.00	293,500	
新日本科学	100	1,682.00	168,200	
ベネフィット・ワン	200	970.90	194,180	
エムスリー	1,000	2,399.50	2,399,500	
アウトソーシング	300	1,095.00	328,500	
ディー・エヌ・エー	200	1,435.00	287,000	
博報堂DYホールディングス	600	1,213.00	727,800	
エスプール	200	325.00	65,000	
アドウェイズ	100	535.00	53,500	
バリューコマース	100	1,225.00	122,500	
インフォマート	500	369.00	184,500	
サッポロホールディングス	200	5,057.00	1,011,400	
アサヒグループホールディングス	1,100	5,281.00	5,809,100	
麒麟ホールディングス	2,000	2,071.50	4,143,000	
宝ホールディングス	300	1,216.50	364,950	
オエノンホールディングス	200	382.00	76,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	400	1,887.00	754,800	
サントリー食品インターナショナル	300	4,378.00	1,313,400	
伊藤園	200	4,839.00	967,800	
キーコーヒー	100	2,014.00	201,400	
日清オイリオグループ	100	4,000.00	400,000	
不二製油グループ本社	100	2,233.00	223,300	
J-オイルミルズ	100	1,706.00	170,600	

ローソン	100	6,935.00	693,500	
エービーシー・マート	200	2,332.00	466,400	
アスクル	100	2,014.00	201,400	
ゲオホールディングス	100	2,115.00	211,500	
アダストリア	100	3,050.00	305,000	
くら寿司	100	3,255.00	325,500	
エレマテック	100	1,755.00	175,500	
パルグループホールディングス	100	1,709.00	170,900	
エディオン	200	1,474.00	294,800	
サーラコーポレーション	100	721.00	72,100	
J Pホールディングス	200	334.00	66,800	
ひらまつ	200	243.00	48,600	
円谷フィールズホールディングス	100	1,558.00	155,800	
双日	500	3,109.00	1,554,500	
アルフレッサ ホールディングス	500	2,381.50	1,190,750	
キッコーマン	300	8,228.00	2,468,400	
味の素	1,200	5,565.00	6,678,000	
キューピー	300	2,556.00	766,800	
ハウス食品グループ本社	100	3,120.00	312,000	
カゴメ	200	3,077.00	615,400	
ニチレイ	200	3,214.00	642,800	
横浜冷凍	200	1,154.00	230,800	
東洋水産	200	5,980.00	1,196,000	
日清食品ホールディングス	200	12,240.00	2,448,000	
フジッコ	100	1,893.00	189,300	
ロック・フィールド	100	1,522.00	152,200	
日本たばこ産業	2,900	3,423.00	9,926,700	
ファーマフーズ	100	1,400.00	140,000	
北の達人コーポレーション	200	197.00	39,400	
ユーグレナ	300	729.00	218,700	
紀文食品	100	1,111.00	111,100	
片倉工業	100	1,747.00	174,700	
ヒューリック	1,100	1,345.50	1,480,050	
アルペン	100	1,923.00	192,300	
クオールホールディングス	100	1,685.00	168,500	
アルコニックス	100	1,340.00	134,000	
神戸物産	400	3,768.00	1,507,200	
ビックカメラ	300	1,084.00	325,200	
DCMホールディングス	300	1,199.00	359,700	
ペッパーフードサービス	100	113.00	11,300	
MonotaRO	700	1,215.50	850,850	
あい ホールディングス	100	2,323.00	232,300	
J.フロント リテイリング	700	1,385.00	969,500	
ドトール・日レスホールディングス	100	2,114.00	211,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	900	2,560.00	2,304,000	
ZOZO	300	2,792.00	837,600	
物語コーポレーション	100	3,605.00	360,500	
三越伊勢丹ホールディングス	900	1,632.00	1,468,800	
東洋紡	200	1,011.50	202,300	
日清紡ホールディングス	400	1,089.00	435,600	

ダイワボウホールディングス	200	2,790.00	558,000	
日東紡績	100	3,550.00	355,000	
トヨタ紡織	200	2,549.00	509,800	
マクニカホールディングス	100	7,190.00	719,000	
ウエルシアホールディングス	300	2,373.50	712,050	
クリエイトSDホールディングス	100	3,230.00	323,000	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	100	987.00	98,700	
八洲電機	100	1,252.00	125,200	
レスターホールディングス	100	2,480.00	248,000	
TOKAIホールディングス	200	941.00	188,200	
三洋貿易	100	1,295.00	129,500	
オイシックス・ラ・大地	100	1,143.00	114,300	
ネクステージ	100	2,110.00	211,000	
ジョイフル本田	200	1,754.00	350,800	
すかいらーくホールディングス	700	2,095.00	1,466,500	
綿半ホールディングス	100	1,299.00	129,900	
日本毛織	100	1,388.00	138,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	200	1,043.00	208,600	
野村不動産ホールディングス	300	3,687.00	1,106,100	
サムティ	100	2,436.00	243,600	
ディア・ライフ	100	757.00	75,700	
地主	100	1,944.00	194,400	
プレゼンスコーポレーション	100	1,670.00	167,000	
JPMC	100	1,127.00	112,700	
フージャースホールディングス	100	1,051.00	105,100	
オープンハウスグループ	200	4,754.00	950,800	
東急不動産ホールディングス	1,500	884.50	1,326,750	
飯田グループホールディングス	400	2,312.00	924,800	
帝国繊維	100	1,834.00	183,400	
あさひ	100	1,252.00	125,200	
コスモス薬品	100	14,265.00	1,426,500	
シップヘルスケアホールディングス	200	2,150.00	430,000	
セブン&アイ・ホールディングス	1,800	5,227.00	9,408,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	400	984.00	393,600	
ツルハホールディングス	100	10,530.00	1,053,000	
サンマルクホールディングス	100	1,859.00	185,900	
トリドールホールディングス	100	3,450.00	345,000	
帝人	500	1,372.00	686,000	
東レ	3,300	726.30	2,396,790	
クラレ	700	1,701.50	1,191,050	
旭化成	3,100	924.70	2,866,570	
トーカロ	200	1,370.00	274,000	
SUMCO	900	1,953.50	1,758,150	
グッドコムアセット	100	994.00	99,400	
JMホールディングス	100	1,934.00	193,400	
コメダホールディングス	100	2,667.00	266,700	
アレンザホールディングス	100	991.00	99,100	

FOOD & LIFE COMPANIES	300	2,486.50	745,950	
セーレン	100	2,140.00	214,000	
小松マテーレ	100	720.00	72,000	
ワコールホールディングス	100	3,442.00	344,200	
ホギメディカル	100	3,230.00	323,000	
T S Iホールディングス	200	767.00	153,400	
ワールド	100	1,532.00	153,200	
T I S	500	3,142.00	1,571,000	
グリー	200	561.00	112,200	
コーエーテックモホールディングス	300	2,026.50	607,950	
ネクソン	1,100	2,500.00	2,750,000	
アイスタイル	200	433.00	86,600	
エムアップホールディングス	100	1,147.00	114,700	
コロブラ	200	581.00	116,200	
オルトプラス	100	187.00	18,700	
ブロードリーフ	300	518.00	155,400	
じげん	200	506.00	101,200	
フィックスターズ	100	1,000.00	100,000	
オブティム	100	806.00	80,600	
テクマトリックス	100	1,487.00	148,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	100	2,303.50	230,350	
GMOペイメントゲートウェイ	100	6,281.00	628,100	
インターネットイニシアティブ	300	2,452.00	735,600	
さくらインターネット	100	1,119.00	111,900	
朝日ネット	100	603.00	60,300	
e B A S E	100	652.00	65,200	
アバントグループ	100	1,208.00	120,800	
コムチュア	100	2,128.00	212,800	
王子ホールディングス	2,000	618.20	1,236,400	
日本製紙	300	1,288.00	386,400	
北越コーポレーション	300	1,037.00	311,100	
大王製紙	200	1,197.00	239,400	
メディカル・データ・ビジョン	100	687.00	68,700	
ラクス	200	1,800.50	360,100	
レンゴー	400	992.70	397,080	
チェンジホールディングス	100	1,507.00	150,700	
マクロミル	100	667.00	66,700	
マネーフォワード	100	3,772.00	377,200	
レゾナック・ホールディングス	500	2,457.50	1,228,750	
住友化学	3,600	402.20	1,447,920	
日産化学	200	6,359.00	1,271,800	
石原産業	100	1,435.00	143,500	
日本曹達	100	5,420.00	542,000	
東ソー	600	1,788.50	1,073,100	
トクヤマ	200	2,251.50	450,300	
セントラル硝子	100	2,918.00	291,800	
東亜合成	300	1,338.50	401,550	
関東電化工業	100	810.00	81,000	

デンカ	200	2,716.00	543,200
イビデン	300	7,414.00	2,224,200
信越化学工業	4,100	4,297.00	17,617,700
第一稀元素化学工業	100	937.00	93,700
エア・ウォーター	500	1,845.50	922,750
日本酸素ホールディングス	500	3,697.00	1,848,500
日本パーカライズング	200	1,094.00	218,800
高圧ガス工業	100	768.00	76,800
四国化成ホールディングス	100	1,703.00	170,300
日本触媒	100	5,445.00	544,500
カネカ	100	3,740.00	374,000
協和キリン	600	2,374.00	1,424,400
A P P I E R G R O U P	200	1,375.00	275,000
三菱瓦斯化学	400	2,019.50	807,800
三井化学	400	3,656.00	1,462,400
J S R	500	4,010.00	2,005,000
東京応化工業	100	8,603.00	860,300
三菱ケミカルグループ	3,300	855.20	2,822,160
K H ネオケム	100	2,226.00	222,600
ダイセル	700	1,226.50	858,550
住友ベークライト	100	6,659.00	665,900
積水化学工業	1,000	2,019.50	2,019,500
日本ゼオン	300	1,507.00	452,100
アイカ工業	100	3,276.00	327,600
U B E	200	2,287.50	457,500
積水樹脂	100	2,423.00	242,300
タキロンシーアイ	100	564.00	56,400
リケンテクノス	100	719.00	71,900
積水化成成品工業	100	439.00	43,900
ダイキョーニシカワ	100	762.00	76,200
日本化薬	400	1,263.50	505,400
プレステージ・インターナショナル	200	599.00	119,800
プロトコーポレーション	100	1,111.00	111,100
野村総合研究所	1,000	3,739.00	3,739,000
電通グループ	500	4,416.00	2,208,000
インテージホールディングス	100	1,767.00	176,700
ソースネクスト	300	175.00	52,500
シーティーエス	100	676.00	67,600
インフォコム	100	2,607.00	260,700
トリケミカル研究所	100	3,325.00	332,500
シンプレクス・ホールディングス	100	2,646.00	264,600
ラクスル	100	1,138.00	113,800
メルカリ	300	3,054.00	916,200
A D E K A	200	2,652.00	530,400
日油	200	6,006.00	1,201,200
ウイングアーク1st	100	2,746.00	274,600
S a n s a n	200	1,102.00	220,400
花王	1,100	5,444.00	5,988,400
メドレー	100	4,230.00	423,000
J M D C	100	4,870.00	487,000

武田薬品工業	4,300	4,352.00	18,713,600
アステラス製薬	4,600	1,882.00	8,657,200
住友ファーマ	400	480.00	192,000
塩野義製薬	600	6,993.00	4,195,800
日本新薬	100	5,510.00	551,000
中外製薬	1,500	4,548.00	6,822,000
科研製薬	100	3,344.00	334,400
エーザイ	600	8,085.00	4,851,000
ロート製薬	500	3,395.00	1,697,500
小野薬品工業	900	2,631.50	2,368,350
久光製薬	100	4,806.00	480,600
持田製薬	100	3,310.00	331,000
参天製薬	900	1,294.50	1,165,050
ツムラ	200	2,621.00	524,200
テルモ	1,500	3,869.00	5,803,500
H・U・グループホールディングス	200	2,444.50	488,900
キッセイ薬品工業	100	3,210.00	321,000
生化学工業	100	769.00	76,900
栄研化学	100	1,463.00	146,300
JCRファーマ	200	1,115.50	223,100
東和薬品	100	2,681.00	268,100
ゼリア新薬工業	100	2,008.00	200,800
そーせいグループ	200	1,344.00	268,800
第一三共	4,300	4,095.00	17,608,500
杏林製薬	100	1,785.00	178,500
大幸薬品	100	328.00	32,800
大塚ホールディングス	1,000	4,980.00	4,980,000
大正製薬ホールディングス	100	5,926.00	592,600
ペプチドリーム	200	1,256.00	251,200
大日本塗料	100	939.00	93,900
日本ペイントホールディングス	2,600	965.50	2,510,300
関西ペイント	400	2,177.50	871,000
中国塗料	100	1,317.00	131,700
太陽ホールディングス	100	2,460.00	246,000
D I C	200	2,385.50	477,100
サカタインクス	100	1,222.00	122,200
東洋インキS Cホールディングス	100	2,464.00	246,400
アルプス技研	100	2,527.00	252,700
サニックス	100	310.00	31,000
日本空調サービス	100	762.00	76,200
オリエンタルランド	2,700	4,578.00	12,360,600
フォーカスシステムズ	100	967.00	96,700
ダスキン	100	3,250.00	325,000
パーク24	300	1,659.00	497,700
明光ネットワークジャパン	100	695.00	69,500
フジ・メディア・ホールディングス	500	1,510.00	755,000
ラウンドワン	400	534.00	213,600
リゾートトラスト	200	2,097.00	419,400
オービック	200	22,290.00	4,458,000
ジャストシステム	100	2,728.50	272,850

LINEヤフー	7,000	382.30	2,676,100
ビー・エム・エル	100	2,749.00	274,900
トレンドマイクロ	200	5,597.00	1,119,400
リソー教育	300	257.00	77,100
日本オラクル	100	10,575.00	1,057,500
フューチャー	100	1,446.00	144,600
ユー・エス・エス	500	2,586.50	1,293,250
オービックビジネスコンサルタント	100	6,060.00	606,000
伊藤忠テクノソリューションズ	100	4,321.00	432,100
アイティフォー	100	1,067.00	106,700
サイバーエージェント	1,100	777.90	855,690
楽天グループ	4,300	575.00	2,472,500
テー・オー・ダブリュー	300	309.00	92,700
大塚商会	200	5,952.00	1,190,400
サイボウズ	100	1,701.00	170,100
セントラルスポーツ	100	2,369.00	236,900
電通国際情報サービス	100	5,210.00	521,000
デジタルガレージ	100	2,809.00	280,900
C I J	100	534.00	53,400
WOWOW	100	1,090.00	109,000
スカラ	100	753.00	75,300
フルキャストホールディングス	100	1,699.00	169,900
エン・ジャパン	100	2,125.00	212,500
あすか製薬ホールディングス	100	1,717.00	171,700
サワイグループホールディングス	100	4,575.00	457,500
富士フイルムホールディングス	900	8,470.00	7,623,000
コニカミノルタ	1,100	450.20	495,220
資生堂	1,000	4,711.00	4,711,000
ライオン	600	1,418.00	850,800
マンダム	100	1,350.00	135,000
ミルボン	100	4,001.00	400,100
ファンケル	200	2,224.00	444,800
コーセー	100	10,015.00	1,001,500
コタ	100	1,625.00	162,500
ポーラ・オルビスホールディングス	300	1,664.50	499,350
エステー	100	1,497.00	149,700
コニシ	100	2,179.00	217,900
長谷川香料	100	3,070.00	307,000
小林製薬	100	6,165.00	616,500
荒川化学工業	100	1,010.00	101,000
タカラバイオ	100	1,287.00	128,700
J C U	100	3,165.00	316,500
デクセリアルズ	100	3,740.00	374,000
北興化学工業	100	913.00	91,300
クミアイ化学工業	200	1,149.00	229,800
日本農薬	100	650.00	65,000
ニチレキ	100	2,038.00	203,800
富士石油	100	326.00	32,600
出光興産	500	3,332.00	1,666,000
ENEOSホールディングス	8,400	565.00	4,746,000

コスモエネルギーホールディングス	200	5,324.00	1,064,800	
テスホールディングス	100	478.00	47,800	
インフロニア・ホールディングス	500	1,541.50	770,750	
横浜ゴム	300	2,849.50	854,850	
TOYO TIRE	300	2,225.00	667,500	
ブリヂストン	1,400	5,808.00	8,131,200	
住友ゴム工業	500	1,490.00	745,000	
アキレス	100	1,503.00	150,300	
ニッタ	100	3,390.00	339,000	
住友理工	100	1,017.00	101,700	
三ツ星ベルト	100	4,450.00	445,000	
バンドー化学	100	1,514.00	151,400	
AGC	500	5,169.00	2,584,500	
日本板硝子	300	685.00	205,500	
日本電気硝子	200	2,770.00	554,000	
住友大阪セメント	100	3,501.00	350,100	
太平洋セメント	300	2,514.50	754,350	
日本コンクリート工業	200	300.00	60,000	
アジアパイルホールディングス	100	679.00	67,900	
東海カーボン	500	1,134.00	567,000	
TOTO	300	3,674.00	1,102,200	
日本碍子	600	1,774.00	1,064,400	
日本特殊陶業	400	3,184.00	1,273,600	
フジインコーポレーテッド	100	2,920.00	292,000	
ニチアス	100	3,020.00	302,000	
日本製鉄	2,300	3,219.00	7,403,700	
神戸製鋼所	1,000	1,788.00	1,788,000	
中山製鋼所	100	848.00	84,800	
JFEホールディングス	1,400	2,069.50	2,897,300	
東京製鉄	100	1,637.00	163,700	
共英製鋼	100	1,854.00	185,400	
大和工業	100	6,969.00	696,900	
淀川製鋼所	100	3,525.00	352,500	
丸一鋼管	200	3,649.00	729,800	
大同特殊鋼	100	5,895.00	589,500	
山陽特殊製鋼	100	2,646.00	264,600	
新日本電工	300	288.00	86,400	
日本製鋼所	100	2,539.50	253,950	
大紀アルミニウム工業所	100	1,214.00	121,400	
日本軽金属ホールディングス	100	1,583.00	158,300	
三井金属鉱業	100	3,762.00	376,200	
三菱マテリアル	300	2,325.00	697,500	
住友金属鉱山	600	4,138.00	2,482,800	
DOWAホールディングス	100	4,500.00	450,000	
古河機械金属	100	1,907.00	190,700	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	3,120.00	312,000	
東邦チタニウム	100	1,818.00	181,800	
UACJ	100	3,000.00	300,000	
古河電気工業	200	2,245.50	449,100	
住友電気工業	1,700	1,606.00	2,730,200	

フジクラ	500	1,135.50	567,750
S W C C	100	1,998.00	199,800
タツタ電線	100	694.00	69,400
いよぎんホールディングス	600	1,066.50	639,900
しずおかフィナンシャルグループ	1,100	1,236.00	1,359,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	400	1,155.00	462,000
楽天銀行	200	2,390.00	478,000
京都フィナンシャルグループ	200	8,461.00	1,692,200
リョービ	100	2,682.00	268,200
A R E ホールディングス	200	1,880.00	376,000
東洋製罐グループホールディングス	300	2,460.50	738,150
横河ブリッジホールディングス	100	2,657.00	265,700
三和ホールディングス	500	2,028.00	1,014,000
文化シャッター	200	1,130.00	226,000
三協立山	100	775.00	77,500
L I X I L	700	1,616.50	1,131,550
ノーリツ	100	1,565.00	156,500
長府製作所	100	2,105.00	210,500
リンナイ	300	2,688.00	806,400
ユニプレス	100	1,048.00	104,800
日東精工	100	573.00	57,300
岡部	100	718.00	71,800
ジーテクト	100	1,738.00	173,800
東プレ	100	1,603.00	160,300
高周波熱錬	100	1,012.00	101,200
パイオラックス	100	2,147.00	214,700
エイチワン	100	789.00	78,900
日本発条	500	1,049.50	524,750
三浦工業	200	2,953.00	590,600
タクマ	100	1,467.00	146,700
テクノプロ・ホールディングス	300	2,953.00	885,900
ジャパンマテリアル	200	2,364.00	472,800
ベクトル	100	1,128.00	112,800
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,089.00	108,900
パリュウHR	100	1,212.00	121,200
シグマクシス・ホールディングス	100	1,455.00	145,500
ウィルグループ	100	1,095.00	109,500
メドピア	100	955.00	95,500
リクルートホールディングス	3,700	4,498.00	16,642,600
エラン	100	749.00	74,900
ツガミ	100	1,115.00	111,500
オークマ	100	6,502.00	650,200
アマダ	800	1,470.50	1,176,400
アイダエンジニアリング	100	925.00	92,500
F U J I	200	2,355.50	471,100
牧野フライス製作所	100	6,200.00	620,000
オーエスジー	200	1,716.00	343,200
旭ダイヤモンド工業	100	813.00	81,300
D M G 森精機	300	2,467.50	740,250
ソディック	100	764.00	76,400

ディスコ	200	28,000.00	5,600,000
日進工具	100	1,078.00	107,800
日本郵政	6,100	1,278.50	7,798,850
ベルシステム24ホールディングス	100	1,476.00	147,600
鎌倉新書	100	590.00	59,000
ソラスト	200	561.00	112,200
インソース	100	852.00	85,200
豊田自動織機	400	11,140.00	4,456,000
島精機製作所	100	1,623.00	162,300
オプトラン	100	1,829.00	182,900
フリー	100	1,427.00	142,700
ヤマシンフィルタ	100	304.00	30,400
日阪製作所	100	956.00	95,600
やまびこ	100	1,387.00	138,700
ナブテスコ	300	2,692.00	807,600
三井海洋開発	100	1,689.00	168,900
レオン自動機	100	1,320.00	132,000
S M C	200	70,110.00	14,022,000
オイレス工業	100	1,927.00	192,700
サトーホールディングス	100	2,044.00	204,400
日精樹脂工業	100	1,029.00	102,900
小松製作所	2,300	3,810.00	8,763,000
住友重機械工業	300	3,533.00	1,059,900
日立建機	200	4,089.00	817,800
日工	100	659.00	65,900
井関農機	100	1,098.00	109,800
T O W A	100	5,370.00	537,000
クボタ	2,600	2,018.00	5,246,800
東洋エンジニアリング	100	585.00	58,500
月島ホールディングス	100	1,253.00	125,300
新東工業	100	1,041.00	104,100
澁谷工業	100	2,450.00	245,000
小森コーポレーション	100	1,039.00	103,900
荏原製作所	200	6,556.00	1,311,200
北越工業	100	1,876.00	187,600
ダイキン工業	600	22,015.00	13,209,000
オルガノ	100	3,935.00	393,500
栗田工業	300	4,332.00	1,299,600
椿本チエイン	100	3,840.00	384,000
日機装	100	927.00	92,700
レイズネクスト	100	1,450.00	145,000
アネスト岩田	100	1,114.00	111,400
ダイフク	800	2,573.00	2,058,400
タダノ	300	1,156.00	346,800
フジテック	200	3,235.00	647,000
C K D	100	2,038.00	203,800
平和	200	2,115.00	423,000
S A N K Y O	100	6,260.00	626,000
日本金銭機械	100	965.00	96,500
竹内製作所	100	4,580.00	458,000

アマノ	100	3,156.00	315,600	
JUKI	100	594.00	59,400	
サンデン	100	186.00	18,600	
ジャノメ	100	690.00	69,000	
ブラザー工業	700	2,365.00	1,655,500	
マックス	100	2,534.00	253,400	
モリタホールディングス	100	1,554.00	155,400	
グローリー	100	2,780.00	278,000	
新晃工業	100	2,153.00	215,300	
大和冷機工業	100	1,322.00	132,200	
セガサミーホールディングス	400	2,405.00	962,000	
T P R	100	1,738.00	173,800	
ホシザキ	300	4,825.00	1,447,500	
大豊工業	100	802.00	80,200	
日本精工	800	821.20	656,960	
NTN	1,000	270.30	270,300	
ジェイテクト	400	1,259.50	503,800	
ミネベアミツミ	900	2,352.00	2,116,800	
日本トムソン	200	549.00	109,800	
T H K	300	2,730.50	819,150	
前澤給装工業	100	1,266.00	126,600	
イーグル工業	100	1,648.00	164,800	
キッツ	200	1,015.00	203,000	
日立製作所	2,400	8,750.00	21,000,000	
東芝	1,000	4,601.00	4,601,000	
三菱電機	5,100	1,765.00	9,001,500	
富士電機	300	6,237.00	1,871,100	
安川電機	600	5,155.00	3,093,000	
シンフォニア テクノロジー	100	1,540.00	154,000	
明電舎	100	2,052.00	205,200	
P H C ホールディングス	100	1,443.00	144,300	
ソシオネクスト	100	14,830.00	1,483,000	
ベイカレント・コンサルティング	400	3,969.00	1,587,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	200	1,915.00	383,000	
三櫻工業	100	878.00	87,800	
マキタ	600	3,616.00	2,169,600	
東芝テック	100	3,165.00	316,500	
マブチモーター	100	4,355.00	435,500	
ニデック	1,200	6,699.00	8,038,800	
ダブル・スコープ	100	986.00	98,600	
ヤーマン	100	1,018.00	101,800	
J V C ケンウッド	500	626.00	313,000	
ミマキエンジニアリング	100	748.00	74,800	
大崎電気工業	100	635.00	63,500	
オムロン	500	6,210.00	3,105,000	
日東工業	100	3,455.00	345,500	
I D E C	100	2,792.00	279,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	200	2,440.00	488,000	
日本電気	700	7,636.00	5,345,200	

富士通	500	17,020.00	8,510,000	
沖電気工業	200	945.00	189,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,200	2,249.00	7,196,800	
セイコーエプソン	600	2,309.00	1,385,400	
ワコム	400	559.00	223,600	
アルバック	100	5,483.00	548,300	
ジャパンディスプレイ	2,200	38.00	83,600	
日本信号	100	914.00	91,400	
京三製作所	100	484.00	48,400	
能美防災	100	1,772.00	177,200	
エレコム	100	1,735.00	173,500	
パナソニック ホールディングス	5,800	1,487.50	8,627,500	
シャープ	600	934.40	560,640	
アンリツ	400	997.10	398,840	
富士通ゼネラル	100	2,655.50	265,550	
ソニーグループ	3,500	12,555.00	43,942,500	
T D K	800	5,606.00	4,484,800	
タムラ製作所	200	500.00	100,000	
アルプスアルパイン	400	1,236.50	494,600	
日本電波工業	100	1,216.00	121,600	
メイコー	100	3,225.00	322,500	
フォスター電機	100	948.00	94,800	
ホシデン	100	1,750.00	175,000	
ヒロセ電機	100	17,820.00	1,782,000	
日本航空電子工業	100	2,876.00	287,600	
T O A	100	1,057.00	105,700	
マクセル	100	1,605.00	160,500	
古野電気	100	1,585.00	158,500	
スミダコーポレーション	100	1,321.00	132,100	
横河電機	500	2,711.50	1,355,750	
アズビル	300	4,492.00	1,347,600	
日本光電工業	200	3,571.00	714,200	
堀場製作所	100	7,790.00	779,000	
アドバンテスト	1,600	4,259.00	6,814,400	
キーエンス	500	54,630.00	27,315,000	
シスメックス	400	7,056.00	2,822,400	
日本マイクロニクス	100	2,349.00	234,900	
デンソー	4,000	2,312.50	9,250,000	
コーセル	100	1,155.00	115,500	
オプテックスグループ	100	1,669.00	166,900	
レーザーテック	200	26,500.00	5,300,000	
スタンレー電気	300	2,388.00	716,400	
ウシオ電機	300	1,935.50	580,650	
古河電池	100	923.00	92,300	
日本電子	100	4,841.00	484,100	
カシオ計算機	400	1,184.50	473,800	
ファナック	2,400	3,823.00	9,175,200	
日本シイエムケイ	100	668.00	66,800	
大真空	100	738.00	73,800	
ローム	800	2,724.50	2,179,600	

浜松ホトニクス	400	5,921.00	2,368,400
三井ハイテック	100	6,730.00	673,000
新光電気工業	200	5,476.00	1,095,200
京セラ	800	7,324.00	5,859,200
太陽誘電	200	3,472.00	694,400
村田製作所	4,500	2,632.00	11,844,000
双葉電子工業	100	507.00	50,700
日東電工	400	9,414.00	3,765,600
東海理化電機製作所	100	2,204.00	220,400
ニチコン	100	1,274.00	127,400
日本ケミコン	100	1,295.00	129,500
K O A	100	1,661.00	166,100
三井E & S	300	432.00	129,600
日立造船	400	793.00	317,200
三菱重工業	900	7,914.00	7,122,600
川崎重工業	400	3,433.00	1,373,200
I H I	300	2,821.00	846,300
名村造船所	100	816.00	81,600
アンビスホールディングス	100	2,312.00	231,200
カーブスホールディングス	200	653.00	130,600
三菱ロジスネクスト	100	1,214.00	121,400
F P G	200	1,273.00	254,600
全国保証	100	4,888.00	488,800
めぶきフィナンシャルグループ	2,400	425.90	1,022,160
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	4,435.00	443,500
九州フィナンシャルグループ	900	886.00	797,400
かんぽ生命保険	600	2,717.00	1,630,200
ゆうちょ銀行	1,300	1,334.00	1,734,200
富山第一銀行	200	934.00	186,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,600	689.00	1,791,400
西日本フィナンシャルホールディングス	300	1,728.00	518,400
アルヒ	100	823.00	82,300
プレミアグループ	100	1,398.00	139,800
日産自動車	7,000	600.90	4,206,300
いすゞ自動車	1,400	1,771.00	2,479,400
トヨタ自動車	26,900	2,617.00	70,397,300
日野自動車	600	531.40	318,840
三菱自動車工業	1,900	524.40	996,360
武蔵精密工業	100	1,462.00	146,200
日産車体	100	808.00	80,800
新明和工業	200	1,211.00	242,200
極東開発工業	100	1,767.00	176,700
曙ブレーキ工業	400	126.00	50,400
タチエス	100	1,609.00	160,900
N O K	200	1,887.00	377,400
フタバ産業	200	696.00	139,200
カヤバ	100	4,375.00	437,500
市光工業	100	529.00	52,900

大同メタル工業	100	513.00	51,300
プレス工業	300	642.00	192,600
太平洋工業	100	1,353.00	135,300
アイシン	400	5,386.00	2,154,400
マツダ	1,600	1,513.50	2,421,600
本田技研工業	12,000	1,632.00	19,584,000
スズキ	900	5,788.00	5,209,200
S U B A R U	1,600	2,683.50	4,293,600
ヤマハ発動機	700	3,778.00	2,644,600
小糸製作所	600	2,219.50	1,331,700
エクセディ	100	2,486.00	248,600
ミツバ	100	682.00	68,200
豊田合成	100	2,953.00	295,300
愛三工業	100	1,160.00	116,000
ヨロズ	100	890.00	89,000
エフ・シー・シー	100	1,768.00	176,800
シマノ	200	20,570.00	4,114,000
テイ・エス テック	200	1,663.50	332,700
三十三フィナンシャルグループ	100	1,853.00	185,300
第四北越フィナンシャルグループ	100	3,790.00	379,000
ひろぎんホールディングス	600	942.70	565,620
十六フィナンシャルグループ	100	3,805.00	380,500
北國フィナンシャルホールディングス	100	5,150.00	515,000
ネットプロテクションズホールディングス	200	275.00	55,000
プロクレアホールディングス	100	1,884.00	188,400
あいちフィナンシャルグループ	100	2,367.00	236,700
小野建	100	1,662.00	166,200
ノジマ	200	1,306.00	261,200
カッパ・クリエイト	100	1,543.00	154,300
コンドーテック	100	1,113.00	111,300
ナガイレーベン	100	2,061.00	206,100
良品計画	600	2,001.00	1,200,600
第一興商	200	2,252.00	450,400
メディカルホールディングス	500	2,485.00	1,242,500
アドヴァングループ	100	1,014.00	101,400
アズワン	100	4,694.00	469,400
ドウシシャ	100	2,170.00	217,000
G - 7ホールディングス	100	1,181.00	118,100
イオン北海道	100	865.00	86,500
コジマ	100	633.00	63,300
コーナン商事	100	3,935.00	393,500
ネットワンシステムズ	200	2,663.50	532,700
ワタミ	100	1,116.00	111,600
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	1,000	2,825.50	2,825,500
丸文	100	1,138.00	113,800
西松屋チェーン	100	1,863.00	186,300
ゼンショーホールディングス	300	7,032.00	2,109,600
幸楽苑ホールディングス	100	1,091.00	109,100

日本ライフライン	200	1,110.00	222,000
サイゼリヤ	100	5,690.00	569,000
VTホールディングス	200	503.00	100,600
アルゴグラフィックス	100	3,135.00	313,500
IDOM	200	857.00	171,400
ユナイテッドアローズ	100	1,879.00	187,900
ハイデイ日高	100	2,577.00	257,700
シークス	100	1,445.00	144,500
コロワイド	200	2,255.50	451,100
スギホールディングス	100	5,667.00	566,700
島津製作所	600	3,701.00	2,220,600
スター精密	100	1,843.00	184,300
東京計器	100	1,474.00	147,400
東京精密	100	7,080.00	708,000
マニー	200	2,058.00	411,600
ニコン	700	1,490.00	1,043,000
トプコン	300	1,705.00	511,500
オリンパス	3,000	1,965.50	5,896,500
SCREENホールディングス	200	7,243.00	1,448,600
HOYA	1,000	14,615.00	14,615,000
A&Dホロンホールディングス	100	1,555.00	155,500
朝日インテック	500	2,550.00	1,275,000
キヤノン	2,400	3,695.00	8,868,000
リコー	1,200	1,226.50	1,471,800
シチズン時計	500	881.00	440,500
メニコン	200	1,710.00	342,000
スノーピーク	100	1,021.00	102,100
パラマウントベッドホールディングス	100	2,369.00	236,900
ニホンフラッシュ	100	862.00	86,200
アートネイチャー	100	814.00	81,400
バンダイナムコホールディングス	1,300	3,107.00	4,039,100
SHOEI	100	2,089.00	208,900
フランスベッドホールディングス	100	1,184.00	118,400
マーベラス	100	685.00	68,500
パイロットコーポレーション	100	5,164.00	516,400
エイベックス	100	1,328.00	132,800
フジシールインターナショナル	100	1,678.00	167,800
タカラトミー	200	2,015.00	403,000
レック	100	990.00	99,000
三光合成	100	540.00	54,000
TOPPANホールディングス	600	3,302.00	1,981,200
大日本印刷	500	3,870.00	1,935,000
NISSHA	100	1,593.00	159,300
前澤化成工業	100	1,493.00	149,300
アシックス	400	4,646.00	1,858,400
ニチハ	100	2,940.00	294,000
エフピコ	100	2,577.50	257,750
ヤマハ	300	3,945.00	1,183,500
クリナップ	100	688.00	68,800
ビジョン	300	1,607.00	482,100

象印マホービン	100	1,516.00	151,600
リンテック	100	2,525.00	252,500
信越ポリマー	100	1,317.00	131,700
イトーキ	100	1,414.00	141,400
任天堂	3,100	6,101.00	18,913,100
三菱鉛筆	100	1,853.00	185,300
タカラスタンダード	100	1,800.00	180,000
コクヨ	200	2,346.00	469,200
ニフコ	200	3,729.00	745,800
オカムラ	100	2,134.00	213,400
伊藤忠商事	3,200	5,312.00	16,998,400
丸紅	4,000	2,215.50	8,862,000
スクロール	100	1,062.00	106,200
ヨンドシーホールディングス	100	1,893.00	189,300
長瀬産業	200	2,305.00	461,000
豊田通商	500	8,061.00	4,030,500
オンワードホールディングス	300	472.00	141,600
三共生興	100	810.00	81,000
兼松	200	1,940.00	388,000
美津濃	100	4,425.00	442,500
三井物産	3,600	5,518.00	19,864,800
東京エレクトロン	1,000	20,085.00	20,085,000
カメイ	100	1,420.00	142,000
セイコーグループ	100	2,351.00	235,100
山善	100	1,193.00	119,300
住友商事	3,100	2,951.00	9,148,100
B I P R O G Y	200	3,669.00	733,800
三菱商事	3,200	6,947.00	22,230,400
キヤノンマーケティングジャパン	100	3,863.00	386,300
佐藤商事	100	1,455.00	145,500
東京産業	100	819.00	81,900
阪和興業	100	4,410.00	441,000
R Y O D E N	100	2,336.00	233,600
ニプロ	400	1,085.00	434,000
岩谷産業	100	7,216.00	721,600
アステナホールディングス	200	528.00	105,600
三愛オブリ	100	1,604.00	160,400
稲畑産業	100	3,070.00	307,000
明和産業	100	641.00	64,100
ゴールドウイン	100	9,851.00	985,100
ユニ・チャーム	1,000	5,053.00	5,053,000
デサント	100	4,305.00	430,500
ワキタ	100	1,518.00	151,800
東邦ホールディングス	100	3,253.00	325,300
サンゲツ	100	2,860.00	286,000
ミツウロコグループホールディングス	100	1,287.00	128,700
伊藤忠エネクス	100	1,510.00	151,000
サンリオ	100	6,431.00	643,100
リョーサン	100	4,620.00	462,000
新光商事	100	1,160.00	116,000

東陽テクニカ	100	1,277.00	127,700
モスフードサービス	100	3,225.00	322,500
木曽路	100	2,520.00	252,000
S R S ホールディングス	100	1,023.00	102,300
千趣会	100	400.00	40,000
リテールパートナーズ	100	1,705.00	170,500
ケーヨー	100	1,297.00	129,700
上新電機	100	2,327.00	232,700
日本瓦斯	300	2,201.50	660,450
ロイヤルホールディングス	100	2,434.00	243,400
いなげや	100	1,591.00	159,100
リンガーハット	100	2,281.00	228,100
MrMaxHD	100	610.00	61,000
テンアライド	100	293.00	29,300
AOKIホールディングス	100	969.00	96,900
オークワ	100	825.00	82,500
コメリ	100	3,090.00	309,000
青山商事	100	1,417.00	141,700
しまむら	100	14,675.00	1,467,500
高島屋	400	1,972.50	789,000
松屋	100	906.00	90,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	300	1,591.00	477,300
丸井グループ	400	2,352.00	940,800
クレディセゾン	300	2,253.50	676,050
イオン	1,800	3,059.00	5,506,200
イズミ	100	3,803.00	380,300
平和堂	100	2,411.00	241,100
フジ	100	1,823.00	182,300
ヤオコー	100	7,489.00	748,900
ゼビオホールディングス	100	952.00	95,200
ケーズホールディングス	400	1,383.00	553,200
PALTAC	100	4,522.00	452,200
三谷産業	200	319.00	63,800
あおぞら銀行	300	2,858.50	857,550
三菱UFJフィナンシャル・グループ	30,200	1,235.00	37,297,000
りそなホールディングス	6,100	807.40	4,925,140
三井住友トラスト・ホールディングス	900	5,603.00	5,042,700
三井住友フィナンシャルグループ	3,400	7,190.00	24,446,000
千葉銀行	1,300	1,103.00	1,433,900
群馬銀行	1,000	693.90	693,900
武蔵野銀行	100	2,726.00	272,600
筑波銀行	300	281.00	84,300
七十七銀行	200	3,220.00	644,000
山形銀行	100	1,132.00	113,200
東邦銀行	400	277.00	110,800
ふくおかフィナンシャルグループ	400	3,742.00	1,496,800
スルガ銀行	400	628.00	251,200
八十二銀行	1,100	821.00	903,100
山梨中央銀行	100	1,765.00	176,500
大垣共立銀行	100	1,979.00	197,900

福井銀行	100	1,548.00	154,800
滋賀銀行	100	3,730.00	373,000
南都銀行	100	2,616.00	261,600
百五銀行	500	536.00	268,000
紀陽銀行	200	1,485.00	297,000
ほくほくフィナンシャルグループ	300	1,652.00	495,600
山陰合同銀行	300	992.00	297,600
四国銀行	100	1,029.00	102,900
阿波銀行	100	2,357.00	235,700
琉球銀行	100	1,183.00	118,300
セブン銀行	1,700	293.80	499,460
みずほフィナンシャルグループ	7,000	2,546.00	17,822,000
山口フィナンシャルグループ	500	1,292.50	646,250
みずほリース	100	4,715.00	471,500
東京センチュリー	100	5,831.00	583,100
SBIホールディングス	700	3,121.00	2,184,700
日本証券金融	200	1,481.00	296,200
アイフル	800	386.00	308,800
北洋銀行	700	361.00	252,700
愛媛銀行	100	1,058.00	105,800
京葉銀行	200	661.00	132,200
栃木銀行	200	325.00	65,000
東和銀行	100	659.00	65,900
イオンフィナンシャルサービス	300	1,226.00	367,800
アコム	900	353.90	318,510
ジャックス	100	5,140.00	514,000
オリエントコーポレーション	100	1,112.00	111,200
オリックス	3,200	2,699.50	8,638,400
三菱HCキャピタル	1,900	959.60	1,823,240
ジャフコグループ	200	1,547.00	309,400
トモニホールディングス	400	474.00	189,600
大和証券グループ本社	3,400	851.30	2,894,420
野村ホールディングス	8,700	581.50	5,059,050
岡三証券グループ	400	705.00	282,000
丸三証券	200	803.00	160,600
東洋証券	200	324.00	64,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	500	497.00	248,500
水戸証券	100	452.00	45,200
いちよし証券	100	718.00	71,800
松井証券	200	754.00	150,800
SOMPOホールディングス	800	6,370.00	5,096,000
日本取引所グループ	1,400	2,954.00	4,135,600
マネックスグループ	500	638.00	319,000
極東証券	100	1,000.00	100,000
岩井コスモホールディングス	100	1,733.00	173,300
アイザワ証券グループ	100	1,140.00	114,000
フィデアホールディングス	100	1,584.00	158,400
池田泉州ホールディングス	600	329.00	197,400
アニコムホールディングス	200	556.00	111,200

MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	1,000	5,427.00	5,427,000	
スパークス・グループ	100	1,428.00	142,800	
第一生命ホールディングス	2,400	3,089.00	7,413,600	
東京海上ホールディングス	4,800	3,353.00	16,094,400	
イー・ギャランティ	100	1,753.00	175,300	
T & Dホールディングス	1,300	2,543.50	3,306,550	
三井不動産	2,100	3,290.00	6,909,000	
三菱地所	2,900	1,954.50	5,668,050	
平和不動産	100	3,980.00	398,000	
東京建物	400	2,031.50	812,600	
京阪神ビルディング	100	1,365.00	136,500	
住友不動産	900	3,726.00	3,353,400	
テーオーシー	100	644.00	64,400	
レオパレス21	600	332.00	199,200	
スターツコーポレーション	100	2,808.00	280,800	
フジ住宅	100	720.00	72,000	
ゴールドクレスト	100	2,386.00	238,600	
リログループ	300	1,459.50	437,850	
日神グループホールディングス	100	526.00	52,600	
日本エスコン	100	893.00	89,300	
M I R A R T Hホールディングス	300	469.00	140,700	
イオンモール	200	1,736.50	347,300	
カチタス	100	2,057.00	205,700	
トーセイ	100	1,768.00	176,800	
サンフロンティア不動産	100	1,457.00	145,700	
F Jネクストホールディングス	100	1,041.00	104,100	
東武鉄道	500	3,520.00	1,760,000	
相鉄ホールディングス	200	2,680.00	536,000	
東急	1,400	1,645.00	2,303,000	
京浜急行電鉄	600	1,243.50	746,100	
小田急電鉄	700	2,066.00	1,446,200	
京王電鉄	300	4,374.00	1,312,200	
京成電鉄	300	5,541.00	1,662,300	
富士急行	100	4,065.00	406,500	
東日本旅客鉄道	800	7,739.00	6,191,200	
西日本旅客鉄道	600	5,635.00	3,381,000	
東海旅客鉄道	2,000	3,335.00	6,670,000	
西武ホールディングス	600	1,427.00	856,200	
鴻池運輸	100	1,904.00	190,400	
西日本鉄道	100	2,391.50	239,150	
近鉄グループホールディングス	500	4,144.00	2,072,000	
阪急阪神ホールディングス	600	4,637.00	2,782,200	
南海電気鉄道	200	2,810.50	562,100	
京阪ホールディングス	300	3,572.00	1,071,600	
名古屋鉄道	500	2,077.00	1,038,500	
ヤマトホールディングス	600	2,381.00	1,428,600	
山九	100	5,090.00	509,000	
センコーグループホールディングス	200	1,028.00	205,600	
ニッコンホールディングス	200	3,239.00	647,800	

セイノーホールディングス	300	2,129.50	638,850
A Z - C O M 丸和ホールディングス	100	2,034.00	203,400
C & F ロジホールディングス	100	1,372.00	137,200
日本郵船	1,300	3,863.00	5,021,900
商船三井	900	4,088.00	3,679,200
川崎汽船	400	5,225.00	2,090,000
飯野海運	200	1,035.00	207,000
九州旅客鉄道	300	3,021.00	906,300
S Gホールディングス	900	1,905.00	1,714,500
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	200	7,580.00	1,516,000
日本航空	1,200	2,657.00	3,188,400
A N Aホールディングス	1,300	2,871.50	3,732,950
T R Eホールディングス	100	1,128.00	112,800
K P Pグループホールディングス	100	623.00	62,300
三菱倉庫	100	3,879.00	387,900
住友倉庫	100	2,385.00	238,500
乾汽船	100	1,221.00	122,100
日本トランスシティ	100	651.00	65,100
安田倉庫	100	1,082.00	108,200
大栄環境	100	2,064.00	206,400
日本管財ホールディングス	100	2,451.00	245,100
上組	200	3,054.00	610,800
T B Sホールディングス	300	2,400.00	720,000
日本テレビホールディングス	400	1,471.50	588,600
朝日放送グループホールディングス	100	664.00	66,400
テレビ朝日ホールディングス	100	1,621.00	162,100
スカパーJ S A Tホールディングス	400	704.00	281,600
ビジョン	100	1,280.00	128,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	100	3,450.00	345,000
日本通信	500	204.00	102,000
日本電信電話	157,300	173.60	27,307,280
K D D I	3,800	4,452.00	16,917,600
ソフトバンク	7,900	1,673.50	13,220,650
光通信	100	21,335.00	2,133,500
G M Oインターネットグループ	200	2,182.50	436,500
K A D O K A W A	300	2,995.50	898,650
学研ホールディングス	100	825.00	82,500
ゼンリン	100	927.00	92,700
東京電力ホールディングス	4,400	636.20	2,799,280
中部電力	1,800	1,795.00	3,231,000
関西電力	1,900	1,943.00	3,691,700
中国電力	800	921.30	737,040
北陸電力	500	761.90	380,950
東北電力	1,200	940.70	1,128,840
四国電力	400	1,020.00	408,000
九州電力	1,100	953.30	1,048,630
北海道電力	500	633.90	316,950
沖縄電力	100	1,066.00	106,600

電源開発	400	2,319.50	927,800
イーレックス	100	722.00	72,200
レノバ	100	1,082.00	108,200
東京瓦斯	1,000	3,402.00	3,402,000
大阪瓦斯	1,000	2,466.00	2,466,000
東邦瓦斯	200	2,590.00	518,000
広島ガス	200	389.00	77,800
西部ガスホールディングス	100	1,950.00	195,000
静岡ガス	100	1,009.00	100,900
メタウォーター	100	1,836.00	183,600
東宝	300	4,866.00	1,459,800
エイチ・アイ・エス	200	1,630.00	326,000
NTTデータグループ	1,500	1,768.00	2,652,000
共立メンテナンス	100	5,577.00	557,700
イチネンホールディングス	100	1,367.00	136,700
アインホールディングス	100	4,072.00	407,200
カナモト	100	2,444.00	244,400
DTS	100	3,235.00	323,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	5,048.00	1,009,600
シーイーシー	100	1,530.00	153,000
カブコン	500	5,288.00	2,644,000
ニシオホールディングス	100	3,260.00	326,000
日本空港ビルデング	200	6,407.00	1,281,400
トランス・コスモス	100	3,105.00	310,500
乃村工藝社	200	872.00	174,400
ジャステック	100	1,502.00	150,200
SCSK	400	2,466.00	986,400
セコム	500	10,090.00	5,045,000
アイネス	100	1,588.00	158,800
丹青社	100	836.00	83,600
メイテックグループホールディングス	200	2,586.50	517,300
TKC	100	3,500.00	350,000
富士ソフト	100	5,410.00	541,000
船井総研ホールディングス	100	2,504.00	250,400
NSD	200	2,772.00	554,400
コナミグループ	200	8,116.00	1,623,200
ベネッセホールディングス	200	1,778.00	355,600
イオンディライト	100	3,260.00	326,000
ダイセキ	100	4,060.00	406,000
トラスコ中山	100	2,315.00	231,500
ヤマダホールディングス	2,100	461.40	968,940
オートバックスセブン	200	1,508.50	301,700
アーケランズ	200	1,527.00	305,400
ニトリホールディングス	200	15,615.00	3,123,000
グルメ杵屋	100	1,055.00	105,500
吉野家ホールディングス	200	3,160.00	632,000
加藤産業	100	3,990.00	399,000
イエローハット	100	1,795.00	179,500
JKホールディングス	100	939.00	93,900

サガミホールディングス	100	1,306.00	130,600	
ミロク情報サービス	100	1,560.00	156,000	
因幡電機産業	100	3,175.00	317,500	
アークス	100	2,772.00	277,200	
パローホールディングス	100	2,193.00	219,300	
ミスミグループ本社	800	2,333.00	1,866,400	
ファーストリテイリング	200	33,840.00	6,768,000	
ソフトバンクグループ	2,400	6,255.00	15,012,000	
スズケン	200	4,580.00	916,000	
サンドラッグ	200	3,955.00	791,000	
サックスパー ホールディングス	100	838.00	83,800	
ベルーナ	100	630.00	63,000	
合計	743,300		1,557,335,340	

(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10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	46,997,451
国債証券	8,919,954,350
地方債証券	663,288,900
特殊債券	605,355,000
社債券	294,860,000
未収利息	13,861,829
前払費用	412,895
流動資産合計	10,544,730,425
資産合計	10,544,730,425
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,171,000
流動負債合計	13,171,000
負債合計	13,171,000
純資産の部	
元本等	
元本	8,756,589,665
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,774,969,760
元本等合計	10,531,559,425
純資産合計	10,531,559,425
負債純資産合計	10,544,730,425

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあつては、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10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,366,977,587円
同期中追加設定元本額	956,609,520円
同期中一部解約元本額	566,997,442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	4,192,576,141円
新光7資産バランスファンド	504,434,964円
日本債券ファンド	3,495,065,347円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	470,503,187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）	14,269,919円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	51,144,972円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	28,595,135円
計	8,756,589,665円
2. 受益権の総数	8,756,589,665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 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月20日現在
----	---------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		322,820,250
地方債証券		11,674,700
特殊債券		10,908,000
社債券		4,464,000
合計		349,866,950

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年11月11日から2023年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2023年10月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2027円 (12,027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10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	442回 利付国庫債券(2年)	60,000,000	60,036,600	

444回 利付国庫債券(2年)	30,000,000	30,014,100	
445回 利付国庫債券(2年)	20,000,000	20,007,600	
446回 利付国庫債券(2年)	30,000,000	30,008,100	
447回 利付国庫債券(2年)	40,000,000	40,005,600	
448回 利付国庫債券(2年)	40,000,000	39,996,800	
449回 利付国庫債券(2年)	20,000,000	19,995,000	
452回 利付国庫債券(2年)	30,000,000	29,972,100	
142回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,097,200	
143回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,080,500	
144回 利付国庫債券(5年)	100,000,000	100,149,000	
145回 利付国庫債券(5年)	90,000,000	90,111,600	
146回 利付国庫債券(5年)	120,000,000	120,116,400	
147回 利付国庫債券(5年)	120,000,000	119,782,800	
148回 利付国庫債券(5年)	100,000,000	99,748,000	
149回 利付国庫債券(5年)	90,000,000	89,686,800	
150回 利付国庫債券(5年)	90,000,000	89,589,600	
151回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,827,200	
152回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,873,000	
153回 利付国庫債券(5年)	70,000,000	69,503,700	
154回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	79,596,800	
155回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	20,028,600	
156回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,866,000	
157回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,875,800	
158回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,575,500	
159回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	19,793,400	

160回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,713,000	
161回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	39,944,800	
1回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	11,324,600	
2回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	10,916,100	
3回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	21,782,600	
4回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	21,747,400	
5回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	20,869,400	
6回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	20,443,400	
7回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	29,209,500	
8回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	27,022,800	
9回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	26,156,000	
10回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	30,787,600	
11回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	22,165,800	
12回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	19,634,400	
13回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	25,861,600	
14回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	27,603,200	
15回 利付国庫債券(40年)	50,000,000	37,984,000	
16回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	8,310,800	
336回 利付国庫債券(10年)	30,000,000	30,187,800	
337回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,315,200	
338回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,466,400	
339回 利付国庫債券(10年)	120,000,000	120,775,200	
340回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,556,800	
341回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,369,600	
342回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,038,400	
343回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,000,000	
344回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	79,941,600	
345回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	59,905,200	
346回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	69,822,200	
347回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	69,745,200	

348回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	89,546,400	
349回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	99,321,000	
350回 利付国庫債券(10年)	120,000,000	118,981,200	
351回 利付国庫債券(10年)	120,000,000	118,760,400	
352回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	79,015,200	
353回 利付国庫債券(10年)	110,000,000	108,523,800	
354回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,792,000	
355回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,650,400	
356回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,478,400	
357回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,274,400	
358回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	68,282,900	
359回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	87,539,400	
360回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	87,245,100	
361回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	86,910,300	
362回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	86,594,400	
363回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	86,294,700	
364回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	76,431,200	
365回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	66,655,400	
366回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	76,611,200	
367回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	66,815,700	
368回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	76,134,400	
369回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	58,513,800	
370回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	77,866,400	
371回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	67,338,600	
10回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,551,800	

11回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	10,826,200	
12回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,203,900	
15回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,629,400	
17回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,544,400	
19回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,446,800	
20回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,670,800	
21回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,452,700	
22回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,687,700	
23回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,691,800	
26回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,559,200	
27回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,681,800	
28回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	23,351,000	
29回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	23,049,800	
30回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,727,400	
31回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,402,400	
32回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,964,500	
33回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,550,000	
34回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,358,800	
35回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,368,800	
36回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,279,700	
37回 利付国庫債券(30年)	60,000,000	63,394,800	
38回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,730,400	
39回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,558,200	
40回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,650,600	
41回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,289,200	

42回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,260,800	
43回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,231,800	
44回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	30,303,600	
45回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,202,600	
46回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,149,800	
47回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,642,400	
48回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	38,023,600	
49回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	28,459,500	
50回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	25,069,800	
51回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,186,200	
52回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	30,962,400	
53回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	23,708,700	
54回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,774,000	
55回 利付国庫債券(30年)	25,000,000	20,578,750	
56回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,614,700	
57回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,535,500	
58回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,456,600	
59回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,850,200	
60回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	16,590,400	
61回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,740,400	
62回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	14,883,400	
63回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	14,403,000	
64回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,514,500	
65回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	14,295,600	
66回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,336,900	

67回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,501,500	
68回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,416,900	
69回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	30,659,200	
70回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,933,500	
71回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,871,700	
72回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,810,200	
73回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,769,400	
74回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,677,400	
75回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	26,610,600	
76回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	27,251,700	
77回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	28,579,200	
78回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,147,600	
79回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	17,229,800	
81回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,374,900	
84回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,419,400	
88回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,583,100	
90回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,603,000	
92回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,229,400	
95回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,528,800	
99回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,277,600	
105回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,699,800	
108回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,785,400	
110回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,916,800	
111回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,004,900	
112回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,899,000	

113回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,925,000	
114回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,998,700	
116回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,075,700	
117回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,027,000	
118回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,939,800	
120回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,417,400	
121回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,826,200	
122回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,846,500	
123回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,119,800	
124回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,991,100	
125回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,138,400	
126回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,992,600	
127回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,921,700	
128回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,871,400	
129回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,862,600	
130回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,730,200	
131回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,789,800	
132回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,788,400	
133回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,739,800	
134回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,755,000	
135回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,798,100	
136回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,428,800	
137回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,606,000	
138回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,906,800	
139回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,886,000	

140回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	64,841,400	
141回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	43,256,400	
142回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	43,599,200	
143回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,183,700	
144回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,271,000	
145回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	75,783,400	
146回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	54,106,500	
147回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,632,000	
148回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,485,200	
149回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,072,000	
150回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	63,011,400	
151回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,390,500	
152回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,286,000	
153回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,755,000	
154回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,091,000	
155回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	49,864,500	
156回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,255,000	
157回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	44,875,500	
158回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	55,741,200	
159回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	56,227,800	
160回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	47,276,500	
161回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,161,600	
162回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,258,500	
163回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,062,500	
164回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	45,201,500	

	165回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	44,992,000	
	166回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,109,000	
	167回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	35,631,600	
	168回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,886,800	
	169回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,151,600	
	170回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	25,473,900	
	171回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,778,800	
	172回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	42,730,500	
	173回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,999,600	
	174回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	42,267,500	
	175回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,237,600	
	176回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,079,200	
	177回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,299,600	
	178回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,757,200	
	179回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	42,024,500	
	180回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	35,374,400	
	181回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	35,873,600	
	182回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,042,400	
	183回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,184,300	
	184回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	27,615,000	
	185回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	36,680,000	
	国債証券 合計	9,225,000,000	8,919,954,350	
地方債証券	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,061,000	
	218回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,021,000	
	412回 大阪府公募公債 10年	50,000,000	49,708,000	
	190回 大阪府公募公債 5年	100,000,000	99,104,000	

	12回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	100,311,000	
	令和3年度11回 愛知県公募公債	100,000,000	94,739,000	
	24年度1回 福岡県公募公債 30年	10,000,000	10,709,900	
	169回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,635,000	
地方債証券 合計		660,000,000	663,288,900	
特殊債券	147回 高速道路機構債	100,000,000	97,976,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,211,000	
	249回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,632,000	
	327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,305,000	
	250回 住宅金融支援機構	100,000,000	98,758,000	
	87回 中日本高速道路債券	100,000,000	99,473,000	
特殊債券 合計		600,000,000	605,355,000	
社債券	11回 プリヂストン社債	100,000,000	99,186,000	
	36回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,223,000	
	494回 九州電力社債	100,000,000	93,451,000	
社債券 合計		300,000,000	294,860,000	
合計			10,483,458,250	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,465,629,999
投資証券	76,144,070,900
未収入金	64,784,753
未収配当金	778,088,248
前払金	84,623,280
差入委託証拠金	135,642,000
流動資産合計	78,672,839,180
資産合計	78,672,839,180
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	109,197,700
未払解約金	83,650,000
流動負債合計	192,847,700
負債合計	192,847,700
純資産の部	
元本等	
元本	36,087,319,626
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	42,392,671,854
元本等合計	78,479,991,480
純資産合計	78,479,991,480
負債純資産合計	78,672,839,180

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,020,847,590円
同期中追加設定元本額	417,166,351円
同期中一部解約元本額	3,350,694,315円
元本の内訳	
ファンド名	
J-REITパッケージ	1,925,871,959円
新光J-REITオープン	31,646,671,380円
One DC 国内リートインデックスファンド	1,476,828,680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）	760,467,650円
計	36,087,319,626円
2. 受益権の総数	36,087,319,626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 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券	1,979,606,513	
合計	1,979,606,513	

(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10月21日から2023年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2023年10月20日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	2,325,160,280	-	2,216,097,000	109,063,280
合計	2,325,160,280	-	2,216,097,000	109,063,280

（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10月20日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1747円 (21,747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10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	3,163	508,294,100	
	GLP投資法人	24,818	3,275,976,000	
	NTT都市開発リート投資法人	7,063	950,679,800	
	Oneリート投資法人	1,282	325,115,200	
	SOSILA物流リート投資法人	3,666	443,586,000	
	いちごオフィスリート投資法人	6,020	524,944,000	
	いちごホテルリート投資法人	1,217	128,880,300	
	アクティブ・プロパティーズ 投資法人	3,855	1,578,622,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	7,209	2,386,179,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,219	403,984,500	
	イオンリート投資法人	9,013	1,309,588,900	
	インヴィンシブル投資法人	35,574	2,041,947,600	

エスコンジャパンリート投資法人	1,494	174,349,800	
オリックス不動産投資法人	14,639	2,613,061,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	5,425	616,822,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	4,275	1,427,850,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	5,394	1,185,601,200	
ケネディクス商業リート投資法人	3,194	898,791,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,613	1,105,578,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,002	226,025,800	
サンケイリアルエステート投資法人	2,354	216,803,400	
ザイマックス・リート投資法人	1,192	137,437,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	24,595	1,704,433,500	
ジャパンエクセレント投資法人	6,385	842,820,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	7,547	4,256,508,000	
スターアジア不動産投資法人	11,323	668,057,000	
スターツプロシード投資法人	1,274	269,578,400	
タカラレーベン不動産投資法人	3,484	340,735,200	
トーセイ・リート投資法人	1,547	218,281,700	
ヒューリックリート投資法人	6,874	1,063,407,800	
フロンティア不動産投資法人	2,726	1,211,707,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,811	254,264,400	
マリモ地方創生リート投資法人	1,132	143,764,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	16,435	2,478,398,000	
ラサールロジポート投資法人	9,392	1,389,076,800	
阪急阪神リート投資法人	3,503	491,120,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,056	1,428,680,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,537	961,523,000	
産業ファンド投資法人	11,210	1,532,407,000	
森トラストリート投資法人	14,162	1,028,161,200	
森ヒルズリート投資法人	8,640	1,208,736,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,356	824,448,000	
積水ハウス・リート投資法人	22,078	1,788,318,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,123	72,545,800	
大和ハウスリート投資法人	11,075	2,941,520,000	
大和証券オフィス投資法人	1,522	992,344,000	
大和証券リビング投資法人	10,820	1,186,954,000	
投資法人みらい	9,396	444,430,800	
東海道リート投資法人	1,093	137,718,000	

東急リアル・エステート投資法人	4,926	876,828,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	2,537	1,550,107,000	
日本ビルファンド投資法人	8,571	5,031,177,000	
日本プライムリアルティ投資法人	5,025	1,781,362,500	
日本プロロジスリート投資法人	12,799	3,486,447,600	
日本リート投資法人	2,386	833,907,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,706	1,344,974,800	
日本都市ファンド投資法人	35,218	3,497,147,400	
福岡リート投資法人	3,800	608,380,000	
平和不動産リート投資法人	5,489	784,378,100	
野村不動産マスターファンド投資法人	23,760	3,989,304,000	
投資証券 合計	454,994	76,144,070,900	
合計		76,144,070,900	

(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10月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	48,702,497
コール・ローン	5,373,349
株式	1,503,637,038
投資信託受益証券	2,392,471
投資証券	26,774,400
未収配当金	1,132,233
差入委託証拠金	105,467,735
流動資産合計	1,693,479,723
資産合計	1,693,479,723
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,995,694
流動負債合計	4,995,694
負債合計	4,995,694
純資産の部	
元本等	
元本	362,540,197
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,325,943,832
元本等合計	1,688,484,029
純資産合計	1,688,484,029
負債純資産合計	1,693,479,723

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	407,556,522円
同期中追加設定元本額	1,692,437円
同期中一部解約元本額	46,708,762円
元本の内訳 ファンド名	
新光7資産バランスファンド	133,658,339円
新光外国株式インデックスV A	154,868,466円

世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	61,707,018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)	1,226,042円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	6,608,143円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	4,472,189円
計	362,540,197円
2. 受益権の総数	362,540,197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 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式		159,215,838
投資信託受益証券		1,274
投資証券		2,774,748
合計		156,442,364

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年11月11日から2023年10月20日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年10月20日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	154,539,882	-	149,544,188	4,995,694
合計	154,539,882	-	149,544,188	4,995,694

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
 - 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2023年10月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.6574円 (46,574円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年10月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,865	128.400	239,466.000	
	ABBOTT LABORATORIES	350	95.440	33,404.000	
	AES CORP	157	13.840	2,172.880	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	183	138.010	25,255.830	
	ADVANCED MICRO DEVICES	323	102.400	33,075.200	

ADOBE INC	92	555.740	51,128.080	
CHUBB LTD	83	210.550	17,475.650	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	45	280.610	12,627.450	
ALLSTATE CORP	51	124.740	6,361.740	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	136	182.270	24,788.720	
AMGEN INC	107	280.600	30,024.200	
HESS CORP	55	166.080	9,134.400	
AMERICAN EXPRESS CO	127	149.620	19,001.740	
AMERICAN ELECTRIC POWER	100	74.420	7,442.000	
AFLAC INC	113	79.550	8,989.150	
AMERICAN INTL GROUP	151	61.170	9,236.670	
ANALOG DEVICES	100	168.720	16,872.000	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	143	49.200	7,035.600	
VALERO ENERGY CORP	75	132.420	9,931.500	
ANSYS INC	17	285.920	4,860.640	
APPLE INC	3,178	175.460	557,611.880	
APPLIED MATERIALS INC	171	134.430	22,987.530	
ALBEMARLE CORP	24	144.560	3,469.440	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	108	73.840	7,974.720	
AMEREN CORP	48	77.650	3,727.200	
ARROW ELECTRONICS INC	10	112.640	1,126.400	
AUTODESK INC	44	206.070	9,067.080	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	85	246.080	20,916.800	
AUTOZONE INC	4	2,494.660	9,978.640	
AVERY DENNISON CORP	17	176.930	3,007.810	
BALL CORP	57	45.160	2,574.120	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	262	338.660	88,728.920	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	150	42.190	6,328.500	
BAXTER INTERNATIONAL INC	100	32.610	3,261.000	
BECTON DICKINSON & CO	57	257.480	14,676.360	
AMETEK INC	45	143.650	6,464.250	
VERIZON COMM INC	842	31.580	26,590.360	
WR BERKLEY CORP	45	64.240	2,890.800	
BEST BUY CO INC	36	69.500	2,502.000	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	4	315.990	1,263.960	
YUM! BRANDS INC	57	120.560	6,871.920	
FIRSTENERGY CORP	109	35.660	3,886.940	
BOEING CO	114	182.790	20,838.060	
ROBERT HALF INC	25	74.470	1,861.750	
BORGWARNER INC	49	38.110	1,867.390	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	294	50.550	14,861.700	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	19	83.310	1,582.890	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	36	140.280	5,050.080	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	4	1,014.120	4,056.480	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	433	56.480	24,455.840	
ONEOK INC	111	69.210	7,682.310	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	17	109.100	1,854.700	
UNITED RENTALS INC	13	411.190	5,345.470	
SEMPRA	128	69.550	8,902.400	
FEDEX CORP	50	243.290	12,164.500	
VERISIGN INC	20	211.660	4,233.200	
AMPHENOL CORP	119	80.890	9,625.910	
BROWN-FORMAN CORP	63	55.750	3,512.250	
QUANTA SERVICES INC	28	168.740	4,724.720	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	218	4.560	994.080	
CSX CORP	422	30.540	12,887.880	
COTERRA ENERGY INC	164	29.600	4,854.400	
CAMPBELL SOUP CO	34	39.780	1,352.520	
CONSTELLATION BRANDS INC	33	233.200	7,695.600	
CARDINAL HEALTH INC	51	92.790	4,732.290	
CARLISLE COS INC	11	246.620	2,712.820	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	204	11.390	2,323.560	
CATERPILLAR INC	106	252.890	26,806.340	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	20	135.500	2,710.000	
JPMORGAN CHASE & CO	589	145.290	85,575.810	
CHURCH & DWIGHT CO INC	50	89.600	4,480.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32	100.920	3,229.440	
CINTAS CORP	19	502.820	9,553.580	
CISCO SYSTEMS INC	819	53.320	43,669.080	
CLEVELAND-CLIFFS INC	128	14.540	1,861.120	
CLOROX COMPANY	28	123.990	3,471.720	
COCA-COLA CO/THE	831	54.350	45,164.850	
COPART INC	172	44.330	7,624.760	
COGNEX CORP	29	36.790	1,066.910	
COLGATE-PALMOLIVE CO	164	73.190	12,003.160	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	52	192.310	10,000.120	
MOLINA HEALTHCARE INC	11	349.620	3,845.820	
NRG ENERGY, INC.	42	40.760	1,711.920	
COMCAST CORP-CL A	838	43.070	36,092.660	
CONAGRA BRANDS INC	103	27.150	2,796.450	
CONSOLIDATED EDISON INC	72	87.670	6,312.240	
CMS ENERGY CORP	63	53.510	3,371.130	

COOPER COS INC	10	323.800	3,238.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	39	58.340	2,275.260	
CORNING INC	158	27.430	4,333.940	
WOLFSPEED INC	27	34.000	918.000	
SEALED AIR CORP	32	29.030	928.960	
HEICO CORP-CL A	14	127.500	1,785.000	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	13	196.260	2,551.380	
CUMMINS INC	30	221.700	6,651.000	
DARLING INTERNATIONAL INC	36	43.210	1,555.560	
DR HORTON INC	63	101.240	6,378.120	
DANAHER CORP	141	207.300	29,229.300	
MOODY'S CORP	34	311.580	10,593.720	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	101	65.440	6,609.440	
TARGET CORP	92	108.360	9,969.120	
DEERE & CO	57	381.370	21,738.090	
MORGAN STANLEY	257	72.920	18,740.440	
REPUBLIC SERVICES INC	43	145.790	6,268.970	
COSTAR GROUP INC	82	73.940	6,063.080	
DECKERS OUTDOOR CORP	5	508.880	2,544.400	
THE WALT DISNEY CO	375	83.250	31,218.750	
DOLLAR TREE INC	45	113.110	5,089.950	
DOVER CORP	28	134.430	3,764.040	
OMNICOM GROUP	38	74.220	2,820.360	
DTE ENERGY CO	38	96.740	3,676.120	
DUKE ENERGY CORP	155	87.780	13,605.900	
DARDEN RESTAURANTS INC	25	142.260	3,556.500	
EBAY INC	110	41.140	4,525.400	
BANK OF AMERICA CORP	1,439	26.960	38,795.440	
CITIGROUP INC	399	40.060	15,983.940	
EASTMAN CHEMICAL CO	25	71.530	1,788.250	
EATON CORP PLC	81	199.910	16,192.710	
CADENCE DESIGN SYS INC	55	245.060	13,478.300	
ECOLAB INC	53	160.340	8,498.020	
REVVITY INC	25	101.430	2,535.750	
ELECTRONIC ARTS INC	51	128.230	6,539.730	
SALESFORCE INC	196	208.320	40,830.720	
ERIE INDEMNITY CO	6	304.070	1,824.420	
EMERSON ELECTRIC CO	113	93.140	10,524.820	
ATMOS ENERGY CORP	31	110.100	3,413.100	
ENTERGY CORP	38	93.370	3,548.060	
EOG RESOURCES INC	120	136.230	16,347.600	
EQUIFAX INC	25	178.980	4,474.500	
EQT CORP	86	43.090	3,705.740	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	46	138.810	6,385.260	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	31	114.780	3,558.180	
EXXON MOBIL CORP	815	113.020	92,111.300	
FMC CORP	28	66.590	1,864.520	

NEXTERA ENERGY INC	413	52.390	21,637.070	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	8	436.870	3,494.960	
FAIR ISAAC CORP	5	919.260	4,596.300	
ASSURANT INC	9	149.070	1,341.630	
FASTENAL CO	120	58.530	7,023.600	
FIFTH THIRD BANCORP	125	24.920	3,115.000	
M&T BANK CORP	34	119.610	4,066.740	
FIRST HORIZON CORP	128	11.190	1,432.320	
FISERV INC	128	111.970	14,332.160	
FORD MOTOR CO	785	11.530	9,051.050	
FRANKLIN RESOURCES INC	72	22.630	1,629.360	
FREEPORT-MCMORAN INC	287	35.230	10,111.010	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2	1,355.770	2,711.540	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	44	231.030	10,165.320	
DENTSPLY SIRONA INC	34	31.500	1,071.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	47	237.950	11,183.650	
GENERAL MILLS INC	120	62.860	7,543.200	
GENUINE PARTS CO	30	130.120	3,903.600	
GILEAD SCIENCES INC	250	78.440	19,610.000	
GARTNER INC	16	353.030	5,648.480	
MCKESSON CORP	28	453.270	12,691.560	
NVIDIA CORP	499	421.010	210,083.990	
GRACO INC	36	70.740	2,546.640	
GENERAL ELECTRIC CO	218	106.950	23,315.100	
VW GRAINGER INC	9	702.830	6,325.470	
HALLIBURTON CO	178	43.260	7,700.280	
MONSTER BEVERAGE CORP	157	50.400	7,912.800	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	68	299.190	20,344.920	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	39	177.900	6,938.100	
HASBRO INC	25	56.620	1,415.500	
HENRY SCHEIN INC	24	68.750	1,650.000	
HEICO CORP	11	160.840	1,769.240	
HERSHEY FOODS CORP	30	191.580	5,747.400	
HP INC	186	26.450	4,919.700	
F5 INC	14	148.510	2,079.140	
CROWN HOLDINGS INC NPR	22	79.890	1,757.580	
UNITED THERAPEUTICS CORP	10	225.820	2,258.200	
JUNIPER NETWORKS INC	73	25.070	1,830.110	
HOLOGIC INC	54	67.820	3,662.280	
HOME DEPOT INC	203	286.770	58,214.310	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	41	82.590	3,386.190	
HORMEL FOODS CORP	67	31.820	2,131.940	
CENTERPOINT ENERGY INC	118	27.470	3,241.460	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6	357.340	2,144.040	
HUBBELL INC	12	285.000	3,420.000	

HUMANA INC	25	522.720	13,068.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15	178.810	2,682.150	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	316	10.030	3,169.480	
BIOGEN INC	28	257.300	7,204.400	
IDEX CORP	14	195.600	2,738.400	
ILLINOIS TOOL WORKS	60	224.900	13,494.000	
INTUIT INC	57	521.520	29,726.640	
IDEXX LABORATORIES INC	16	425.680	6,810.880	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	45	191.320	8,609.400	
INTEL CORP	839	35.670	29,927.130	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	56	66.400	3,718.400	
INTERNATIONAL PAPER CO	56	34.260	1,918.560	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	72	28.540	2,054.880	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	16	145.610	2,329.760	
JABIL CIRCUIT INC	24	130.340	3,128.160	
INCYTE CORP	42	55.640	2,336.880	
JOHNSON & JOHNSON	486	152.320	74,027.520	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	59	71.990	4,247.410	
KLA CORPORATION	27	465.050	12,556.350	
DEVON ENERGY CORP	125	49.250	6,156.250	
KELLANOVA	56	49.890	2,793.840	
KEYCORP	195	10.560	2,059.200	
KIMBERLY-CLARK CORP	69	122.860	8,477.340	
BLACKROCK INC/NEW YORK	30	622.510	18,675.300	
KROGER CO	134	44.500	5,963.000	
LAM RESEARCH CORP	27	601.950	16,252.650	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9	393.610	3,542.490	
PACKAGING CORP OF AMERICA	17	149.550	2,542.350	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	27	73.980	1,997.460	
AKAMAI TECHNOLOGIES	29	106.990	3,102.710	
LENNAR CORP	51	104.610	5,335.110	
ELI LILLY & CO	163	590.800	96,300.400	
BATH & BODY WORKS INC	45	30.710	1,381.950	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	145	152.060	22,048.700	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	61	109.510	6,680.110	
LOCKHEED MARTIN CORP	45	449.180	20,213.100	
LOEWS CORP	35	64.080	2,242.800	
LOWE'S COS INC	117	190.460	22,283.820	
DOMINION ENERGY INC	162	40.640	6,583.680	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	54	35.990	1,943.460	
MCCORMICK & CO INC	50	60.040	3,002.000	
MCDONALD'S CORPORATION	148	258.380	38,240.240	
S&P GLOBAL INC	67	357.560	23,956.520	
EVEREST GROUP LTD	9	401.850	3,616.650	
MARKEL GROUP INC	2	1,479.330	2,958.660	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	123	69.080	8,496.840	
MARSH & MCLENNAN COS	99	191.000	18,909.000	
MASCO CORP	39	50.120	1,954.680	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	13	410.720	5,339.360	
METLIFE INC	132	61.920	8,173.440	
MEDTRONIC PLC	267	72.350	19,317.450	
CVS HEALTH CORP	257	70.610	18,146.770	
MERCK & CO. INC.	512	100.430	51,420.160	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	86	87.010	7,482.860	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	19	199.430	3,789.170	
MICROSOFT CORP	1,427	331.320	472,793.640	
MICRON TECH INC	225	67.530	15,194.250	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	116	76.790	8,907.640	
3M CO	116	87.060	10,098.960	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6	79.130	474.780	
ENTEGRIS INC	27	91.870	2,480.490	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	12	187.400	2,248.800	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	35	281.940	9,867.900	
ILLUMINA INC	33	119.980	3,959.340	
XCEL ENERGY INC	105	59.050	6,200.250	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19	111.130	2,111.470	
NETAPP INC	48	75.040	3,601.920	
NEWMONT CORP	152	39.450	5,996.400	
NVR INC	1	5,563.550	5,563.550	
NIKE INC-CL B	247	103.050	25,453.350	
NORDSON CORP	10	216.170	2,161.700	
NORFOLK SOUTHERN CORP	44	200.090	8,803.960	
EVERSOURCE ENERGY	74	53.900	3,988.600	
NISOURCE INC	72	25.630	1,845.360	
NORTHERN TRUST CORP	37	65.500	2,423.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	28	489.940	13,718.320	
WELLS FARGO & CO	737	41.180	30,349.660	
NUCOR CORP	49	143.750	7,043.750	
CHENIERE ENERGY INC	48	175.540	8,425.920	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	80	92.700	7,416.000	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	136	66.460	9,038.560	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	20	396.450	7,929.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12	898.390	10,780.680	
ORACLE CORP	328	108.340	35,535.520	
PACCAR INC	110	82.550	9,080.500	
PTC INC	22	141.320	3,109.040	
EXELON CORP	196	39.770	7,794.920	
PARKER HANNIFIN CORP	27	374.980	10,124.460	
PAYCHEX INC	67	118.190	7,918.730	
ALIGN TECHNOLOGY INC	16	270.290	4,324.640	
PPL CORPORATION	136	23.820	3,239.520	
PEPSICO INC	278	160.560	44,635.680	
PENTAIR PLC	28	63.040	1,765.120	
PFIZER INC	1,137	31.190	35,463.030	
ESSENTIAL UTILITIES INC	61	33.040	2,015.440	
CONOCOPHILLIPS	244	126.380	30,836.720	
PG&E CORP	389	16.000	6,224.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	48	255.330	12,255.840	
ALTRIA GROUP INC	361	42.610	15,382.210	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	78	115.660	9,021.480	
BROWN & BROWN INC	49	68.270	3,345.230	
GARMIN LTD	29	104.330	3,025.570	
PPG INDUSTRIES INC	45	124.340	5,595.300	
COSTCO WHOLESALE CORP	89	565.630	50,341.070	
T ROWE PRICE GROUP INC	45	97.370	4,381.650	
QUEST DIAGNOSTICS	22	122.830	2,702.260	
PROCTER & GAMBLE CO	477	148.250	70,715.250	
PROGRESSIVE CORP	120	157.800	18,936.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	105	59.830	6,282.150	
PULTE GROUP INC	47	70.130	3,296.110	
GLOBAL PAYMENTS INC	53	112.410	5,957.730	
QUALCOMM INC	229	111.280	25,483.120	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	38	96.850	3,680.300	
EXACT SCIENCES CORP	37	64.450	2,384.650	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	12	250.300	3,003.600	
REGENERON PHARMACEUTICALS	22	808.640	17,790.080	
REPLIGEN CORP	11	146.280	1,609.080	
RESMED INC	32	142.290	4,553.280	
US BANCORP	303	32.750	9,923.250	
SEAGEN INC	28	214.970	6,019.160	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	72	83.780	6,032.160	

ROSS STORES INC	67	116.260	7,789.420	
ROLLINS INC	46	32.920	1,514.320	
ROPER TECHNOLOGIES INC	22	487.530	10,725.660	
ROCKWELL AUTOMATION INC	22	271.520	5,973.440	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	42	82.080	3,447.360	
RPM INTERNATIONAL INC	29	94.410	2,737.890	
ACCENTURE PLC-CL A	127	302.940	38,473.380	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	274	64.210	17,593.540	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	21	207.360	4,354.560	
AXON ENTERPRISE INC	15	212.310	3,184.650	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	48	163.940	7,869.120	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	119	51.420	6,118.980	
BOOKING HOLDINGS INC	7	2,785.200	19,496.400	
SCHLUMBERGER LTD	284	59.970	17,031.480	
SCHWAB (CHARLES) CORP	300	51.900	15,570.000	
POOL CORP	7	325.200	2,276.400	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	41	104.810	4,297.210	
BUNGE LTD	34	103.650	3,524.100	
SEI INVESTMENTS CO	22	55.580	1,222.760	
ELEVANCE HEALTH INC	49	463.280	22,700.720	
CENCORA INC	36	189.890	6,836.040	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44	69.510	3,058.440	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	50	238.890	11,944.500	
CENTENE CORP	109	71.940	7,841.460	
SMITH (A.O.) CORP	26	67.010	1,742.260	
SNAP-ON INC	12	252.710	3,032.520	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	73	93.290	6,810.170	
EDISON INTERNATIONAL	83	64.000	5,312.000	
SOUTHERN CO	220	66.440	14,616.800	
TRUIST FINANCIAL CORP	270	28.060	7,576.200	
SOUTHWEST AIRLINES	29	24.370	706.730	
AT&T INC	1,437	15.260	21,928.620	
CHEVRON CORP	366	169.100	61,890.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	29	78.860	2,286.940	
STATE STREET CORP	64	66.360	4,247.040	
STARBUCKS CORP	230	94.420	21,716.600	
STEEL DYNAMICS INC	30	99.200	2,976.000	
STRYKER CORP	68	268.420	18,252.560	
NETFLIX INC	90	401.770	36,159.300	
GEN DIGITAL INC	130	17.390	2,260.700	

KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30	45.880	1,376.400	
SYNOPSIS INC	30	482.370	14,471.100	
SYSCO CORP	109	65.660	7,156.940	
INTUITIVE SURGICAL INC	70	273.450	19,141.500	
TELEFLEX INC	8	186.020	1,488.160	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	278	8.160	2,268.480	
TERADYNE INC	34	92.740	3,153.160	
TEXAS INSTRUMENTS INC	182	150.940	27,471.080	
TEXTRON INC	41	77.340	3,170.940	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	78	469.670	36,634.260	
GLOBE LIFE INC	21	113.590	2,385.390	
TORO CO	22	83.620	1,839.640	
DAVITA INC	16	81.620	1,305.920	
TRACTOR SUPPLY CO	24	202.140	4,851.360	
BIO-TECHNE CORP	27	63.500	1,714.500	
TRIMBLE INC	44	49.530	2,179.320	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8	377.000	3,016.000	
TYSON FOODS INC	60	46.590	2,795.400	
MARATHON OIL CORP	142	29.190	4,144.980	
UNION PACIFIC CORP	122	210.330	25,660.260	
RTX CORP	299	73.890	22,093.110	
UNITEDHEALTH GROUP INC	188	531.630	99,946.440	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	11	127.660	1,404.260	
VF CORP	73	18.560	1,354.880	
PARAMOUNT GLOBAL	70	11.780	824.600	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	52	364.800	18,969.600	
VULCAN MATERIALS CO	26	202.690	5,269.940	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	137	20.960	2,871.520	
WALMART INC	299	160.770	48,070.230	
WASTE MANAGEMENT INC	84	157.070	13,193.880	
WATERS CORP	11	252.330	2,775.630	
WATSCO INC	6	353.970	2,123.820	
WEBSTER FINANCIAL CORP	36	40.130	1,444.680	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	16	369.330	5,909.280	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	22	113.820	2,504.040	
VAIL RESORTS INC	8	215.520	1,724.160	
WESTERN DIGITAL CORP	62	43.060	2,669.720	
WABTEC CORP	33	100.080	3,302.640	
WHIRLPOOL CORP	14	129.150	1,808.100	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	32	93.580	2,994.560	
WYNN RESORTS LTD	23	88.220	2,029.060	

NASDAQ INC	67	51.290	3,436.430	
CME GROUP INC	72	214.120	15,416.640	
WILLIAMS COS INC	251	35.570	8,928.070	
DICK'S SPORTING GOODS INC	13	108.810	1,414.530	
LKQ CORP	50	48.810	2,440.500	
ALLIANT ENERGY CORP	56	49.450	2,769.200	
WEC ENERGY GROUP INC	67	82.450	5,524.150	
CARMAX INC	38	63.420	2,409.960	
TJX COMPANIES INC	238	89.830	21,379.540	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	11	205.990	2,265.890	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	343	3.420	1,173.060	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	100	40.900	4,090.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	26	160.500	4,173.000	
CBRE GROUP INC	70	68.320	4,782.400	
REGIONS FINANCIAL CORP	156	16.480	2,570.880	
DOMINO'S PIZZA INC	7	344.310	2,410.170	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	9	433.750	3,903.750	
WESTLAKE CORP	4	117.990	471.960	
T-MOBILE US INC	107	137.840	14,748.880	
LAS VEGAS SANDS CORP	74	45.880	3,395.120	
MOSAIC CO/THE	57	36.440	2,077.080	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	9	234.830	2,113.470	
CELANESE CORP	21	116.650	2,449.650	
DEXCOM INC	77	86.040	6,625.080	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	23	111.390	2,561.970	
EXPEDIA GROUP INC	33	95.660	3,156.780	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	44	85.680	3,769.920	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	22	316.590	6,964.980	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34	17.870	607.580	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	113	109.570	12,381.410	
LIVE NATION	32	80.500	2,576.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	1,847.630	11,085.780	
TRANSDIGM GROUP INC	11	830.620	9,136.820	
MASTERCARD INC	171	387.870	66,325.770	
OWENS CORNING	19	122.830	2,333.770	
LEIDOS HOLDINGS INC	23	93.410	2,148.430	
AERCAP HOLDINGS NV	33	58.110	1,917.630	
FIRST SOLAR INC	22	151.970	3,343.340	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	23	175.900	4,045.700	

SUPER MICRO COMPUTER INC	10	265.050	2,650.500	
AECOM TECHNOLOGY CORP	27	78.110	2,108.970	
DELTA AIR LINES INC	27	32.710	883.170	
INSULET CORP	15	145.240	2,178.600	
DISCOVER FINANCIAL	50	84.590	4,229.500	
TE CONNECTIVITY LTD	67	119.350	7,996.450	
LULULEMON ATHLETICA INC	24	396.190	9,508.560	
VMWARE INC	51	150.310	7,665.810	
MERCADOLIBRE INC	9	1,179.960	10,619.640	
ULTA BEAUTY INC	10	372.860	3,728.600	
INVESCO LTD	75	12.800	960.000	
MSCI INC	16	497.270	7,956.320	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	319	90.730	28,942.870	
VISA INC	327	233.810	76,455.870	
KEURIG DR PEPPER INC	195	28.450	5,547.750	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40	117.020	4,680.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	86	152.840	13,144.240	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	23	57.600	1,324.800	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	411	17.010	6,991.110	
XYLEM INC	50	92.160	4,608.000	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	49	92.750	4,544.750	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	8	221.330	1,770.640	
SPLUNK INC	31	147.900	4,584.900	
EPAM SYSTEMS INC	13	230.730	2,999.490	
HCA HEALTHCARE INC	41	244.050	10,006.050	
VERISK ANALYTICS INC	30	234.450	7,033.500	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	132.030	2,112.480	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13	241.970	3,145.610	
NXP SEMICONDUCTOR NV	55	187.930	10,336.150	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	28	123.310	3,452.680	
TARGA RESOURCES CORP	45	87.710	3,946.950	
LEAR CORP	13	130.370	1,694.810	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	23	162.730	3,742.790	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	40	50.780	2,031.200	
DOLLAR GENERAL CORP	47	115.510	5,428.970	
FORTINET INC	132	57.770	7,625.640	
HYATT HOTELS CORP	8	103.880	831.040	
TESLA INC	576	220.110	126,783.360	
GENERAC HOLDINGS INC	15	93.960	1,409.400	
ENPHASE ENERGY INC	31	115.900	3,592.900	

GENERAL MOTORS CO	280	29.330	8,212.400	
ALLY FINANCIAL INC	39	24.620	960.180	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	15	225.880	3,388.200	
APTIV PLC	60	90.250	5,415.000	
PHILLIPS 66	95	115.190	10,943.050	
META PLATFORMS INC	447	312.810	139,826.070	
IQVIA HOLDINGS INC	37	186.750	6,909.750	
DIAMONDBACK ENERGY INC	36	168.920	6,081.120	
SERVICENOW INC	41	559.980	22,959.180	
PALO ALTO NETWORKS INC	61	253.130	15,440.930	
WORKDAY INC	43	213.260	9,170.180	
ABBVIE INC	356	145.520	51,805.120	
ZOETIS INC	93	168.040	15,627.720	
NEWS CORP/NEW-CL A	90	21.620	1,945.800	
CDW CORP	26	202.850	5,274.100	
HOWMET AEROSPACE INC	90	43.710	3,933.900	
TWILIO INC	30	55.410	1,662.300	
SNAP INC	190	9.650	1,833.500	
TRADE DESK INC A	89	75.870	6,752.430	
OKTA INC	35	85.460	2,991.100	
BAKER HUGHES CO	219	35.580	7,792.020	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	35	87.490	3,062.150	
BROADCOM INC	83	867.830	72,029.890	
ARES MANAGEMENT CORP	35	105.130	3,679.550	
MONGODB INC	14	358.000	5,012.000	
BURLINGTON STORES INC	14	120.620	1,688.680	
VEEVA SYSTEMS INC	30	202.170	6,065.100	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	31	35.750	1,108.250	
EVERGY INC	37	48.520	1,795.240	
ALLEGION PLC	20	98.560	1,971.200	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	30	71.300	2,139.000	
STERIS PLC	19	216.900	4,121.100	
DOCUSIGN INC	51	41.140	2,098.140	
WIX.COM LTD	14	84.080	1,177.120	
DROPBOX INC	57	27.320	1,557.240	
KKR & CO INC	125	55.610	6,951.250	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	16	58.430	934.880	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	51	62.360	3,180.360	
MODERNA INC	64	82.370	5,271.680	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	52	150.310	7,816.120	
ARAMARK	53	26.420	1,400.260	
CIGNA GROUP	59	310.170	18,300.030	
DELL TECHNOLOGIES INC	58	67.030	3,887.740	
DOW INC	137	49.450	6,774.650	
OVINTIV INC	50	50.870	2,543.500	

AMCOR PLC	318	8.620	2,741.160	
PINTEREST INC	117	26.550	3,106.350	
FOX CORP-A	71	30.850	2,190.350	
FOX CORP-B	24	28.510	684.240	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	105	6.720	705.600	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	47	184.520	8,672.440	
CHEWY INC	26	16.860	438.360	
AVANTOR INC	134	20.830	2,791.220	
DYNATRACE INC	55	47.600	2,618.000	
CLOUDFLARE INC	51	62.790	3,202.290	
TRADEWEB MARKETS INC	24	82.470	1,979.280	
CARRIER GLOBAL CORP	177	49.000	8,673.000	
OTIS WORLDWIDE CORP	81	78.170	6,331.770	
UBER TECHNOLOGIES INC	376	42.720	16,062.720	
CORTEVA INC	134	50.960	6,828.640	
MATCH GROUP INC	66	36.200	2,389.200	
FERGUSON PLC	40	155.290	6,211.600	
BILL HOLDINGS INC	19	102.500	1,947.500	
BLACKSTONE INC	146	94.220	13,756.120	
PAYLOCITY HOLDING CORP	9	196.050	1,764.450	
CARLYLE GROUP INC	43	27.540	1,184.220	
DATADOG INC	49	87.750	4,299.750	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	32	66.870	2,139.840	
INGERSOLL RAND INC	79	61.220	4,836.380	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	86	65.450	5,628.700	
PAYCOM SOFTWARE INC	9	265.500	2,389.500	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	116	17.160	1,990.560	
DRAFTKINGS INC	95	27.720	2,633.400	
UNITY SOFTWARE INC	51	27.490	1,401.990	
AON PLC	42	319.080	13,401.360	
WARNER BROS DISCOVERY INC	467	10.390	4,852.130	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1	1,965.020	1,965.020	
BENTLEY SYSTEMS INC	36	51.360	1,848.960	
COINBASE GLOBAL INC	30	73.100	2,193.000	
UIPATH INC	70	16.040	1,122.800	
AIRBNB INC	83	119.970	9,957.510	
CONSTELLATION ENERGY CORP	67	114.290	7,657.430	
MONDAY.COM LTD	3	138.880	416.640	
ROYALTY PHARMA PLC	75	28.110	2,108.250	
ROBLOX CORP	91	31.670	2,881.970	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	69	17.000	1,173.000	
VIATRIS INC	263	9.310	2,448.530	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	48	41.910	2,011.680	

CHESAPEAKE ENERGY CORP	22	88.770	1,952.940	
HF SINCLAIR CORP	37	56.690	2,097.530	
SNOWFLAKE INC	52	153.430	7,978.360	
DOORDASH INC	48	73.370	3,521.760	
ARISTA NETWORKS INC	52	191.480	9,956.960	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	81	83.380	6,753.780	
GLOBAL-E ONLINE LTD	18	35.340	636.120	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	385	17.060	6,568.100	
FNF GROUP	57	38.410	2,189.370	
JACOBS SOLUTIONS INC	25	132.820	3,320.500	
MARVELL TECHNOLOGY INC	169	50.690	8,566.610	
APA CORP	57	43.300	2,468.100	
CONFLUENT INC	33	29.820	984.060	
LINDE PLC	98	370.140	36,273.720	
ROBINHOOD MARKETS INC	115	8.970	1,031.550	
LUCID GROUP INC	213	4.340	924.420	
U-HAUL HOLDING CO	18	50.190	903.420	
ASPEN TECHNOLOGY INC	6	189.600	1,137.600	
TOAST INC	48	17.810	854.880	
GRAB HOLDINGS LTD	357	3.300	1,178.100	
CATALENT INC	39	43.140	1,682.460	
SYNCHRONY FINANCIAL	104	28.760	2,991.040	
VERALTO CORP	48	70.290	3,373.920	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	36	25.230	908.280	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	39	68.400	2,667.600	
KENVUE INC	328	19.840	6,507.520	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	111	24.880	2,761.680	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	168.040	1,344.320	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	36	123.990	4,463.640	
HUBSPOT INC	9	444.830	4,003.470	
QORVO INC	17	90.980	1,546.660	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	20	91.100	1,822.000	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	13	113.980	1,481.740	
GODADDY INC	29	75.470	2,188.630	
ETSY INC	26	65.420	1,700.920	
TRANSUNION	39	66.350	2,587.650	
ALBERTSONS COS INC	55	22.340	1,228.700	
BLOCK INC	106	44.170	4,682.020	
DUPONT DE NEMOURS INC	93	73.980	6,880.140	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	41	57.830	2,371.030	

WESTROCK CO	54	35.340	1,908.360	
KRAFT HEINZ CO	178	31.450	5,598.100	
FORTIVE CORP	72	71.100	5,119.200	
WASTE CONNECTIONS INC	51	136.030	6,937.530	
ALPHABET INC-CL A	1,200	137.750	165,300.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	251	16.300	4,091.300	
PAYPAL HOLDINGS INC	212	54.810	11,619.720	
SEA LTD ADR	78	45.090	3,517.020	
EQUITABLE HOLDINGS INC	60	27.640	1,658.400	
ZILLOW GROUP INC-C	29	39.390	1,142.310	
ALPHABET INC-CL C	1,068	138.980	148,430.640	
ZSCALER INC	16	169.070	2,705.120	
ATLASSIAN CORP PLC	33	192.400	6,349.200	
ROKU INC	20	62.480	1,249.600	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	19	435.870	8,281.530	
VISTRA CORP	67	32.110	2,151.370	
アメリカ・ドル	小計	69,355	7,486,545.370 (1,122,682,344)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	69	13.470	929.430
	ASHTREAD GROUP	88	47.770	4,203.760
	SEVERN TRENT PLC	53	25.140	1,332.420
	BARCLAYS PLC	3,262	1.478	4,821.230
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	208	3.925	816.400
	BT GROUP PLC	1,139	1.160	1,321.240
	BUNZL PLC	65	28.900	1,878.500
	CRH PLC	149	45.680	6,806.320
	AVIVA PLC	521	4.049	2,109.520
	CRODA INTERNATIONAL	30	41.350	1,240.500
	DIAGEO PLC	451	31.140	14,044.140
	SCHRODERS PLC	229	3.743	857.140
	DCC PLC	22	45.270	995.940
	NATIONAL GRID PLC	732	9.718	7,113.570
	KINGFISHER PLC	413	2.029	837.970
	BAE SYSTEMS PLC	633	10.405	6,586.360
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	442	24.880	10,996.960
	HALMA PLC	74	18.605	1,376.770
	NEXT PLC	27	69.640	1,880.280
	IMPERIAL BRANDS PLC	188	17.205	3,234.540
	JOHNSON MATTHEY PLC	52	14.920	775.840
	ANGLO AMERICAN PLC	245	21.560	5,282.200
	COMPASS GROUP PLC	346	20.460	7,079.160
	HSBC HOLDINGS PLC	3,978	6.412	25,506.930
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,098	2.118	2,325.560
	CENTRICA PLC	1,265	1.571	1,987.310

UNILEVER PLC	508	39.885	20,261.580	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	165	10.160	1,676.400	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	76	19.410	1,475.160	
PEARSON PLC	156	9.080	1,416.480	
PERSIMMON PLC	64	9.800	627.200	
PRUDENTIAL PLC	589	8.596	5,063.040	
RIO TINTO PLC	226	50.520	11,417.520	
VODAFONE GROUP PLC	4,486	0.766	3,436.270	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	149	59.420	8,853.580	
RELX PLC	389	28.800	11,203.200	
RENTOKIL INITIAL PLC	537	4.839	2,598.540	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,645	2.056	3,382.120	
NATWEST GROUP PLC	1,183	2.224	2,630.990	
ST JAMES'S PLACE PLC	100	6.354	635.400	
SSE PLC	234	15.870	3,713.580	
BP PLC	3,461	5.529	19,135.860	
SAGE GROUP PLC(THE)	196	9.878	1,936.080	
SMITHS GROUP PLC	80	15.420	1,233.600	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14	83.840	1,173.760	
STANDARD CHARTERED PLC	516	7.356	3,795.690	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,592	0.418	5,263.450	
TAYLOR WIMPLEY PLC	400	1.049	419.600	
TESCO PLC	1,495	2.739	4,094.800	
3I GROUP PLC	191	20.310	3,879.210	
SMITH & NEPHEW PLC	195	9.208	1,795.560	
GSK PLC	821	14.512	11,914.350	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	86	82.260	7,074.360	
WPP PLC	202	7.012	1,416.420	
ASTRAZENECA PLC	312	104.880	32,722.560	
WHITBREAD PLC	39	33.410	1,302.990	
INTERTEK GROUP PLC	29	40.720	1,180.880	
BURBERRY GROUP PLC	83	17.220	1,429.260	
INTERCONTINENTAL HOTELS	29	61.540	1,784.660	
SAINSBURY (J) PLC	302	2.553	771.000	
ADMIRAL GROUP PLC	59	24.890	1,468.510	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	12	39.800	477.600	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	43	19.920	856.560	
ABRDN PLC	388	1.535	595.580	
EXPERIAN PLC	184	26.380	4,853.920	
MONDI PLC	125	12.520	1,565.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	117	6.922	809.870	
OCADO GROUP PLC	126	5.022	632.770	

	INFORMA PLC	294	7.016	2,062.700	
	GLENCORE PLC	2,111	4.501	9,501.610	
	ENTAIN PLC	153	9.422	1,441.560	
	COCA-COLA HBC AG	32	21.370	683.840	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	130	4.551	591.630	
	M&G PLC	366	1.984	726.140	
	ENDEAVOUR MINING PLC	18	16.860	303.480	
	WISE PLC	103	6.924	713.170	
	JD SPORTS FASHION PLC	595	1.300	773.500	
	HALEON PLC	1,081	3.346	3,617.020	
	SHELL PLC	1,345	27.580	37,095.100	
	AUTO TRADER GROUP PLC	134	6.114	819.270	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	296	4.607	1,363.670	
イギリス・ポンド	小計	55,041		368,007.640 (66,918,509)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	318	28.950	9,206.100	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	266	26.000	6,916.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5	777.000	3,885.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	247	17.360	4,287.920	
	ICL GROUP LTD	193	20.720	3,998.960	
	NICE LTD	12	644.000	7,728.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17	121.000	2,057.000	
	AZRIELI GROUP	17	175.000	2,975.000	
イスラエル・シュケル	小計	1,075		41,053.980 (1,521,941)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	30	50.490	1,514.700	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	703	21.150	14,868.450	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	349	21.870	7,632.630	
	TELSTRA GROUP LTD	956	3.870	3,699.720	
	ASX LTD	48	55.370	2,657.760	
	BHP GROUP LTD	1,035	45.230	46,813.050	
	AMPOL LTD	49	32.170	1,576.330	
	COMPUTERSHARE LT	107	26.030	2,785.210	
	CSL LIMITED	97	235.870	22,879.390	
	REA GROUP LTD	6	156.860	941.160	
	TRANSURBAN GROUP	640	12.050	7,712.000	
	COCHLEAR LTD	14	250.610	3,508.540	
	ORIGIN ENERGY LTD	315	9.220	2,904.300	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	337	99.780	33,625.860	
	RIO TINTO LIMITED	80	115.470	9,237.600	
	APA GROUP	248	8.000	1,984.000	
ARISTOCRAT LEISU	110	38.740	4,261.400		

	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	522	5.790	3,022.380	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	76	40.000	3,040.000	
	IGO LTD	118	11.400	1,345.200	
	ORICA LTD	100	15.200	1,520.000	
	LEND LEASE CORP LTD	207	6.580	1,362.060	
	BLUESCOPE STEEL LTD	51	17.750	905.250	
	MACQUARIE GROUP LTD	71	164.100	11,651.100	
	SUNCORP GROUP LTD	237	13.970	3,310.890	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	625	29.120	18,200.000	
	NEWCREST MINING LTD	195	25.140	4,902.300	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	136	4.740	644.640	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	288	15.860	4,567.680	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	244	11.980	2,923.120	
	REECE LTD	30	17.800	534.000	
	SANTOS LTD	623	7.850	4,890.550	
	SONIC HEALTHCARE	85	29.620	2,517.700	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	40	34.480	1,379.200	
	WESFARMERS LTD	224	51.700	11,580.800	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	392	36.560	14,331.520	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	233	36.790	8,572.070	
	SEEK LTD	81	22.440	1,817.640	
	MINERAL RESOURCES LTD	45	61.040	2,746.800	
	BRAMBLES LTD	288	14.270	4,109.760	
	PILBARA MINERALS LTD	512	3.860	1,976.320	
	AURIZON HOLDINGS LTD	267	3.500	934.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	186	11.870	2,207.820	
	XERO LTD	27	111.080	2,999.160	
	IDP EDUCATION LTD	49	21.790	1,067.710	
	LOTTERY CORP LTD	433	4.420	1,913.860	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	402	5.170	2,078.340	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	597	25.630	15,301.110	
	MEDIBANK PVT LTD	498	3.570	1,777.860	
	SOUTH32 LTD(AUD)	1,072	3.390	3,634.080	
	COLES GROUP LTD	269	15.160	4,078.040	
	WISETECH GLOBAL LTD	39	61.630	2,403.570	
	オーストラリア・ドル 小計	14,386		318,849.130 (30,204,578)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	103	68.070	7,011.210	
	BARRICK GOLD CORP	342	22.740	7,777.080	
	BANK OF MONTREAL	142	108.440	15,398.480	

BANK OF NOVA SCOTIA	232	58.230	13,509.360	
NATIONAL BANK OF CANADA	72	88.550	6,375.600	
BCE INC	8	51.510	412.080	
BROOKFIELD CORP	286	42.800	12,240.800	
SAPUTO INC	46	27.130	1,247.980	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	122	7.070	862.540	
DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17	100.710	1,712.070	
CGI INC	46	135.170	6,217.820	
CCL INDUSTRIES INC	36	55.450	1,996.200	
CAE INC	67	29.340	1,965.780	
CAMECO CORP	90	52.610	4,734.900	
ROGERS COMM-CL B	73	52.010	3,796.730	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	188	50.320	9,460.160	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	217	91.150	19,779.550	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	11	139.060	1,529.660	
CANADIAN UTILITIES LTD	43	29.140	1,253.020	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	114	144.120	16,429.680	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31	39.870	1,235.970	
OPEN TEXT CORP	50	45.860	2,293.000	
EMPIRE CO LTD	12	37.250	447.000	
KINROSS GOLD CORP	311	7.360	2,288.960	
RB GLOBAL INC	33	87.700	2,894.100	
FORTIS INC	102	53.970	5,504.940	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	116	30.990	3,594.840	
TELUS CORP	88	22.450	1,975.600	
GREAT WEST LIFECO INC	70	38.640	2,704.800	
IMPERIAL OIL LTD	39	83.580	3,259.620	
ENBRIDGE INC	431	44.020	18,972.620	
IGM FINANCIAL INC	35	32.210	1,127.350	
MANULIFE FINANCIAL CORP	354	24.430	8,648.220	
LOBLAW CO LTD	33	111.870	3,691.710	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	154	73.800	11,365.200	
MAGNA INTERNATIONAL INC	55	69.230	3,807.650	
SUN LIFE FINANCIAL INC	118	64.120	7,566.160	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4	1,108.900	4,435.600	
METRO INC	39	70.210	2,738.190	
EMERA INC	58	45.530	2,640.740	
ONEX CORP	13	76.600	995.800	
PAN AMERICAN SILVER CORP	73	20.890	1,524.970	
POWER CORP OF CANADA	133	34.010	4,523.330	
QUEBECOR INC-B	38	28.350	1,077.300	
ROYAL BANK OF CANADA	282	113.030	31,874.460	

CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	190	97.780	18,578.200	
STANTEC INC	18	84.770	1,525.860	
SUNCOR ENERGY INC	278	47.290	13,146.620	
LUNDIN MINING CORP	208	8.960	1,863.680	
TECK RESOURCES LTD-CL B	84	54.780	4,601.520	
THOMSON REUTERS CORP	36	168.010	6,048.360	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	19	106.400	2,021.600	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	364	79.920	29,090.880	
TC ENERGY CORP	194	47.350	9,185.900	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	10	93.330	933.300	
WESTON (GEORGE) LTD	16	146.010	2,336.160	
INTACT FINANCIAL CORP	38	198.440	7,540.720	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	92	58.950	5,423.400	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	2,857.610	11,430.440	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	42	189.350	7,952.700	
TOURMALINE OIL CORP	60	73.280	4,396.800	
KEYERA CORP	42	32.970	1,384.740	
PARKLAND CORP	41	41.360	1,695.760	
ALTAGAS LTD	79	26.100	2,061.900	
PEMBINA PIPELINE CORP	110	42.220	4,644.200	
DOLLARAMA INC	54	94.020	5,077.080	
CENOVUS ENERGY INC W/I	297	29.030	8,621.910	
ARC RESOURCES LTD	94	22.580	2,122.520	
NORTHLAND POWER INC	57	20.320	1,158.240	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	70	18.860	1,320.200	
TMX GROUP LTD	40	29.530	1,181.200	
BRP INC	7	97.310	681.170	
IVANHOE MINES LTD	91	10.880	990.080	
NUTRIEN LTD	96	83.480	8,014.080	
TFI INTERNATIONAL INC	19	160.690	3,053.110	
WSP GLOBAL INC	26	186.290	4,843.540	
IA FINANCIAL CORP INC	17	81.850	1,391.450	
GFL ENVIRONMENTAL INC	49	41.230	2,020.270	
NUVEI CORP	14	21.260	297.640	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	18	31.450	566.100	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	80	42.160	3,372.800	
AIR CANADA	21	17.080	358.680	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	61	90.490	5,519.890	
SHOPIFY INC	240	71.100	17,064.000	
FIRSTSERVICE CORP	9	192.150	1,729.350	

	HYDRO ONE LTD	74	34.890	2,581.860	
カナダ・ドル 小計		8,286		472,726.740 (51,645,396)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	300	3.790	1,137.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	100	4.560	456.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	400	33.170	13,268.000	
	SEATRIM LTD	5,725	0.117	669.820	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	200	9.650	1,930.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	800	0.830	664.000	
	KEPPEL CORP LTD	300	6.250	1,875.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	700	12.830	8,981.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,400	2.360	3,304.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	400	6.050	2,420.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	300	27.880	8,364.000	
	UOL GROUP LIMITED	100	6.220	622.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	300	3.510	1,053.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	600	3.020	1,812.000	
シンガポール・ドル 小計		11,625		46,555.820 (5,082,499)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	39	63.020	2,457.780	
	NESTLE SA-REGISTERED	541	98.750	53,423.750	
	CIE FINANC RICHEMONT	107	106.050	11,347.350	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	141	238.450	33,621.450	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8	184.100	1,472.800	
	SIKA INHABER	31	218.200	6,764.200	
	SGS SA-REG	27	76.120	2,055.240	
	NOVARTIS AG-REG SHS	414	84.750	35,086.500	
	BALOISE HOLDING AG -R	8	129.100	1,032.800	
	BARRY CALLEBAUT AG	1	1,361.000	1,361.000	
	CLARIANT AG-REG	69	12.360	852.840	
	SWISSCOM AG-REG	6	539.400	3,236.400	
	ABB LTD	327	30.260	9,895.020	
	ADECCO GROUP AG-REG	44	34.360	1,511.840	
	GEBERIT AG	7	427.700	2,993.900	
	LONZA GROUP AG-REG	16	342.000	5,472.000	
	GIVAUDAN-REG	2	2,897.000	5,794.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	30	425.700	12,771.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	7	252.600	1,768.200	
	HOLCIM LTD	106	56.480	5,986.880	
	TEMENOS GROUP	7	62.640	438.480	
BACHEM HOLDING AG	5	65.800	329.000		
SONOVA HOLDING AG	10	213.700	2,137.000		

	KUEHNE & NAGEL INTL AG	11	251.700	2,768.700	
	STRAUMANN HOLDING AG	23	113.500	2,610.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6	229.600	1,377.600	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	43.450	434.500	
	HELVETIA HOLDING AG	9	120.000	1,080.000	
	SCHINDLER NAMEN	6	178.600	1,071.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	6	574.000	3,444.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	8	99.250	794.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	2	604.000	1,208.000	
	SWISS PRIME SITE AG	12	82.350	988.200	
	DUFREY GROUP	9	31.400	282.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	5	976.600	4,883.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	42	55.320	2,323.440	
	SWISS RE LTD	63	98.380	6,197.940	
	BKW AG	7	153.100	1,071.700	
	SIG GROUP AG	50	19.490	974.500	
	ALCON INC	103	65.300	6,725.900	
	SANDOZ GROUP AG	85	27.770	2,360.450	
	UBS GROUP AG	659	21.710	14,306.890	
	VAT GROUP AG	5	325.800	1,629.000	
スイス・フラン	小計	3,074		258,341.950 (43,401,448)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	558	142.800	79,682.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	288	125.650	36,187.200	
	ERICSSON LM-B SHS	561	49.510	27,775.110	
	GETINGE AB-B SHS	49	190.700	9,344.300	
	LUNDBERGS B	9	449.900	4,049.100	
	SKF AB-B SHS	67	173.100	11,597.700	
	SANDVIK AB	223	189.950	42,358.850	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	321	134.450	43,158.450	
	SKANSKA AB-B SHS	48	168.150	8,071.200	
	SWEDBANK AB	157	206.700	32,451.900	
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	143	153.700	21,979.100	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	265	100.550	26,645.750	
	VOLVO AB-A SHS	47	225.600	10,603.200	
	VOLVO AB-B SHS	307	222.850	68,414.950	
	HOLMEN AB-B SHS	28	415.400	11,631.200	
	TELE2 AB-B SHS	145	85.100	12,339.500	
	INDUSTRIVARDEN A	19	285.600	5,426.400	
	INDUSTRIVARDEN C	40	284.600	11,384.000	
	SAAB AB-B	13	563.600	7,326.800	
	SECURITAS AB-B SHS	101	92.280	9,320.280	
	INVESTOR AB-B SHS	335	210.000	70,350.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	125	152.920	19,115.000	

	ASSA ABLOY AB-B	221	234.600	51,846.600	
	TELIA CO AB	640	25.370	16,236.800	
	BOLIDEN AB	46	289.850	13,333.100	
	ALFA LAVAL AB	48	360.700	17,313.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	144	44.720	6,439.680	
	INDUTRADE AB	76	190.000	14,440.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25	79.140	1,978.500	
	NIBE INDUSTRIER AB	342	65.280	22,325.760	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	41	208.800	8,560.800	
	HEXAGON AB-B SHS	385	95.760	36,867.600	
	SAGAX AB	60	189.700	11,382.000	
	EPIROC AB-A	126	203.600	25,653.600	
	EPIROC AB-B	56	171.900	9,626.400	
	ESSITY AB-B	122	244.100	29,780.200	
	EQT AB	78	207.000	16,146.000	
	VOLVO CAR AB	144	45.430	6,541.920	
	BEIJER REF AB	40	101.500	4,060.000	
	LIFCO AB	43	177.650	7,638.950	
	EVOLUTION AB	41	1,046.200	42,894.200	
	NORDEA BANK ABP	704	120.760	85,015.040	
	INVESTMENT AB LATOUR	23	187.100	4,303.300	
スウェーデン・クローナ 小計		7,254		1,001,596.440 (13,691,823)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	20	877.400	17,548.000	
	A P MOLLER A/S	1	11,570.000	11,570.000	
	AP MOLLER MAERSK A	1	11,460.000	11,460.000	
	DANSKE BANK A/S	135	164.600	22,221.000	
	GENMAB A/S	13	1,986.000	25,818.000	
	NOVOZYMES-B SHS	48	284.300	13,646.400	
	ROCKWOOL AS	2	1,518.500	3,037.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	658	684.200	450,203.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	208	141.360	29,402.880	
	COLOPLAST-B	23	708.000	16,284.000	
	DSV A/S	39	1,130.500	44,089.500	
	DEMANT A/S	9	266.100	2,394.900	
	TRYG A/S	84	137.650	11,562.600	
	PANDORA A/S	21	814.600	17,106.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	27	430.500	11,623.500	
ORSTED A/S	34	325.000	11,050.000		
デンマーク・クローネ 小計		1,323		699,017.980 (14,847,142)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	345	7.810	2,694.450	
	EBOS GROUP LTD	18	34.290	617.220	
	FISHER & PAYKEL	148	21.150	3,130.200	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	235	4.980	1,170.300	

	MIGHTY RIVER POWER LTD	87	6.045	525.910	
	MERIDIAN ENERGY LTD	226	5.080	1,148.080	
ニュージーランド・ドル 小計		1,059		9,286.160 (812,168)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	113	182.150	20,582.950	
	NORSK HYDRO ASA	235	59.320	13,940.200	
	TELENOR ASA	162	115.400	18,694.800	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	26	477.000	12,402.000	
	ORKLA ASA	135	80.680	10,891.800	
	EQUINOR ASA	195	377.800	73,671.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33	386.000	12,738.000	
	AKER BP ASA	61	317.800	19,385.800	
	SALMAR ASA	11	529.400	5,823.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24	158.100	3,794.400	
	ADEVINTA ASA	72	104.000	7,488.000	
	DNB BANK ASA	170	207.600	35,292.000	
ノルウェー・クローネ 小計		1,237		234,704.350 (3,194,326)	
ユーロ	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	35	146.000	5,110.000	
	KERRY GROUP PLC-A	33	72.500	2,392.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	30	64.160	1,924.800	
	UMICORE	47	24.040	1,129.880	
	AIR LIQUIDE	103	157.040	16,175.120	
	AIRBUS SE	117	123.900	14,496.300	
	AXA SA	376	27.875	10,481.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	150	25.720	3,858.000	
	ADIDAS AG	35	174.320	6,101.200	
	ASSICURAZIONI GENERALI	198	18.580	3,678.840	
	DASSAULT AVIATION SA	4	183.500	734.000	
	DANONE	137	54.080	7,408.960	
	SAFRAN SA	70	148.460	10,392.200	
	INTESA SANPAOLO	3,038	2.375	7,215.250	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	64	95.310	6,099.840	
	ACCOR SA	28	30.200	845.600	
	BOUYGUES	48	31.470	1,510.560	
	BNP PARIBAS	214	56.710	12,135.940	
	THALES SA	21	138.300	2,904.300	
	CAPGEMINI SA	32	164.400	5,260.800	
	UNICREDIT SPA	365	22.505	8,214.320	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	17	86.800	1,475.600	
	D' IETEREN TRDG	6	148.000	888.000	
	COMMERZBANK AG	231	10.255	2,368.900	
EIFFAGE	18	85.420	1,537.560		
FRESENIUS SE & CO KGAA	76	24.900	1,892.400		

PUBLICIS GROUPE	51	74.500	3,799.500	
IBERDROLA SA	1,327	10.410	13,814.070	
ENI SPA	494	15.452	7,633.280	
JERONIMO MARTINS	51	20.600	1,050.600	
KESKO OYJ-B	72	15.325	1,103.400	
KBC GROUPE	54	53.860	2,908.440	
HANNOVER RUECK SE	14	210.800	2,951.200	
WARTSILA OYJ	111	9.870	1,095.570	
L'OREAL	48	386.200	18,537.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	55	670.600	36,883.000	
GEA GROUP AG	28	32.940	922.320	
BOLLORE	224	5.055	1,132.320	
MEDIOBANCA SPA	115	11.230	1,291.450	
MICHELIN(CGDE) -B	141	28.450	4,011.450	
CONTINENTAL AG	25	60.980	1,524.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	200	37.845	7,569.000	
OMV AG	35	42.940	1,502.900	
VERBUND AG	13	82.350	1,070.550	
PERNOD-RICARD	42	166.150	6,978.300	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	27	45.810	1,236.870	
RENAULT SA	42	33.425	1,403.850	
REPSOL SA	233	14.990	3,492.670	
REMY COINTREAU	3	119.200	357.600	
MERCK KGAA	27	150.050	4,051.350	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	99	50.240	4,973.760	
RWE AG	123	34.240	4,211.520	
SEB SA	9	88.450	796.050	
SOCIETE GENERALE-A	141	21.395	3,016.690	
VINCI S.A.	109	100.600	10,965.400	
SODEXO	15	98.300	1,474.500	
SOFINA	3	180.900	542.700	
SOLVAY SA	18	98.680	1,776.240	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	108	145.740	15,739.920	
VIVENDI SE	106	8.256	875.130	
SAP SE	209	127.280	26,601.520	
TELEFONICA S.A	1,040	3.802	3,954.080	
TOTALENERGIES SE	448	63.330	28,371.840	
VALEO	32	12.590	402.880	
E.ON SE	441	10.910	4,811.310	
VOEST-ALPINE AG	26	23.940	622.440	
HENKEL AG & CO KGAA	16	58.920	942.720	
SIEMENS AG-REG	155	129.860	20,128.300	
UPM-KYMMENE OYJ	107	31.640	3,385.480	
ING GROEP NV-CVA	722	12.376	8,935.470	
PUMA AG	14	50.560	707.840	
BAYER AG	203	42.145	8,555.430	

STORA ENSO OYJ-R SHS	97	11.355	1,101.430	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	40	67.120	2,684.800	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	162	63.450	10,278.900	
BASF SE	186	41.430	7,705.980	
BEIERSDORF AG	20	121.050	2,421.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	26	70.840	1,841.840	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	38	33.150	1,259.700	
ASM INTERNATIONAL NV	10	370.050	3,700.500	
ORANGE	417	10.906	4,547.800	
SAMPO OYJ-A SHS	92	37.600	3,459.200	
RANDSTAD NV	20	48.460	969.200	
ALLIANZ SE	79	221.250	17,478.750	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	651	3.755	2,444.500	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	211	27.515	5,805.660	
HERMES INTL	6	1,680.000	10,080.000	
ENDESA S.A.	49	19.030	932.470	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	81	6.808	551.440	
ERSTE GROUP BANK AG	69	32.500	2,242.500	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	28	377.700	10,575.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	120	21.365	2,563.800	
DASSAULT SYSTEMES SA	140	34.845	4,878.300	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	42	32.510	1,365.420	
RHEINMETALL STAMM	8	258.300	2,066.400	
HEINEKEN NV	57	83.480	4,758.360	
AKZO NOBEL	41	64.060	2,626.460	
ASML HOLDING NV	81	562.500	45,562.500	
AEGON LTD	404	4.583	1,851.530	
VOLKSWAGEN AG	5	118.100	590.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	45	105.300	4,738.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,217	7.624	9,278.400	
KERING	14	410.650	5,749.100	
ACCIONA S.A.	4	119.250	477.000	
FORTUM OYJ	90	11.010	990.900	
AGEAS	25	38.960	974.000	
UCB SA	23	72.460	1,666.580	
NEMETSCHEK SE	12	64.080	768.960	
CARREFOUR SA	136	15.820	2,151.520	
NATURGY ENERGY GROUP SA	15	26.360	395.400	
NOKIA OYJ	1,012	3.050	3,086.600	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	189	17.474	3,302.580	
WOLTERS KLUWER-CVA	53	121.400	6,434.200	
SANOFI	228	98.810	22,528.680	
STMICROELECTRONICS NV	149	38.935	5,801.310	

ELISA OYJ	33	41.720	1,376.760	
BANCO SANTANDER SA	3,320	3.508	11,646.560	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	72	15.075	1,085.400	
QIAGEN N.V.	53	35.460	1,879.380	
DEUTSCHE BANK AG-REG	374	9.749	3,646.120	
BMW VORZUG	8	88.100	704.800	
ENEL SPA	1,606	5.682	9,125.290	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	646	20.350	13,146.100	
SARTORIUS AG	5	257.500	1,287.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	256	30.065	7,696.640	
RATIONAL AG	1	577.500	577.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG	12	78.040	936.480	
BECHTLE AG	21	41.620	874.020	
KONINKLIJKE KPN NV	551	3.139	1,729.580	
EUROFINS SCIENTIFIC	25	47.480	1,187.000	
TELEPERFORMANCE	14	118.850	1,663.900	
DEUTSCHE BOERSE AG	40	157.650	6,306.000	
EURAZEO	11	52.800	580.800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15	70.200	1,053.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	24	70.350	1,688.400	
INDITEX	225	33.960	7,641.000	
ESSILORLUXOTTICA	58	162.140	9,404.120	
SNAM SPA	307	4.425	1,358.470	
CREDIT AGRICOLE SA	218	11.378	2,480.400	
ENAGAS	51	15.980	814.980	
WENDEL	6	75.200	451.200	
TENARIS SA	87	15.625	1,359.370	
TELECOM ITALIA SPA	1,698	0.267	453.360	
TERNA SPA	287	7.240	2,077.880	
BIOMERIEUX	11	85.900	944.900	
GRIFOLS SA	92	10.715	985.780	
NESTE OYJ	79	29.970	2,367.630	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	19	44.620	847.780	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	89	10.935	973.210	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	11	167.050	1,837.550	
KONE OYJ	74	39.050	2,889.700	
ELIA GROUP	4	91.600	366.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	5	195.000	975.000	
ENGIE	367	14.874	5,458.750	
ALSTOM	49	12.455	610.290	
IPSEN SA	5	115.400	577.000	
ARKEMA SA	14	85.480	1,196.720	
LEGRAND SA	53	83.120	4,405.360	
AMPLIFON SPA	27	27.080	731.160	

ADP	10	103.000	1,030.000	
ORION OYJ	14	36.670	513.380	
METSO CORPORATION	125	9.114	1,139.250	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	92	14.670	1,349.640	
SYMRISE AG	30	91.400	2,742.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	60	30.690	1,841.400	
PRYSMIAN SPA	62	35.110	2,176.820	
DIASORIN ITALIA SPA	3	82.220	246.660	
CAIXABANK	931	3.854	3,588.070	
BUREAU VERITAS SA	49	23.280	1,140.720	
GETLINK	48	14.675	704.400	
EDP RENOVAVEIS SA	78	14.310	1,116.180	
AMADEUS IT GROUP SA	86	54.740	4,707.640	
BRENTAG SE	30	67.960	2,038.800	
EVONIK INDUSTRIES AG	15	16.570	248.550	
EDENRED	51	52.560	2,680.560	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	239	1.679	401.280	
TALANX AG	13	59.350	771.550	
LEG IMMOBILIEN SE	19	55.760	1,059.440	
VONOVIA SE	159	20.510	3,261.090	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	237	9.326	2,210.260	
KNORR-BREMSE AG	12	54.820	657.840	
OCI NV	29	24.680	715.720	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65	46.030	2,991.950	
FERRARI NV	25	285.100	7,127.500	
ASR NEDERLAND NV	28	35.740	1,000.720	
CNH INDUSTRIAL NV	183	10.885	1,991.950	
AIB GROUP PLC	250	4.300	1,075.000	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	25	29.040	726.000	
MONCLER SPA	43	53.120	2,284.160	
NEXI SPA	160	6.460	1,033.600	
PROSUS NV	305	26.450	8,067.250	
DR ING HC F PORSCHE AG	22	91.300	2,008.600	
JDE PEET'S BV	9	25.540	229.860	
EXOR NV	21	84.420	1,772.820	
SIEMENS ENERGY AG	114	11.245	1,281.930	
EURONEXT NV	16	66.950	1,071.200	
IMCD NV	12	111.450	1,337.400	
WORLDLINE SA	47	24.080	1,131.760	
NN GROUP NV	39	30.620	1,194.180	
FINECOBANK SPA	147	10.990	1,615.530	
ARGENX SE	12	450.800	5,409.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	169	24.650	4,165.850	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	96	30.360	2,914.560	

	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	20	25.660	513.200	
	DSM-FIRMENICH AG	35	77.070	2,697.450	
	ZALANDO SE	43	22.120	951.160	
	STELLANTIS NV	437	18.086	7,903.580	
	FERROVIAL SE	111	28.390	3,151.290	
	AENA SME SA	17	139.950	2,379.150	
	CELLNEX TELECOM SAU	108	27.550	2,975.400	
	ABN AMRO BANK NV	70	13.045	913.150	
	SCOUT24 SE	20	59.940	1,198.800	
	COVESTRO AG	43	47.620	2,047.660	
	HELLOFRESH SE	26	24.410	634.660	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	178	50.550	8,997.900	
	POSTE ITALIANE SPA	150	9.522	1,428.300	
	AMUNDI SA	10	50.850	508.500	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	59	10.355	610.940	
	ADYEN NV	4	699.300	2,797.200	
	DELIVERY HERO SE	49	24.990	1,224.510	
ユーロ 小計		44,944		886,137.910 (140,497,166)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	235	57.050	13,406.750	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	36.400	18,200.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	266	282.600	75,171.600	
	MTR CORP	403	29.950	12,069.850	
	HANG SENG BANK LTD	100	92.800	9,280.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	86	20.350	1,750.100	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	67	37.350	2,502.450	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,515	5.500	8,332.500	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	43.300	23,252.100	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	684	20.800	14,227.200	
	SINO LAND CO	576	8.570	4,936.320	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	81.350	40,675.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	273	67.800	18,509.400	
	AIA GROUP LTD	2,351	66.750	156,929.250	
	HKT TRUST / HKT LTD	1,080	8.120	8,769.600	
	SANDS CHINA LTD	574	21.400	12,283.600	
	SWIRE PROPERTIES LTD	32	15.260	488.320	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	500	14.580	7,290.000	
	WH GROUP LTD	1,500	4.360	6,540.000	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	534	39.900	21,306.600	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	534	38.850	20,745.900	
香港・ドル	小計	12,847		476,666.540 (9,137,698)	
合計		231,506		1,503,637,038 (1,503,637,038)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	4.000	0.000	
	カナダ・ドル	小計	4.000	0.000 (0)	
新株予約権証券 合計			4	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	286.000	1,993.420	
		GOODMAN GROUP	380.000	8,151.000	
		GPT GROUP	525.000	1,984.500	
		MIRVAC GROUP	1,078.000	2,209.900	
		SCENTRE GROUP	1,109.000	2,794.680	
		STOCKLAND	473.000	1,759.560	
		VICINITY CENTRES	700.000	1,228.500	
	オーストラリア・ドル	小計	4,551.000	20,121.560 (1,906,114)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,079.000	1,899.040	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	600.000	1,530.000	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		500.000	760.000		
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		200.000	266.000		
シンガポール・ドル	小計	2,379.000	4,455.040 (486,357)		
投資信託受益証券 合計			6,930	2,392,471 (2,392,471)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	37.000	3,504.640	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	60.000	2,038.200	
		AMERICAN TOWER CORP	94.000	14,986.420	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	87.000	1,421.580	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28.000	4,845.400	
		BOSTON PROPERTIES INC	34.000	1,854.700	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	24.000	2,256.960	
		CROWN CASTLE INC	85.000	7,300.650	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	58.000	6,707.120	

	EQUINIX INC	19.000	13,372.390	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30.000	1,968.000	
	EQUITY RESIDENTIAL	80.000	4,679.200	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	13.000	2,785.900	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	41.000	4,612.500	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	50.000	2,282.500	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	96.000	1,394.880	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90.000	1,501.200	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	154.000	2,425.500	
	INVITATION HOMES INC	119.000	3,755.640	
	IRON MOUNTAIN INC	60.000	3,585.000	
	KIMCO REALTY	151.000	2,548.880	
	MID AMERICA	24.000	3,141.600	
	PROLOGIS INC	186.000	19,079.880	
	PUBLIC STORAGE	32.000	8,272.000	
	REALTY INCOME CORP	134.000	6,622.280	
	REGENCY CENTERS CORP	38.000	2,249.220	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	20.000	3,788.800	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	69.000	7,348.500	
	SUN COMMUNITIES INC	21.000	2,218.650	
	UDR INC	65.000	2,287.350	
	VENTAS INC	73.000	3,053.590	
	VICI PROPERTIES INC	197.000	5,531.760	
	WELLTOWER INC	99.000	8,308.080	
	WEYERHAEUSER CO	146.000	4,282.180	
	WP CAREY INC	53.000	2,836.560	
アメリカ・ドル	小計	2,567.000	168,847.710 (25,320,402)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	134.000	764.870	
	SEGRO PLC	218.000	1,543.440	
イギリス・ポンド	小計	352.000	2,308.310 (419,743)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	10.000	435.100	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15.000	259.350	
カナダ・ドル	小計	25.000	694.450 (75,869)	
ユーロ	COVIVIO	4.000	151.840	
	GECINA SA	7.000	641.550	
	KLEPIERRE	31.000	674.560	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	33.000	1,446.390	
	WAREHOUSES DE PAUW	41.000	926.600	
ユーロ	小計	116.000	3,840.940	

				(608,981)	
	香港・ドル	LINK REIT	507.000	18,226.650	
	香港・ドル	小計	507.000	18,226.650	(349,405)
投資証券	合計		3,567	26,774,400	(26,774,400)
合計				29,166,871	(29,166,871)

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額 に対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 604銘柄 投資証券 35銘柄	66.49	-	-	-	74.90
イギリス・ポンド	株式 81銘柄 投資証券 2銘柄	3.96	-	-	-	4.39
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.09	-	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄 投資信託受益証券 7銘柄	1.79	-	0.11	-	2.09
カナダ・ドル	株式 86銘柄 新株予約権証券 1銘柄 投資証券 2銘柄	3.06	0.00	-	-	3.37
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	0.30	-	0.03	-	0.36
スイス・フラン	株式 43銘柄	2.57	-	-	-	2.83
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	0.81	-	-	-	0.89
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.88	-	-	-	0.97
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.19	-	-	-	0.21
ユーロ	株式 221銘柄 投資証券 5銘柄	8.32	-	-	0.04	9.21
香港・ドル	株式 21銘柄 投資証券 1銘柄	0.54	-	-	0.02	0.62

(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10月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,317,902
コール・ローン	41,954,454
国債証券	13,190,958,625
未収利息	86,876,630
前払費用	29,207,076
流動資産合計	13,356,314,687
資産合計	13,356,314,687
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	4,994,283,961
剰余金	
剰余金又は欠損金()	8,362,030,726
元本等合計	13,356,314,687
純資産合計	13,356,314,687
負債純資産合計	13,356,314,687

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,227,014,118円
同期中追加設定元本額	12,277,243円
同期中一部解約元本額	245,007,400円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	3,610,752,364円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	645,393,677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）	503,085,859円
計	4,994,283,961円
2. 受益権の総数	4,994,283,961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 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	623,860,364	
合計	623,860,364	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年11月5日から2023年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年10月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6743円 (26,743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10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.625 08/15/30	4,540,000.000	3,405,709.360	
		US T N/B 1.25 08/15/31	3,300,000.000	2,509,611.320	
		US T N/B 1.625 05/15/31	7,300,000.000	5,772,132.760	
		US T N/B 1.875 02/15/32	6,800,000.000	5,368,281.210	
		US T N/B 2.875 05/15/32	7,400,000.000	6,311,101.530	

	US T N/B 3.375 05/15/33	3,460,000.000	3,039,934.370	
	US T N/B 3.5 02/15/33	5,700,000.000	5,071,218.750	
	US T N/B 4.375 08/31/28	2,100,000.000	2,048,976.550	
	US T N/B 5.0 08/31/25	3,200,000.000	3,188,750.010	
アメリカ・ドル	小計	43,800,000.000 (6,568,248,000)	36,715,715.860 (5,505,888,750)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.375 10/22/30	500,000.000	376,180.300	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	900,000.000	677,772.000	
	UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,000,000.000	1,786,936.000	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	2,220,000.000	1,941,782.940	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	570,000.000	556,752.060	
イギリス・ポンド	小計	6,190,000.000 (1,125,589,600)	5,339,423.300 (970,920,733)	
カナダ・ドル	CANADA 1.25 06/01/30	200,000.000	165,856.010	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,400,000.000	1,152,272.150	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,450,000.000	1,180,010.650	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,600,000.000	1,394,459.210	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,240,000.000	1,391,254.590	
カナダ・ドル	小計	5,890,000.000 (643,482,500)	5,283,852.610 (577,260,898)	
ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,900,000.000	1,550,419.000	
	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,500,000.000	1,978,756.250	
	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,900,000.000	1,573,086.000	
	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,960,000.000	1,575,898.800	
	DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	2,050,000.000	1,950,759.500	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/31	5,100,000.000	3,894,120.300	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,000,000.000	1,721,731.500	
	FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,400,000.000	1,831,680.000	
	FRANCE OAT 2.0 11/25/32	4,000,000.000	3,549,234.000	
	FRANCE OAT 2.5 05/25/30	5,460,000.000	5,207,370.860	
	FRANCE OAT 3.0 05/25/33	1,100,000.000	1,055,353.200	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	800,000.000	886,966.400	
	ITALY BTPS 0.6 08/01/31	200,000.000	147,782.800	
	ITALY BTPS 0.95 06/01/32	4,020,000.000	2,959,926.000	
	ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.000	1,426,500.000	
	ITALY BTPS 3.0 08/01/29	500,000.000	464,705.000	
	ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,000,000.000	1,894,798.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	5,200,000.000	5,037,240.000		
ユーロ	小計	44,890,000.000 (7,117,309,500)	38,706,327.610 (6,136,888,244)	
国債証券	合計	15,454,629,600 (15,454,629,600)	13,190,958,625 (13,190,958,625)	
合計			13,190,958,625 (13,190,958,625)	

(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	41.22	41.74
イギリス・ポンド	国債証券 5銘柄	7.27	7.36
カナダ・ドル	国債証券 5銘柄	4.32	4.38
ユーロ	国債証券 18銘柄	45.95	46.52

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,944,834
コール・ローン	1,198,162
投資証券	580,946,250
未収配当金	653,652
流動資産合計	586,742,898
資産合計	586,742,898
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（ ）	342,710,230
元本等合計	586,742,898
純資産合計	586,742,898
負債純資産合計	586,742,898

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	244,032,668円
同期中追加設定元本額	- 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 2023年4月21日 至 2023年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券	40,711,541	
合計	40,711,541	

(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10月21日から2023年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年10月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4044円 (24,044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10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	337.000	4,691.040	
		AGREE REALTY CORP	335.000	18,408.250	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	262.000	4,215.580	
		ALEXANDER'S INC.	7.000	1,233.820	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	625.000	59,200.000	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	39.000	645.450	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	182.000	3,290.560	
AMERICAN HOMES 4 RENT	1,223.000	41,545.310	
AMERICAN TOWER CORP	1,712.000	272,944.160	
AMERICOLD REALTY TRUST	986.000	26,700.880	
APARTMENT INCOME REIT CORP	545.000	17,096.650	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	542.000	3,436.280	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	778.000	12,323.520	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	246.000	2,528.880	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	521.000	90,159.050	
BOSTON PROPERTIES INC	574.000	31,311.700	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	217.000	601.090	
BRANDYWINE REALTY TRUST	644.000	2,543.800	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,099.000	22,287.720	
BROADSTONE NET LEASE INC	676.000	9,572.160	
BRT APARTMENTS CORP	43.000	739.600	
CAMDEN PROPERTY TRUST	381.000	35,829.240	
CARETRUST REIT INC	358.000	7,657.620	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	100.000	2,063.000	
CENTERSPACE	55.000	2,971.100	
CHATHAM LODGING TRUST	162.000	1,553.580	
CITY OFFICE REIT INC	145.000	559.700	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	864.000	3,646.080	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	89.000	2,514.250	
COPT DEFENCE PROPERTIES	408.000	9,645.120	
COUSINS PROPERTIES INC	550.000	10,087.000	
CROWN CASTLE INC	1,590.000	136,565.100	
CTO REALTY GROUTH INC	76.000	1,219.040	
CUBESMART	819.000	29,623.230	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	759.000	5,973.330	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,097.000	126,857.080	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	803.000	1,501.610	
DOUGLAS EMMETT INC	594.000	6,819.120	
EAST GROUP	160.000	25,433.600	

EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	330.000	3,534.300	
ELME COMMUNITIES	316.000	4,417.680	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	490.000	3,773.000	
EPR PROPERTIES	269.000	11,063.970	
EQUINIX INC	343.000	241,406.830	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	651.000	42,705.600	
EQUITY RESIDENTIAL	1,371.000	80,189.790	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	564.000	11,827.080	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	235.000	50,360.500	
EXTRA SPACE STORAGE INC	769.000	86,512.500	
FARMLAND PARTNERS INC	181.000	1,848.010	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	295.000	25,850.850	
FIRST INDUSTRIAL RT	485.000	20,627.050	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	312.000	6,589.440	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	331.000	556.080	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	924.000	42,180.600	
GETTY REALTY CORP	161.000	4,264.890	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	143.000	1,733.160	
GLADSTONE LAND CORP	121.000	1,677.060	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	231.000	2,007.390	
GLOBAL NET LEASE INC	700.000	5,649.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,391.000	20,211.230	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,004.000	33,426.720	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	109.000	1,076.920	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	378.000	7,064.820	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2,589.000	40,776.750	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	472.000	2,411.920	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	812.000	10,921.400	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	220.000	514.800	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	100.000	7,517.000	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	245.000	6,095.600	
INVITATION HOMES INC	2,246.000	70,883.760	
IRON MOUNTAIN INC	1,064.000	63,574.000	

JBG SMITH PROPERTIES	406.000	5,631.220	
KILROY REALTY CORP	423.000	12,334.680	
KIMCO REALTY	2,212.000	37,338.560	
KITE REALTY GROUP TRUST	788.000	16,201.280	
LAMAR ADVERTISING CO	318.000	26,355.840	
LTC PROPERTIES INC	145.000	4,611.000	
LXP INDUSTRIAL TRUST	1,043.000	8,531.740	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,161.000	10,027.040	
MID AMERICA	427.000	55,894.300	
NATIONAL HEALTH INVS INC	151.000	7,415.610	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	291.000	8,910.420	
NETSTREIT CORP	244.000	3,369.640	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	112.000	898.240	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	82.000	2,481.320	
NNN REIT INC	665.000	23,521.050	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	162.000	742.770	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	858.000	28,682.940	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	55.000	1,016.400	
ORION OFFICE REIT INC	193.000	937.980	
OUTFRONT MEDIA INC	530.000	4,897.200	
PARAMOUNT GROUP INC	682.000	3,034.900	
PARK HOTELS & RESORTS INC	778.000	9,164.840	
PEAKSTONE REALTY TRUST	131.000	1,811.730	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	440.000	5,799.200	
PHILLIPS EDISON & CO INC	424.000	14,479.600	
PHYSICIANS REALTY TRUST	859.000	9,689.520	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	456.000	2,362.080	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	155.000	3,117.050	
POSTAL REALTY TRUST INC	64.000	858.240	
POTLATCH CORP	288.000	12,709.440	
PROLOGIS INC	3,225.000	330,820.500	
PUBLIC STORAGE	576.000	148,896.000	
RAYONIER INC	537.000	13,854.600	
REALTY INCOME CORP	2,476.000	122,363.920	
REGENCY CENTERS CORP	664.000	39,302.160	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	436.000	5,179.680	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	756.000	33,694.920	
RLJ LODGING TRUST	580.000	5,579.600	

	RPT REALTY	307.000	3,131.400	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	208.000	17,721.600	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	835.000	11,698.350	
	SAFEHOLD INC	158.000	2,464.800	
	SAUL CENTERS INC	40.000	1,380.000	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	395.000	74,828.800	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	594.000	4,359.960	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,193.000	127,054.500	
	SITE CENTERS CORP	695.000	8,117.600	
	SL GREEN	233.000	7,400.080	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	512.000	17,085.440	
	STAG INDUSTRIAL INC	660.000	21,727.200	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	386.000	2,215.640	
	SUN COMMUNITIES INC	452.000	47,753.800	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	767.000	7,186.790	
	TANGER FACTORY OUTLET	367.000	8,639.180	
	TERRENO REALTY CORP	297.000	15,518.250	
	THE MACERICH COMPANY	779.000	8,304.140	
	UDR INC	1,205.000	42,403.950	
	UMH PROPERTIES INC	196.000	2,753.800	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	49.000	1,857.100	
	URBAN EDGE PROPERTIES	414.000	6,214.140	
	VENTAS INC	1,468.000	61,406.440	
	VERIS RESIDENTIAL INC	286.000	4,564.560	
	VICI PROPERTIES INC	3,689.000	103,587.120	
	VORNADO REALTY TRUST	642.000	12,917.040	
	WELLTOWER INC	1,826.000	153,237.920	
	WEYERHAEUSER CO	2,691.000	78,927.030	
	WHITESTONE REIT	166.000	1,601.900	
	WP CAREY INC	776.000	41,531.520	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	397.000	4,656.810	
	アメリカ・ドル 小計	88,931.000	3,874,008.070 (580,946,250)	
投資証券 合計		88,931	580,946,250 (580,946,250)	
合計			580,946,250 (580,946,250)	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（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 141銘柄	99.01	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・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド

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

2023年5月31日現在

	2023年 (日本円)	2022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	12,471,305,693	13,785,685,489
未収申込金	154,214,000	-
現金および現金同等物	720,574,601	932,564,219
その他の債権	4,996,679	23,997,115
資産合計	<u>13,351,090,973</u>	<u>14,742,246,823</u>
負債		
流動負債		
ブローカーに対する債務	102,005	-
未払費用	35,371,234	22,867,234
負債合計	<u>35,473,239</u>	<u>22,867,234</u>
受益証券保有者に帰属する純資産	<u>13,315,617,734</u>	<u>14,719,379,589</u>

要約投資明細表(無監査)

2023年5月31日現在

	公正価値 (日本円)	純資産比率
債券		
アンゴラ		
Angolan Government International Bond 8.000% due 26/11/2029 REGS	368,925,532	2.77%
Angolan Government International Bond 8.750% due 14/04/2032 REGS	71,408,830	0.54%
アンゴラ合計(取得原価:435,591,670円)	440,334,362	3.31%
アルメニア		
Republic Of International Armenian Bond 3.600% due 02/02/2031 REGS	304,397,451	2.29%
アルメニア合計(取得原価:289,668,803円)	304,397,451	2.29%
アゼルバイジャン		
Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026 REGS	173,187,428	1.30%
アゼルバイジャン合計(取得原価:139,920,300円)	173,187,428	1.30%
ベラルーシ		
Republic of Belarus International Bond 6.200% due 28/02/2030 REGS	71,135,639	0.53%
ベラルーシ合計(取得原価:126,447,365円)	71,135,639	0.53%
ベナン		
Benin, Republik 4.875% due 19/01/2032	262,887,184	1.97%
ベナン合計(取得原価:290,634,512円)	262,887,184	1.97%
ブラジル		
Brazilian Government International Bond 3.875% due 12/06/2030	164,663,461	1.24%
ブラジル合計(取得原価:151,649,617円)	164,663,461	1.24%
カメルーン		
Republic of Cameroon International Bank 5.950% due 07/07/2032 REGS	170,732,329	1.28%
カメルーン合計(取得原価:198,302,823円)	170,732,329	1.28%

公正価値 (日本円)	純資産比率
---------------	-------

債券(続き)

コロンビア

Bogota Distrito Capital 9.750% due 26/07/2028 REGS	371,257,044	2.79%
Colombia Government International Bond 7.500% 02/02/2034	205,953,090	1.55%
コロンビア合計(取得原価: 656,469,060円)	577,210,134	4.34%

コスタリカ

Costa Rica Government International Bond 7.158% due 12/03/2045	239,193,114	1.80%
コスタリカ合計(取得原価: 177,131,168円)	239,193,114	1.80%

コートジボワール

Ivory Coast Government International Bond 4.875% due 30/01/2032 REGS	300,362,732	2.26%
コートジボワール合計(取得原価: 260,024,764円)	300,362,732	2.26%

ドミニカ共和国

Dominican Republic International Bond 9.750% due 05/06/2026 REGS	491,843,073	3.69%
ドミニカ共和国合計(取得原価: 396,156,338円)	491,843,073	3.69%

エジプト

Egypt Government International Bond 7.500% due 16/02/2061 REGS	118,771,423	0.89%
Egypt Government International Bond 7.625% due 29/05/2032 REGS	42,656,812	0.32%
エジプト合計(取得原価: 210,099,769円)	161,428,235	1.21%

エチオピア

Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	224,797,705	1.69%
エチオピア合計(取得原価: 259,981,998円)	224,797,705	1.69%

ジョージア

Georgia Treasury Bond 9.125% due 30/05/2025	66,989,140	0.50%
Georgian Railway JSC 4.000% due 17/06/2028 REGS	122,484,635	0.92%
ジョージア合計(取得原価: 177,466,044円)	189,473,775	1.42%

ガーナ

Saderea DAC 12.500% due 30/11/2026 REGS	29,642,455	0.22%
ガーナ合計(取得原価: 57,254,212円)	29,642,455	0.22%

	保有資産	公正価値 (日本円)	純資産比率
債券(続き)			
ホンジュラス			
Honduras Government International Bond 5.625% due 24/06/2030		196,275,332	1.47%
ホンジュラス合計(取得原価:181,934,931円)		196,275,332	1.47%
ハンガリー			
Hungary Treasury Bills 30/04/2024 TBLM		112,091,856	0.84%
ハンガリー合計(取得原価:111,842,366円)		112,091,856	0.84%
インドネシア			
Indonesia Government International Bond 4.150% due 20/09/2027		124,568,282	0.93%
Republic of Indonesia 4.350% due 08/01/2027		70,415,888	0.53%
インドネシア合計(取得原価:183,407,412円)		194,984,170	1.46%
ジャマイカ			
Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045		198,442,895	1.49%
ジャマイカ合計(取得原価:154,018,645円)		198,442,895	1.49%
ヨルダン			
Jordan Kingdom 6.125% due 29/01/2026 REGS		310,901,579	2.34%
ヨルダン合計(取得原価:253,107,584円)		310,901,579	2.34%
カザフスタン			
Kazakhstan Government Bond - MEOKAM 14.500% due 28/04/2025		222,162,916	1.67%
Kazakhstan Government Bond - MEUKAM 9.500% due 30/01/2024		14,403,384	0.11%
Kazakhstan Treasury Bill - MEKKAM due 20/01/2024 TBLM		101,122,238	0.76%
Kazakhstan Treasury Bill - MEKKAM due 07/04/2024 TBLM		62,192,895	0.47%
Kazmunaygas National Co JSC 5.750% due 19/04/2047 REGS		260,246,788	1.95%
カザフスタン合計(取得原価:630,355,998円)		660,128,221	4.96%
メキシコ			
Mexican Bonos 7.750% due 29/05/2031	37,500,000	287,702,144	2.16%
Mexican Bonos 8.000% due 07/11/2047	66,330,000	489,721,123	3.68%
Mexican Udibonos 4.000% due 30/11/2028	2,200,000	132,248,648	0.99%
Mexico Government International Bond 2.659% due 24/05/2031	1,640,000	190,581,272	1.43%
Mexico Government International Bond 4.600% due 23/01/2046	1,400,000	162,694,739	1.22%
メキシコ合計(取得原価:1,046,380,472円)		1,262,947,926	9.48%

	保有資産	公正価値 (日本円)	純資産比率
債券(続き)			
ナイジェリア			
B01 Finance BV 7.5000% due 16/02/2027		157,088,858	1.18%
ナイジェリア合計(取得原価:165,038,289円)		157,088,858	1.18%
北マケドニア			
North Macedonia Government International Bond 6.960% 13/03/2027 REGS		123,953,023	0.93%
北マケドニア合計(取得原価:115,116,069円)		123,953,023	0.93%
パキスタン			
Pakistan 7.375% due 08/04/2031		91,729,454	0.69%
パキスタン合計(取得原価:193,628,835円)		91,729,454	0.69%
パラグアイ			
Rutas 2 and 7 Finance Ltd 0.000% due 30/09/2036 REGS		209,677,605	1.57%
パラグアイ合計(取得原価:173,375,574円)		209,677,605	1.57%
ペルー			
Iirsa Norte Finance Ltd 8.750% due 30/05/2024 REGS		24,705,499	0.19%
Peru Government Bond 5.400% 12/08/2034		224,051,358	1.68%
ペルー合計(取得原価:194,410,628円)		248,756,857	1.87%
セルビア共和国			
Serbia International Bond 6.250% due 26/05/2028 REGS		138,486,144	1.04%
セルビア共和国合計(取得原価:132,849,721円)		138,486,144	1.04%
ルーマニア			
Romani 6.125% due 22/01/2044 REGS		506,728,923	3.81%
ルーマニア合計(取得原価:502,412,025円)		506,728,923	3.81%
ロシア			
Russian Federation Bond 7.650% due 10/04/2030		93,558,426	0.70%
Russian Foreign Bond 5.625% due 04/04/2042		37,926,727	0.29%
ロシア合計(取得原価:326,159,061円)		131,485,153	0.99%
南アフリカ			
Government of South Africa 4.300% due 12/10/2028	2,600,000	315,215,051	2.37%
Government of South Africa 7.000% due 28/02/2031	79,805,000	441,106,921	3.31%
南アフリカ合計(取得原価:848,972,026円)		756,321,972	5.68%

	保有資産	公正価値 (日本円)	純資産比率
国際機関			
Asian Development Bank 8.175% due 15/09/2024		255,439,868	1.92%
Asian Development Bank 8.300% due 18/10/2024 REGS		73,199,819	0.55%
Asian Development Bank 13.600% due 17/04/2024		136,894,066	1.03%
European Bank For Reconstruction & Development 5.000% due 27/01/2025	14,250,000	370,063,347	2.78%
European Bank For Reconstruction & Development 6.170% due 10/03/2025	44,500,000,000	419,821,484	3.15%
European Investment Bank 8.500% due 01/12/2023 REGS		213,589,003	1.60%
国際機関合計(取得原価:1,273,504,888円)		1,469,007,587	11.03%
スリナム			
Suriname Government International Bond 9.875% due 30/12/2023 REGS		230,946,078	1.73%
スリナム合計(取得原価:212,330,047円)		230,946,078	1.73%
トリニダード・トバゴ			
Heritage Petroleum Co. Ltd 9.000% due 12/08/2029 REGS		358,227,672	2.69%
トリニダード・トバゴ合計(取得原価:311,897,349円)		358,227,672	2.69%
トルコ			
Istanbul Metropolitan Municipality 10.750% due 12/04/2027		99,508,703	0.75%
Turkey Government International Bond 5.950% due 15/01/2031 REGS		127,664,492	0.96%
トルコ合計(取得原価:210,512,903円)		227,173,195	1.71%
ウクライナ			
ST Savings Bank 9.625% due 20/03/2025		75,138,540	0.57%
Ukraine Government International Bond 7.375% due 25/09/2034		76,060,208	0.57%
ウクライナ合計(取得原価:389,622,273円)		151,198,748	1.14%
ウルグアイ			
Uruguay Government International Bond 8.250% due 21/05/2031		258,442,519	1.94%
Uruguay Republic of 3.700% due 26/06/2037 Index Linked		278,959,344	2.10%
ウルグアイ合計(取得原価:288,220,903円)		537,401,863	4.04%
ウズベキスタン			
Republic of Uzbekistan Bond 14.000% due 19/07/2024 REGS		234,754,520	1.76%
Republic of Uzbekistan Bond 14.500% due 25/11/2023 REGS		142,610,454	1.07%
ウズベキスタン合計(取得原価:328,080,116円)		377,364,974	2.83%
債券合計(取得原価:12,053,976,558円)		12,452,609,162	93.52%
原油ワラント			
ベネズエラ			
Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020		18,696,531	0.14%
ベネズエラ合計(取得原価:1,683,204,644円)		18,696,531	0.14%
原油ワラント合計(取得原価:1,683,204,644円)		18,696,531	0.14%
公正価値による有価証券合計(取得原価:13,737,181,202円)		12,471,305,693	93.66%

(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10月31日現在

資産総額	4,403,565,738円
負債総額	1,497,704円
純資産総額(-)	4,402,068,034円
発行済数量	4,169,293,572口
1口当たり純資産額(/)	1.0558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10月31日現在

資産総額	1,617,635,601円
負債総額	15,773,428円
純資産総額(-)	1,601,862,173円
発行済数量	479,162,517口
1口当たり純資産額(/)	3.3430円

新光日本債券インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

資産総額	10,474,496,371円
負債総額	17,166,300円
純資産総額(-)	10,457,330,071円
発行済数量	8,760,217,335口
1口当たり純資産額(/)	1.1937円

新光J-REITマザーファンド

2023年10月31日現在

資産総額	78,512,147,096円
負債総額	218,157,410円
純資産総額(-)	78,293,989,686円
発行済数量	36,040,833,660口
1口当たり純資産額(/)	2.1724円

新光外国株式インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

資産総額	1,650,793,017円
負債総額	8,599,941円
純資産総額(-)	1,642,193,076円
発行済数量	362,527,812口
1口当たり純資産額(/)	4.5298円

海外国債マザーファンド

2023年10月31日現在

資産総額	13,415,408,839円
負債総額	0円
純資産総額(-)	13,415,408,839円
発行済数量	4,968,468,725口
1口当たり純資産額(/)	2.7001円

新光米国REITマザーファンド

2023年10月31日現在

資産総額	576,101,387円
負債総額	0円
純資産総額(-)	576,101,387円
発行済数量	244,032,668口
1口当たり純資産額(/)	2.3608円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2023年10月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2023年10月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,479,197,039,659
追加型株式投資信託	780	14,682,815,646,282
単位型公社債投資信託	21	35,110,885,684
単位型株式投資信託	208	1,060,283,148,398
合計	1,035	17,257,406,720,023

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第39期中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第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
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							11,280	11,280	11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

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

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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(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</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

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

（会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当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

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年3月31日現在）

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

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 其他有価証券	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 其他有価証券(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 其他有価証券(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	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
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	第38期
	(2022年3月31日現在)	(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

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第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

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,013
金銭の信託		28,384
未収委託者報酬		17,669
未収運用受託報酬		3,747
未収投資助言報酬		305
未収収益		13
前払費用		1,318
その他		2,504
	流動資産計	81,956
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	947
器具備品	1	100
リース資産	1	6
無形固定資産		
ソフトウェア		4,959
ソフトウェア仮勘定		2,954
電話加入権		2,002
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		8,557
関係会社株式		184
長期差入保証金		4,888
繰延税金資産		772
繰延税金資産		2,592
その他		120
	固定資産計	14,572
資産合計		96,529

（単位：百万円）

	第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	418
リース債務	1
未払金	7,850
未払収益分配金	1
未払償還金	0
未払手数料	7,654
その他未払金	193
未払費用	7,452
未払法人税等	2,372
未払消費税等	1,076
契約負債	20
賞与引当金	861
役員賞与引当金	26
流動負債計	20,081
固定負債	
リース債務	5
退職給付引当金	2,701
時効後支払損引当金	72
固定負債計	2,780
負債合計	22,861
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	52,115
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,991
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,311
株主資本計	73,668
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等計	0
純資産合計	73,668
負債・純資産合計	96,529

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	49,984	
運用受託報酬	8,063	
投資助言報酬	1,082	
その他営業収益	13	
		営業収益計 59,144
営業費用		
支払手数料	21,623	
広告宣伝費	107	
公告費	0	
調査費	17,657	
調査費	6,728	
委託調査費	10,928	
委託計算費	280	
営業雑経費	372	
通信費	17	
印刷費	253	
協会費	33	
諸会費	29	
支払販売手数料	38	
		営業費用計 40,042
一般管理費		
給料	4,831	
役員報酬	77	
給料・手当	4,735	
賞与	19	
交際費	14	
寄付金	3	
旅費交通費	63	
租税公課	175	
不動産賃借料	508	
退職給付費用	206	
固定資産減価償却費	1 749	
福利厚生費	17	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	861	
役員賞与引当金繰入額	26	
機器リース料	0	
事務委託費	1,714	
事務用消耗品費	24	
器具備品費	0	
諸経費	120	
		一般管理費計 9,319
営業利益		9,782

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	3	
受取配当金	3	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	35	
雑収入	10	
営業外収益計		53
営業外費用		
為替差損	7	
金銭の信託運用損	785	
早期割増退職金	0	
雑損失	3	
営業外費用計		797
経常利益		9,038
特別損失		
固定資産除却損	2	
関係会社株式評価損	922	
特別損失計		924
税引前中間純利益		8,113
法人税、住民税及び事業税		2,136
法人税等調整額		303
法人税等合計		2,440
中間純利益		5,673

(3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,040
中間純利益							5,673
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	5,366
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,311

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	57,481	79,034	0	0	79,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,040	11,040			11,040
中間純利益	5,673	5,673			5,673
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	5,366	5,366	0	0	5,366
当中間期末残高	52,115	73,668	0	0	73,668

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第39期中間会計期間末 （2023年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	577百万円
	器具備品	...	764百万円
	リース資産	...	2百万円

（中間損益計算書関係）

項目	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	71百万円
	無形固定資産	...	678百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類 株式				

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

（金融商品関係）

第39期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	28,384	28,384	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,386	28,386	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	28,384	-	28,384
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,386	-	28,386

（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、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開
示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	182
関係会社株式	
非上場株式	4,888

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)			
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(中間貸借対照表計上額4,888百万円)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			
区分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額182百万円)については、市場価格がないことから、上 表に含めておりません。			

(持分法損益等)

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	65,400百万円
資産合計	65,400百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	3,358百万円
負債合計	3,358百万円
純資産	62,041百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額49,546百万円及び顧客関連資産の金額19,028百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	3,824百万円
経常利益	3,824百万円
税引前中間純利益	3,824百万円
中間純利益	3,237百万円
1株当たり中間純利益	80,925円14銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額1,918百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第39期中間会計期間
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

委託者報酬	49,984百万円
運用受託報酬	7,464百万円
投資助言報酬	1,082百万円
成功報酬(注)	599百万円
その他営業収益	13百万円
合計	59,144百万円

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,841,700円33銭
1株当たり中間純利益金額	141,837円37銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益金額	5,673百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	5,673百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社に対する出資比率が、2023年10月6日付で49.9%から23.4%に引き下がりました。

(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（2023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 ） 19,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
西村証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三にいがた証券株式会社	852	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
三豊証券株式会社	300	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2023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) 2022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
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年12月15日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光7資産バランスファンドの2023年4月21日から2023年10月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの2023年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月22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 森重 俊寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。