

【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7月22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7月23日から2025年1月21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。

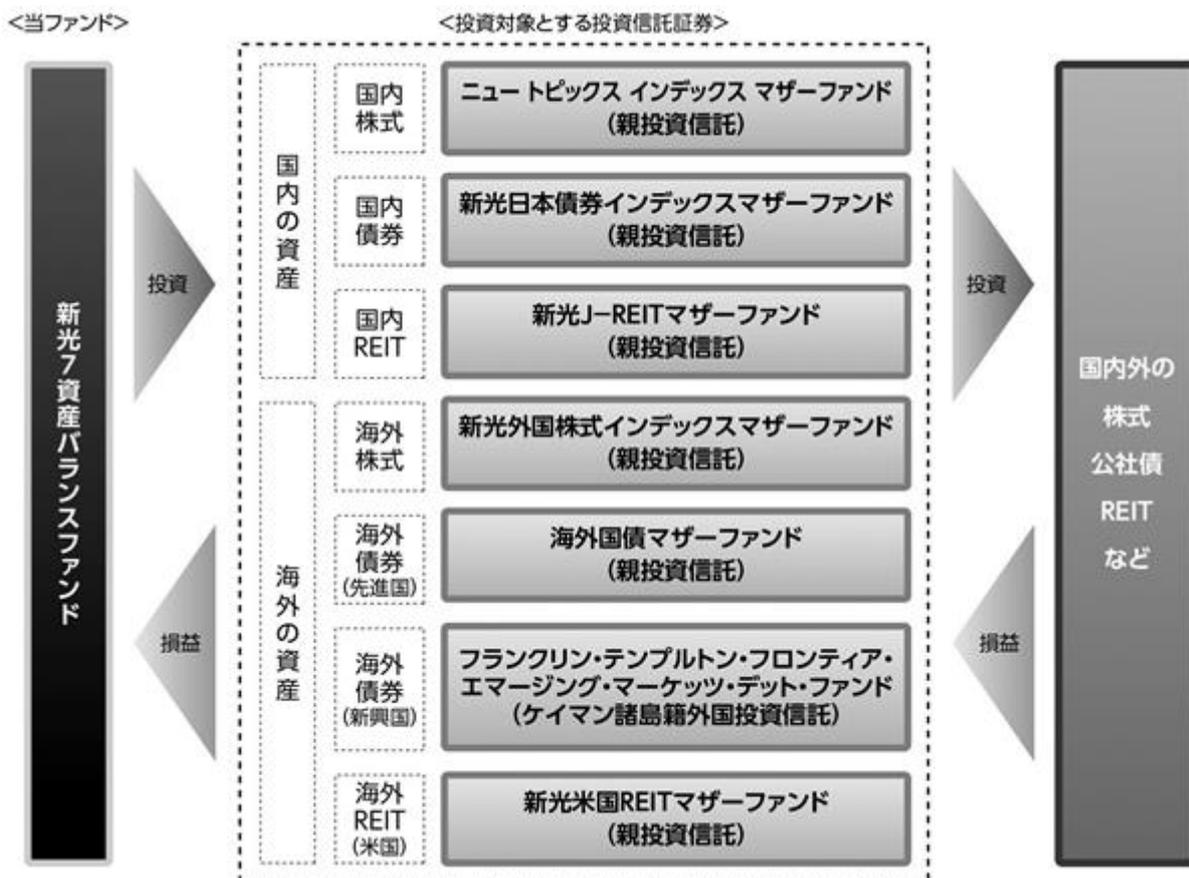
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



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。

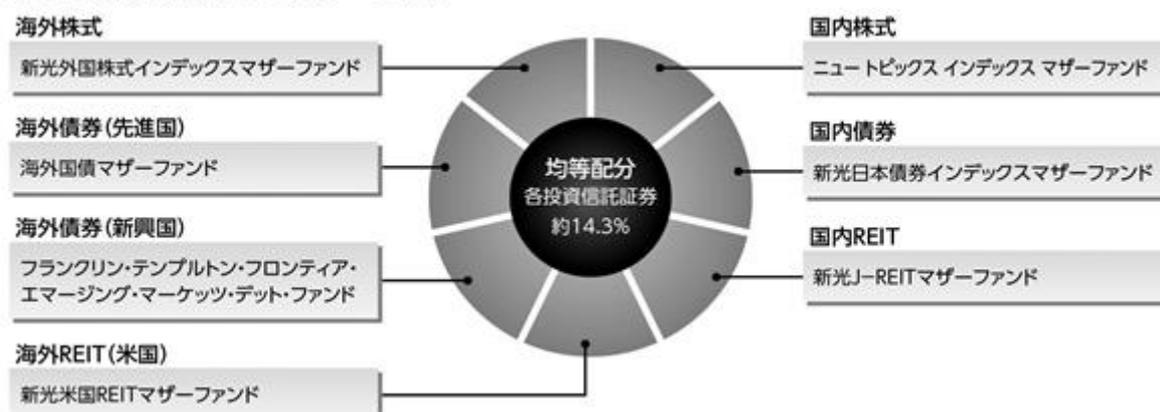


2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

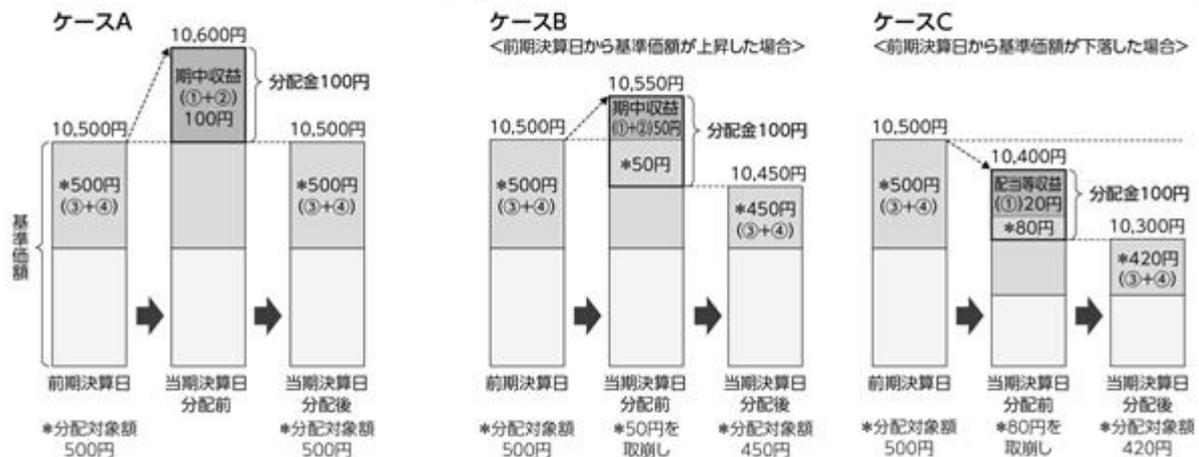
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

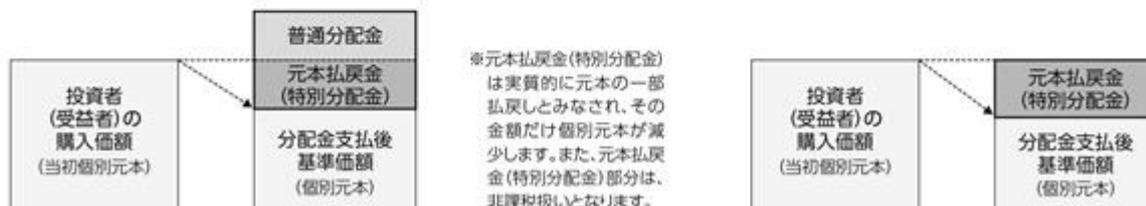
ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
 ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
 ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

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。

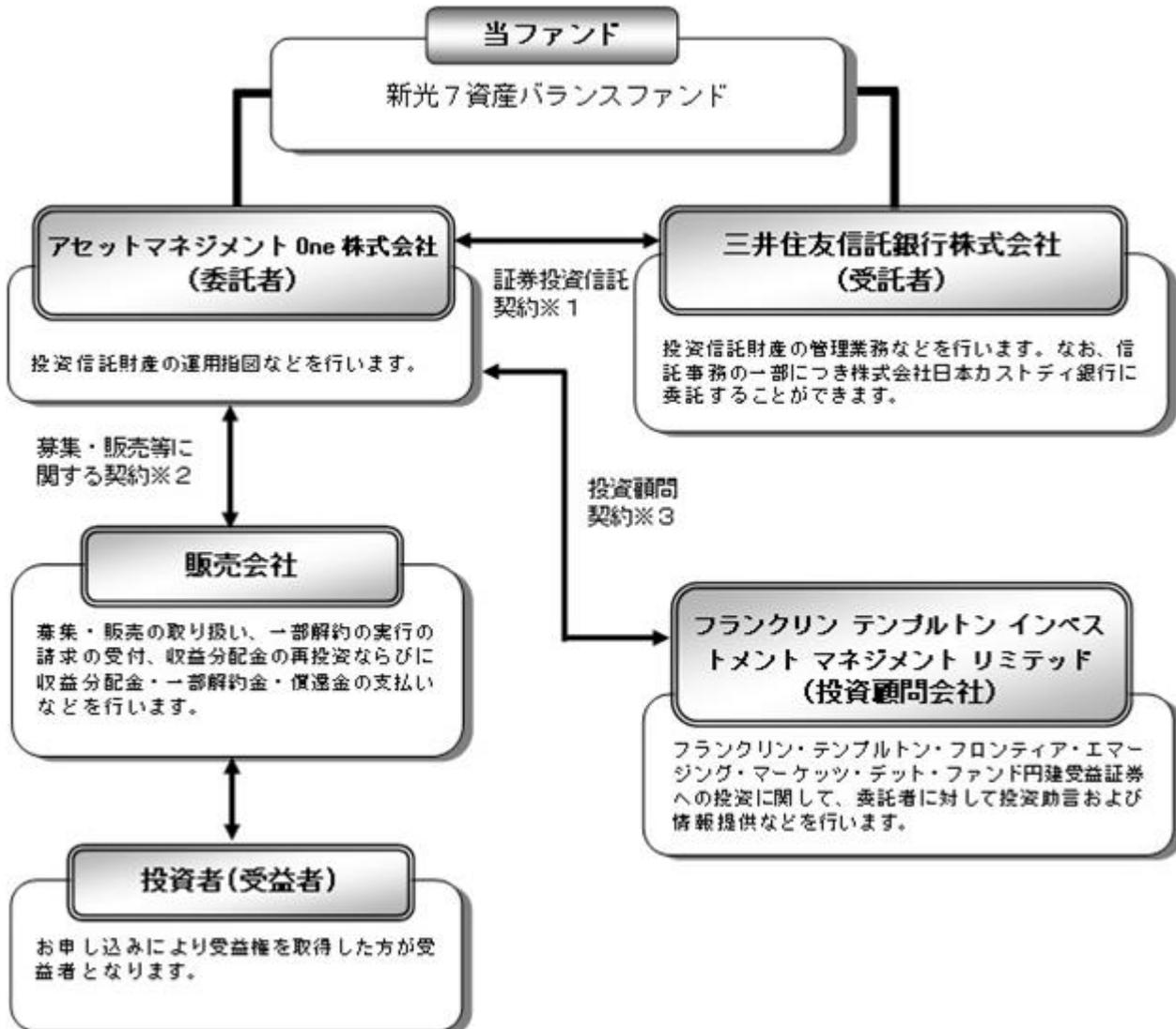
元本払戻金（特別分配金）: 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

(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

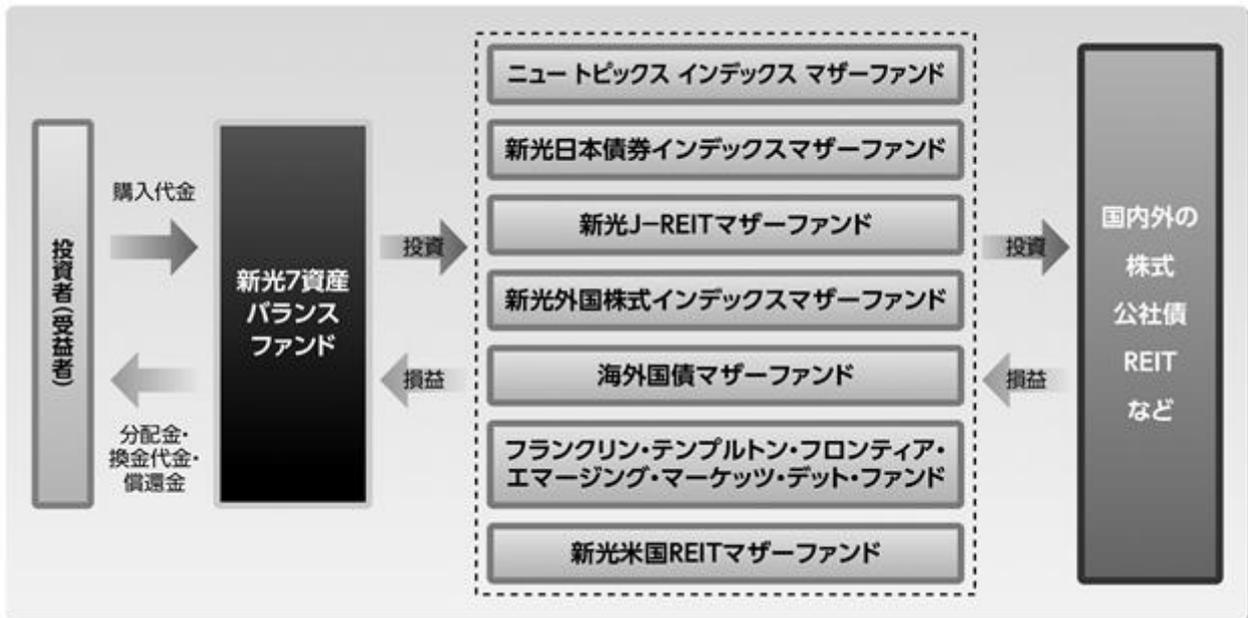
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

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（2024年4月30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

（2024年4月30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。

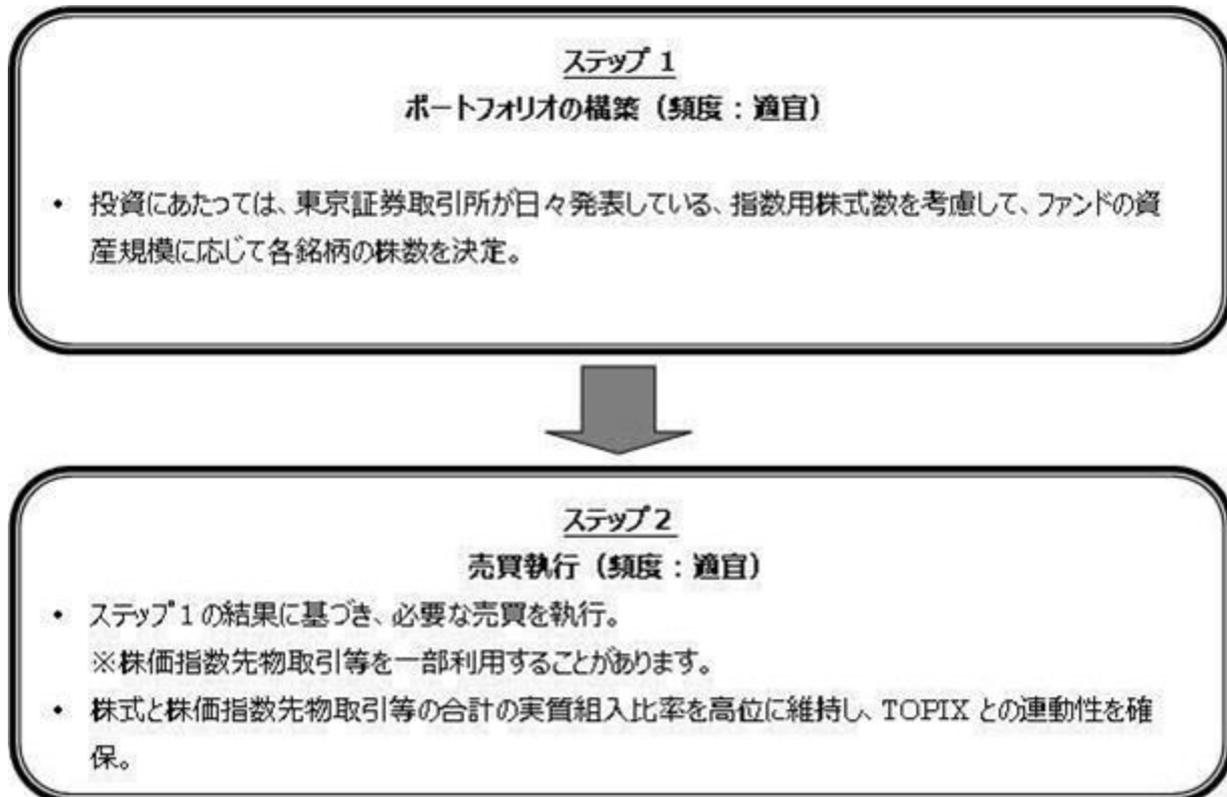
J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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2024年4月30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

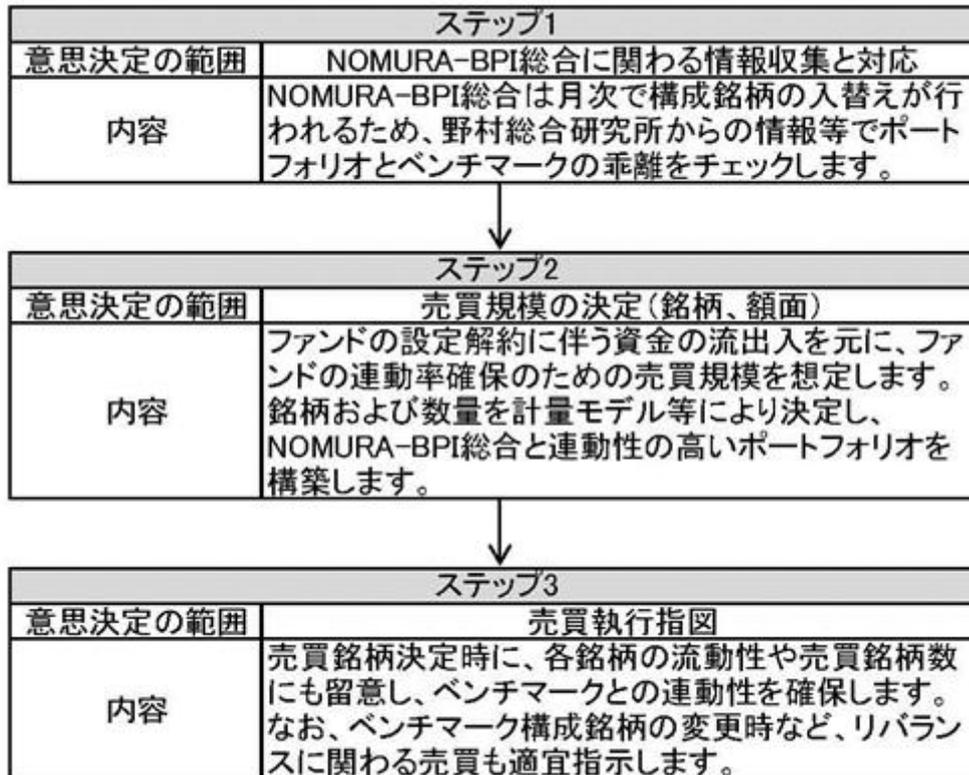
NOMURA - B P I 総合について

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2024年4月30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。

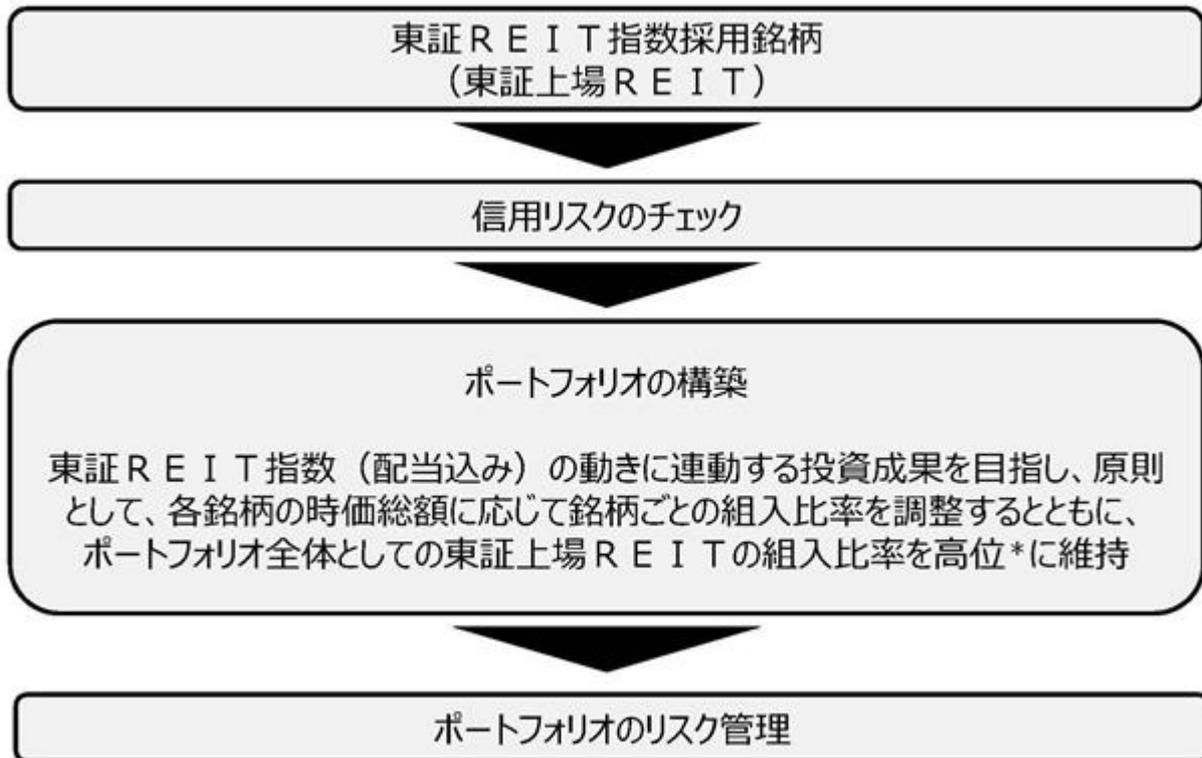
J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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2024年4月30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。

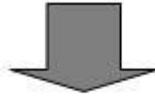
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

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2024年4月30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2024年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

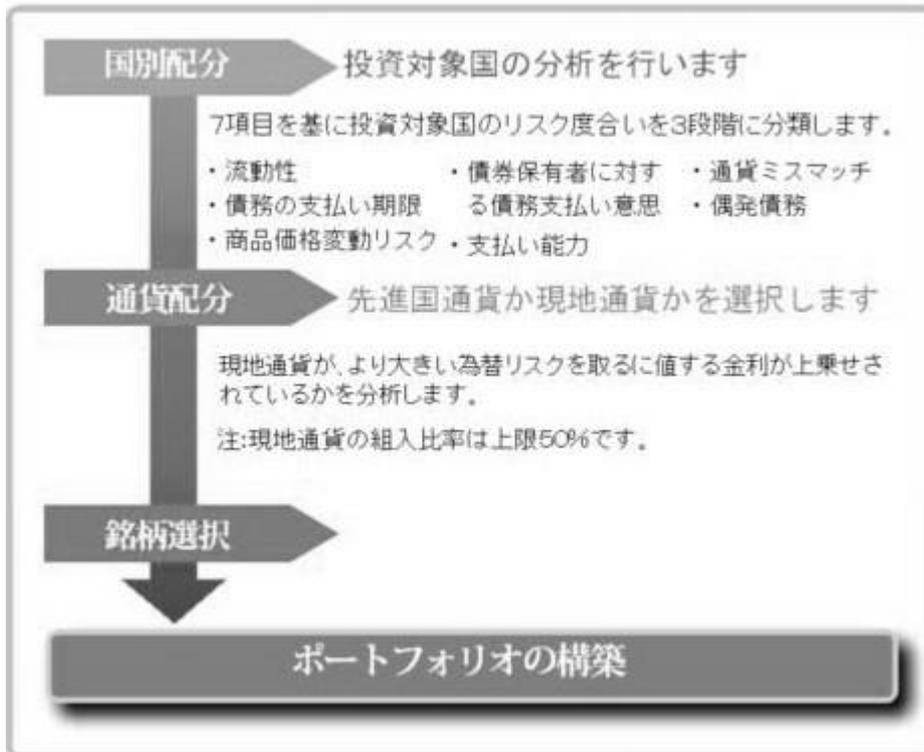
ファンド名	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地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

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

フランクリン テンプレトン インベストメント マネジメント リミテッド（FTIML社）は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン・テンプレトン（設立：1947年、運用総資産：約249.0兆円）の一員です。FTIML社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2024年3月末現在、1米ドル = 151.41円で換算

運用プロセス



出所：FTIML社資料を基にアセットマネジメントOne作成

運用プロセスは2024年4月30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。

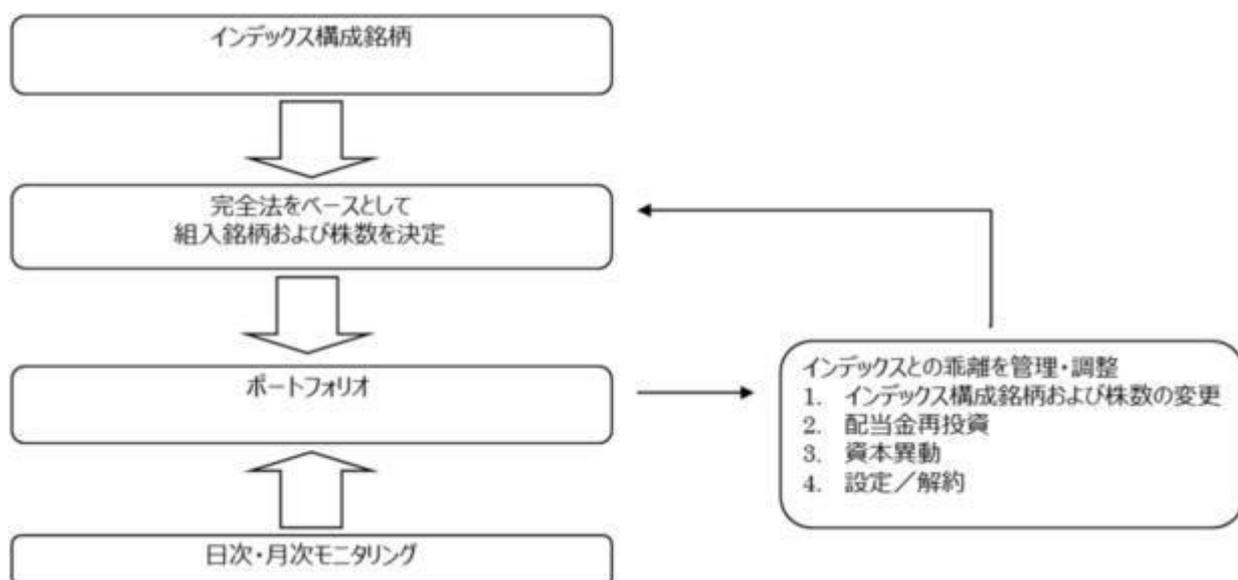
新光米国REITマザーファンド（以下「当マザーファンド」といいます。）は、アセットマネジメントOne株式会社によって単独で開発されたものです。当マザーファンドは、いかなる方法においても、FTSE、London Stock Exchange Group plcおよび、そのグループ企業（以下、総称して「LSE Group」といいます。）またはNareitによって出資、保証、販売または販売促進されることはありません。

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。



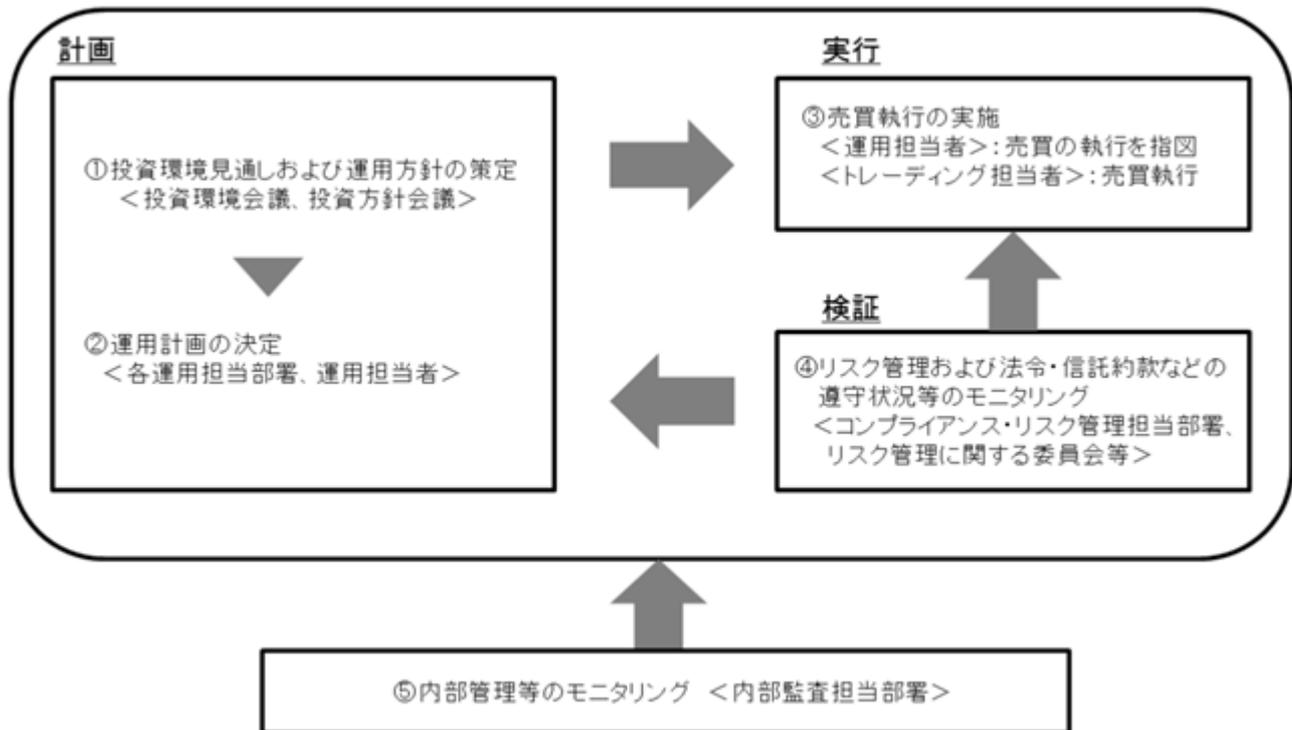
運用プロセスは2024年4月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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7月22日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2024年4月30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。

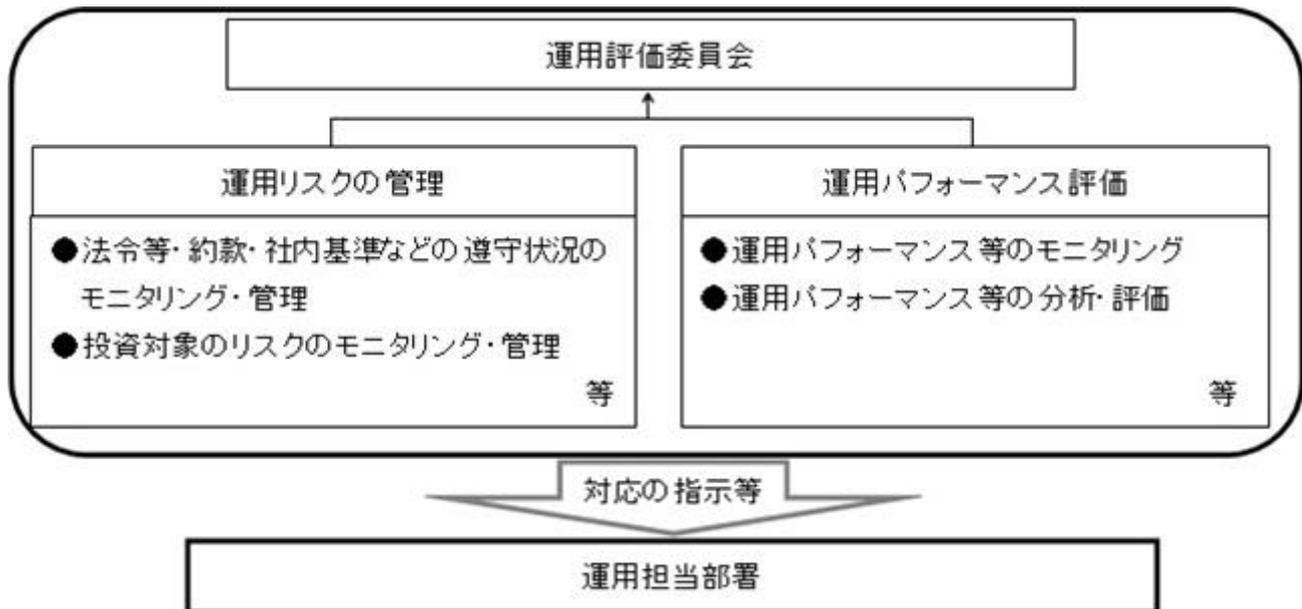
（ハ）有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

- (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ことがあるあります。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る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る有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入る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。

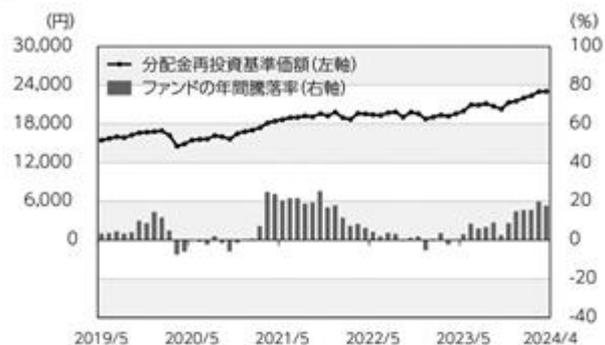


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

リスク管理体制は2024年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

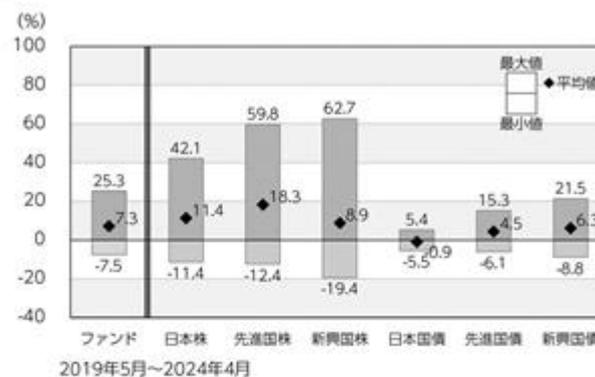
＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村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 1374 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・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865%</p> <p>当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</p>																								
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4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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
1.31%	1.04%	0.27%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年10月21日~2024年4月22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】

2024年4月30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	713,664,400	14.99
内 ケイマン諸島	713,664,400	14.99
親投資信託受益証券	3,958,086,359	83.15
内 日本	3,958,086,359	83.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	88,710,687	1.86
純資産総額	4,760,461,446	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

2024年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,532,836,350	95.79
内 日本	1,532,836,350	95.79
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	67,429,383	4.21
純資産総額	1,600,265,733	100.00

その他資産の投資状況

2024年4月30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）	54,940,000	3.43
内 日本	54,940,000	3.43

（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

2024年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	8,469,012,100	84.93
内 日本	8,469,012,100	84.93
地方債証券	662,823,800	6.65
内 日本	662,823,800	6.65
特殊債券	604,360,000	6.06
内 日本	604,360,000	6.06
社債券	194,197,000	1.95
内 日本	194,197,000	1.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	41,408,096	0.42
純資産総額	9,971,800,996	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

2024年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	69,818,013,700	96.78
内 日本	69,818,013,700	96.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,324,450,762	3.22
純資産総額	72,142,464,462	100.00

その他資産の投資状況

2024年4月30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）	2,204,488,000	3.06
内 日本	2,204,488,000	3.06

（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

2024年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,621,221,952	89.82
内 アメリカ	1,176,397,748	65.17
内 イギリス	63,735,619	3.53
内 カナダ	55,220,512	3.06
内 フランス	50,703,582	2.81
内 スイス	48,178,376	2.67
内 ドイツ	39,360,248	2.18
内 オランダ	32,765,010	1.82
内 オーストラリア	30,264,396	1.68
内 アイルランド	29,717,795	1.65
内 デンマーク	16,800,499	0.93
内 スウェーデン	13,979,568	0.77
内 スペイン	12,311,899	0.68
内 イタリア	9,361,179	0.52
内 香港	6,439,903	0.36
内 ジャージー	5,265,980	0.29
内 シンガポール	5,245,158	0.29
内 フィンランド	4,587,112	0.25
内 ベルギー	3,352,621	0.19
内 イスラエル	3,327,513	0.18
内 ノルウェー	2,699,711	0.15
内 パミュダ	2,356,489	0.13
内 ケイマン諸島	1,974,419	0.11
内 オランダ領キュラソー	1,968,867	0.11
内 ニュージーランド	1,173,966	0.07
内 リベリア	944,713	0.05
内 オーストリア	907,208	0.05
内 ルクセンブルグ	834,939	0.05
内 ポルトガル	755,372	0.04
内 パナマ	436,797	0.02
内 マン島	154,753	0.01

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		2,561,274	0.14
	内 オーストラリア	2,030,892	0.11
	内 シンガポール	530,382	0.03
投資証券		27,981,195	1.55
	内 アメリカ	26,240,905	1.45
	内 フランス	605,099	0.03
	内 イギリス	539,792	0.03
	内 香港	343,588	0.02
	内 ベルギー	172,736	0.01
	内 カナダ	79,075	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		153,250,467	8.49
純資産総額		1,805,014,888	100.00

その他資産の投資状況

2024年4月30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）	145,553,761	8.06	
	内 アメリカ	121,134,645	6.71
	内 イギリス	16,083,727	0.89
	内 ドイツ	8,335,389	0.46

（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

2024年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
国債証券	13,816,284,806	97.93	
	内 アメリカ	5,944,914,947	42.14
	内 フランス	2,831,447,194	20.07
	内 ドイツ	1,741,155,188	12.34
	内 イタリア	1,671,185,963	11.85
	内 イギリス	835,595,244	5.92
	内 カナダ	791,986,270	5.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	291,360,126	2.07	
純資産総額	14,107,644,932	100.00	

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

新光米国REITマザーファンド

2024年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
投資証券	644,213,132	99.25	
	内 アメリカ	644,213,132	99.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,879,001	0.75	
純資産総額	649,092,133	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】

2024年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	新光外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	123,450,399	5.5570 686,026,212	5.8025 716,320,940	- -	15.05
2	フランクリン・テンブルト ン・フロンティア・エマー ジング・マーケット・デッ ト・ファンド ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	333,800	2,085.0000 695,973,000	2,138.0000 713,664,400	- -	14.99
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	169,841,560	4.0057 680,351,321	4.1264 700,834,213	- -	14.72
4	海外国債マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	224,883,758	2.9267 658,189,782	2.9814 670,468,436	- -	14.08
5	新光米国REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	229,354,163	2.7315 626,503,831	2.8301 649,095,216	- -	13.64
6	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	2.1966 609,540,221	2.2136 614,229,632	- -	12.90
7	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	1.2033 607,037,035	1.2036 607,137,922	- -	12.75

(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

2024年4月30日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	14.99
親投資信託受益証券	83.15
合計	98.14

(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

2024年4月30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	22,200	2,889.29 64,142,247	3,638.00 80,763,600	- -	5.05
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	24,100	1,292.77 31,155,838	1,579.50 38,065,950	- -	2.38
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	2,800	14,449.68 40,459,124	13,085.00 36,638,000	- -	2.29
4	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	900	27,066.06 24,359,462	35,120.00 31,608,000	- -	1.98
5	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,100	11,212.65 23,546,576	14,620.00 30,702,000	- -	1.92
6	三菱商事 日本	株式 卸売業	8,200	2,516.63 20,636,426	3,620.00 29,684,000	- -	1.85
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	400	66,970.00 26,788,000	70,300.00 28,120,000	- -	1.76
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,800	7,308.47 20,463,730	8,980.00 25,144,000	- -	1.57
9	三井物産 日本	株式 卸売業	3,200	5,959.16 19,069,330	7,639.00 24,444,800	- -	1.53
10	信越化学工業 日本	株式 化学	3,600	5,771.59 20,777,739	6,195.00 22,302,000	- -	1.39
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	3,000	6,261.54 18,784,630	6,902.00 20,706,000	- -	1.29
12	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	2,900	6,575.88 19,070,079	7,136.00 20,694,400	- -	1.29
13	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	120,100	179.33 21,538,668	170.80 20,513,080	- -	1.28
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,900	3,825.02 14,917,590	4,991.00 19,464,900	- -	1.22
15	任天堂 日本	株式 その他製品	2,500	8,041.90 20,104,756	7,720.00 19,300,000	- -	1.21
16	第一三共 日本	株式 医薬品	3,500	4,535.85 15,875,487	5,364.00 18,774,000	- -	1.17
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	9,500	1,576.65 14,978,176	1,812.00 17,214,000	- -	1.08
18	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	2,100	6,607.46 13,875,684	7,915.00 16,621,500	- -	1.04
19	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	5,300	2,562.85 13,583,125	3,052.00 16,175,600	- -	1.01
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	3,600	4,312.32 15,524,373	4,153.00 14,950,800	- -	0.93

21	HOYA	日本	株式 精密機器	800	18,085.00 14,468,000	18,470.00 14,776,000	- -	0.92
22	KDDI	日本	株式 情報・通信業	3,100	4,851.71 15,040,319	4,400.00 13,640,000	- -	0.85
23	三菱電機	日本	株式 電気機器	4,500	2,170.12 9,765,548	2,773.00 12,478,500	- -	0.78
24	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	6,400	1,878.46 12,022,168	1,911.00 12,230,400	- -	0.76
25	ダイキン工業	日本	株式 機械	500	24,590.00 12,295,000	21,745.00 10,872,500	- -	0.68
26	住友商事	日本	株式 卸売業	2,600	3,352.04 8,715,310	4,155.00 10,803,000	- -	0.68
27	村田製作所	日本	株式 電気機器	3,700	2,961.97 10,959,323	2,903.50 10,742,950	- -	0.67
28	日本たばこ産業	日本	株式 食料品	2,400	3,829.44 9,190,658	4,245.00 10,188,000	- -	0.64
29	三菱重工業	日本	株式 機械	7,100	925.00 6,567,500	1,417.50 10,064,250	- -	0.63
30	丸紅	日本	株式 卸売業	3,500	2,448.05 8,568,209	2,824.00 9,884,000	- -	0.62

（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

2024年4月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	95.79
合計	95.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年4月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	16.93
輸送用機器		9.09
卸売業		7.53
銀行業		7.34
情報・通信業		6.60
化学		5.27
機械		5.15
医薬品		4.23
サービス業		4.08
小売業		3.88
食料品		3.00
保険業		2.76
陸運業		2.27
精密機器		2.14
その他製品		2.09
建設業		2.03
不動産業		1.98

電気・ガス業	1.41
その他金融業	1.07
証券、商品先物取引業	0.89
鉄鋼	0.81
海運業	0.77
非鉄金属	0.75
ゴム製品	0.68
ガラス・土石製品	0.67
石油・石炭製品	0.51
金属製品	0.47
空運業	0.38
繊維製品	0.36
鉱業	0.33
パルプ・紙	0.14
倉庫・運輸関連業	0.10
水産・農林業	0.08
合計	95.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

新光日本債券インデックスマザーファンド

2024年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	120,000,000	100.03 120,037,200	99.82 119,784,000	0.1 2025/12/20	1.20
2	147回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	120,000,000	99.74 119,690,400	99.54 119,448,000	0.005 2026/3/20	1.20
3	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	120,000,000	98.75 118,507,200	98.81 118,582,800	0.1 2028/6/20	1.19
4	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	110,000,000	100.61 110,671,000	100.34 110,380,600	0.4 2025/6/20	1.11
5	97回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債券	100,000,000	108.80 108,809,000	108.53 108,533,000	2.1 2029/12/28	1.09
6	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	110,000,000	98.35 108,187,200	98.43 108,275,200	0.1 2028/12/20	1.09
7	18回 東京都公募公債 20年 日本	地方債証券	100,000,000	108.65 108,658,000	107.96 107,961,000	2.22 2029/3/19	1.08
8	373回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	110,000,000	98.69 108,568,000	97.72 107,501,900	0.6 2033/12/20	1.08
9	12回 兵庫県公募公債 15年 日本	地方債証券	100,000,000	100.17 100,177,000	100.72 100,728,000	0.781 2030/12/6	1.01

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	100.61 100,610,000	100.36 100,366,000	0.484 2025/6/30	1.01
11	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	100,000,000	100.13 100,135,000	100.00 100,005,000	0.1 2025/6/20	1.00
12	218回 神奈川県公募公 債 日本	地方債 証券	100,000,000	100.00 100,000,000	99.82 99,820,000	0.195 2025/12/19	1.00
13	169回 共同発行市場公 募地方債 日本	地方債 証券	100,000,000	99.51 99,516,000	99.41 99,411,000	0.205 2027/4/23	1.00
14	87回 中日本高速道路債 券 日本	特殊債 券	100,000,000	99.41 99,416,000	99.32 99,325,000	0.06 2026/3/18	1.00
15	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	99.14 99,140,000	99.19 99,195,000	0.17 2027/10/29	0.99
16	11回 プリヂストーン社債 日本	社債券	100,000,000	99.01 99,013,000	99.11 99,119,000	0.295 2027/4/21	0.99
17	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	100,000,000	99.14 99,149,000	99.10 99,101,000	0.1 2027/12/20	0.99
18	190回 大阪府公募公 債 5年 日本	地方債 証券	100,000,000	99.02 99,028,000	98.99 98,991,000	0.001 2026/12/25	0.99
19	250回 住宅金融支援機 構 日本	特殊債 券	100,000,000	98.45 98,459,000	98.68 98,687,000	0.289 2028/11/20	0.99
20	147回 高速道路機構債 券 日本	特殊債 券	100,000,000	97.83 97,832,000	98.25 98,254,000	0.955 2034/12/20	0.99
21	令和3年度11回 愛知県 公募公債 日本	地方債 証券	100,000,000	94.66 94,669,000	95.57 95,571,000	0.145 2031/10/29	0.96
22	494回 九州電力社債 日本	社債券	100,000,000	93.16 93,165,000	95.07 95,078,000	0.31 2031/5/23	0.95
23	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	90,000,000	100.08 90,074,700	99.93 89,937,000	0.1 2025/9/20	0.90
24	148回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	90,000,000	99.65 89,685,000	99.41 89,473,500	0.005 2026/6/20	0.90
25	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	90,000,000	99.31 89,382,600	99.21 89,290,800	0.1 2027/9/20	0.90
26	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	90,000,000	97.04 87,338,600	97.19 87,472,800	0.1 2030/9/20	0.88
27	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	80,000,000	100.63 80,510,400	100.34 80,276,800	0.4 2025/9/20	0.81

28	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	99.96 79,971,200	99.71 79,774,400	0.1 2026/3/20	0.80
29	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	99.81 79,852,000	99.56 79,648,800	0.1 2026/9/20	0.80
30	149回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	80,000,000	99.54 79,636,000	99.33 79,468,000	0.005 2026/9/20	0.80

(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

2024年4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.93
地方債証券	6.65
特殊債券	6.06
社債券	1.95
合計	99.58

(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

2024年4月30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	7,870	587,266.51 4,621,787,448	603,000.00 4,745,610,000	- -	6.58
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	6,930	563,806.01 3,907,175,690	536,000.00 3,714,480,000	- -	5.15
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	21,816	167,676.53 3,658,031,229	150,800.00 3,289,852,800	- -	4.56
4	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	11,752	272,276.62 3,199,794,851	272,600.00 3,203,595,200	- -	4.44
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	32,336	99,237.87 3,208,955,909	95,400.00 3,084,854,400	- -	4.28
6	KDX不動産投資法人 日本	投資証券	19,414	164,469.27 3,193,006,468	155,900.00 3,026,642,600	- -	4.20
7	GLP投資法人 日本	投資証券	22,660	131,996.23 2,991,034,706	128,500.00 2,911,810,000	- -	4.04
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	10,169	265,415.69 2,699,012,205	265,100.00 2,695,801,900	- -	3.74
9	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	32,664	57,531.40 1,879,205,925	70,800.00 2,312,611,200	- -	3.21

10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	15,091	150,744.90 2,274,891,396	151,500.00 2,286,286,500	- -	3.17
11	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	6,619	330,883.77 2,190,119,734	341,500.00 2,260,388,500	- -	3.13
12	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	13,442	178,262.28 2,396,201,671	166,500.00 2,238,093,000	- -	3.10
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	22,583	69,420.02 1,567,712,348	83,000.00 1,874,389,000	- -	2.60
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	20,272	80,951.85 1,641,055,966	81,000.00 1,642,032,000	- -	2.28
15	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	12,288	135,403.44 1,663,837,491	130,600.00 1,604,812,800	- -	2.22
16	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	4,614	354,308.42 1,634,779,068	342,000.00 1,577,988,000	- -	2.19
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	2,329	611,141.37 1,423,348,273	658,000.00 1,532,482,000	- -	2.12
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	3,539	409,242.09 1,448,307,791	392,500.00 1,389,057,500	- -	1.93
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	8,624	147,960.08 1,276,007,765	158,300.00 1,365,179,200	- -	1.89
20	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	2,806	467,144.05 1,310,806,211	453,000.00 1,271,118,000	- -	1.76
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	4,306	285,693.36 1,230,195,645	281,300.00 1,211,277,800	- -	1.68
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	2,503	444,449.81 1,112,457,877	459,000.00 1,148,877,000	- -	1.59
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	8,275	145,163.48 1,201,227,819	138,100.00 1,142,777,500	- -	1.58
24	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	3,317	306,250.02 1,015,831,339	342,500.00 1,136,072,500	- -	1.57
25	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	7,933	139,842.09 1,109,367,358	137,400.00 1,089,994,200	- -	1.51
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	9,934	109,609.19 1,088,857,783	107,100.00 1,063,931,400	- -	1.47
27	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	6,312	154,637.40 976,071,289	150,900.00 952,480,800	- -	1.32
28	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	13,003	72,598.47 943,998,010	73,200.00 951,819,600	- -	1.32

29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	2,329	378,959.41	404,500.00	-	1.31
				882,596,466	942,080,500	-	
30	NTT都市開発リート投資法人 日本	投資証券	6,840	133,950.47	121,000.00	-	1.15
				916,221,252	827,640,000	-	

(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

2024年4月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	96.78
合計	96.78

(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

2024年4月30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	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,246	56,598.51 70,521,753	63,113.02 78,638,829	- -	4.36
2	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	2,592	28,620.12 74,183,374	27,222.14 70,559,812	- -	3.91
3	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	436	73,663.38 32,117,238	137,690.73 60,033,159	- -	3.33
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	1,641	22,068.25 36,214,002	28,392.62 46,592,295	- -	2.58
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	1,034	20,434.65 21,129,434	26,068.93 26,955,278	- -	1.49
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	392	50,303.88 19,719,121	67,878.07 26,608,206	- -	1.47

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	920	20,662.16 19,009,188	26,343.50 24,236,029	- -	1.34
8	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	79	143,176.81 11,310,968	210,029.46 16,592,328	- -	0.92
9	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	143	92,777.85 13,267,233	115,666.67 16,540,335	- -	0.92
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	509	22,639.10 11,523,302	30,325.63 15,435,746	- -	0.86
11	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	505	32,979.85 16,654,826	30,446.44 15,375,454	- -	0.85
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	231	54,629.44 12,619,401	62,910.62 14,532,354	- -	0.81
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	706	16,154.42 11,405,023	18,771.51 13,252,690	- -	0.73
14	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	163	84,569.09 13,784,763	76,728.80 12,506,795	- -	0.69
15	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	279	37,913.31 10,577,815	42,651.69 11,899,823	- -	0.66
16	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	578	15,683.52 9,065,077	19,952.23 11,532,394	- -	0.64
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	148	60,870.91 9,008,896	71,718.98 10,614,410	- -	0.59
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	416	23,589.91 9,813,404	25,364.45 10,551,612	- -	0.58
19	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	71	101,460.40 7,203,689	142,515.32 10,118,588	- -	0.56
20	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	424	23,130.19 9,807,203	23,036.05 9,767,288	- -	0.54

21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	176	45,166.80 7,949,357	52,843.91 9,300,529	- -	0.52
22	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	447	16,063.42 7,180,349	20,415.82 9,125,875	- -	0.51
23	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	78	88,377.05 6,893,410	113,961.16 8,888,971	- -	0.49
24	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	316	22,270.38 7,037,441	26,097.17 8,246,707	- -	0.46
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	312	21,658.47 6,757,444	25,342.48 7,906,856	- -	0.44
26	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	474	17,201.50 8,153,513	15,853.41 7,514,518	- -	0.42
27	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	785	8,573.01 6,729,817	9,451.65 7,419,549	- -	0.41
28	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	171	32,950.56 5,634,547	43,263.60 7,398,076	- -	0.41
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,255	4,319.45 5,420,918	5,891.59 7,393,951	- -	0.41
30	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	285	17,829.44 5,081,393	25,135.37 7,163,583	- -	0.40

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年4月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	89.82
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	91.51

（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

2024年4月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	7.87
半導体・半導体製造装置		7.60
銀行		5.16
医薬品		4.56

インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.43
石油・ガス・消耗燃料	4.28
コンピュータ・周辺機器	4.21
大規模小売り	2.96
金融サービス	2.86
資本市場	2.85
保険	2.79
ヘルスケア機器・用品	2.04
航空宇宙・防衛	1.92
ホテル・レストラン・レジャー	1.85
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.80
機械	1.79
化学	1.68
生活必需品流通・小売り	1.58
バイオテクノロジー	1.53
電力	1.49
自動車	1.46
専門小売り	1.45
飲料	1.40
金属・鉱業	1.34
食品	1.16
情報技術サービス	1.15
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.10
繊維・アパレル・贅沢品	1.06
陸上運輸	1.01
電気設備	1.00
娯楽	0.96
家庭用品	0.95
専門サービス	0.88
各種電気通信サービス	0.82
総合公益事業	0.64
建設関連製品	0.61
通信機器	0.58
商業サービス・用品	0.57
コングロマリット	0.57
パーソナルケア用品	0.54
メディア	0.53
タバコ	0.47
電子装置・機器・部品	0.46
商社・流通業	0.45
航空貨物・物流サービス	0.41
消費者金融	0.39
建設資材	0.31
家庭用耐久財	0.30
建設・土木	0.29
不動産管理・開発	0.27
エネルギー設備・サービス	0.23
容器・包装	0.20
無線通信サービス	0.20
自動車用部品	0.13

独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11
運送インフラ	0.08
販売	0.08
ガス	0.08
水道	0.08
紙製品・林産品	0.07
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
旅客航空輸送	0.04
海上運輸	0.04
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	89.82

(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

2024年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,521,930,000	79.76 1,214,025,391	79.35 1,207,704,964	1.25 2031/8/15	8.56
2	FRANCE OAT 3.5 11/25/33 フランス	国債証 券	991,908,000	105.07 1,042,229,678	104.16 1,033,245,964	3.5 2033/11/25	7.32
3	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,161,060,000	86.80 1,007,899,860	88.27 1,024,907,577	2.875 2032/5/15	7.26
4	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	1,113,990,000	92.01 1,025,023,276	91.89 1,023,652,372	3.5 2033/2/15	7.26
5	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証 券	847,260,000	94.41 799,965,681	94.35 799,403,042	3.875 2033/8/15	5.67
6	FRANCE OAT 0.0 11/25/31 フランス	国債証 券	806,976,000	77.66 626,732,059	80.76 651,759,008	- 2031/11/25	4.62
7	FRANCE OAT 2.0 11/25/32 フランス	国債証 券	672,480,000	90.16 606,322,762	93.11 626,170,337	2 2032/11/25	4.44
8	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	658,980,000	80.41 529,931,946	82.11 541,148,715	1.875 2032/2/15	3.84
9	DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34 ドイツ	国債証 券	514,447,200	98.79 508,266,671	97.26 500,377,069	2.2 2034/2/15	3.55
10	ITALY BTPS 0.95 06/01/32 イタリア	国債証 券	608,594,400	75.52 459,671,350	81.70 497,282,484	0.95 2032/6/1	3.52
11	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証 券	542,874,000	89.48 485,787,405	90.82 493,039,858	3.375 2033/5/15	3.49
12	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証 券	486,390,000	103.99 505,825,375	99.03 481,716,093	4.5 2033/11/15	3.41
13	ITALY BTPS 0.6 08/01/31 イタリア	国債証 券	479,142,000	78.88 377,963,685	81.53 390,669,387	0.6 2031/8/1	2.77
14	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証 券	392,250,000	98.33 385,722,715	95.17 373,342,326	4 2034/2/15	2.65
15	ITALY BTPS 4.4 05/01/33 イタリア	国債証 券	336,240,000	99.00 332,877,600	105.42 354,464,208	4.4 2033/5/1	2.51

16	DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 ドイツ	国債証券	353,052,000	99.20 350,242,546	97.04 342,626,374	2.5 2044/7/4	2.43
17	DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 ドイツ	国債証券	344,646,000	96.59 332,914,250	98.60 339,845,081	2.3 2033/2/15	2.41
18	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 ドイツ	国債証券	403,488,000	84.91 342,633,939	83.89 338,510,292	- 2031/8/15	2.40
19	ITALY BTPS 4.2 03/01/34 イタリア	国債証券	302,616,000	104.13 315,127,322	103.42 312,995,728	4.2 2034/3/1	2.22
20	FRANCE OAT 3.0 05/25/33 フランス	国債証券	268,992,000	99.20 266,860,187	100.36 269,987,270	3 2033/5/25	1.91
21	UK TREASURY 4.25 06/07/32 イギリス	国債証券	250,215,400	101.59 254,201,173	100.67 251,914,362	4.25 2032/6/7	1.79
22	FRANCE OAT 1.75 06/25/39 フランス	国債証券	302,616,000	80.11 242,430,721	82.70 250,284,615	1.75 2039/6/25	1.77
23	CANADA 1.5 12/01/31 カナダ	国債証券	257,084,800	84.56 217,403,766	85.24 219,145,739	1.5 2031/12/1	1.55
24	CANADA 2.5 12/01/32 カナダ	国債証券	183,632,000	88.97 163,388,464	90.84 166,829,486	2.5 2032/12/1	1.18
25	CANADA 3.25 12/01/33 カナダ	国債証券	168,711,900	98.48 166,164,028	95.94 161,877,819	3.25 2033/12/1	1.15
26	UK TREASURY 0.875 07/31/33 イギリス	国債証券	216,722,000	75.80 164,293,992	74.45 161,371,201	0.875 2033/7/31	1.14
27	UK TREASURY 0.25 07/31/31 イギリス	国債証券	197,020,000	77.57 152,830,384	75.84 149,419,968	0.25 2031/7/31	1.06
28	CANADA 1.5 06/01/31 カナダ	国債証券	169,859,600	85.79 145,724,754	86.13 146,300,382	1.5 2031/6/1	1.04
29	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 ドイツ	国債証券	163,076,400	80.48 131,252,040	82.80 135,038,674	- 2032/2/15	0.96
30	UK TREASURY 4.625 01/31/34 イギリス	国債証券	118,212,000	105.71 124,970,180	102.72 121,429,730	4.625 2034/1/31	0.86

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年4月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.93
合計	97.93

（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

2024年4月30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	3,204	16,206.66 51,926,141	16,476.06 52,789,325	- -	8.13

2	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証 券	1,617	25,143.40 40,656,886	27,455.93 44,396,240	- -	6.84
3	EQUINIX INC アメリカ	投資証 券	324	110,688.48 35,863,069	113,962.74 36,923,929	- -	5.69
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証 券	1,924	13,274.65 25,540,436	15,027.88 28,913,644	- -	4.45
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証 券	1,126	16,821.79 18,941,341	22,723.82 25,587,029	- -	3.94
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証 券	2,887	7,729.10 22,313,917	8,521.23 24,600,816	- -	3.79
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	1,049	18,221.22 19,114,069	22,333.14 23,427,470	- -	3.61
8	CROWN CASTLE INC アメリカ	投資証 券	1,502	13,543.67 20,342,604	14,955.70 22,463,473	- -	3.46
9	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証 券	544	40,659.18 22,118,596	41,253.71 22,442,022	- -	3.46
10	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	3,590	4,424.00 15,882,174	4,557.94 16,363,022	- -	2.52
11	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	726	17,773.81 12,903,793	21,554.92 15,648,873	- -	2.41
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	492	27,177.99 13,371,574	29,971.03 14,745,750	- -	2.27
13	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	1,295	9,186.35 11,896,327	10,245.56 13,268,013	- -	2.04
14	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証 券	2,542	4,615.94 11,733,741	4,892.14 12,435,824	- -	1.92
15	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証 券	1,005	9,416.43 9,463,520	12,233.49 12,294,660	- -	1.89
16	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証 券	373	29,838.60 11,129,798	31,676.53 11,815,349	- -	1.82
17	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	2,121	4,959.96 10,520,091	5,425.60 11,507,701	- -	1.77
18	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証 券	602	15,012.81 9,037,714	18,694.63 11,254,170	- -	1.73
19	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	1,387	6,577.69 9,123,259	7,008.72 9,721,098	- -	1.50
20	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	222	33,728.99 7,487,837	38,914.33 8,638,983	- -	1.33
21	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	403	20,543.66 8,279,096	20,574.29 8,291,441	- -	1.28
22	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	426	16,645.82 7,091,122	18,876.63 8,041,448	- -	1.24
23	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証 券	2,426	2,481.01 6,018,939	3,010.91 7,304,470	- -	1.13
24	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	2,451	2,627.23 6,439,354	2,971.68 7,283,602	- -	1.12
25	UDR INC アメリカ	投資証 券	1,139	5,527.35 6,295,661	6,007.70 6,842,771	- -	1.05

26	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	2,277	2,655.14 6,045,772	2,951.28 6,720,085	- -	1.04
27	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	1,155	5,335.51 6,162,522	5,665.65 6,543,836	- -	1.01
28	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	748	8,327.45 6,228,933	8,739.32 6,537,018	- -	1.01
29	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	888	7,163.66 6,361,337	6,778.07 6,018,935	- -	0.93
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	612	10,293.63 6,299,702	9,525.39 5,829,544	- -	0.90

(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

2024年4月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.25
合計	99.25

(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

2024年4月30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 0606月	買建	2	54,105,660	54,940,000	3.43

(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

2024年4月30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 0606月	買建	1,222	2,077,901,020	2,204,488,000	3.06

(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

2024年4月30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 Jun24	買建	3	122,210,194	121,134,645	6.71
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun24	買建	1	15,127,195	16,083,727	0.89
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun24	買建	1	8,209,719	8,335,389	0.46

(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（2024年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第35特定期間末 (2024年4月22日)	4,652	4,660	1.1585	1.1605
2023年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	-
11月末日	4,592	-	1.1061	-
12月末日	4,602	-	1.1156	-
2024年1月末日	4,660	-	1.1393	-

2月末日	4,682	-	1.1545	-
3月末日	4,761	-	1.1853	-
4月末日	4,760	-	1.1852	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第35特定期間	0.0120

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第35特定期間	10.2

(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】

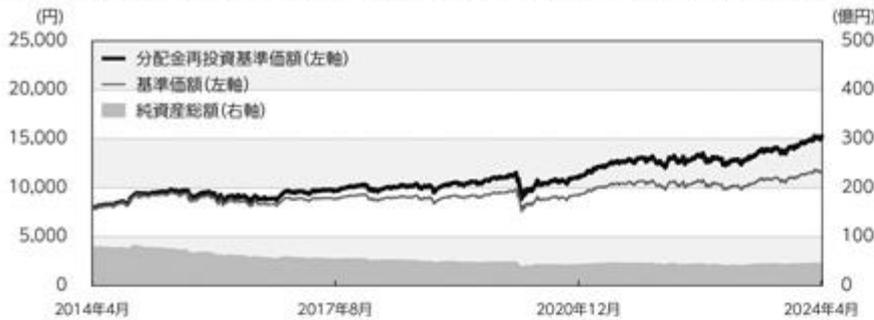
	設定口数	解約口数
第16特定期間	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	13,815,643	989,033,927
第18特定期間	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	5,348,676	374,412,075
第22特定期間	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	45,095,213	164,575,560
第24特定期間	4,817,074	285,434,876
第25特定期間	13,966,043	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
第35特定期間	13,061,456	167,896,169

(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:2024年4月30日

基準価額・純資産の推移 (2014年4月30日～2024年4月30日)



※基準価額は1万円当たり・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12月	20円
2024年1月	20円
2024年2月	20円
2024年3月	20円
2024年4月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	5,240円

※分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	新光外国株式インデックスマザーファンド	15.05
2	フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマーゼンディング・マーケット・デット・ファンド	14.99
3	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	14.72
4	海外国債マザーファンド	14.08
5	新光米国REITマザーファンド	13.64
6	新光J-REITマザーファンド	12.90
7	新光日本債券インデックスマザーファンド	12.75

■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	5.05
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.38
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.29
4	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.98
5	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.92

■新光日本債券インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	146回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/12/20	1.20
2	147回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/3/20	1.20
3	351回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/6/20	1.19
4	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	1.11
5	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	特殊債券	日本	2.1	2029/12/28	1.09

■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	6.58
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.15
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.56
4	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.44
5	日本都市ファンド投資法人	日本	4.28

○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:2024年4月30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	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.36
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	3.91
3	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	3.33
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.58
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	1.49

■海外国債マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	8.56
2	FRANCE OAT 3.5 11/25/33	国債証券	フランス	3.5	2033/11/25	7.32
3	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	7.26
4	US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	アメリカ	3.5	2033/2/15	7.26
5	US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	アメリカ	3.875	2033/8/15	5.67

■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(現地2024年4月12日現在)

※フランクリン・templton・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・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	48.4
2	ユーロ	7.7
3	メキシコペソ	5.9
4	南アフリカランド	3.7
5	ブラジルレアル	3.6

②組入公社債の上位5カ国

順位	国/地域	比率(%)
1	その他	11.2
2	メキシコ	7.6
3	南アフリカ	5.9
4	コロンビア	5.3
5	カザフスタン	5.1

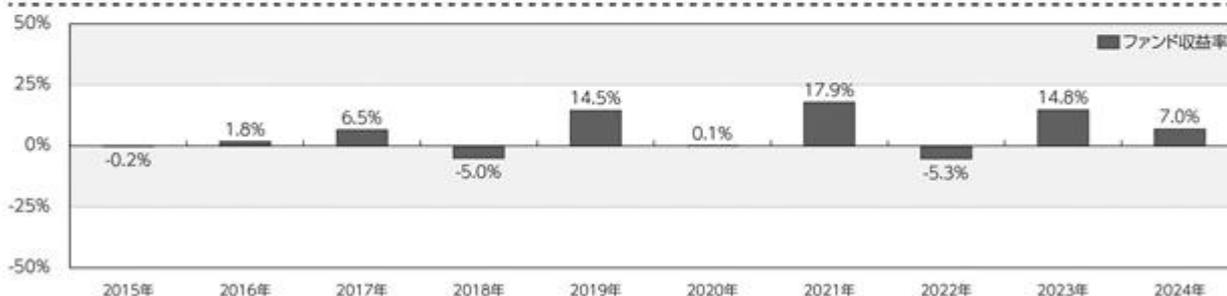
■新光米国REITマザーファンド

※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	8.13
2	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	6.84
3	EQUINIX INC	アメリカ	5.69
4	WELLTOWER INC	アメリカ	4.45
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.94

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。

※2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

(ハ) 取得申し込みの受付は、原則として営業日の午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。）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（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。）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、受益者的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ときは、投資信託契約の解約をしません。
- (ホ) 委託者は、上記(ニ)の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ヘ) 上記(ハ)から(ホ)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(ホ)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (ト) 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。
- (チ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。
- 上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、約款第53条第4項に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。
- (リ) 受託者は、委託者の承諾を受けて、その任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、下記「b. 投資信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託者を選任します。
- 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

b. 投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d. 運用報告書

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

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

e. 公告

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

<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、）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、）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10月21日から2024年4月22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10月20日現在	当期 2024年4月22日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	140,206,851	101,691,061
投資信託受益証券	637,224,200	695,973,000
親投資信託受益証券	3,663,991,691	3,867,648,402
流動資産合計	4,441,422,742	4,665,312,463
資産合計	4,441,422,742	4,665,312,463
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	8,341,940	8,032,270
未払解約金	1,076,900	173,518
未払受託者報酬	324,866	364,241
未払委託者報酬	3,532,988	3,961,250
その他未払費用	14,442	16,191
流動負債合計	13,291,136	12,547,470
負債合計	13,291,136	12,547,470
純資産の部		
元本等		
元本	4,170,970,134	4,016,135,421
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	257,161,472	636,629,572
（分配準備積立金）	562,853,295	857,630,091
元本等合計	4,428,131,606	4,652,764,993
純資産合計	4,428,131,606	4,652,764,993
負債純資産合計	4,441,422,742	4,665,312,463

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日	当期 自 2023年10月21日 至 2024年4月22日
営業収益		
受取配当金	32,539,200	32,044,800
受取利息	-	6,340
有価証券売買等損益	185,561,146	440,405,511
営業収益合計	218,100,346	472,456,651
営業費用		
支払利息	26,935	4,440
受託者報酬	1,990,195	2,056,646
委託者報酬	21,643,812	22,366,509
その他費用	88,469	91,422
営業費用合計	23,749,411	24,519,017
営業利益又は営業損失()	194,350,935	447,937,634
経常利益又は経常損失()	194,350,935	447,937,634
当期純利益又は当期純損失()	194,350,935	447,937,634
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()	36,783	153,857
期首剰余金又は期首欠損金()	118,321,993	257,161,472
剰余金増加額又は欠損金減少額	756,486	1,517,251
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	756,486	1,517,251
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,789,638	21,165,662
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,789,638	21,165,662
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	50,441,521	48,974,980
期末剰余金又は期末欠損金()	257,161,472	636,629,572

(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10月21日 至 2024年4月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月20日及び10月20日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を2024年4月22日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2023年10月20日現在	2024年4月22日現在
1. 期首元本額	4,233,110,286円	4,170,970,134円
期中追加設定元本額	17,589,380円	13,061,456円
期中一部解約元本額	79,729,532円	167,896,169円
2. 受益権の総数	4,170,970,134口	4,016,135,421口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2023年4月21日 至 2023年10月20日	自 2023年10月21日 至 2024年4月22日
1. 分配金の計算過程	(自2023年4月21日 至2023年5月22日) 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。	(自2023年10月21日 至2023年11月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,571,974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(17,276,197円)、信託約款に規定される収益調整金(30,679,735円)及び分配準備積立金(559,713,557円)より分配対象収益は618,241,463円(1万口当たり1,488.38円)であり、うち8,307,547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5月23日 至2023年6月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。</p>	<p>(自2023年11月21日 至2023年12月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,762,272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(46,524,627円)、信託約款に規定される収益調整金(30,565,538円)及び分配準備積立金(575,414,953円)より分配対象収益は664,267,390円(1万口当たり1,609.62円)であり、うち8,253,697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6月21日 至2023年7月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,055,043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。</p>	<p>(自2023年12月21日 至2024年1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(13,453,087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(100,001,038円)、信託約款に規定される収益調整金(30,406,193円)及び分配準備積立金(620,310,030円)より分配対象収益は764,170,348円(1万口当たり1,866.78円)であり、うち8,187,039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7月21日 至2023年8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(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>	<p>(自2024年1月23日 至2024年2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(8,949,264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(9,249,051円)、信託約款に規定される収益調整金(30,270,227円)及び分配準備積立金(719,754,664円)より分配対象収益は768,223,206円(1万口当たり1,891.59円)であり、うち8,122,506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>	<p>（自2024年2月21日 至2024年3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（15,710,395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（124,404,795円）、信託約款に規定される収益調整金（30,211,334円）及び分配準備積立金（725,156,118円）より分配対象収益は895,482,642円（1万口当たり2,218.75円）であり、うち8,071,921円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p> <p>（自2024年3月22日 至2024年4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（13,621,477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（31,017,363円）及び分配準備積立金（852,040,884円）より分配対象収益は896,679,724円（1万口当たり2,232.69円）であり、うち8,032,270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 2023年4月21日 至 2023年10月20日	当期 自 2023年10月21日 至 2024年4月22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10月20日現在	当期 2024年4月22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10月20日現在	当期 2024年4月22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	16,022,400	4,673,200
親投資信託受益証券	133,438,079	77,928,608
合計	149,460,479	73,255,408

（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10月20日現在	当期 2024年4月22日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0617円 (10,617円)	1.1585円 (11,585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

2024年4月22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	695,973,000	
投資信託受益証券 合計		333,800	695,973,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	224,883,758	658,189,782	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	169,841,560	680,351,321	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	123,450,399	686,026,212	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	504,434,964	607,037,035	
	新光J-REITマザーファンド	277,479,957	609,540,221	
	新光米国REITマザーファンド	229,354,163	626,503,831	
親投資信託受益証券 合計		1,529,444,801	3,867,648,402	
合計			4,563,621,402	

（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)

2024年4月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	54,289,768
株式	1,495,717,080
未収配当金	14,904,204
前払金	2,565,000
差入委託証拠金	2,663,195
流動資産合計	1,570,139,247
資産合計	1,570,139,247
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,825,660
未払解約金	10,000
流動負債合計	1,835,660
負債合計	1,835,660
純資産の部	
元本等	
元本	391,510,481
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,176,793,106
元本等合計	1,568,303,587
純資産合計	1,568,303,587
負債純資産合計	1,570,139,247

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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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	481,384,413円
同期中追加設定元本額	10,370,451円
同期中一部解約元本額	100,244,383円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	169,841,560円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	33,840,438円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	177,207,512円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	2,944,057円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	7,278,236円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	398,678円
計	391,510,481円
2. 受益権の総数	391,510,481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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年4月22日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	94,263,443
合計	94,263,443

(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(2024年1月15日から2024年4月22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	2024年4月22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	55,085,000	-	53,260,000	1,825,000
合計	55,085,000	-	53,260,000	1,825,000

(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)

2024年4月22日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.0058円 (40,058円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年4月22日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ニッセイ	600	957.60	574,560	
マルハニチロ	100	3,068.00	306,800	
雪国まいたけ	100	972.00	97,200	
サカタのタネ	100	3,600.00	360,000	
ホクト	100	1,824.00	182,400	
ショーボンドホールディングス	100	6,018.00	601,800	
ミライト・ワン	200	1,913.00	382,600	
robot home	100	154.00	15,400	
住石ホールディングス	100	1,339.00	133,900	
INPEX	1,900	2,389.50	4,540,050	
石油資源開発	100	6,750.00	675,000	
安藤・間	500	1,162.00	581,000	
東急建設	200	797.00	159,400	
コムシスホールディングス	200	3,687.00	737,400	
ビーアールホールディングス	100	362.00	36,200	
オリエンタル白石	300	372.00	111,600	
大成建設	400	5,358.00	2,143,200	
大林組	1,300	1,721.50	2,237,950	
清水建設	1,000	925.70	925,700	
長谷工コーポレーション	400	1,835.50	734,200	
鹿島建設	800	2,873.50	2,298,800	

西松建設	100	4,357.00	435,700
三井住友建設	400	404.00	161,600
奥村組	100	4,790.00	479,000
東鉄工業	100	3,020.00	302,000
戸田建設	600	988.20	592,920
熊谷組	100	4,065.00	406,500
矢作建設工業	100	1,427.00	142,700
ピーエス三菱	100	977.00	97,700
日本ハウスホールディングス	400	325.00	130,000
大東建託	300	16,995.00	5,098,500
新日本建設	100	1,571.00	157,100
日本道路	100	1,813.00	181,300
日本国土開発	200	505.00	101,000
東洋建設	100	1,245.00	124,500
五洋建設	600	774.60	464,760
世紀東急工業	100	1,786.00	178,600
住友林業	400	4,508.00	1,803,200
大和ハウス工業	1,100	4,322.00	4,754,200
ライト工業	100	2,045.00	204,500
積水ハウス	1,200	3,435.00	4,122,000
日特建設	100	1,129.00	112,900
ユアテック	100	1,368.00	136,800
中電工	100	3,160.00	316,000
関電工	400	1,839.00	735,600
きんでん	300	3,047.00	914,100
日本電設工業	100	2,111.00	211,100
エクシオグループ	400	1,681.50	672,600
九電工	100	6,927.00	692,700
三機工業	100	2,129.00	212,900
日揮ホールディングス	400	1,493.50	597,400
高砂熱学工業	100	5,320.00	532,000
NEC ネットエスアイ	200	2,511.00	502,200
明星工業	100	1,227.00	122,700
ダイダン	100	2,653.00	265,300
ニッポン	100	2,385.00	238,500
日清製粉グループ本社	400	2,041.00	816,400
中部飼料	100	1,173.00	117,300
フィード・ワン	100	996.00	99,600
LIFULL	200	161.00	32,200
MIXI	100	2,494.00	249,400
日本M&Aセンターホールディングス	700	860.40	602,280
UTグループ	100	3,370.00	337,000
ケアネット	100	581.00	58,100
オープンアップグループ	100	2,037.00	203,700
コシダカホールディングス	100	926.00	92,600
パソナグループ	100	2,141.00	214,100
リンクアンドモチベーション	100	494.00	49,400
エス・エム・エス	200	2,283.50	456,700
パーソルホールディングス	3,900	214.90	838,110
クックパッド	100	177.00	17,700

森永製菓	200	2,530.50	506,100
江崎グリコ	100	4,170.00	417,000
山崎製パン	300	3,715.00	1,114,500
寿スピリッツ	200	1,653.00	330,600
カルビー	200	3,397.00	679,400
森永乳業	200	3,059.00	611,800
ヤクルト本社	600	3,101.00	1,860,600
明治ホールディングス	500	3,511.00	1,755,500
雪印メグミルク	100	2,612.00	261,200
プリマハム	100	2,273.00	227,300
日本ハム	200	5,231.00	1,046,200
伊藤ハム米久ホールディングス	100	4,100.00	410,000
システナ	700	262.00	183,400
日鉄ソリューションズ	100	5,180.00	518,000
総合警備保障	700	854.20	597,940
いちご	500	438.00	219,000
日本駐車場開発	500	201.00	100,500
カカクコム	300	1,779.00	533,700
セントケア・ホールディング	100	852.00	85,200
ルネサンス	100	1,002.00	100,200
ディップ	100	2,756.00	275,600
ベネフィット・ワン	200	2,164.50	432,900
エムスリー	800	1,861.00	1,488,800
アウトソーシング	300	1,750.50	525,150
ディー・エヌ・エー	200	1,538.00	307,600
博報堂DYホールディングス	700	1,445.00	1,011,500
ぐるなび	100	327.00	32,700
タカミヤ	100	526.00	52,600
ファンコミュニケーションズ	100	402.00	40,200
エスプール	200	305.00	61,000
アドウェイズ	100	436.00	43,600
インフォマート	500	377.00	188,500
サッポロホールディングス	100	5,772.00	577,200
アサヒグループホールディングス	900	5,473.00	4,925,700
麒麟ホールディングス	1,500	2,268.00	3,402,000
宝ホールディングス	300	1,015.00	304,500
オエノンホールディングス	100	347.00	34,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	300	2,192.50	657,750
サントリー食品インターナショナル	300	5,122.00	1,536,600
伊藤園	100	3,751.00	375,100
日清オイリオグループ	100	5,070.00	507,000
不二製油グループ本社	100	2,329.50	232,950
ローソン	100	10,355.00	1,035,500
エービーシー・マート	200	3,125.00	625,000
アスクル	100	2,367.00	236,700
ゲオホールディングス	100	2,001.00	200,100
アダストリア	100	3,400.00	340,000
くら寿司	100	4,725.00	472,500
パルグループホールディングス	100	1,886.00	188,600

エディオン	200	1,600.00	320,000
サーラコーポレーション	100	794.00	79,400
J Pホールディングス	100	488.00	48,800
円谷フィールズホールディングス	100	1,675.00	167,500
双日	500	3,887.00	1,943,500
アルフレッサ ホールディングス	600	2,203.50	1,322,100
キッコーマン	1,500	1,920.50	2,880,750
味の素	900	5,564.00	5,007,600
キュービー	200	3,122.00	624,400
ハウス食品グループ本社	100	3,087.00	308,700
カゴメ	200	3,686.00	737,200
ニチレイ	200	3,918.00	783,600
横浜冷凍	100	1,008.00	100,800
東洋水産	200	9,242.00	1,848,400
日清食品ホールディングス	700	4,251.00	2,975,700
ロック・フィールド	100	1,604.00	160,400
日本たばこ産業	2,200	4,149.00	9,127,800
ファーマフーズ	100	833.00	83,300
北の達人コーポレーション	300	177.00	53,100
ユーグレナ	300	505.00	151,500
紀文食品	100	1,143.00	114,300
スター・マイカ・ホールディングス	100	606.00	60,600
片倉工業	100	1,830.00	183,000
ヒューリック	1,000	1,489.00	1,489,000
アルペン	100	2,043.00	204,300
クオールホールディングス	100	1,775.00	177,500
アルコニックス	100	1,410.00	141,000
神戸物産	500	3,352.00	1,676,000
ビックカメラ	300	1,577.00	473,100
DCMホールディングス	200	1,407.00	281,400
Monotaro	800	1,915.00	1,532,000
あい ホールディングス	100	2,400.00	240,000
J . フロント リテイリング	600	1,512.50	907,500
ドトール・日レスホールディングス	100	2,091.00	209,100
マツキヨココカラ&カンパニー	800	2,273.00	1,818,400
ZOZO	300	3,417.00	1,025,100
物語コーポレーション	100	4,305.00	430,500
三越伊勢丹ホールディングス	800	2,330.00	1,864,000
東洋紡	200	1,108.00	221,600
ユニチカ	100	218.00	21,800
日清紡ホールディングス	300	1,160.00	348,000
ダイワボウホールディングス	200	2,629.00	525,800
日東紡績	100	5,050.00	505,000
トヨタ紡織	200	2,438.50	487,700
マクニカホールディングス	100	6,699.00	669,900
ウエルシアホールディングス	200	2,351.50	470,300
クリエイトSDホールディングス	100	3,385.00	338,500
パイタルケーエスケー・ホールディングス	100	1,206.00	120,600
TOKAIホールディングス	200	961.00	192,200

三洋貿易	100	1,437.00	143,700
オイシックス・ラ・大地	100	1,153.00	115,300
ネクステージ	100	2,757.00	275,700
ジョイフル本田	100	2,218.00	221,800
すかいらーくホールディングス	600	2,239.00	1,343,400
日本毛織	100	1,311.00	131,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	100	884.00	88,400
野村不動産ホールディングス	200	4,168.00	833,600
三重交通グループホールディングス	100	600.00	60,000
サムティ	100	2,646.00	264,600
ディア・ライフ	100	1,017.00	101,700
プレサンスコーポレーション	100	1,755.00	175,500
フージャースホールディングス	100	1,072.00	107,200
オープンハウスグループ	300	4,592.00	1,377,600
東急不動産ホールディングス	1,100	1,137.00	1,250,700
飯田グループホールディングス	400	2,008.00	803,200
日本コークス工業	300	133.00	39,900
シップヘルスケアホールディングス	200	2,224.00	444,800
セブン&アイ・ホールディングス	4,100	2,031.00	8,327,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	300	1,085.00	325,500
ツルハホールディングス	100	9,961.00	996,100
トリドールホールディングス	100	3,775.00	377,500
帝人	400	1,512.50	605,000
東レ	2,500	724.50	1,811,250
クラレ	600	1,693.00	1,015,800
旭化成	2,400	1,108.50	2,660,400
TOKYO BASE	100	276.00	27,600
トーカロ	100	1,786.00	178,600
SUMCO	800	2,312.50	1,850,000
コメダホールディングス	100	2,576.00	257,600
パロックジャパンリミテッド	100	759.00	75,900
クスリのアオキホールディングス	100	2,821.50	282,150
FOOD & LIFE COMPANIES	200	3,024.00	604,800
セーレン	100	2,697.00	269,700
小松マテーレ	100	744.00	74,400
ワコールホールディングス	100	3,456.00	345,600
ホギメディカル	100	3,640.00	364,000
T S Iホールディングス	100	868.00	86,800
ワールド	100	2,095.00	209,500
T I S	500	3,290.00	1,645,000
グリー	100	466.00	46,600
コーエーテクモホールディングス	300	1,464.00	439,200
K L a b	100	256.00	25,600
ポルトゥウィンホールディングス	100	475.00	47,500
ネクソン	900	2,465.00	2,218,500
アイスタイル	100	490.00	49,000
エムアップホールディングス	100	1,036.00	103,600

エニグモ	100	340.00	34,000
コロブラ	200	589.00	117,800
ブロードリーフ	200	580.00	116,000
じげん	100	528.00	52,800
ブイキューブ	100	237.00	23,700
ティーガイア	100	2,064.00	206,400
テクマトリックス	100	1,651.00	165,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	100	2,242.50	224,250
GMOペイメントゲートウェイ	100	7,612.00	761,200
インターネットイニシアティブ	200	2,769.00	553,800
さくらインターネット	100	5,770.00	577,000
eBASE	100	675.00	67,500
アバントグループ	100	1,229.00	122,900
コムチュア	100	1,801.00	180,100
王子ホールディングス	1,600	639.80	1,023,680
日本製紙	300	1,120.00	336,000
北越コーポレーション	200	1,408.00	281,600
大王製紙	200	1,130.00	226,000
メディカル・データ・ビジョン	200	593.00	118,600
gumi	100	376.00	37,600
ラクス	200	1,634.00	326,800
レンゴー	400	1,156.50	462,600
チェンジホールディングス	100	1,178.00	117,800
マクロミル	100	731.00	73,100
マネーフォワード	100	5,613.00	561,300
レゾナック・ホールディングス	400	3,735.00	1,494,000
住友化学	2,600	357.50	929,500
日産化学	200	5,551.00	1,110,200
石原産業	100	1,790.00	179,000
日本曹達	100	5,740.00	574,000
東ソー	600	2,134.00	1,280,400
トクヤマ	100	2,829.50	282,950
東亜合成	200	1,602.50	320,500
関東電化工業	100	988.00	98,800
デンカ	300	2,277.50	683,250
イビデン	200	5,968.00	1,193,600
信越化学工業	3,500	6,116.00	21,406,000
エア・ウォーター	400	2,318.50	927,400
日本酸素ホールディングス	400	4,332.00	1,732,800
日本パーカライズン	200	1,194.00	238,800
高圧ガス工業	100	856.00	85,600
四国化成ホールディングス	100	1,719.00	171,900
日本触媒	400	1,487.50	595,000
カネカ	100	3,969.00	396,900
協和キリン	500	2,656.00	1,328,000
APPIER GROUP	100	1,372.00	137,200
三菱瓦斯化学	300	2,782.00	834,600
三井化学	500	4,433.00	2,216,500
JSR	500	4,336.00	2,168,000

東京応化工業	200	4,045.00	809,000
三菱ケミカルグループ	2,700	916.20	2,473,740
KHネオケム	100	2,349.00	234,900
ダイセル	700	1,424.50	997,150
住友ベークライト	200	4,293.00	858,600
積水化学工業	900	2,252.50	2,027,250
日本ゼオン	300	1,405.00	421,500
アイカ工業	100	3,670.00	367,000
UBE	200	2,780.00	556,000
積水樹脂	100	2,590.00	259,000
タキロンシーアイ	100	641.00	64,100
リケンテクノス	100	971.00	97,100
積水化成成品工業	200	474.00	94,800
ダイキョーニシカワ	100	726.00	72,600
日本化薬	300	1,281.50	384,450
プレステージ・インターナショナル	200	669.00	133,800
野村総合研究所	900	3,973.00	3,575,700
電通グループ	500	4,212.00	2,106,000
インテージホールディングス	100	1,449.00	144,900
ソースネクスト	200	181.00	36,200
シーティーエス	100	734.00	73,400
インフォコム	100	2,751.00	275,100
メディカルシステムネットワーク	100	637.00	63,700
トリケミカル研究所	100	3,975.00	397,500
シンプレクス・ホールディングス	100	2,702.00	270,200
ラクスル	100	891.00	89,100
メルカリ	300	1,777.50	533,250
ADEKA	300	3,165.00	949,500
日油	300	2,080.50	624,150
Sansan	200	1,405.00	281,000
花王	900	6,451.00	5,805,900
メドレー	100	3,875.00	387,500
JMDC	100	3,116.00	311,600
武田薬品工業	3,400	4,128.00	14,035,200
アステラス製薬	3,300	1,476.00	4,870,800
住友ファーマ	300	415.00	124,500
塩野義製薬	700	7,267.00	5,086,900
日本新薬	100	4,288.00	428,800
中外製薬	1,300	5,150.00	6,695,000
科研製薬	100	3,458.00	345,800
エーザイ	500	6,092.00	3,046,000
ロート製薬	400	2,975.00	1,190,000
小野薬品工業	800	2,292.50	1,834,000
久光製薬	100	3,774.00	377,400
持田製薬	200	3,150.00	630,000
参天製薬	800	1,471.00	1,176,800
ツムラ	100	3,794.00	379,400
テルモ	2,400	2,602.50	6,246,000
H.U.グループホールディングス	100	2,389.50	238,950
キッセイ薬品工業	100	3,525.00	352,500

生化学工業	100	745.00	74,500
栄研化学	100	1,959.00	195,900
JCRファーマ	200	811.00	162,200
東和薬品	100	2,792.00	279,200
ゼリア新薬工業	100	2,058.00	205,800
ネクセラファーマ	100	1,467.00	146,700
第一三共	3,300	4,633.00	15,288,900
杏林製薬	100	1,805.00	180,500
大幸薬品	100	333.00	33,300
大塚ホールディングス	800	6,322.00	5,057,600
ペプチドリーム	200	1,517.50	303,500
日本ペイントホールディングス	2,100	975.60	2,048,760
関西ペイント	400	2,061.00	824,400
中国塗料	100	1,993.00	199,300
藤倉化成	100	458.00	45,800
太陽ホールディングス	100	3,050.00	305,000
DIC	200	2,900.00	580,000
サカタイクス	100	1,557.00	155,700
artience	100	2,915.00	291,500
オリエンタルランド	1,900	4,645.00	8,825,500
ダスキン	100	3,258.00	325,800
パーク24	300	1,772.50	531,750
明光ネットワークジャパン	100	707.00	70,700
フジ・メディア・ホールディングス	400	1,877.50	751,000
ラウンドワン	500	713.00	356,500
リゾートトラスト	200	2,616.50	523,300
オービック	100	21,355.00	2,135,500
ジャストシステム	100	2,607.00	260,700
LINEヤフー	5,300	355.20	1,882,560
ビー・エム・エル	100	2,954.00	295,400
トレンドマイクロ	200	7,867.00	1,573,400
リソー教育	200	271.00	54,200
日本オラクル	100	11,435.00	1,143,500
フューチャー	100	1,777.00	177,700
ユー・エス・エス	1,000	1,234.50	1,234,500
オービックビジネスコンサルタント	100	6,728.00	672,800
アイティフォー	100	1,371.00	137,100
東京個別指導学院	100	404.00	40,400
サイバーエージェント	900	1,032.00	928,800
楽天グループ	3,200	760.80	2,434,560
SBIグローバルアセットマネジメント	100	687.00	68,700
大塚商会	400	3,152.00	1,260,800
サイボウズ	100	1,577.00	157,700
セントラルスポーツ	100	2,430.00	243,000
電通総研	100	5,050.00	505,000
デジタルガレージ	100	2,605.00	260,500
イーエムシステムズ	100	624.00	62,400
CIJ	100	488.00	48,800
WOWOW	100	1,092.00	109,200

エン・ジャパン	100	2,740.00	274,000
サワイグループホールディングス	100	6,140.00	614,000
富士フイルムホールディングス	2,100	3,347.00	7,028,700
コニカミノルタ	900	547.00	492,300
資生堂	800	4,229.00	3,383,200
ライオン	700	1,388.00	971,600
マンダム	100	1,311.00	131,100
ミルボン	100	3,069.00	306,900
ファンケル	200	1,849.50	369,900
コーセー	100	7,970.00	797,000
ポーラ・オルビスホールディングス	200	1,442.50	288,500
エステー	100	1,537.00	153,700
コニシ	200	1,399.00	279,800
長谷川香料	100	3,060.00	306,000
小林製薬	100	5,696.00	569,600
タカラバイオ	100	989.00	98,900
JCU	100	3,655.00	365,500
デクセリアルズ	100	5,619.00	561,900
クミアイ化学工業	200	807.00	161,400
日本農薬	100	732.00	73,200
ニチレキ	100	2,396.00	239,600
富士石油	200	467.00	93,400
出光興産	1,900	1,023.00	1,943,700
ENEOSホールディングス	5,700	719.70	4,102,290
コスモエネルギーホールディングス	100	7,411.00	741,100
テスホールディングス	100	445.00	44,500
インフロニア・ホールディングス	500	1,384.50	692,250
横浜ゴム	200	4,084.00	816,800
TOYO TIRE	300	2,893.50	868,050
ブリヂストン	1,100	6,817.00	7,498,700
住友ゴム工業	400	1,903.50	761,400
住友理工	100	1,342.00	134,200
三ツ星ベルト	100	4,815.00	481,500
バンドー化学	100	1,764.00	176,400
AGC	400	5,734.00	2,293,600
日本板硝子	200	513.00	102,600
有沢製作所	100	1,504.00	150,400
日本電気硝子	200	3,745.00	749,000
住友大阪セメント	100	3,877.00	387,700
太平洋セメント	300	3,481.00	1,044,300
アジアパイルホールディングス	100	835.00	83,500
東海カーボン	400	1,037.00	414,800
TOTO	300	4,360.00	1,308,000
日本碍子	500	2,053.00	1,026,500
日本特殊陶業	500	5,049.00	2,524,500
品川リフラクトリーズ	100	1,815.00	181,500
フジインコーポレーテッド	100	3,245.00	324,500
ニチアス	100	4,015.00	401,500
日本製鉄	1,800	3,480.00	6,264,000
神戸製鋼所	800	1,907.00	1,525,600

中山製鋼所	100	918.00	91,800
JFEホールディングス	1,200	2,380.00	2,856,000
東京製鐵	100	1,653.00	165,300
共英製鋼	100	2,543.00	254,300
大和工業	100	8,157.00	815,700
淀川製鋼所	100	4,540.00	454,000
丸一鋼管	100	4,113.00	411,300
大同特殊鋼	500	1,725.50	862,750
新日本電工	300	313.00	93,900
日本製鋼所	100	3,761.00	376,100
大紀アルミニウム工業所	100	1,333.00	133,300
日本軽金属ホールディングス	100	1,879.00	187,900
三井金属鉱業	100	4,932.00	493,200
三菱マテリアル	300	3,063.00	918,900
住友金属鉱山	500	5,216.00	2,608,000
DOWAホールディングス	100	5,717.00	571,700
古河機械金属	100	1,893.00	189,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	2,470.00	247,000
東邦チタニウム	100	1,391.00	139,100
UACJ	100	4,635.00	463,500
古河電気工業	200	3,316.00	663,200
住友電気工業	1,400	2,401.50	3,362,100
フジクラ	600	2,562.00	1,537,200
SWCC	200	3,995.00	799,000
タツタ電線	100	717.00	71,700
いよぎんホールディングス	500	1,180.00	590,000
しずおかフィナンシャルグループ	900	1,460.00	1,314,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	400	1,314.50	525,800
楽天銀行	200	3,275.00	655,000
京都フィナンシャルグループ	400	2,768.50	1,107,400
リョービ	100	2,724.00	272,400
AREホールディングス	200	1,982.00	396,400
東洋製罐グループホールディングス	300	2,407.50	722,250
横河ブリッジホールディングス	100	2,788.00	278,800
三和ホールディングス	600	2,455.50	1,473,300
文化シャッター	100	1,642.00	164,200
三協立山	100	826.00	82,600
LIXIL	700	1,786.00	1,250,200
ノーリツ	100	1,750.00	175,000
リンナイ	200	3,328.00	665,600
ユニプレス	100	1,158.00	115,800
日東精工	100	595.00	59,500
岡部	100	798.00	79,800
ジーテクト	100	2,125.00	212,500
東プレ	100	2,524.00	252,400
高周波熱錬	100	1,047.00	104,700
パイオラックス	100	2,647.00	264,700
エイチワン	100	681.00	68,100
日本発条	400	1,504.00	601,600
三浦工業	200	2,477.50	495,500

タクマ	100	1,918.00	191,800	
テクノプロ・ホールディングス	300	2,850.00	855,000	
ジャパンマテリアル	100	2,186.00	218,600	
ベクトル	100	1,244.00	124,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,472.00	147,200	
シグマクス・ホールディングス	100	1,564.00	156,400	
リクルートホールディングス	2,700	6,308.00	17,031,600	
エラン	100	903.00	90,300	
ツガミ	100	1,242.00	124,200	
アマダ	700	1,672.50	1,170,750	
アイダエンジニアリング	100	887.00	88,700	
F U J I	200	2,496.00	499,200	
オーエスジー	200	1,940.00	388,000	
旭ダイヤモンド工業	100	898.00	89,800	
D M G 森精機	300	4,035.00	1,210,500	
ソディック	100	713.00	71,300	
ディスコ	200	47,620.00	9,524,000	
日進工具	100	900.00	90,000	
日本郵政	4,500	1,454.50	6,545,250	
ベルシステム24ホールディングス	100	1,509.00	150,900	
ソラスト	100	491.00	49,100	
インソース	100	739.00	73,900	
豊田自動織機	400	14,185.00	5,674,000	
リケンN P R	100	2,943.00	294,300	
島精機製作所	100	1,253.00	125,300	
オプトラン	100	1,884.00	188,400	
ヤマシンフィルタ	100	403.00	40,300	
やまびこ	100	2,029.00	202,900	
ナブテスコ	300	2,578.00	773,400	
三井海洋開発	100	3,090.00	309,000	
レオン自動機	100	1,463.00	146,300	
S M C	100	77,800.00	7,780,000	
オイレス工業	100	2,334.00	233,400	
サトーホールディングス	100	2,171.00	217,100	
技研製作所	100	1,913.00	191,300	
小松製作所	1,800	4,457.00	8,022,600	
住友重機械工業	400	4,556.00	1,822,400	
日立建機	200	4,520.00	904,000	
日工	100	737.00	73,700	
T O W A	100	9,250.00	925,000	
クボタ	2,000	2,417.50	4,835,000	
月島ホールディングス	100	1,384.00	138,400	
新東工業	100	1,224.00	122,400	
アイチコーポレーション	100	1,086.00	108,600	
小森コーポレーション	100	1,155.00	115,500	
荏原製作所	200	12,775.00	2,555,000	
ダイキン工業	500	19,680.00	9,840,000	
オルガノ	200	7,030.00	1,406,000	
栗田工業	300	5,895.00	1,768,500	
椿本チエイン	100	5,210.00	521,000	

日機装	100	1,263.00	126,300
レイズネクスト	100	2,010.00	201,000
アネスト岩田	100	1,335.00	133,500
ダイフク	800	3,164.00	2,531,200
タダノ	400	1,230.00	492,000
フジテック	100	3,725.00	372,500
CKD	100	2,851.00	285,100
平和	100	1,955.00	195,500
SANKYO	500	1,642.00	821,000
日本金銭機械	100	1,315.00	131,500
竹内製作所	100	5,750.00	575,000
アマノ	100	3,773.00	377,300
JUKI	100	541.00	54,100
ジャノメ	100	652.00	65,200
ブラザー工業	600	2,841.50	1,704,900
マックス	100	3,200.00	320,000
モリタホールディングス	100	1,752.00	175,200
グローリー	100	2,806.00	280,600
大和冷機工業	100	1,498.00	149,800
セガサミーホールディングス	400	2,027.00	810,800
TPR	100	2,250.00	225,000
ホシザキ	300	5,400.00	1,620,000
日本精工	700	867.90	607,530
NTN	900	312.80	281,520
ジェイテクト	400	1,398.50	559,400
ミネベアミツミ	900	2,782.00	2,503,800
日本トムソン	200	623.00	124,600
THK	400	3,304.00	1,321,600
イーグル工業	100	1,766.00	176,600
キッツ	100	1,302.00	130,200
日立製作所	1,900	13,295.00	25,260,500
三菱電機	4,100	2,451.50	10,051,150
富士電機	300	9,625.00	2,887,500
安川電機	500	6,149.00	3,074,500
シンフォニアテクノロジー	100	3,215.00	321,500
明電舎	100	3,350.00	335,000
PHCホールディングス	100	1,138.00	113,800
KOKUSAI ELECTRIC	200	3,840.00	768,000
ソシオネクスト	500	4,108.00	2,054,000
ベイカレント・コンサルティング	300	3,284.00	985,200
アイモバイル	100	381.00	38,100
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	100	2,441.00	244,100
RPAホールディングス	100	249.00	24,900
三櫻工業	100	1,132.00	113,200
マキタ	500	4,219.00	2,109,500
東芝テック	100	3,120.00	312,000
マブチモーター	200	2,655.50	531,100
ニデック	1,000	6,762.00	6,762,000
ダブル・スコープ	100	503.00	50,300

ヤーマン	100	989.00	98,900	
JVCケンウッド	400	839.00	335,600	
大崎電気工業	100	668.00	66,800	
オムロン	300	5,252.00	1,575,600	
日東工業	100	4,090.00	409,000	
I D E C	100	2,648.00	264,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	200	2,946.00	589,200	
日本電気	700	10,740.00	7,518,000	
富士通	4,000	2,463.50	9,854,000	
沖電気工業	200	1,105.00	221,000	
ルネサスエレクトロニクス	2,600	2,317.50	6,025,500	
セイコーエプソン	700	2,754.00	1,927,800	
ワコム	400	596.00	238,400	
アルバック	100	9,190.00	919,000	
日本信号	100	1,010.00	101,000	
京三製作所	100	494.00	49,400	
能美防災	100	2,345.00	234,500	
エレコム	100	1,502.00	150,200	
パナソニック ホールディングス	4,400	1,379.00	6,067,600	
シャープ	800	817.20	653,760	
アンリツ	300	1,197.50	359,250	
富士通ゼネラル	100	1,819.00	181,900	
ソニーグループ	2,700	12,530.00	33,831,000	
T D K	700	7,092.00	4,964,400	
タムラ製作所	200	588.00	117,600	
アルプスアルパイン	400	1,293.50	517,400	
日本電波工業	100	1,202.00	120,200	
ホシデン	100	1,920.00	192,000	
ヒロセ電機	100	16,270.00	1,627,000	
日本航空電子工業	100	2,309.00	230,900	
マクセル	100	1,501.00	150,100	
古野電気	100	1,826.00	182,600	
スミダコーポレーション	100	1,183.00	118,300	
横河電機	500	3,428.00	1,714,000	
アズビル	300	4,347.00	1,304,100	
日本光電工業	200	4,185.00	837,000	
堀場製作所	100	14,335.00	1,433,500	
アドバンテスト	1,100	5,269.00	5,795,900	
キーエンス	400	63,720.00	25,488,000	
シスメックス	1,200	2,450.50	2,940,600	
日本マイクロニクス	100	6,500.00	650,000	
デンソー	3,100	2,850.00	8,835,000	
コーセル	100	1,439.00	143,900	
オプテックスグループ	100	1,817.00	181,700	
レーザーテック	200	34,520.00	6,904,000	
スタンレー電気	300	2,775.50	832,650	
ウシオ電機	200	1,988.00	397,600	
日本電子	100	6,387.00	638,700	
カシオ計算機	300	1,329.00	398,700	
ファナック	1,800	4,426.00	7,966,800	

日本シイエムケイ	100	579.00	57,900	
大真空	100	754.00	75,400	
ローム	800	2,142.50	1,714,000	
浜松ホトニクス	300	5,570.00	1,671,000	
新光電気工業	200	5,525.00	1,105,000	
京セラ	2,200	1,933.00	4,252,600	
太陽誘電	200	3,568.00	713,600	
村田製作所	3,400	2,745.50	9,334,700	
双葉電子工業	100	464.00	46,400	
日東電工	300	13,855.00	4,156,500	
東海理化電機製作所	100	2,321.00	232,100	
ニチコン	100	1,286.00	128,600	
日本ケミコン	100	1,448.00	144,800	
K O A	100	1,420.00	142,000	
日立造船	400	1,233.00	493,200	
三菱重工業	8,000	1,357.50	10,860,000	
川崎重工業	500	4,750.00	2,375,000	
I H I	300	3,833.00	1,149,900	
名村造船所	100	1,778.00	177,800	
アンピスホールディングス	100	2,352.00	235,200	
カーブスホールディングス	100	759.00	75,900	
フォーラムエンジニアリング	100	922.00	92,200	
三菱ロジスネクスト	100	1,492.00	149,200	
F P G	100	2,204.00	220,400	
全国保証	100	5,500.00	550,000	
めぶきフィナンシャルグループ	1,800	545.50	981,900	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	4,645.00	464,500	
九州フィナンシャルグループ	800	1,050.00	840,000	
かんぽ生命保険	400	2,925.50	1,170,200	
ゆうちょ銀行	4,000	1,562.50	6,250,000	
富山第一銀行	200	913.00	182,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,900	833.10	1,582,890	
西日本フィナンシャルホールディングス	300	1,939.00	581,700	
プレミアグループ	100	1,958.00	195,800	
日産自動車	5,400	550.40	2,972,160	
いすゞ自動車	1,200	1,953.00	2,343,600	
トヨタ自動車	20,900	3,517.00	73,505,300	
日野自動車	800	490.40	392,320	
三菱自動車工業	1,300	461.30	599,690	
武蔵精密工業	100	1,642.00	164,200	
日産車体	100	954.00	95,400	
新明和工業	100	1,179.00	117,900	
極東開発工業	100	2,529.00	252,900	
タチエス	100	1,921.00	192,100	
N O K	200	2,121.50	424,300	
フタバ産業	100	1,051.00	105,100	
市光工業	100	515.00	51,500	
大同メタル工業	100	632.00	63,200	

プレス工業	200	762.00	152,400
太平洋工業	100	1,678.00	167,800
アイシン	300	6,202.00	1,860,600
マツダ	1,100	1,684.50	1,852,950
本田技研工業	9,000	1,773.50	15,961,500
スズキ	2,800	1,762.00	4,933,600
S U B A R U	1,100	3,307.00	3,637,700
ヤマハ発動機	1,600	1,417.00	2,267,200
小糸製作所	600	2,253.00	1,351,800
エクセディ	100	3,010.00	301,000
ミツバ	100	1,451.00	145,100
豊田合成	100	3,217.00	321,700
愛三工業	100	1,613.00	161,300
エフ・シー・シー	100	2,220.00	222,000
シマノ	200	23,805.00	4,761,000
テイ・エス テック	200	1,936.50	387,300
三十三フィナンシャルグループ	100	2,029.00	202,900
第四北越フィナンシャルグループ	100	4,435.00	443,500
ひろぎんホールディングス	600	1,101.00	660,600
十六フィナンシャルグループ	100	4,625.00	462,500
ネットプロテクションズホールディングス	100	204.00	20,400
あいちフィナンシャルグループ	100	3,175.00	317,500
ノジマ	100	1,811.00	181,100
カッパ・クリエイト	100	1,596.00	159,600
コンドーテック	100	1,234.00	123,400
ナガイレーベン	100	2,341.00	234,100
良品計画	500	2,455.50	1,227,750
第一興商	200	1,853.00	370,600
メディバルホールディングス	600	2,432.00	1,459,200
アズワン	200	2,556.50	511,300
ドウシシャ	100	2,110.00	211,000
G - 7ホールディングス	100	1,375.00	137,500
イオン北海道	100	914.00	91,400
コジマ	100	837.00	83,700
コーナン商事	100	4,410.00	441,000
ネットワンシステムズ	200	2,674.50	534,900
システムソフト	200	52.00	10,400
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	800	3,757.00	3,005,600
西松屋チェーン	100	2,134.00	213,400
ゼンショーホールディングス	200	6,034.00	1,206,800
日本ライフライン	100	1,151.00	115,100
サイゼリヤ	100	5,390.00	539,000
V Tホールディングス	200	519.00	103,800
I D O M	100	1,404.00	140,400
ユナイテッドアローズ	100	1,804.00	180,400
ハイデイ日高	100	2,765.00	276,500
シークス	100	1,548.00	154,800
コロワイド	200	2,152.50	430,500

スギホールディングス	300	2,388.00	716,400
島津製作所	700	4,155.00	2,908,500
JMS	100	520.00	52,000
スター精密	100	1,789.00	178,900
東京精密	100	10,220.00	1,022,000
マニー	200	1,862.50	372,500
ニコン	600	1,562.00	937,200
トプコン	200	1,766.50	353,300
オリンパス	2,300	2,171.00	4,993,300
SCREENホールディングス	100	16,025.00	1,602,500
HOYA	800	17,540.00	14,032,000
A&Dホロンホールディングス	100	2,610.00	261,000
朝日インテック	500	2,231.00	1,115,500
キャノン	1,900	4,432.00	8,420,800
リコー	1,000	1,373.00	1,373,000
シチズン時計	400	1,027.00	410,800
メニコン	200	1,503.00	300,600
スノーピーク	100	1,245.00	124,500
パラマウントベッドホールディングス	100	2,696.00	269,600
アートネイチャー	100	762.00	76,200
バンダイナムコホールディングス	1,100	2,911.00	3,202,100
SHOEI	100	2,289.00	228,900
マーベラス	100	676.00	67,600
パイロットコーポレーション	100	4,169.00	416,900
エイベックス	100	1,305.00	130,500
フジシールインターナショナル	100	2,050.00	205,000
タカラトミー	200	2,494.50	498,900
広済堂ホールディングス	100	692.00	69,200
レック	100	1,098.00	109,800
三光合成	100	654.00	65,400
TOPPANホールディングス	500	3,622.00	1,811,000
大日本印刷	500	4,480.00	2,240,000
NISSHA	100	1,609.00	160,900
アシックス	400	6,596.00	2,638,400
ニチハ	100	3,630.00	363,000
エフピコ	100	2,647.00	264,700
ヤマハ	300	3,346.00	1,003,800
クリナップ	100	748.00	74,800
ピジョン	300	1,417.50	425,250
キングジム	100	879.00	87,900
象印マホービン	100	1,478.00	147,800
リンテック	100	3,050.00	305,000
信越ポリマー	100	1,473.00	147,300
イトーキ	100	1,894.00	189,400
任天堂	2,300	7,525.00	17,307,500
三菱鉛筆	100	2,477.00	247,700
タカラスタANDARD	100	1,821.00	182,100
コクヨ	200	2,559.00	511,800
ニフコ	100	3,769.00	376,900
オカムラ	100	2,301.00	230,100

伊藤忠商事	2,700	6,577.00	17,757,900
丸紅	3,400	2,645.50	8,994,700
スクロール	100	918.00	91,800
長瀬産業	200	2,607.00	521,400
豊田通商	400	9,398.00	3,759,200
オンワードホールディングス	300	623.00	186,900
三共生興	100	743.00	74,300
兼松	200	2,503.00	500,600
三井物産	3,000	7,273.00	21,819,000
東京エレクトロン	800	32,450.00	25,960,000
カメイ	100	2,005.00	200,500
セイコーグループ	100	4,060.00	406,000
山善	100	1,338.00	133,800
住友商事	2,400	3,781.00	9,074,400
B I P R O G Y	100	4,628.00	462,800
三菱商事	7,600	3,477.00	26,425,200
キヤノンマーケティングジャパン	100	4,271.00	427,100
阪和興業	100	5,850.00	585,000
ニプロ	500	1,258.00	629,000
岩谷産業	100	8,914.00	891,400
アステナホールディングス	100	486.00	48,600
三愛オブリ	100	2,047.00	204,700
稲畑産業	100	3,135.00	313,500
ゴールドウイン	100	9,355.00	935,500
ユニ・チャーム	800	4,653.00	3,722,400
デサント	100	3,350.00	335,000
ワキタ	100	1,509.00	150,900
東邦ホールディングス	100	3,677.00	367,700
サンゲツ	100	3,340.00	334,000
ミツウロコグループホールディングス	100	1,339.00	133,900
伊藤忠エネクス	100	1,538.00	153,800
サンリオ	300	2,639.50	791,850
新光商事	100	964.00	96,400
モスフードサービス	100	3,430.00	343,000
木曽路	100	2,499.00	249,900
S R S ホールディングス	100	1,136.00	113,600
リテールパートナーズ	100	1,688.00	168,800
日本瓦斯	200	2,590.00	518,000
ロイヤルホールディングス	100	2,465.00	246,500
リンガーハット	100	2,336.00	233,600
MrMaxHD	100	651.00	65,100
A O K I ホールディングス	100	1,110.00	111,000
オークワ	100	994.00	99,400
コメリ	100	3,400.00	340,000
青山商事	100	1,597.00	159,700
しまむら	200	7,429.00	1,485,800
高島屋	300	2,262.00	678,600
松屋	100	923.00	92,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	200	1,835.00	367,000
丸井グループ	300	2,407.00	722,100

クレディセゾン	300	2,947.00	884,100	
イオン	1,300	3,322.00	4,318,600	
イズミ	100	3,663.00	366,300	
平和堂	100	2,430.00	243,000	
フジ	100	1,939.00	193,900	
ヤオコー	100	8,398.00	839,800	
ゼビオホールディングス	100	1,009.00	100,900	
ケーズホールディングス	300	1,490.50	447,150	
PALTAC	100	4,532.00	453,200	
三谷産業	100	388.00	38,800	
あおぞら銀行	300	2,463.00	738,900	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	22,500	1,546.00	34,785,000	
りそなホールディングス	4,300	996.10	4,283,230	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,200	3,243.00	3,891,600	
三井住友フィナンシャルグループ	2,600	8,699.00	22,617,400	
千葉銀行	1,100	1,323.00	1,455,300	
群馬銀行	800	917.40	733,920	
武蔵野銀行	100	2,990.00	299,000	
千葉興業銀行	100	1,113.00	111,300	
筑波銀行	200	298.00	59,600	
七十七銀行	100	4,265.00	426,500	
東邦銀行	400	336.00	134,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	400	4,188.00	1,675,200	
スルガ銀行	400	954.00	381,600	
八十二銀行	800	1,033.50	826,800	
大垣共立銀行	100	2,224.00	222,400	
福井銀行	100	1,852.00	185,200	
滋賀銀行	100	4,075.00	407,500	
南都銀行	100	3,015.00	301,500	
百五銀行	400	642.00	256,800	
紀陽銀行	300	1,780.00	534,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	300	1,897.00	569,100	
山陰合同銀行	400	1,171.00	468,400	
四国銀行	100	1,125.00	112,500	
阿波銀行	100	2,486.00	248,600	
琉球銀行	100	1,153.00	115,300	
セブン銀行	1,100	279.70	307,670	
みずほフィナンシャルグループ	4,900	3,019.00	14,793,100	
山口フィナンシャルグループ	400	1,580.50	632,200	
みずほリース	500	1,092.00	546,000	
東京センチュリー	300	1,548.00	464,400	
SBIホールディングス	600	3,750.00	2,250,000	
日本証券金融	200	1,557.00	311,400	
アイフル	600	489.00	293,400	
北洋銀行	700	453.00	317,100	
愛媛銀行	100	1,141.00	114,100	
京葉銀行	200	752.00	150,400	
栃木銀行	300	351.00	105,300	
東和銀行	100	659.00	65,900	
イオンフィナンシャルサービス	200	1,307.00	261,400	

アコム	800	394.20	315,360
オリエントコーポレーション	100	1,036.00	103,600
オリックス	2,200	3,183.00	7,002,600
三菱HCキャピタル	1,600	1,018.00	1,628,800
ジャフコグループ	100	1,718.50	171,850
トモニホールディングス	400	418.00	167,200
大和証券グループ本社	2,900	1,110.00	3,219,000
野村ホールディングス	6,000	897.30	5,383,800
岡三証券グループ	400	753.00	301,200
丸三証券	100	1,028.00	102,800
東洋証券	100	364.00	36,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	500	569.00	284,500
水戸証券	100	485.00	48,500
いちよし証券	100	813.00	81,300
松井証券	200	815.00	163,000
SOMPOホールディングス	2,100	3,039.00	6,381,900
日本取引所グループ	900	3,794.00	3,414,600
マネックスグループ	400	826.00	330,400
極東証券	100	1,544.00	154,400
岩井コスモホールディングス	100	2,210.00	221,000
アイザワ証券グループ	100	1,310.00	131,000
池田泉州ホールディングス	600	388.00	232,800
アニコムホールディングス	100	563.00	56,300
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,700	2,730.00	7,371,000
スパークス・グループ	100	1,775.00	177,500
第一生命ホールディングス	1,800	3,489.00	6,280,200
東京海上ホールディングス	3,600	4,740.00	17,064,000
イー・ギャランティ	100	1,730.00	173,000
T&Dホールディングス	1,100	2,528.50	2,781,350
三井不動産	5,100	1,585.00	8,083,500
三菱地所	2,400	2,793.50	6,704,400
平和不動産	100	4,120.00	412,000
東京建物	400	2,590.50	1,036,200
京阪神ビルディング	100	1,535.00	153,500
住友不動産	600	5,467.00	3,280,200
テーオーシー	100	799.00	79,900
スターツコーポレーション	100	3,530.00	353,000
フジ住宅	100	735.00	73,500
空港施設	100	614.00	61,400
リログループ	200	1,319.00	263,800
日神グループホールディングス	100	534.00	53,400
日本エスコン	100	1,002.00	100,200
MIRARTHホールディングス	200	483.00	96,600
イオンモール	200	1,792.00	358,400
ランド	2,100	8.00	16,800
カチタス	100	1,824.00	182,400
トーセイ	100	2,396.00	239,600
サンフロンティア不動産	100	1,914.00	191,400

FJネクストホールディングス	100	1,329.00	132,900	
東武鉄道	500	3,270.00	1,635,000	
相鉄ホールディングス	300	2,647.00	794,100	
東急	1,100	1,907.00	2,097,700	
京浜急行電鉄	600	1,305.00	783,000	
小田急電鉄	700	1,826.00	1,278,200	
京王電鉄	200	3,980.00	796,000	
京成電鉄	300	6,025.00	1,807,500	
富士急行	100	3,585.00	358,500	
東日本旅客鉄道	2,100	2,919.50	6,130,950	
西日本旅客鉄道	1,000	3,053.00	3,053,000	
東海旅客鉄道	1,400	3,658.00	5,121,200	
西武ホールディングス	500	2,541.50	1,270,750	
鴻池運輸	100	2,223.00	222,300	
西日本鉄道	100	2,510.50	251,050	
近鉄グループホールディングス	400	4,238.00	1,695,200	
阪急阪神ホールディングス	600	4,231.00	2,538,600	
南海電気鉄道	200	3,065.00	613,000	
京阪ホールディングス	200	3,393.00	678,600	
名古屋鉄道	500	2,108.50	1,054,250	
ヤマトホールディングス	600	2,056.50	1,233,900	
山九	100	5,402.00	540,200	
センコーグループホールディングス	200	1,157.00	231,400	
ニッコンホールディングス	100	3,033.00	303,300	
セイノーホールディングス	200	2,119.50	423,900	
AZ-COM丸和ホールディングス	100	1,221.00	122,100	
C&Fロジホールディングス	100	3,170.00	317,000	
日本郵船	1,100	4,237.00	4,660,700	
商船三井	900	4,729.00	4,256,100	
川崎汽船	1,200	2,085.00	2,502,000	
飯野海運	200	1,248.00	249,600	
九州旅客鉄道	300	3,549.00	1,064,700	
SGホールディングス	700	1,827.50	1,279,250	
NIPPON EXPRESSホールディングス	100	8,020.00	802,000	
日本航空	1,000	2,862.50	2,862,500	
ANAホールディングス	1,100	3,054.00	3,359,400	
TREホールディングス	100	1,240.00	124,000	
KPPグループホールディングス	100	726.00	72,600	
三菱倉庫	100	5,140.00	514,000	
住友倉庫	100	2,644.00	264,400	
乾汽船	100	1,086.00	108,600	
日本トランスシティ	100	721.00	72,100	
中央倉庫	100	1,129.00	112,900	
大栄環境	100	2,630.00	263,000	
日本管財ホールディングス	100	2,547.00	254,700	
上組	200	3,344.00	668,800	
TBSホールディングス	200	4,265.00	853,000	
日本テレビホールディングス	400	2,257.50	903,000	
朝日放送グループホールディングス	100	642.00	64,200	

テレビ朝日ホールディングス	100	2,053.00	205,300
スカパーJ S A Tホールディングス	400	932.00	372,800
ビジョン	100	1,019.00	101,900
U - N E X T H O L D I N G S	100	4,295.00	429,500
日本通信	300	196.00	58,800
日本電信電話	110,900	172.00	19,074,800
K D D I	2,900	4,359.00	12,641,100
ソフトバンク	5,800	1,837.00	10,654,600
G M Oインターネットグループ	200	2,600.00	520,000
K A D O K A W A	200	2,799.50	559,900
学研ホールディングス	100	933.00	93,300
ゼンリン	100	812.00	81,200
東京電力ホールディングス	3,300	1,032.50	3,407,250
中部電力	1,300	2,023.00	2,629,900
関西電力	1,400	2,424.00	3,393,600
中国電力	800	1,174.00	939,200
北陸電力	500	955.40	477,700
東北電力	1,000	1,242.00	1,242,000
四国電力	400	1,250.00	500,000
九州電力	900	1,529.50	1,376,550
北海道電力	400	1,270.00	508,000
沖縄電力	100	1,253.00	125,300
電源開発	500	2,697.00	1,348,500
イーレックス	100	823.00	82,300
レノバ	100	1,380.00	138,000
東京瓦斯	800	3,945.00	3,156,000
大阪瓦斯	800	3,348.00	2,678,400
東邦瓦斯	200	3,735.00	747,000
広島ガス	100	383.00	38,300
西部ガスホールディングス	100	2,006.00	200,600
静岡ガス	100	971.00	97,100
メタウォーター	200	2,300.00	460,000
東宝	200	5,488.00	1,097,600
エイチ・アイ・エス	100	1,767.00	176,700
N T Tデータグループ	1,000	2,363.50	2,363,500
共立メンテナンス	200	3,372.00	674,400
アインホールディングス	100	5,925.00	592,500
カナモト	100	2,676.00	267,600
D T S	100	4,000.00	400,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	5,651.00	1,130,200
シーイーシー	100	1,765.00	176,500
カブコン	800	2,509.50	2,007,600
日本空港ビルデング	300	5,560.00	1,668,000
トランス・コスモス	100	3,215.00	321,500
乃村工藝社	200	855.00	171,000
ジャステック	100	1,937.00	193,700
S C S K	300	2,742.50	822,750
セコム	600	11,010.00	6,606,000
アイネス	100	1,532.00	153,200

丹青社	100	874.00	87,400	
メイテックグループホールディングス	200	2,865.50	573,100	
T K C	100	3,740.00	374,000	
富士ソフト	100	6,140.00	614,000	
船井総研ホールディングス	100	2,352.00	235,200	
N S D	300	3,015.00	904,500	
コナミグループ	200	9,374.00	1,874,800	
ベネッセホールディングス	200	2,590.00	518,000	
ナック	200	522.00	104,400	
ダイセキ	100	2,977.00	297,700	
トラスコ中山	100	2,423.00	242,300	
ヤマダホールディングス	1,100	449.20	494,120	
オートバックスセブン	200	1,585.00	317,000	
アーケランズ	100	1,923.00	192,300	
ニトリホールディングス	200	21,480.00	4,296,000	
吉野家ホールディングス	200	2,891.00	578,200	
加藤産業	100	4,545.00	454,500	
イエローハット	100	2,068.00	206,800	
サガミホールディングス	100	1,471.00	147,100	
因幡電機産業	100	3,445.00	344,500	
アークス	100	3,210.00	321,000	
パローホールディングス	100	2,443.00	244,300	
ミスミグループ本社	700	2,283.50	1,598,450	
ファーストリテイリング	200	41,450.00	8,290,000	
ソフトバンクグループ	2,000	7,511.00	15,022,000	
スズケン	200	4,537.00	907,400	
サンドラッグ	300	4,414.00	1,324,200	
ベルーナ	100	622.00	62,200	
合計	631,700		1,495,717,080	

(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）

2024年4月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	36,655,461
国債証券	8,464,820,400
地方債証券	662,437,500
特殊債証券	604,235,000
社債証券	193,943,000
未収利息	14,235,343
前払費用	319,950
流動資産合計	9,976,646,654
資産合計	9,976,646,654
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,879,000
流動負債合計	10,879,000
負債合計	10,879,000
純資産の部	
元本等	
元本	8,281,249,365
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,684,518,289
元本等合計	9,965,767,654
純資産合計	9,965,767,654
負債純資産合計	9,976,646,654

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10月21日 至 2024年4月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年4月22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	8,756,589,665円
同期中追加設定元本額	491,392,578円
同期中一部解約元本額	966,732,878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	4,374,695,863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	2,924,964,666円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	477,153,872円
計	8,281,249,365円
2. 受益権の総数	8,281,249,365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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年4月22日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	50,788,300	
地方債証券	92,000	
特殊債証券	31,000	
社債証券	1,765,000	
合計	49,146,300	

(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11月11日から2024年4月22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)

		2024年4月22日現在
1口当たり純資産額		1.2034円
(1万口当たり純資産額)		(12,034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

2024年4月22日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	448回 利付国庫債券(2年)	30,000,000	29,970,900	
	449回 利付国庫債券(2年)	20,000,000	19,977,800	
	450回 利付国庫債券(2年)	30,000,000	29,962,500	

452回 利付国庫債券(2年)	30,000,000	29,940,900	
453回 利付国庫債券(2年)	30,000,000	29,926,500	
456回 利付国庫債券(2年)	10,000,000	9,976,300	
457回 利付国庫債券(2年)	10,000,000	9,972,500	
458回 利付国庫債券(2年)	10,000,000	9,988,000	
144回 利付国庫債券(5年)	100,000,000	99,988,000	
145回 利付国庫債券(5年)	90,000,000	89,923,500	
146回 利付国庫債券(5年)	120,000,000	119,761,200	
147回 利付国庫債券(5年)	120,000,000	119,407,200	
148回 利付国庫債券(5年)	90,000,000	89,468,100	
149回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	79,463,200	
150回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	79,387,200	
151回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	39,654,000	
152回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,704,500	
153回 利付国庫債券(5年)	70,000,000	69,309,800	
154回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	39,676,000	
155回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	19,956,600	
156回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,710,500	
157回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,786,100	
158回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,451,500	
159回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	19,750,400	
160回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,748,300	
161回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,871,000	
162回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	19,883,000	
163回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	59,908,800	

164回 利付国庫債券(5年)	10,000,000	9,876,800	
165回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	39,689,600	
166回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,910,900	
1回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	11,228,000	
2回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	10,808,700	
3回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	21,546,600	
4回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	21,469,600	
5回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	20,552,000	
6回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	20,056,000	
7回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	19,073,400	
8回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	26,410,500	
9回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	25,520,800	
10回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	29,988,000	
11回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	21,529,800	
12回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	18,975,000	
13回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	24,933,200	
14回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	26,587,200	
15回 利付国庫債券(40年)	50,000,000	36,614,000	
16回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	24,062,400	
339回 利付国庫債券(10年)	110,000,000	110,368,500	
340回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	80,269,600	
341回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,092,400	
342回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	79,748,800	
343回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	69,729,100	
344回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	79,645,600	
345回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	59,691,000	
346回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	49,704,500	
347回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	69,517,700	
348回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	89,271,000	
349回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	99,060,000	

350回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	79,122,400	
351回 利付国庫債券(10年)	120,000,000	118,502,400	
352回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,840,000	
353回 利付国庫債券(10年)	110,000,000	108,168,500	
354回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,504,800	
355回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,390,400	
356回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	68,506,200	
357回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	58,630,200	
358回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	68,256,300	
359回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	77,832,000	
360回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	87,329,700	
361回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	77,412,800	
362回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	77,193,600	
363回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	67,342,800	
364回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	47,953,500	
365回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	66,921,400	
366回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	76,858,400	
367回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	57,484,800	
368回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	66,874,500	
369回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	58,636,800	
370回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,004,000	
371回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	67,466,000	
372回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	69,785,800	
373回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	87,873,300	
10回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,533,000	

11回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	10,781,800	
12回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,142,600	
15回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,548,300	
17回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,470,200	
19回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,385,000	
20回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,607,600	
21回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,399,200	
22回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,626,900	
23回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,638,700	
26回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,521,300	
27回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,649,700	
28回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	23,279,000	
29回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	23,005,200	
30回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,710,000	
31回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,382,800	
32回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,931,800	
33回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,553,900	
34回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,372,000	
35回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,361,000	
36回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,276,700	
37回 利付国庫債券(30年)	60,000,000	63,416,400	
38回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,746,200	
39回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,551,000	
40回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,638,200	
41回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,253,600	

42回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,225,600	
43回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,181,800	
44回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	30,228,900	
45回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,149,200	
46回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,096,700	
47回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	29,579,100	
48回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	28,453,200	
49回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	28,395,300	
50回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	25,050,300	
51回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,220,400	
52回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	23,215,800	
53回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,781,400	
54回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,713,100	
55回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,633,300	
56回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	16,368,800	
57回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,473,700	
58回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,374,400	
59回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,790,600	
60回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	16,513,200	
61回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,667,200	
62回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	14,815,200	
63回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	14,344,000	
64回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,407,700	
65回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,318,000	
66回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	14,141,000	

67回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,345,500	
68回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,241,700	
69回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,782,600	
70回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,701,000	
71回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,618,500	
72回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,536,300	
73回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,454,700	
74回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	16,228,800	
75回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	26,240,700	
76回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	26,836,200	
77回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,747,400	
78回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	26,751,900	
79回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	25,415,700	
80回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	9,783,600	
81回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	9,324,700	
81回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,259,000	
84回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,294,400	
88回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,434,500	
90回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,459,800	
92回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	20,955,600	
95回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,245,000	
99回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,897,200	
105回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,455,000	
108回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,659,400	
110回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,779,200	

111回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,865,800	
112回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,631,000	
113回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,554,500	
114回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,886,700	
116回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,969,000	
117回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,823,400	
118回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,753,400	
120回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,269,800	
121回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,665,200	
122回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,770,700	
123回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,963,400	
124回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,917,500	
125回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,068,400	
126回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,932,100	
127回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,865,700	
128回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,754,600	
129回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,808,800	
130回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,633,800	
131回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,746,100	
132回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,754,400	
133回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,654,400	
134回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,672,600	
135回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,761,300	
136回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,364,400	
137回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,535,200	

138回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,827,600	
139回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,745,200	
140回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	64,637,400	
141回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	43,107,600	
142回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	43,450,800	
143回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,088,600	
144回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,216,800	
145回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	75,472,600	
146回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,914,500	
147回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	64,131,600	
148回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,356,000	
149回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,915,000	
150回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,354,500	
151回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,027,200	
152回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,210,000	
153回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,328,800	
154回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,050,000	
155回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,895,600	
156回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,412,500	
157回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	45,101,000	
158回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,622,000	
159回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,610,000	
160回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,955,600	
161回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,336,000	
162回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,480,500	

163回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,288,500	
164回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	45,449,500	
165回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	45,243,500	
166回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,086,800	
167回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	44,826,000	
168回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	35,153,200	
169回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,411,600	
170回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	25,670,400	
171回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,042,400	
172回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	25,828,200	
173回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,254,800	
174回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,070,800	
175回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,484,400	
176回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,327,200	
177回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,537,600	
178回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,984,800	
179回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,824,800	
180回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	26,659,200	
181回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	36,034,800	
182回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,182,000	
183回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	38,990,400	
184回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	27,702,000	
185回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	36,797,200	
186回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,468,100	
187回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	18,918,600	
国債証券 合計	8,780,000,000	8,464,820,400	

地方債証券	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,937,000	
	218回 神奈川県公募公債	100,000,000	99,801,000	
	412回 大阪府公募公債 10年	50,000,000	49,613,000	
	190回 大阪府公募公債 5年	100,000,000	98,968,000	
	12回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	100,556,000	
	令和3年度11回 愛知県公募公債	100,000,000	95,419,000	
	24年度1回 福岡県公募公債 30年	10,000,000	10,737,500	
	169回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,406,000	
地方債証券 合計		660,000,000	662,437,500	
特殊債券	147回 高速道路機構債	100,000,000	98,269,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,496,000	
	249回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,365,000	
	327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,166,000	
	250回 住宅金融支援機構	100,000,000	98,657,000	
	87回 中日本高速道路債券	100,000,000	99,282,000	
特殊債券 合計		600,000,000	604,235,000	
社債券	11回 プリヂストーン社債	100,000,000	99,048,000	
	494回 九州電力社債	100,000,000	94,895,000	
社債券 合計		200,000,000	193,943,000	
合計			9,925,435,900	

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)

2024年4月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,465,126,373
投資証券	69,326,520,800
派生商品評価勘定	109,478,980
未収入金	166,023,799
未収配当金	719,997,180
差入委託証拠金	133,609,889
流動資産合計	71,920,757,021
資産合計	71,920,757,021
負債の部	
流動負債	
前受金	84,562,400
未払解約金	201,489,000
流動負債合計	286,051,400
負債合計	286,051,400
純資産の部	
元本等	
元本	32,609,489,021
剰余金	
剰余金又は欠損金()	39,025,216,600
元本等合計	71,634,705,621
純資産合計	71,634,705,621
負債純資産合計	71,920,757,021

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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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	36,087,319,626円
同期中追加設定元本額	477,370,160円
同期中一部解約元本額	3,955,200,765円
元本の内訳	
ファンド名	
J-REITパッケージ	1,555,683,352円
新光J-REITオープン	28,354,661,131円
One DC 国内リートインデックスファンド	1,678,397,909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）	743,266,672円
計	32,609,489,021円
2. 受益権の総数	32,609,489,021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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年4月22日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
投資証券	762,670,070	
合計	762,670,070	

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2024年4月22日現在		
	契約額等（円）	時価（円）	評価損益（円）
	うち 1年超		

市場取引 先物取引 買建	2,077,766,600	-	2,187,380,000	109,613,400
合計	2,077,766,600	-	2,187,380,000	109,613,400

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年4月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,1967円 (21,967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

2024年4月22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	2,898	430,353,000	
	GLP投資法人	22,616	2,937,818,400	
	KDX不動産投資法人	19,376	3,088,534,400	
	NTT都市開発リート投資法人	6,826	837,550,200	
	Oneリート投資法人	1,174	310,288,200	
	SOSILA物流リート投資法人	3,359	412,149,300	
	いちごオフィスリート投資法人	5,517	447,980,400	
	いちごホテルリート投資法人	1,115	128,002,000	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	3,532	1,384,544,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	6,606	2,199,798,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,950	352,525,000	
	イオンリート投資法人	8,259	1,129,831,200	
	インヴィンシブル投資法人	32,599	2,242,811,200	
	エスコンジャパンリート投資法人	1,369	173,999,900	
	オリックス不動産投資法人	13,415	2,252,378,500	

グローバル・ワン不動産投資法人	4,972	530,512,400	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,311	1,094,285,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,835	197,813,000	
サンケイリアルエステート投資法人	2,157	195,424,200	
ザイマックス・リート投資法人	1,092	131,586,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	22,539	1,803,120,000	
ジャパンエクセレント投資法人	5,851	748,928,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	6,916	3,706,976,000	
スターアジア不動産投資法人	10,376	633,973,600	
スターアップロード投資法人	1,167	246,120,300	
タカラレーベン不動産投資法人	3,587	368,026,200	
トーセイ・リート投資法人	1,418	204,901,000	
ヒューリックリート投資法人	6,299	947,999,500	
フロンティア不動産投資法人	2,498	1,142,835,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,660	217,460,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,038	135,978,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	15,061	2,281,741,500	
ラサールロジポート投資法人	8,607	1,370,234,400	
阪急阪神リート投資法人	3,210	447,153,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,800	1,250,200,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,325	913,725,000	
産業ファンド投資法人	12,263	1,605,226,700	
森トラストリート投資法人	12,978	952,585,200	
森ヒルズリート投資法人	7,917	1,067,211,600	
星野リゾート・リート投資法人	1,242	689,310,000	
積水ハウス・リート投資法人	20,232	1,652,954,400	
大和ハウスリート投資法人	10,149	2,670,201,900	
大和証券オフィス投資法人	1,395	790,965,000	
大和証券リビング投資法人	9,915	1,056,939,000	
投資法人みらい	9,240	425,964,000	
東海道リート投資法人	1,150	145,935,000	
東急リアル・エステート投資法人	4,514	730,816,600	
日本アコモデーションファンド投資法人	2,325	1,492,650,000	
日本ビルファンド投資法人	7,854	4,696,692,000	
日本プライムリアルティ投資法人	4,605	1,568,002,500	
日本プロロジスリート投資法人	11,729	3,166,830,000	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	1,030	82,297,000	
日本リート投資法人	2,187	765,450,000	

	日本ロジスティクスファンド投資法人	4,298	1,189,686,400	
	日本都市ファンド投資法人	32,273	3,098,208,000	
	福岡リート投資法人	3,482	583,583,200	
	平和不動産リート投資法人	5,030	709,733,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	21,773	3,287,723,000	
投資証券	合計	427,911	69,326,520,800	
合計			69,326,520,800	

(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)

2024年4月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	46,345,125
コール・ローン	5,853,603
株式	1,553,646,204
投資信託受益証券	2,449,328
投資証券	26,966,185
派生商品評価勘定	450,143
未収配当金	1,537,353
差入委託証拠金	104,314,460
流動資産合計	1,741,562,401
資産合計	1,741,562,401
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,434,441
未払解約金	14,000
流動負債合計	4,448,441
負債合計	4,448,441
純資産の部	
元本等	
元本	312,591,283
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,424,522,677
元本等合計	1,737,113,960
純資産合計	1,737,113,960
負債純資産合計	1,741,562,401

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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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	362,540,197円
同期中追加設定元本額	362,746円
同期中一部解約元本額	50,311,660円
元本の内訳 ファンド名	
新光7資産バランスファンド	123,450,399円
新光外国株式インデックスV A	138,538,476円

世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	50,602,408円
計	312,591,283円
2. 受益権の総数	312,591,283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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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	2024年4月22日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	185,314,495	
投資信託受益証券	319,244	
投資証券	1,169,198	
合計	186,802,937	

（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11月11日から2024年4月22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	2024年4月22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	151,395,451	-	147,411,153	3,984,298
合計	151,395,451	-	147,411,153	3,984,298

（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）

2024年4月22日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.5571円 (55,571円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年4月22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	1,641	174.630	286,567.830	
	ABBOTT LABORATORIES	306	107.280	32,827.680	
	AES CORP	106	16.400	1,738.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	161	181.580	29,234.380	
	ADVANCED MICRO DEVICES	285	146.640	41,792.400	
	ADOBE INC	80	465.020	37,201.600	
	CHUBB LTD	71	250.210	17,764.910	

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	40	231.640	9,265.600	
ALLSTATE CORP	46	172.960	7,956.160	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	115	194.260	22,339.900	
AMGEN INC	94	268.930	25,279.420	
HESS CORP	49	154.350	7,563.150	
AMERICAN EXPRESS CO	103	231.040	23,797.120	
AMERICAN ELECTRIC POWER	89	84.200	7,493.800	
AFLAC INC	98	83.230	8,156.540	
AMERICAN INTL GROUP	128	74.230	9,501.440	
ANALOG DEVICES	87	183.360	15,952.320	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	122	63.660	7,766.520	
VALERO ENERGY CORP	59	163.890	9,669.510	
ANSYS INC	16	322.110	5,153.760	
APPLE INC	2,592	165.000	427,680.000	
APPLIED MATERIALS INC	147	189.770	27,896.190	
ALBEMARLE CORP	21	112.150	2,355.150	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	94	62.600	5,884.400	
AMEREN CORP	48	73.880	3,546.240	
AUTODESK INC	38	216.500	8,227.000	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	71	243.310	17,275.010	
AUTOZONE INC	3	2,985.540	8,956.620	
AVERY DENNISON CORP	15	211.570	3,173.550	
BALL CORP	57	64.950	3,702.150	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	231	405.080	93,573.480	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	134	56.290	7,542.860	
BAXTER INTERNATIONAL INC	90	39.470	3,552.300	
BECTON DICKINSON & CO	51	234.120	11,940.120	
AMETEK INC	40	177.700	7,108.000	
VERIZON COMM INC	740	40.490	29,962.600	
WR BERKLEY CORP	32	82.400	2,636.800	
BEST BUY CO INC	36	76.150	2,741.400	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	4	279.730	1,118.920	
YUM! BRANDS INC	50	138.500	6,925.000	
FIRSTENERGY CORP	100	38.170	3,817.000	
BOEING CO	101	169.820	17,151.820	
ROBERT HALF INC	16	70.230	1,123.680	
BORGWARNER INC	39	32.800	1,279.200	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	258	67.330	17,371.140	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	19	71.220	1,353.180	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	30	140.600	4,218.000	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	4	1,188.540	4,754.160	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	361	48.930	17,663.730	
ONEOK INC	103	79.630	8,201.890	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10	127.860	1,278.600	
UNITED RENTALS INC	12	628.340	7,540.080	
SEMPRA	109	70.080	7,638.720	
FEDEX CORP	43	266.990	11,480.570	
VERISIGN INC	17	184.120	3,130.040	
AMPHENOL CORP	104	110.170	11,457.680	
BROWN-FORMAN CORP	57	49.060	2,796.420	
QUANTA SERVICES INC	26	243.260	6,324.760	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	135	3.090	417.150	
CSX CORP	371	34.340	12,740.140	
COTERRA ENERGY INC	129	27.750	3,579.750	
CAMPBELL SOUP CO	34	44.200	1,502.800	
CONSTELLATION BRANDS INC	29	260.700	7,560.300	
CARDINAL HEALTH INC	44	108.190	4,760.360	
CARLISLE COS INC	8	367.410	2,939.280	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	184	14.120	2,598.080	
CATERPILLAR INC	90	354.660	31,919.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	15	157.950	2,369.250	
JPMORGAN CHASE & CO	509	185.800	94,572.200	
CHURCH & DWIGHT CO INC	43	104.350	4,487.050	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	29	119.950	3,478.550	
CINTAS CORP	16	661.290	10,580.640	
CISCO SYSTEMS INC	713	48.320	34,452.160	
CLEVELAND-CLIFFS INC	79	20.810	1,643.990	
CLOROX COMPANY	22	143.550	3,158.100	
COCA-COLA CO/THE	721	60.170	43,382.570	
COPART INC	155	52.880	8,196.400	
COLGATE-PALMOLIVE CO	139	87.130	12,111.070	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	44	236.000	10,384.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	11	367.520	4,042.720	
NRG ENERGY, INC.	42	69.970	2,938.740	
COMCAST CORP-CL A	706	40.240	28,409.440	
CONAGRA BRANDS INC	71	30.620	2,174.020	
CONSOLIDATED EDISON INC	61	91.770	5,597.970	
CMS ENERGY CORP	45	59.550	2,679.750	
COOPER COS INC	37	90.420	3,345.540	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	39	64.230	2,504.970	
CORNING INC	147	31.270	4,596.690	

HEICO CORP-CL A	14	159.770	2,236.780	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	13	226.340	2,942.420	
CUMMINS INC	26	287.560	7,476.560	
DARLING INTERNATIONAL INC	29	42.610	1,235.690	
DR HORTON INC	53	142.190	7,536.070	
DANAHER CORP	124	235.510	29,203.240	
MOODY'S CORP	29	374.670	10,865.430	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	91	67.440	6,137.040	
TARGET CORP	82	168.300	13,800.600	
DEERE & CO	47	400.320	18,815.040	
MORGAN STANLEY	217	90.660	19,673.220	
REPUBLIC SERVICES INC	39	189.760	7,400.640	
COSTAR GROUP INC	72	84.260	6,066.720	
DECKERS OUTDOOR CORP	4	800.380	3,201.520	
THE WALT DISNEY CO	323	112.610	36,373.030	
DOLLAR TREE INC	36	122.030	4,393.080	
DOVER CORP	26	169.840	4,415.840	
OMNICOM GROUP	35	92.620	3,241.700	
DTE ENERGY CO	38	108.570	4,125.660	
DUKE ENERGY CORP	135	98.240	13,262.400	
DARDEN RESTAURANTS INC	19	152.500	2,897.500	
EBAY INC	92	50.390	4,635.880	
BANK OF AMERICA CORP	1,255	36.970	46,397.350	
CITIGROUP INC	337	59.140	19,930.180	
EASTMAN CHEMICAL CO	22	96.420	2,121.240	
EATON CORP PLC	71	303.020	21,514.420	
CADENCE DESIGN SYS INC	49	280.250	13,732.250	
ECOLAB INC	45	218.160	9,817.200	
REVVITY INC	25	100.860	2,521.500	
ELECTRONIC ARTS INC	45	127.270	5,727.150	
SALESFORCE INC	171	270.370	46,233.270	
ERIE INDEMNITY CO	5	381.560	1,907.800	
EMERSON ELECTRIC CO	100	108.580	10,858.000	
ATMOS ENERGY CORP	28	117.200	3,281.600	
ENTERGY CORP	38	106.770	4,057.260	
EOG RESOURCES INC	104	133.170	13,849.680	
EQUIFAX INC	22	216.200	4,756.400	
EQT CORP	67	36.650	2,455.550	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	40	144.410	5,776.400	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	25	114.610	2,865.250	
EXXON MOBIL CORP	706	119.880	84,635.280	
FMC CORP	23	57.820	1,329.860	
NEXTERA ENERGY INC	362	64.300	23,276.600	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6	434.020	2,604.120	
FAIR ISAAC CORP	4	1,130.060	4,520.240	
ASSURANT INC	9	173.830	1,564.470	

FASTENAL CO	104	67.570	7,027.280	
FIFTH THIRD BANCORP	125	36.250	4,531.250	
M&T BANK CORP	31	143.380	4,444.780	
FISERV INC	106	148.620	15,753.720	
FORD MOTOR CO	688	12.140	8,352.320	
FRANKLIN RESOURCES INC	42	25.150	1,056.300	
FREEMPORT-MCMORAN INC	252	49.610	12,501.720	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2	1,567.360	3,134.720	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	38	236.570	8,989.660	
GENERAL DYNAMICS CORP	41	288.620	11,833.420	
GENERAL MILLS INC	103	70.420	7,253.260	
GENUINE PARTS CO	24	162.390	3,897.360	
GILEAD SCIENCES INC	220	66.760	14,687.200	
GARTNER INC	14	440.380	6,165.320	
MCKESSON CORP	23	524.830	12,071.090	
NVIDIA CORP	436	762.000	332,232.000	
GRACO INC	36	88.380	3,181.680	
GENERAL ELECTRIC CO	192	148.060	28,427.520	
WW GRAINGER INC	8	942.650	7,541.200	
HALLIBURTON CO	157	39.080	6,135.560	
MONSTER BEVERAGE CORP	142	53.140	7,545.880	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	57	404.000	23,028.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	33	205.450	6,779.850	
HASBRO INC	25	55.270	1,381.750	
HENRY SCHEIN INC	24	70.860	1,700.640	
HEICO CORP	7	197.100	1,379.700	
HERSHEY FOODS CORP	25	185.020	4,625.500	
HP INC	159	27.810	4,421.790	
F5 INC	9	177.330	1,595.970	
CROWN HOLDINGS INC NPR	22	77.670	1,708.740	
UNITED THERAPEUTICS CORP	10	237.930	2,379.300	
JUNIPER NETWORKS INC	52	36.060	1,875.120	
HOLOGIC INC	44	75.380	3,316.720	
HOME DEPOT INC	176	335.360	59,023.360	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	33	88.630	2,924.790	
HORMEL FOODS CORP	67	34.740	2,327.580	
CENTERPOINT ENERGY INC	118	28.530	3,366.540	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6	457.150	2,742.900	
HUBBELL INC	9	388.030	3,492.270	
HUMANA INC	22	328.330	7,223.260	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15	167.300	2,509.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	243	13.280	3,227.040	
BIOGEN INC	26	194.380	5,053.880	
IDEX CORP	14	227.040	3,178.560	

ILLINOIS TOOL WORKS	53	250.460	13,274.380	
INTUIT INC	49	605.170	29,653.330	
IDEXX LABORATORIES INC	15	476.350	7,145.250	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	41	288.270	11,819.070	
INTEL CORP	744	34.200	25,444.800	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	46	83.970	3,862.620	
INTERNATIONAL PAPER CO	56	35.370	1,980.720	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	72	30.720	2,211.840	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12	165.600	1,987.200	
JABIL CIRCUIT INC	24	118.750	2,850.000	
INCYTE CORP	28	52.350	1,465.800	
JOHNSON & JOHNSON	424	147.910	62,713.840	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	55	98.950	5,442.250	
KLA CORPORATION	24	628.160	15,075.840	
DEVON ENERGY CORP	113	51.830	5,856.790	
KELLANOVA	56	57.380	3,213.280	
KEYCORP	174	14.630	2,545.620	
KIMBERLY-CLARK CORP	61	126.830	7,736.630	
BLACKROCK INC/NEW YORK	26	749.980	19,499.480	
KROGER CO	124	56.570	7,014.680	
LAM RESEARCH CORP	23	870.250	20,015.750	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8	401.360	3,210.880	
PACKAGING CORP OF AMERICA	17	179.890	3,058.130	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	27	66.510	1,795.770	
AKAMAI TECHNOLOGIES	26	101.500	2,639.000	
LENNAR CORP	43	150.190	6,458.170	
ELI LILLY & CO	143	726.310	103,862.330	
BATH & BODY WORKS INC	38	43.990	1,671.620	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	133	142.770	18,988.410	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	53	132.730	7,034.690	
LOCKHEED MARTIN CORP	39	463.870	18,090.930	
LOEWS CORP	35	75.640	2,647.400	
LOWE'S COS INC	101	230.240	23,254.240	
DOMINION ENERGY INC	149	49.840	7,426.160	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	47	42.420	1,993.740	
MCCORMICK & CO INC	46	73.920	3,400.320	
MCDONALD'S CORPORATION	128	271.990	34,814.720	
S&P GLOBAL INC	57	412.560	23,515.920	
EVEREST GROUP LTD	8	370.260	2,962.080	
MARKEL GROUP INC	2	1,456.690	2,913.380	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	108	85.940	9,281.520	
MARSH & MCLENNAN COS	87	202.410	17,609.670	
MASCO CORP	39	71.910	2,804.490	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	11	575.890	6,334.790	
METLIFE INC	112	71.110	7,964.320	
MEDTRONIC PLC	234	79.480	18,598.320	
CVS HEALTH CORP	227	69.750	15,833.250	
MERCK & CO. INC.	447	125.780	56,223.660	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	75	60.710	4,553.250	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15	201.480	3,022.200	
MICROSOFT CORP	1,246	399.120	497,303.520	
MICRON TECH INC	195	106.770	20,820.150	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	97	81.680	7,922.960	
3M CO	98	92.270	9,042.460	
ENTEGRIS INC	27	122.200	3,299.400	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	8	226.780	1,814.240	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	29	339.650	9,849.850	
ILLUMINA INC	27	117.430	3,170.610	
XCEL ENERGY INC	99	54.720	5,417.280	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19	132.000	2,508.000	
NETAPP INC	38	97.950	3,722.100	
NEWMONT CORP	200	39.020	7,804.000	
NVR INC	1	7,685.000	7,685.000	
NIKE INC-CL B	216	94.530	20,418.480	
NORDSON CORP	10	259.590	2,595.900	
NORFOLK SOUTHERN CORP	41	241.280	9,892.480	
EVERSOURCE ENERGY	55	59.690	3,282.950	
NISOURCE INC	72	27.580	1,985.760	
NORTHERN TRUST CORP	37	81.450	3,013.650	
NORTHROP GRUMMAN CORP	25	462.580	11,564.500	
WELLS FARGO & CO	641	60.350	38,684.350	
NUCOR CORP	42	191.360	8,037.120	
CHENIERE ENERGY INC	42	161.970	6,802.740	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	69	142.910	9,860.790	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	119	66.630	7,928.970	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	36	211.820	7,625.520	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	11	1,090.940	12,000.340	
ORACLE CORP	291	114.880	33,430.080	
PACCAR INC	92	111.190	10,229.480	
PTC INC	22	176.370	3,880.140	

EXELON CORP	170	37.550	6,383.500	
PARKER HANNIFIN CORP	23	534.650	12,296.950	
PAYCHEX INC	59	119.520	7,051.680	
ALIGN TECHNOLOGY INC	13	298.980	3,886.740	
PPL CORPORATION	136	27.020	3,674.720	
PEPSICO INC	242	174.130	42,139.460	
PENTAIR PLC	28	78.530	2,198.840	
PFIZER INC	997	26.000	25,922.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	49	35.440	1,736.560	
CONOCOPHILLIPS	208	129.380	26,911.040	
PG&E CORP	357	16.850	6,015.450	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	41	270.310	11,082.710	
ALTRIA GROUP INC	312	42.090	13,132.080	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	71	152.300	10,813.300	
BROWN & BROWN INC	45	82.170	3,697.650	
GARMIN LTD	29	139.520	4,046.080	
PPG INDUSTRIES INC	42	130.900	5,497.800	
COSTCO WHOLESALE CORP	78	709.510	55,341.780	
T ROWE PRICE GROUP INC	37	108.730	4,023.010	
QUEST DIAGNOSTICS	22	128.440	2,825.680	
PROCTER & GAMBLE CO	416	158.140	65,786.240	
PROGRESSIVE CORP	104	214.690	22,327.760	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	89	65.740	5,850.860	
PULTE GROUP INC	36	105.430	3,795.480	
GLOBAL PAYMENTS INC	47	122.100	5,738.700	
QUALCOMM INC	197	157.630	31,053.110	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	38	123.600	4,696.800	
EXACT SCIENCES CORP	32	60.960	1,950.720	
RELIANCE INC	12	319.490	3,833.880	
REGENERON PHARMACEUTICALS	19	896.820	17,039.580	
REPLIGEN CORP	9	157.140	1,414.260	
RESMED INC	25	178.850	4,471.250	
US BANCORP	273	40.450	11,042.850	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	67	92.930	6,226.310	
ROSS STORES INC	59	133.340	7,867.060	
ROLLINS INC	46	42.510	1,955.460	
ROPER TECHNOLOGIES INC	19	534.380	10,153.220	
ROCKWELL AUTOMATION INC	21	269.960	5,669.160	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	42	129.210	5,426.820	
RPM INTERNATIONAL INC	21	106.570	2,237.970	
ACCENTURE PLC-CL A	111	316.880	35,173.680	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	242	68.110	16,482.620	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	18	264.520	4,761.360	
AXON ENTERPRISE INC	13	293.605	3,816.860	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	40	214.070	8,562.800	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	106	70.730	7,497.380	
BOOKING HOLDINGS INC	6	3,414.820	20,488.920	
SCHLUMBERGER LTD	255	49.850	12,711.750	
SCHWAB (CHARLES) CORP	265	73.420	19,456.300	
POOL CORP	7	361.130	2,527.910	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	38	119.430	4,538.340	
SEI INVESTMENTS CO	22	66.130	1,454.860	
ELEVANCE HEALTH INC	42	531.420	22,319.640	
CENCORA INC	31	239.130	7,413.030	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44	80.440	3,539.360	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	43	305.960	13,156.280	
CENTENE CORP	94	75.150	7,064.100	
SMITH (A.O.) CORP	26	86.070	2,237.820	
SNAP-ON INC	9	268.800	2,419.200	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	65	110.610	7,189.650	
EDISON INTERNATIONAL	70	69.930	4,895.100	
SOUTHERN CO	190	72.150	13,708.500	
TRUIST FINANCIAL CORP	245	36.800	9,016.000	
SOUTHWEST AIRLINES	29	29.380	852.020	
AT&T INC	1,261	16.510	20,819.110	
CHEVRON CORP	316	160.000	50,560.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	29	89.320	2,590.280	
STATE STREET CORP	53	73.370	3,888.610	
STARBUCKS CORP	200	87.610	17,522.000	
STEEL DYNAMICS INC	30	136.900	4,107.000	
STRYKER CORP	60	325.430	19,525.800	
NETFLIX INC	77	555.040	42,738.080	
GEN DIGITAL INC	98	20.500	2,009.000	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30	48.140	1,444.200	
SYNOPSYS INC	27	510.710	13,789.170	
SYSCO CORP	90	76.730	6,905.700	
INTUITIVE SURGICAL INC	62	366.340	22,713.080	
TELEFLEX INC	8	206.560	1,652.480	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	199	12.860	2,559.140	
TERADYNE INC	26	95.970	2,495.220	
TEXAS INSTRUMENTS INC	159	159.680	25,389.120	
TEXTRON INC	32	93.300	2,985.600	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	68	544.780	37,045.040	
GLOBE LIFE INC	13	66.740	867.620	
TORO CO	18	85.110	1,531.980	
DAVITA INC	6	127.820	766.920	
TRACTOR SUPPLY CO	20	252.790	5,055.800	
BIO-TECHNE CORP	27	62.120	1,677.240	
TRIMBLE INC	44	57.970	2,550.680	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8	403.350	3,226.800	
TYSON FOODS INC	54	59.950	3,237.300	
MARATHON OIL CORP	108	27.500	2,970.000	
UNION PACIFIC CORP	113	232.080	26,225.040	
RTX CORP	253	101.560	25,694.680	
UNITEDHEALTH GROUP INC	163	501.130	81,684.190	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	11	157.470	1,732.170	
PARAMOUNT GLOBAL	70	12.440	870.800	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	46	394.280	18,136.880	
VULCAN MATERIALS CO	23	252.060	5,797.380	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	137	18.240	2,498.880	
WALMART INC	785	59.530	46,731.050	
WASTE MANAGEMENT INC	70	207.070	14,494.900	
WATERS CORP	11	296.100	3,257.100	
WATSCO INC	6	396.920	2,381.520	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	13	372.040	4,836.520	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	22	114.760	2,524.720	
VAIL RESORTS INC	8	202.940	1,623.520	
WESTERN DIGITAL CORP	57	66.050	3,764.850	
WABTEC CORP	33	144.170	4,757.610	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	29	96.110	2,787.190	
WYNN RESORTS LTD	19	94.990	1,804.810	
NASDAQ INC	62	60.350	3,741.700	
CME GROUP INC	63	213.040	13,421.520	
WILLIAMS COS INC	216	38.510	8,318.160	
WILLIAMS-SONOMA INC	10	279.200	2,792.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	11	195.080	2,145.880	
LKQ CORP	50	49.120	2,456.000	
ALLIANT ENERGY CORP	37	49.820	1,843.340	
WEC ENERGY GROUP INC	52	81.560	4,241.120	
CARMAX INC	26	68.340	1,776.840	
TJX COMPANIES INC	200	93.360	18,672.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	9	268.070	2,412.630	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	343	2.830	970.690	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21	144.410	3,032.610	
CBRE GROUP INC	56	84.900	4,754.400	
REGIONS FINANCIAL CORP	156	18.900	2,948.400	
DOMINO'S PIZZA INC	6	473.550	2,841.300	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	9	591.520	5,323.680	
WESTLAKE CORP	4	150.760	603.040	
T-MOBILE US INC	90	162.330	14,609.700	
LAS VEGAS SANDS CORP	68	45.460	3,091.280	
MOSAIC CO/THE	57	31.000	1,767.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6	204.010	1,224.060	
CELANESE CORP	19	154.450	2,934.550	
DEXCOM INC	68	130.710	8,888.280	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	23	177.030	4,071.690	
EXPEDIA GROUP INC	23	129.000	2,967.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	34	79.470	2,701.980	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	18	417.010	7,506.180	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	100	131.210	13,121.000	
LIVE NATION	29	89.960	2,608.840	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5	2,869.110	14,345.550	
TRANSDIGM GROUP INC	10	1,187.700	11,877.000	
MASTERCARD INC	148	455.390	67,397.720	
CELSIUS HOLDINGS INC	28	68.840	1,927.520	
OWENS CORNING	17	160.110	2,721.870	
LEIDOS HOLDINGS INC	23	124.910	2,872.930	
AERCAP HOLDINGS NV	33	83.210	2,745.930	
FIRST SOLAR INC	18	175.040	3,150.720	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	21	193.380	4,060.980	
SUPER MICRO COMPUTER INC	9	713.650	6,422.850	
AECOM TECHNOLOGY CORP	27	93.350	2,520.450	
DELTA AIR LINES INC	27	47.570	1,284.390	
INSULET CORP	12	166.250	1,995.000	
DISCOVER FINANCIAL	43	125.350	5,390.050	
TE CONNECTIVITY LTD	54	140.550	7,589.700	
LULULEMON ATHLETICA INC	20	352.470	7,049.400	
MERCADOLIBRE INC	8	1,356.430	10,851.440	
ULTA BEAUTY INC	9	413.500	3,721.500	
MSCI INC	14	510.070	7,140.980	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	272	93.770	25,505.440	
VISA INC	279	269.780	75,268.620	
KEURIG DR PEPPER INC	193	31.500	6,079.500	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	33	118.520	3,911.160	

MARATHON PETROLEUM CORP	68	196.380	13,353.840	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	23	73.510	1,690.730	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	356	18.840	6,707.040	
XYLEM INC	43	127.840	5,497.120	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	46	100.740	4,634.040	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	8	271.660	2,173.280	
EPAM SYSTEMS INC	10	245.960	2,459.600	
HCA HEALTHCARE INC	36	305.110	10,983.960	
VERISK ANALYTICS INC	27	222.520	6,008.040	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9	109.940	989.460	
CORPAY INC	13	294.290	3,825.770	
NXP SEMICONDUCTOR NV	45	215.120	9,680.400	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	22	142.140	3,127.080	
TARGA RESOURCES CORP	35	112.920	3,952.200	
LEAR CORP	11	132.860	1,461.460	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	18	180.850	3,255.300	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	40	60.820	2,432.800	
DOLLAR GENERAL CORP	40	144.820	5,792.800	
FORTINET INC	116	63.400	7,354.400	
HYATT HOTELS CORP	8	146.370	1,170.960	
TESLA INC	505	147.050	74,260.250	
ENPHASE ENERGY INC	23	106.480	2,449.040	
GENERAL MOTORS CO	241	42.370	10,211.170	
ALLY FINANCIAL INC	39	39.050	1,522.950	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	15	262.590	3,938.850	
APTIV PLC	50	69.630	3,481.500	
PHILLIPS 66	78	154.710	12,067.380	
META PLATFORMS INC	392	481.070	188,579.440	
IQVIA HOLDINGS INC	33	228.090	7,526.970	
DIAMONDBACK ENERGY INC	30	200.740	6,022.200	
SERVICENOW INC	36	713.910	25,700.760	
PALO ALTO NETWORKS INC	56	277.710	15,551.760	
WORKDAY INC	37	252.220	9,332.140	
ABBVIE INC	312	166.410	51,919.920	
ZOETIS INC	81	146.500	11,866.500	
NEWS CORP/NEW-CL A	58	24.020	1,393.160	
CDW CORP	24	235.780	5,658.720	
HOWMET AEROSPACE INC	73	63.410	4,628.930	
TWILIO INC	30	57.550	1,726.500	
SNAP INC	190	11.160	2,120.400	
TRADE DESK INC A	79	77.300	6,106.700	
OKTA INC	27	92.030	2,484.810	

BAKER HUGHES CO	176	32.600	5,737.600	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	25	81.000	2,025.000	
CNH INDUSTRIAL NV	191	12.310	2,351.210	
BROADCOM INC	79	1,204.710	95,172.090	
ARES MANAGEMENT CORP	28	129.530	3,626.840	
MONGODB INC	13	327.470	4,257.110	
BURLINGTON STORES INC	12	178.570	2,142.840	
VEEVA SYSTEMS INC	27	198.380	5,356.260	
EVERGY INC	37	51.760	1,915.120	
ALLEGION PLC	13	125.210	1,627.730	
DAYFORCE INC	25	58.750	1,468.750	
STERIS PLC	19	199.510	3,790.690	
DOCUSIGN INC	31	55.700	1,726.700	
WIX.COM LTD	8	121.410	971.280	
DROPBOX INC	44	22.980	1,011.120	
KKR & CO INC	100	92.620	9,262.000	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	10	54.770	547.700	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	39	59.450	2,318.550	
MODERNA INC	56	101.410	5,678.960	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	45	194.470	8,751.150	
CIGNA GROUP	52	352.390	18,324.280	
DELL TECHNOLOGIES INC	43	114.870	4,939.410	
DOW INC	124	56.660	7,025.840	
OVINTIV INC	50	51.980	2,599.000	
AMCOR PLC	264	8.970	2,368.080	
PINTEREST INC	106	32.400	3,434.400	
FOX CORP-A	46	31.390	1,443.940	
FOX CORP-B	24	28.870	692.880	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	40	282.640	11,305.600	
AVANTOR INC	121	24.100	2,916.100	
DYNATRACE INC	42	45.400	1,906.800	
CLOUDFLARE INC	51	84.100	4,289.100	
TRADEWEB MARKETS INC	21	101.050	2,122.050	
CARRIER GLOBAL CORP	144	53.530	7,708.320	
OTIS WORLDWIDE CORP	71	95.110	6,752.810	
UBER TECHNOLOGIES INC	339	69.200	23,458.800	
CORTEVA INC	128	54.800	7,014.400	
MATCH GROUP INC	45	32.180	1,448.100	
FERGUSON PLC	36	208.800	7,516.800	
BILL HOLDINGS INC	19	59.610	1,132.590	
BLACKSTONE INC	125	118.400	14,800.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	7	157.220	1,100.540	
CARLYLE GROUP INC	43	44.080	1,895.440	
DATADOG INC	49	120.090	5,884.410	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	32	82.460	2,638.720	
VERTIV HOLDINGS CO	65	75.010	4,875.650	

INGERSOLL RAND INC	73	88.400	6,453.200	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	74	84.490	6,252.260	
PAYCOM SOFTWARE INC	9	183.250	1,649.250	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	116	8.630	1,001.080	
DRAFTKINGS INC	74	40.680	3,010.320	
UNITY SOFTWARE INC	51	22.890	1,167.390	
AON PLC	35	310.190	10,856.650	
WARNER BROS DISCOVERY INC	397	8.400	3,334.800	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	3	582.600	1,747.800	
BENTLEY SYSTEMS INC	36	52.460	1,888.560	
COINBASE GLOBAL INC	30	211.010	6,330.300	
UIPATH INC	70	18.750	1,312.500	
AIRBNB INC	78	155.010	12,090.780	
CONSTELLATION ENERGY CORP	57	180.900	10,311.300	
MONDAY.COM LTD	6	178.070	1,068.420	
SOLVENTUM CORP	24	62.200	1,492.800	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39	26.980	1,052.220	
APPROVIN CORP	27	66.800	1,803.600	
ROYALTY PHARMA PLC	75	28.160	2,112.000	
ROBLOX CORP	74	35.340	2,615.160	
VIATRIS INC	201	11.250	2,261.250	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	39	38.200	1,489.800	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	22	87.510	1,925.220	
HF SINCLAIR CORP	31	56.850	1,762.350	
SNOWFLAKE INC	50	145.450	7,272.500	
DOORDASH INC	46	127.180	5,850.280	
ARISTA NETWORKS INC	47	246.090	11,566.230	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	69	107.630	7,426.470	
GLOBAL-E ONLINE LTD	18	33.000	594.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	331	20.470	6,775.570	
FNF GROUP	43	48.770	2,097.110	
JACOBS SOLUTIONS INC	23	143.830	3,308.090	
MARVELL TECHNOLOGY INC	152	62.130	9,443.760	
APA CORP	57	32.360	1,844.520	
CONFLUENT INC	33	26.890	887.370	
LINDE PLC	85	446.300	37,935.500	
ROBINHOOD MARKETS INC	65	16.630	1,080.950	
U-HAUL HOLDING CO	18	62.310	1,121.580	
ASPEN TECHNOLOGY INC	6	198.470	1,190.820	
TOAST INC	48	21.620	1,037.760	
GE VERNOVA INC	48	135.100	6,484.800	
GRAB HOLDINGS LTD	357	3.370	1,203.090	
CATALENT INC	33	55.480	1,830.840	

SYNCHRONY FINANCIAL	68	41.570	2,826.760	
VERALTO CORP	43	88.890	3,822.270	
SAMSARA INC	27	30.150	814.050	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	36	24.340	876.240	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	39	68.100	2,655.900	
BUNGE GLOBAL SA	29	109.520	3,176.080	
KENVUE INC	316	19.580	6,187.280	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	79	33.990	2,685.210	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	233.710	1,869.680	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	31	145.120	4,498.720	
HUBSPOT INC	8	631.240	5,049.920	
QORVO INC	17	104.880	1,782.960	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	20	49.880	997.600	
LIBERTY GLOBAL LTD	34	17.390	591.260	
GODADDY INC	22	120.120	2,642.640	
ETSY INC	21	66.760	1,401.960	
TRANSUNION	35	66.700	2,334.500	
ALBERTSONS COS INC	55	20.350	1,119.250	
BLOCK INC	99	70.420	6,971.580	
DUPONT DE NEMOURS INC	78	73.890	5,763.420	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	41	67.580	2,770.780	
WESTROCK CO	54	47.990	2,591.460	
KRAFT HEINZ CO	148	37.780	5,591.440	
FORTIVE CORP	62	79.490	4,928.380	
WASTE CONNECTIONS INC	45	165.020	7,425.900	
ALPHABET INC-CL A	1,034	154.090	159,329.060	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	233	16.790	3,912.070	
PAYPAL HOLDINGS INC	181	62.310	11,278.110	
SEA LTD ADR	58	55.060	3,193.480	
EQUITABLE HOLDINGS INC	60	36.560	2,193.600	
ZILLOW GROUP INC-C	29	41.820	1,212.780	
ALPHABET INC-CL C	920	155.720	143,262.400	
ZSCALER INC	16	169.210	2,707.360	
ATLASSIAN CORP PLC	28	191.550	5,363.400	
ROKU INC	24	56.900	1,365.600	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	17	265.210	4,508.570	
VISTRA CORP	61	65.660	4,005.260	
アメリカ・ドル	小計	60,327	7,549,007.080 (1,168,586,295)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	69	22.500	1,552.500

ASSTEAD GROUP	76	55.580	4,224.080	
SEVERN TRENT PLC	53	24.540	1,300.620	
BARCLAYS PLC	2,759	1.858	5,126.220	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	208	4.415	918.320	
BT GROUP PLC	1,139	1.054	1,200.500	
BUNZL PLC	65	29.940	1,946.100	
CRH PLC	123	62.520	7,689.960	
AVIVA PLC	521	4.597	2,395.030	
CRODA INTERNATIONAL	25	48.760	1,219.000	
DIAGEO PLC	391	28.365	11,090.710	
SCHRODERS PLC	229	3.666	839.510	
DCC PLC	18	54.550	981.900	
NATIONAL GRID PLC	637	10.400	6,624.800	
KINGFISHER PLC	413	2.456	1,014.320	
BAE SYSTEMS PLC	541	12.960	7,011.360	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	359	23.100	8,292.900	
HALMA PLC	74	21.830	1,615.420	
NEXT PLC	20	87.740	1,754.800	
IMPERIAL BRANDS PLC	152	17.740	2,696.480	
ANGLO AMERICAN PLC	232	21.790	5,055.280	
COMPASS GROUP PLC	307	22.030	6,763.210	
HSBC HOLDINGS PLC	3,373	6.462	21,796.320	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	998	2.446	2,441.100	
CENTRICA PLC	1,031	1.317	1,357.820	
UNILEVER PLC	437	38.110	16,654.070	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	96	10.340	992.640	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	66	24.470	1,615.020	
PEARSON PLC	99	9.932	983.260	
PERSIMMON PLC	64	12.860	823.040	
PRUDENTIAL PLC	498	7.220	3,595.560	
RIO TINTO PLC	200	53.800	10,760.000	
VODAFONE GROUP PLC	4,486	0.670	3,005.620	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	128	41.670	5,333.760	
RELX PLC	329	33.020	10,863.580	
RENTOKIL INITIAL PLC	395	4.227	1,669.660	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,498	3.955	5,924.590	
NATWEST GROUP PLC	1,059	2.767	2,930.250	
ST JAMES'S PLACE PLC	100	4.230	423.000	
SSE PLC	186	16.605	3,088.530	
BP PLC	2,986	5.149	15,374.910	
SAGE GROUP PLC(THE)	196	11.405	2,235.380	
SMITHS GROUP PLC	80	15.860	1,268.800	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14	92.150	1,290.100	

STANDARD CHARTERED PLC	437	6.668	2,913.910	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,835	0.509	5,515.010	
TAYLOR WIMPLEY PLC	400	1.307	522.800	
TESCO PLC	1,265	2.814	3,559.710	
3I GROUP PLC	173	28.350	4,904.550	
SMITH & NEPHEW PLC	134	9.618	1,288.810	
GSK PLC	719	15.990	11,496.810	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	71	89.840	6,378.640	
WPP PLC	202	7.742	1,563.880	
ASTRAZENECA PLC	273	109.460	29,882.580	
WHITBREAD PLC	39	30.590	1,193.010	
INTERTEK GROUP PLC	29	49.060	1,422.740	
BURBERRY GROUP PLC	83	11.320	939.560	
INTERCONTINENTAL HOTELS	29	78.160	2,266.640	
SAINSBURY (J) PLC	302	2.588	781.570	
ADMIRAL GROUP PLC	50	27.350	1,367.500	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	12	45.420	545.040	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29	17.990	521.710	
ABRDN PLC	388	1.362	528.450	
EXPERIAN PLC	164	31.980	5,244.720	
MONDI PLC	60	15.045	902.700	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	76	7.182	545.830	
OCADO GROUP PLC	126	3.472	437.470	
INFORMA PLC	253	7.836	1,982.500	
GLENORE PLC	1,855	4.743	8,798.260	
ENTAIN PLC	96	8.374	803.900	
COCA-COLA HBC AG	32	24.560	785.920	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	130	4.812	625.560	
M&G PLC	366	1.998	731.260	
ENDEAVOUR MINING PLC	18	17.670	318.060	
WISE PLC	103	8.080	832.240	
JD SPORTS FASHION PLC	595	1.169	695.550	
HALEON PLC	1,081	3.258	3,521.890	
SHELL PLC	1,146	28.510	32,672.460	
AUTO TRADER GROUP PLC	134	6.686	895.920	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	31	148.400	4,600.400	
MELROSE INDUSTRIES PLC	201	6.228	1,251.820	
イギリス・ボンド 小計	48,667		338,979.410 (64,931,506)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	202	33.880	6,843.760
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	266	29.250	7,780.500
	ELBIT SYSTEMS LTD	5	773.800	3,869.000
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	247	19.190	4,739.930

	ICL GROUP LTD	193	18.050	3,483.650	
	NICE LTD	12	843.000	10,116.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17	136.100	2,313.700	
	AZRIELI GROUP	17	247.000	4,199.000	
イスラエル・シュケル 小計		959		43,345.540 (1,782,221)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	30	50.090	1,502.700	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	611	25.500	15,580.500	
	FORTESCUE LTD	309	24.600	7,601.400	
	TELSTRA GROUP LTD	685	3.650	2,500.250	
	ASX LTD	26	62.510	1,625.260	
	BHP GROUP LTD	894	44.630	39,899.220	
	AMPOL LTD	49	38.810	1,901.690	
	COMPUTERSHARE LT	107	27.920	2,987.440	
	CSL LIMITED	85	269.490	22,906.650	
	REA GROUP LTD	6	175.970	1,055.820	
	TRANSURBAN GROUP	521	12.750	6,642.750	
	COCHLEAR LTD	13	315.650	4,103.450	
	ORIGIN ENERGY LTD	315	9.760	3,074.400	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	292	111.860	32,663.120	
	RIO TINTO LIMITED	71	129.520	9,195.920	
	APA GROUP	248	8.350	2,070.800	
	ARISTOCRAT LEISU	110	40.320	4,435.200	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	444	6.350	2,819.400	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	76	53.330	4,053.080	
	ORICA LTD	100	17.960	1,796.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	51	22.960	1,170.960	
	MACQUARIE GROUP LTD	62	183.330	11,366.460	
	SUNCORP GROUP LTD	237	15.950	3,780.150	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	539	33.060	17,819.340	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	136	5.620	764.320	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	288	17.340	4,993.920	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	209	15.500	3,239.500	
	REECE LTD	30	26.270	788.100	
	SANTOS LTD	623	7.830	4,878.090	
	SONIC HEALTHCARE	85	26.270	2,232.950	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	40	32.500	1,300.000		
WESFARMERS LTD	199	65.250	12,984.750		
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	339	29.400	9,966.600		

	WOOLWORTHS GROUP LTD	218	31.400	6,845.200	
	SEEK LTD	81	23.730	1,922.130	
	MINERAL RESOURCES LTD	27	68.240	1,842.480	
	BRAMBLES LTD	256	15.530	3,975.680	
	PILBARA MINERALS LTD	512	3.830	1,960.960	
	CAR GROUP LTD	72	33.250	2,394.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	267	3.880	1,035.960	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	186	11.840	2,202.240	
	XERO LTD	27	116.810	3,153.870	
	IDP EDUCATION LTD	49	16.440	805.560	
	LOTTERY CORP LTD	433	4.940	2,139.020	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	193	5.320	1,026.760	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	520	28.250	14,690.000	
	MEDIBANK PVT LTD	498	3.590	1,787.820	
	SOUTH32 LTD(AUD)	1,072	3.190	3,419.680	
	COLES GROUP LTD	269	16.050	4,317.450	
	WISETECH GLOBAL LTD	33	88.460	2,919.180	
	オーストラリア・ドル 小計	12,543		300,138.180 (29,887,760)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	87	87.820	7,640.340	
	BARRICK GOLD CORP	321	23.530	7,553.130	
	BANK OF MONTREAL	125	126.750	15,843.750	
	BANK OF NOVA SCOTIA	209	64.280	13,434.520	
	NATIONAL BANK OF CANADA	56	110.120	6,166.720	
	BCE INC	8	44.800	358.400	
	BROOKFIELD CORP	242	53.620	12,976.040	
	SAPUTO INC	46	25.680	1,181.280	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17	124.030	2,108.510	
	CGI INC	37	142.990	5,290.630	
	CCL INDUSTRIES INC	30	70.580	2,117.400	
	CAE INC	67	25.580	1,713.860	
	CAMECO CORP	74	66.180	4,897.320	
	ROGERS COMM-CL B	63	53.010	3,339.630	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	163	65.430	10,665.090	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	188	105.310	19,798.280	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	11	132.260	1,454.860	
	CANADIAN UTILITIES LTD	43	30.200	1,298.600	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	100	175.470	17,547.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	31	48.420	1,501.020	
	OPEN TEXT CORP	50	48.180	2,409.000	
	EMPIRE CO LTD	12	31.690	380.280	
	KINROSS GOLD CORP	202	9.310	1,880.620	
	RB GLOBAL INC	33	99.870	3,295.710	
	FORTIS INC	80	52.890	4,231.200	

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	116	15.960	1,851.360	
TELUS CORP	88	21.870	1,924.560	
GREAT WEST LIFECO INC	47	40.260	1,892.220	
IMPERIAL OIL LTD	34	95.630	3,251.420	
ENBRIDGE INC	364	47.970	17,461.080	
IGM FINANCIAL INC	35	33.600	1,176.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	311	31.720	9,864.920	
LOBLAW CO LTD	30	148.270	4,448.100	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	136	76.060	10,344.160	
MAGNA INTERNATIONAL INC	49	66.450	3,256.050	
SUN LIFE FINANCIAL INC	95	70.300	6,678.500	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4	1,513.790	6,055.160	
METRO INC	39	69.700	2,718.300	
EMERA INC	58	46.710	2,709.180	
ONEX CORP	13	97.300	1,264.900	
PAN AMERICAN SILVER CORP	73	26.240	1,915.520	
POWER CORP OF CANADA	98	36.840	3,610.320	
QUEBECOR INC-B	38	28.550	1,084.900	
ROYAL BANK OF CANADA	242	134.570	32,565.940	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	172	116.410	20,022.520	
STANTEC INC	18	108.500	1,953.000	
SUNCOR ENERGY INC	232	52.990	12,293.680	
LUNDIN MINING CORP	58	15.840	918.720	
TECK RESOURCES LTD-CL B	84	64.810	5,444.040	
THOMSON REUTERS CORP	29	206.670	5,993.430	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	19	129.280	2,456.320	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	307	79.880	24,523.160	
TC ENERGY CORP	178	49.050	8,730.900	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	10	106.420	1,064.200	
WESTON (GEORGE) LTD	10	177.840	1,778.400	
INTACT FINANCIAL CORP	31	221.950	6,880.450	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	85	72.380	6,152.300	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	3,661.670	14,646.680	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	34	167.000	5,678.000	
TOURMALINE OIL CORP	60	65.120	3,907.200	
KEYERA CORP	42	35.000	1,470.000	
PARKLAND CORP	18	42.190	759.420	
ALTAGAS LTD	34	29.890	1,016.260	
PEMBINA PIPELINE CORP	95	47.980	4,558.100	
DOLLARAMA INC	50	112.800	5,640.000	
MEG ENERGY CORP	43	31.160	1,339.880	

	CENOVUS ENERGY INC W/I	237	28.690	6,799.530	
	ARC RESOURCES LTD	94	24.970	2,347.180	
	NORTHLAND POWER INC	57	20.740	1,182.180	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	70	21.500	1,505.000	
	TMX GROUP LTD	40	36.100	1,444.000	
	BRP INC	7	95.380	667.660	
	IVANHOE MINES LTD	91	19.210	1,748.110	
	NUTRIEN LTD	90	72.560	6,530.400	
	TFI INTERNATIONAL INC	14	196.650	2,753.100	
	WSP GLOBAL INC	24	209.640	5,031.360	
	IA FINANCIAL CORP INC	17	82.280	1,398.760	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	49	45.560	2,232.440	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	18	30.720	552.960	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	58	52.680	3,055.440	
	AIR CANADA	21	19.580	411.180	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	51	98.200	5,008.200	
	SHOPIFY INC	213	95.820	20,409.660	
	FIRSTSERVICE CORP	9	205.500	1,849.500	
	HYDRO ONE LTD	48	37.800	1,814.400	
カナダ・ドル 小計		6,986		467,123.500 (52,630,805)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	300	3.950	1,185.000	
	SEBNCORP INDUSTRIES	100	5.320	532.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	400	36.410	14,564.000	
	SEATRUM LTD	5,725	0.077	440.820	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	200	9.060	1,812.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	800	0.920	736.000	
	KEPPEL LTD	300	6.970	2,091.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	700	13.690	9,583.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,400	2.350	3,290.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	200	6.250	1,250.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	200	29.930	5,986.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	300	3.400	1,020.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	600	2.460	1,476.000	
シンガポール・ドル 小計		11,225		43,965.820 (4,992,759)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	30	70.980	2,129.400	
	NESTLE SA-REGISTERED	474	95.240	45,143.760	
	CIE FINANC RICHEMONT	96	127.450	12,235.200	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	125	222.100	27,762.500	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5	225.800	1,129.000	
	SIKA INHABER	27	255.900	6,909.300	
	SGS SA-REG	27	82.000	2,214.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	362	85.530	30,961.860	
	BALOISE HOLDING AG -R	8	139.200	1,113.600	
	BARRY CALLEBAUT AG	1	1,411.000	1,411.000	
	CLARIANT AG-REG	45	13.160	592.200	
	SWISSCOM AG-REG	5	518.500	2,592.500	
	ABB LTD	287	44.640	12,811.680	
	ADECCO GROUP AG-REG	23	31.260	718.980	
	GEBERIT AG	6	485.500	2,913.000	
	LONZA GROUP AG-REG	13	502.800	6,536.400	
	GIVAUDAN-REG	2	3,951.000	7,902.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	26	448.400	11,658.400	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	5	238.000	1,190.000	
	HOLCIM LTD	97	77.540	7,521.380	
	TEMENOS GROUP	10	66.000	660.000	
	BACHEM HOLDING AG	5	78.650	393.250	
	SONOVA HOLDING AG	10	248.000	2,480.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	11	248.700	2,735.700	
	STRAUMANN HOLDING AG	19	133.100	2,528.900	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6	191.000	1,146.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	37.850	378.500	
	HELVETIA HOLDING AG	9	117.900	1,061.100	
	SCHINDLER NAMEN	6	219.500	1,317.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	6	611.200	3,667.200	
	BANQUE CANTONALE VAUD	8	100.600	804.800	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1	688.000	688.000	
	SWISS PRIME SITE AG	12	84.900	1,018.800	
	AVOLTA AG	9	34.560	311.040	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4	1,189.000	4,756.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	42	48.440	2,034.480	
	SWISS RE LTD	54	98.120	5,298.480	
	BKW AG	7	141.400	989.800	
	SIG GROUP AG	50	19.210	960.500	
	ALCON INC	91	72.480	6,595.680	
	SANDOZ GROUP AG	74	29.510	2,183.740	
	UBS GROUP AG	584	25.700	15,008.800	
	VAT GROUP AG	5	459.100	2,295.500	
スイス・フラン	小計	2,697		244,759.430 (41,582,180)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	469	179.450	84,162.050	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	288	155.600	44,812.800	
	ERICSSON LM-B SHS	561	56.300	31,584.300	
	GETINGE AB-B SHS	49	212.800	10,427.200	

LUNDBERGS B	9	539.500	4,855.500	
SKF AB-B SHS	67	219.500	14,706.500	
SANDVIK AB	184	237.100	43,626.400	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	281	145.250	40,815.250	
SKANSKA AB-B SHS	48	189.250	9,084.000	
SWEDBANK AB	157	214.800	33,723.600	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	84	152.950	12,847.800	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	265	109.000	28,885.000	
VOLVO AB-A SHS	47	288.400	13,554.800	
VOLVO AB-B SHS	249	280.200	69,769.800	
HOLMEN AB-B SHS	8	416.200	3,329.600	
TELE2 AB-B SHS	145	100.850	14,623.250	
INDUSTRIVARDEN A	19	353.400	6,714.600	
INDUSTRIVARDEN C	30	352.500	10,575.000	
SAAB AB-B	13	896.600	11,655.800	
SECURITAS AB-B SHS	101	109.650	11,074.650	
INVESTOR AB-B SHS	316	261.050	82,491.800	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	125	171.100	21,387.500	
ASSA ABLOY AB-B	170	305.400	51,918.000	
TELIA CO AB	292	26.520	7,743.840	
BOLIDEN AB	46	346.200	15,925.200	
ALFA LAVAL AB	48	420.500	20,184.000	
FASTIGHETS AB BALDER	144	66.780	9,616.320	
INDUTRADE AB	40	271.800	10,872.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	25	81.080	2,027.000	
NIBE INDUSTRIER AB	276	48.830	13,477.080	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	41	261.000	10,701.000	
HEXAGON AB-B SHS	359	120.400	43,223.600	
SAGAX AB	37	265.600	9,827.200	
EPIROC AB-A	126	212.400	26,762.400	
EPIROC AB-B	56	188.000	10,528.000	
ESSITY AB-B	109	254.500	27,740.500	
EQT AB	68	288.100	19,590.800	
VOLVO CAR AB	144	40.860	5,883.840	
BEIJER REF AB	40	140.600	5,624.000	
VOLVO CAR AB	144	2.307	332.200	
LIFCO AB	43	273.200	11,747.600	
EVOLUTION AB	32	1,281.000	40,992.000	
INVESTMENT AB LATOUR	23	275.100	6,327.300	
スウェーデン・クローナ 小計	5,778		955,751.080 (13,552,550)	
デンマーク・ク ローネ				
CARLSBERG AS-B	18	927.600	16,696.800	
AP MOLLER MAERSK A	1	9,385.000	9,385.000	
DANSKE BANK A/S	124	202.900	25,159.600	

	GENMAB A/S	12	2,006.000	24,072.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	65	387.000	25,155.000	
	ROCKWOOL AS	2	2,228.000	4,456.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	578	866.200	500,663.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	173	176.750	30,577.750	
	COLOPLAST-B	20	906.000	18,120.000	
	DSV A/S	31	1,070.000	33,170.000	
	DEMANT A/S	22	315.600	6,943.200	
	TRYG A/S	68	135.900	9,241.200	
	PANDORA A/S	15	1,082.000	16,230.000	
	ORSTED A/S	34	385.100	13,093.400	
デンマーク・クローネ 小計		1,163		732,963.550 (16,205,824)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	345	7.850	2,708.250	
	EBOS GROUP LTD	18	34.690	624.420	
	FISHER & PAYKEL	93	26.600	2,473.800	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	235	4.650	1,092.750	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	87	6.440	560.280	
	MERIDIAN ENERGY LTD	226	5.890	1,331.140	
ニュージーランド・ドル 小計		1,004		8,790.640 (803,552)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	68	185.900	12,641.200	
	NORSK HYDRO ASA	235	70.720	16,619.200	
	TELENOR ASA	133	124.100	16,505.300	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	12	747.000	8,964.000	
	ORKLA ASA	135	71.900	9,706.500	
	EQUINOR ASA	161	299.000	48,139.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33	337.300	11,130.900	
	AKER BP ASA	61	283.300	17,281.300	
	SALMAR ASA	11	652.500	7,177.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24	164.100	3,938.400	
	ADEVINTA ASA	72	113.500	8,172.000	
	DNB BANK ASA	170	211.500	35,955.000	
ノルウェー・クローネ 小計		1,115		196,230.300 (2,760,960)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	29	79.400	2,302.600	
	KINGSPAN GROUP PLC	26	81.350	2,115.100	
	UMICORE	47	21.080	990.760	
	AIR LIQUIDE	93	187.760	17,461.680	
	AIRBUS SE	103	160.040	16,484.120	
	AXA SA	318	33.900	10,780.200	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	117	28.800	3,369.600	
	ADIDAS AG	29	224.600	6,513.400	
	ASSICURAZIONI GENERALI	171	22.670	3,876.570	
	DASSAULT AVIATION SA	4	205.200	820.800	
	DANONE	122	59.440	7,251.680	

SAFRAN SA	60	205.900	12,354.000	
INTESA SANPAOLO	2,581	3.377	8,716.030	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	57	105.850	6,033.450	
ACCOR SA	28	39.780	1,113.840	
BOUYGUES	28	36.120	1,011.360	
BNP PARIBAS	186	65.430	12,169.980	
THALES SA	15	155.250	2,328.750	
CAPGEMINI SA	28	200.100	5,602.800	
UNICREDIT SPA	275	35.275	9,700.620	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	15	133.500	2,002.500	
D'IETEREN TRDG	2	203.800	407.600	
COMMERZBANK AG	207	13.375	2,768.620	
EIFFAGE	15	98.820	1,482.300	
FRESENIUS SE & CO KGAA	76	26.900	2,044.400	
PUBLICIS GROUPE	42	99.700	4,187.400	
IBERDROLA SA	1,327	11.340	15,048.180	
ENI SPA	369	15.258	5,630.200	
JERONIMO MARTINS	51	17.780	906.780	
KESKO OYJ-B	35	16.535	578.720	
KBC GROUPE	43	69.600	2,992.800	
HANNOVER RUECK SE	11	230.000	2,530.000	
WARTSILA OYJ	90	15.225	1,370.250	
L'OREAL	43	444.950	19,132.850	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	49	796.600	39,033.400	
GEA GROUP AG	28	37.120	1,039.360	
BOLLORE	81	6.150	498.150	
MEDIOBANCA SPA	115	13.495	1,551.920	
MICHELIN(CGDE)-B	120	35.320	4,238.400	
CONTINENTAL AG	17	62.360	1,060.120	
DEUTSCHE POST AG-REG	180	38.340	6,901.200	
OMV AG	27	43.580	1,176.660	
VERBUND AG	13	70.350	914.550	
PERNOD-RICARD	37	145.000	5,365.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	27	48.970	1,322.190	
RENAULT SA	36	47.730	1,718.280	
REPSOL SA	214	14.945	3,198.230	
REMY COINTREAU	3	93.800	281.400	
MERCK KGAA	22	146.000	3,212.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	82	70.260	5,761.320	
RWE AG	113	32.450	3,666.850	
SEB SA	2	111.400	222.800	
SOCIETE GENERALE-A	141	24.750	3,489.750	
VINCI S.A.	88	113.350	9,974.800	
SODEXO	15	78.550	1,178.250	

SOFINA	3	211.800	635.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	95	208.400	19,798.000	
VIVENDI SE	106	9.896	1,048.970	
SAP SE	184	165.800	30,507.200	
TELEFONICA S.A	812	4.007	3,253.680	
TOTALENERGIES SE	380	67.280	25,566.400	
E.ON SE	400	12.380	4,952.000	
VOEST-ALPINE AG	26	25.000	650.000	
HENKEL AG & CO KGAA	16	65.900	1,054.400	
SIEMENS AG-REG	134	172.960	23,176.640	
UPM-KYMMENE OYJ	97	32.000	3,104.000	
ING GROEP NV-CVA	594	15.230	9,046.620	
PUMA AG	14	42.560	595.840	
BAYER AG	175	26.325	4,606.870	
STORA ENSO OYJ-R SHS	97	12.775	1,239.170	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	31	72.220	2,238.820	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	142	74.140	10,527.880	
BASF SE	160	50.440	8,070.400	
BEIERSDORF AG	20	135.800	2,716.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	26	93.140	2,421.640	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	38	36.620	1,391.560	
ASM INTERNATIONAL NV	8	523.000	4,184.000	
ORANGE	346	10.855	3,755.830	
SAMPO OYJ-A SHS	71	39.870	2,830.770	
RANDSTAD NV	20	48.170	963.400	
ALLIANZ SE	67	263.200	17,634.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	567	3.607	2,045.160	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	173	27.380	4,736.740	
HERMES INTL	6	2,320.000	13,920.000	
ENDESA S.A.	49	17.420	853.580	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	81	6.716	543.990	
ERSTE GROUP BANK AG	60	43.000	2,580.000	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	24	415.000	9,960.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	88	23.830	2,097.040	
DASSAULT SYSTEMES SA	120	38.100	4,572.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	42	38.220	1,605.240	
RHEINMETALL STAMM	8	504.000	4,032.000	
HEINEKEN NV	50	89.640	4,482.000	
AKZO NOBEL	33	66.280	2,187.240	
ASML HOLDING NV	71	821.000	58,291.000	
AEGON LTD	233	5.522	1,286.620	
VOLKSWAGEN AG	5	141.300	706.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	36	121.200	4,363.200	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,015	10.205	10,358.070	
KERING	13	339.100	4,408.300	
ACCIONA S.A.	4	107.200	428.800	
FORTUM OYJ	90	12.245	1,102.050	
AGEAS	25	43.060	1,076.500	
UCB SA	23	121.200	2,787.600	
NEMETSCHEK SE	12	79.550	954.600	
CARREFOUR SA	95	15.760	1,497.200	
NOKIA OYJ	922	3.310	3,051.820	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	142	18.850	2,676.700	
WOLTERS KLUWER-CVA	46	140.550	6,465.300	
SANOFI	202	86.890	17,551.780	
STMICROELECTRONICS NV	121	36.710	4,441.910	
ELISA OYJ	33	42.740	1,410.420	
BANCO SANTANDER SA	2,850	4.511	12,856.350	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	72	15.940	1,147.680	
QIAGEN N.V.	32	37.470	1,199.040	
DEUTSCHE BANK AG-REG	353	14.954	5,278.760	
BMW VORZUG	8	98.200	785.600	
ENEL SPA	1,372	5.955	8,170.260	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	559	21.160	11,828.440	
SARTORIUS AG	5	271.600	1,358.000	
LEONARDO SPA	76	21.680	1,647.680	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	236	30.135	7,111.860	
RATIONAL AG	1	785.500	785.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG	5	97.700	488.500	
BECHTLE AG	15	45.520	682.800	
KONINKLIJKE KPN NV	551	3.321	1,829.870	
EUROFINS SCIENTIFIC	25	59.520	1,488.000	
TELEPERFORMANCE	9	87.520	787.680	
DEUTSCHE BOERSE AG	33	186.300	6,147.900	
EURAZEO	11	81.000	891.000	
GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15	69.700	1,045.500	
HEINEKEN HOLDING NV-A	24	74.600	1,790.400	
INDITEX	191	43.740	8,354.340	
ESSILORLUXOTTICA	52	203.300	10,571.600	
SNAM SPA	307	4.284	1,315.180	
CREDIT AGRICOLE SA	218	14.035	3,059.630	
ENAGAS	51	13.680	697.680	
TENARIS SA	87	17.700	1,539.900	
TELECOM ITALIA SPA	1,698	0.221	375.250	
TERNA SPA	287	7.426	2,131.260	
BIOMERIEUX	8	99.550	796.400	
GRIFOLS SA	56	8.346	467.370	
NESTE OYJ	79	25.720	2,031.880	

IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	19	49.860	947.340	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	89	9.476	843.360	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	10	211.900	2,119.000	
KONE OYJ	57	42.900	2,445.300	
ELIA GROUP	4	92.350	369.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	5	200.600	1,003.000	
ENGIE	322	15.930	5,129.460	
ALSTOM	49	15.100	739.900	
IPSEN SA	5	108.400	542.000	
ARKEMA SA	14	95.600	1,338.400	
LEGRAND SA	45	95.480	4,296.600	
AMPLIFON SPA	27	31.340	846.180	
ADP	4	118.200	472.800	
ORION OYJ	14	32.400	453.600	
METSO CORPORATION	125	11.235	1,404.370	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	72	16.040	1,154.880	
SYMRISE AG	23	105.400	2,424.200	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39	40.900	1,595.100	
REXEL SA	25	23.960	599.000	
PRYSMIAN SPA	43	50.400	2,167.200	
DIASORIN ITALIA SPA	3	91.180	273.540	
CAIXABANK	653	4.806	3,138.310	
BUREAU VERITAS SA	49	27.380	1,341.620	
GETLINK	48	15.550	746.400	
EDP RENOVAVEIS SA	27	12.830	346.410	
AMADEUS IT GROUP SA	80	57.420	4,593.600	
BRENNTAG SE	21	74.540	1,565.340	
EVONIK INDUSTRIES AG	15	19.290	289.350	
EDENRED	45	43.710	1,966.950	
TALANX AG	13	68.200	886.600	
LEG IMMOBILIEN SE	15	74.280	1,114.200	
VONOVIA SE	128	25.190	3,224.320	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	204	10.055	2,051.220	
KNORR-BREMSE AG	12	68.100	817.200	
OCI NV	17	24.780	421.260	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	50	50.800	2,540.000	
FERRARI NV	23	387.200	8,905.600	
ASR NEDERLAND NV	28	45.650	1,278.200	
AIB GROUP PLC	250	5.035	1,258.750	
NORDEA BANK ABP	558	10.890	6,076.620	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	25	35.180	879.500	
MONCLER SPA	39	65.440	2,552.160	
NEXI SPA	160	5.408	865.280	

PROSUS NV	255	28.540	7,277.700	
DR ING HC F PORSCHE AG	22	89.920	1,978.240	
JDE PEET'S BV	9	19.920	179.280	
EXOR NV	17	100.700	1,711.900	
SIEMENS ENERGY AG	96	17.620	1,691.520	
EURONEXT NV	16	84.650	1,354.400	
IMCD NV	12	151.250	1,815.000	
WORLDLINE SA	47	9.494	446.210	
NN GROUP NV	39	42.760	1,667.640	
FINECOBANK SPA	76	14.140	1,074.640	
ARGENX SE	11	337.300	3,710.300	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	144	26.780	3,856.320	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	96	43.550	4,180.800	
DSM-FIRMENICH AG	35	104.100	3,643.500	
SYENSQO SA	10	86.670	866.700	
ZALANDO SE	43	26.920	1,157.560	
STELLANTIS NV	386	24.230	9,352.780	
FERROVIAL SE	80	33.220	2,657.600	
AENA SME SA	12	173.200	2,078.400	
CELLNEX TELECOM SAU	75	30.700	2,302.500	
BANCO BPM SPA	227	6.390	1,450.530	
ABN AMRO BANK NV	70	15.625	1,093.750	
SCOUT24 SE	16	66.900	1,070.400	
COVESTRO AG	30	48.500	1,455.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	154	54.960	8,463.840	
POSTE ITALIANE SPA	80	11.650	932.000	
AMUNDI SA	10	63.800	638.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	59	9.945	586.750	
ADYEN NV	4	1,399.200	5,596.800	
DELIVERY HERO SE	35	28.090	983.150	
ユーロ 小計	40,410		902,285.860 (148,868,144)	
香港・ドル				
CLP HOLDINGS LTD	235	59.700	14,029.500	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	42.600	21,300.000	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	166	214.600	35,623.600	
MTR CORP	403	23.450	9,450.350	
HANG SENG BANK LTD	100	96.050	9,605.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	86	22.150	1,904.900	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	67	43.300	2,901.100	
HONG KONG & CHINA GAS	1,515	5.660	8,574.900	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	33.650	18,070.050	

BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	684	22.650	15,492.600	
SINO LAND CO	576	7.830	4,510.080	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	70.000	35,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	273	101.500	27,709.500	
AIA GROUP LTD	2,151	47.200	101,527.200	
HKT TRUST / HKT LTD	1,080	8.680	9,374.400	
SANDS CHINA LTD	574	18.000	10,332.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	32	14.980	479.360	
ESR GROUP LTD	400	8.000	3,200.000	
WH GROUP LTD	1,500	5.390	8,085.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	534	35.850	19,143.900	
CK ASSET HOLDINGS LTD	34	31.100	1,057.400	
香港・ドル 小計	11,947		357,370.840 (7,061,648)	
合計	204,821		1,553,646,204 (1,553,646,204)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年4月22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	2,019.160	
		GOODMAN GROUP	288.000	8,781.120	
		GPT GROUP	219.000	908.850	
		MIRVAC GROUP	425.000	901.000	
		SCENTRE GROUP	1,109.000	3,493.350	
		STOCKLAND	473.000	2,071.740	
		VICINITY CENTRES	700.000	1,333.500	
	オーストラリア・ドル 小計		3,500.000	19,508.720 (1,942,678)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,079.000	2,028.520	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	600.000	1,536.000	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		500.000	655.000		
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		200.000	242.000		
シンガポール・ドル 小計		2,379.000	4,461.520 (506,650)		
投資信託受益証券 合計			5,879	2,449,328 (2,449,328)	

投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28.000	3,239.320	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	60.000	2,116.200	
		AMERICAN TOWER CORP	82.000	14,046.600	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	87.000	1,586.010	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	26.000	4,787.380	
		BOSTON PROPERTIES INC	28.000	1,685.600	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	14.000	1,348.060	
		CROWN CASTLE INC	78.000	7,425.600	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	54.000	7,388.820	
		EQUINIX INC	17.000	12,716.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30.000	1,881.900	
		EQUITY RESIDENTIAL	62.000	3,815.480	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	13.000	3,057.210	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	38.000	5,033.480	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	50.000	2,140.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90.000	1,618.200	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	118.000	2,207.780	
		INVITATION HOMES INC	119.000	3,994.830	
		IRON MOUNTAIN INC	54.000	4,055.400	
		KIMCO REALTY	119.000	2,165.800	
		MID AMERICA	24.000	3,025.920	
		PROLOGIS INC	163.000	16,868.870	
		PUBLIC STORAGE	28.000	7,290.640	
		REALTY INCOME CORP	150.000	7,956.000	
		REGENCY CENTERS CORP	33.000	1,926.210	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	20.000	3,921.200	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	58.000	8,145.520	
		SUN COMMUNITIES INC	21.000	2,471.490	
	UDR INC	56.000	2,038.400		
	VENTAS INC	73.000	3,148.490		
	VICI PROPERTIES INC	186.000	5,187.540		
	WELLTOWER INC	99.000	9,040.680		
	WEYERHAEUSER CO	133.000	4,185.510		
WP CAREY INC	36.000	2,023.560			
アメリカ・ドル	小計	2,247.000	163,539.700 (25,315,944)		
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	134.000	850.230		
	SEGRO PLC	218.000	1,849.940		
イギリス・ポンド	小計	352.000	2,700.170 (517,218)		
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	10.000	426.700		

		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15.000	264.750	
	カナダ・ドル 小計		25.000	691.450 (77,906)	
	ユーロ	COVIVIO	4.000	173.840	
		GECINA SA	7.000	651.700	
		KLEPIERRE	31.000	762.600	
		UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	25.000	1,877.500	
		WAREHOUSES DE PAUW	41.000	1,056.160	
	ユーロ 小計		108.000	4,521.800 (746,052)	
	香港・ドル	LINK REIT	507.000	15,640.950	
	香港・ドル 小計		507.000	15,640.950 (309,065)	
投資証券 合計			3,239	26,966,185 (26,966,185)	
合計				29,415,513 (29,415,513)	

(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 590銘柄	67.27	-	-	-	75.42
	投資証券 34銘柄	-	-	-	1.46	
イギリス・ポンド	株式 81銘柄	3.74	-	-	-	4.13
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式 50銘柄	1.72	-	-	-	2.01
	投資信託受益証券 7銘柄	-	-	0.11	-	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.03	-	-	-	3.33
	新株予約権証券 1銘柄	-	0.00	-	-	
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式 13銘柄	0.29	-	-	-	0.35
	投資信託受益証券 4銘柄	-	-	0.03	-	
スイス・フラン	株式 43銘柄	2.39	-	-	-	2.63
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	0.78	-	-	-	0.86
デンマーク・クローネ	株式 14銘柄	0.93	-	-	-	1.02

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	0.16	-	-	-	0.17
ユーロ	株式	217銘柄	8.57	-	-	-	9.45
	投資証券	5銘柄	-	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	21銘柄	0.41	-	-	-	0.47
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.02	

(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)

2024年4月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,474,014
コール・ローン	65,950,896
国債証券	13,690,492,841
未収利息	93,998,410
前払費用	30,457,386
流動資産合計	13,886,373,547
資産合計	13,886,373,547
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	4,744,504,901
剰余金	
剰余金又は欠損金()	9,141,868,646
元本等合計	13,886,373,547
純資産合計	13,886,373,547
負債純資産合計	13,886,373,547

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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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	4,994,283,961円
同期中追加設定元本額	27,564,352円
同期中一部解約元本額	277,343,412円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	3,415,027,415円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	616,891,848円
新光7資産バランスファンド	224,883,758円
海外国債ファンド（変額年金）	487,701,880円
計	4,744,504,901円
2. 受益権の総数	4,744,504,901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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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	2024年4月22日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	78,227,802	
合計	78,227,802	

(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11月5日から2024年4月22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)

	2024年4月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.9268円 (29,268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

2024年4月22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 1.25 08/15/31	9,700,000.000	7,688,386.720	
		US T N/B 1.875 02/15/32	4,200,000.000	3,447,855.470	
		US T N/B 2.875 05/15/32	7,400,000.000	6,532,234.400	
		US T N/B 3.375 05/15/33	3,460,000.000	3,142,585.540	
		US T N/B 3.5 02/15/33	7,500,000.000	6,893,408.150	

	US T N/B 3.875 08/15/33	5,400,000.000	5,095,828.150	
	US T N/B 4.0 02/15/34	2,500,000.000	2,379,882.800	
	US T N/B 4.5 11/15/33	3,100,000.000	3,071,179.670	
アメリカ・ドル	小計	43,260,000.000 (6,696,648,000)	38,251,360.900 (5,921,310,667)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,000,000.000	759,458.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,100,000.000	820,303.000	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	220,000.000	174,328.880	
	UK TREASURY 3.25 01/31/33	640,000.000	596,034.940	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,270,000.000	1,281,686.540	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	600,000.000	617,850.000	
イギリス・ボンド	小計	4,830,000.000 (925,186,500)	4,249,661.360 (814,022,634)	
カナダ・ドル	CANADA 1.5 06/01/31	1,480,000.000	1,277,286.220	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,240,000.000	1,913,110.780	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,600,000.000	1,456,759.100	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,470,000.000	1,413,626.740	
	CANADA 5.75 06/01/33	740,000.000	854,582.140	
カナダ・ドル	小計	7,530,000.000 (848,405,100)	6,915,364.980 (779,154,172)	
ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	970,000.000	803,337.310	
	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,400,000.000	2,013,264.000	
	DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	3,460,000.000	3,367,618.000	
	DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	2,050,000.000	2,022,468.500	
	DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,100,000.000	2,042,439.000	
	DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	500,000.000	504,375.000	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/31	4,800,000.000	3,865,209.600	
	FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,800,000.000	1,485,945.000	
	FRANCE OAT 2.0 11/25/32	4,000,000.000	3,715,554.000	
	FRANCE OAT 3.0 05/25/33	1,600,000.000	1,602,464.000	
	FRANCE OAT 3.5 11/25/33	5,900,000.000	6,134,182.800	
	ITALY BTPS 0.6 08/01/31	2,850,000.000	2,306,961.000	
	ITALY BTPS 0.95 06/01/32	3,620,000.000	2,936,906.000	
	ITALY BTPS 0.95 08/01/30	800,000.000	684,720.000	
	ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,800,000.000	1,850,760.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	2,000,000.000	2,096,400.000		
ユーロ	小計	40,650,000.000 (6,706,843,500)	37,432,604.210 (6,176,005,368)	
国債証券	合計	15,177,083,100 (15,177,083,100)	13,690,492,841 (13,690,492,841)	
合計			13,690,492,841 (13,690,492,841)	

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 8銘柄	42.64	43.25
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	5.86	5.95
カナダ・ドル	国債証券 5銘柄	5.61	5.69
ユーロ	国債証券 16銘柄	44.48	45.11

(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)

2024年4月22日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,082,910
コール・ローン	1,776,269
投資証券	621,867,945
未収配当金	788,152
流動資産合計	626,515,276
資産合計	626,515,276
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	229,354,163
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	397,161,113
元本等合計	626,515,276
純資産合計	626,515,276
負債純資産合計	626,515,276

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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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	14,678,505円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	229,354,163円
計	229,354,163円
2. 受益権の総数	229,354,163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10月21日 至 2024年4月22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	2024年4月22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。
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	2024年4月22日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	44,178,926
合計	44,178,926

(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)

	2024年4月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7316円 (27,316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

2024年4月22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	344.000	5,865.200	
		AGREE REALTY CORP	342.000	19,343.520	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	262.000	4,215.580	
		ALEXANDER'S INC.	7.000	1,473.710	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	602.000	69,645.380	

ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	39.000	579.930	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	165.000	3,463.350	
AMERICAN HOMES 4 RENT	1,155.000	40,736.850	
AMERICAN TOWER CORP	1,617.000	276,992.100	
AMERICOLD REALTY TRUST	978.000	22,337.520	
APARTMENT INCOME REIT CORP	506.000	19,420.280	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	494.000	3,868.020	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	728.000	11,021.920	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	246.000	2,583.000	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	492.000	90,591.960	
BOSTON PROPERTIES INC	540.000	32,508.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	217.000	499.100	
BRANDYWINE REALTY TRUST	574.000	2,514.120	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,033.000	22,178.510	
BROADSTONE NET LEASE INC	635.000	9,207.500	
BRT APARTMENTS CORP	43.000	746.910	
CAMDEN PROPERTY TRUST	358.000	34,471.820	
CARETRUST REIT INC	410.000	9,712.900	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	100.000	2,182.000	
CENTERSPACE	55.000	3,568.950	
CHATHAM LODGING TRUST	162.000	1,504.980	
CITY OFFICE REIT INC	145.000	662.650	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	815.000	4,327.650	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	89.000	2,270.390	
COPT DEFENCE PROPERTIES	381.000	8,675.370	
COUSINS PROPERTIES INC	515.000	11,417.550	
CROWN CASTLE INC	1,502.000	142,990.400	
CTO REALTY GROUTH INC	76.000	1,290.480	
CUBESMART	771.000	32,420.550	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	710.000	6,269.300	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,049.000	143,534.670	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	803.000	1,935.230	
DOUGLAS EMMETT INC	544.000	7,240.640	
EAST GROUP	158.000	25,164.660	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	330.000	3,824.700	

ELME COMMUNITIES	316.000	4,695.760	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	446.000	4,080.900	
EPR PROPERTIES	253.000	10,223.730	
EQUINIX INC	324.000	242,352.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	612.000	38,390.760	
EQUITY RESIDENTIAL	1,295.000	79,694.300	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	537.000	13,682.760	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	222.000	52,207.740	
EXTRA SPACE STORAGE INC	726.000	96,165.960	
FARMLAND PARTNERS INC	151.000	1,623.250	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	279.000	27,835.830	
FIRST INDUSTRIAL RT	455.000	20,761.650	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	305.000	7,024.150	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	888.000	38,006.400	
GETTY REALTY CORP	161.000	4,345.390	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	143.000	1,880.450	
GLADSTONE LAND CORP	121.000	1,535.490	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	231.000	1,891.890	
GLOBAL NET LEASE INC	670.000	4,522.500	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,318.000	18,399.280	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,451.000	44,068.980	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	354.000	8,559.720	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2,426.000	45,390.460	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	472.000	2,798.960	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	762.000	11,902.440	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	220.000	805.200	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	94.000	8,857.620	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	229.000	5,692.940	
INVITATION HOMES INC	2,121.000	71,201.970	
IRON MOUNTAIN INC	1,005.000	75,475.500	
JBG SMITH PROPERTIES	321.000	4,763.640	
KILROY REALTY CORP	405.000	13,401.450	
KIMCO REALTY	2,277.000	41,441.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	749.000	15,646.610	

LAMAR ADVERTISING CO	302.000	33,654.880	
LTC PROPERTIES INC	145.000	4,611.000	
LXP INDUSTRIAL TRUST	978.000	8,391.240	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,020.000	8,928.400	
MID AMERICA	403.000	50,810.240	
NATIONAL HEALTH INVS INC	141.000	8,674.320	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	259.000	9,194.500	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	51.000	1,171.980	
NETSTREIT CORP	244.000	4,162.640	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	115.000	737.150	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	82.000	2,633.020	
NNN REIT INC	625.000	25,000.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	162.000	307.800	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	843.000	25,644.060	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	55.000	1,217.700	
ORION OFFICE REIT INC	193.000	609.880	
OUTFRONT MEDIA INC	498.000	7,385.340	
PARAMOUNT GROUP INC	682.000	3,116.740	
PARK HOTELS & RESORTS INC	727.000	11,741.050	
PEAKSTONE REALTY TRUST	131.000	1,687.280	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	401.000	5,866.630	
PHILLIPS EDISON & CO INC	412.000	13,604.240	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	456.000	2,964.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	155.000	3,151.150	
POSTAL REALTY TRUST INC	64.000	880.640	
POTLATCH CORP	267.000	10,997.730	
PROLOGIS INC	3,204.000	331,581.960	
PUBLIC STORAGE	544.000	141,646.720	
RAYONIER INC	509.000	15,448.150	
REALTY INCOME CORP	2,887.000	153,126.480	
REGENCY CENTERS CORP	623.000	36,364.510	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	436.000	5,354.080	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	725.000	30,986.500	
RLJ LODGING TRUST	523.000	5,773.920	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	200.000	20,886.000	

	SABRA HEALTH CARE REIT INC	781.000	10,668.460	
	SAFEHOLD INC	176.000	3,336.960	
	SAUL CENTERS INC	40.000	1,454.400	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	373.000	73,130.380	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	594.000	3,552.120	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,126.000	158,135.440	
	SITE CENTERS CORP	643.000	8,776.950	
	SL GREEN	219.000	10,858.020	
	STAG INDUSTRIAL INC	626.000	21,866.180	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	386.000	2,373.900	
	SUN COMMUNITIES INC	426.000	50,135.940	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	703.000	7,177.630	
	TANGER INC	358.000	9,547.860	
	TERRENO REALTY CORP	309.000	16,976.460	
	THE MACERICH COMPANY	729.000	11,146.410	
	UDR INC	1,139.000	41,459.600	
	UMH PROPERTIES INC	196.000	3,012.520	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	49.000	1,639.050	
	URBAN EDGE PROPERTIES	388.000	6,351.560	
	VENTAS INC	1,387.000	59,821.310	
	VERIS RESIDENTIAL INC	286.000	4,126.980	
	VICI PROPERTIES INC	3,590.000	100,125.100	
	VORNADO REALTY TRUST	613.000	15,993.170	
	WELLTOWER INC	1,924.000	175,699.680	
	WEYERHAEUSER CO	2,542.000	79,996.740	
	WHITESTONE REIT	166.000	1,862.520	
	WP CAREY INC	748.000	42,045.080	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	362.000	5,068.000	
	アメリカ・ドル 小計	84,272.000	4,017,234.780 (621,867,945)	
投資証券	合計	84,272	621,867,945 (621,867,945)	
合計			621,867,945 (621,867,945)	

(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)

- 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。
- 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。
- 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 137銘柄	99.26	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

「フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

財政状態計算書

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】

2024年4月30日現在

資産総額	4,761,538,907円
負債総額	1,077,461円
純資産総額（ - ）	4,760,461,446円
発行済数量	4,016,690,119口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1852円

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2024年4月30日現在

資産総額	1,623,275,733円
負債総額	23,010,000円
純資産総額（ - ）	1,600,265,733円
発行済数量	387,811,391口
1口当たり純資産額（ / ）	4.1264円

新光日本債券インデックスマザーファンド

2024年4月30日現在

資産総額	10,086,232,696円
負債総額	114,431,700円
純資産総額（ - ）	9,971,800,996円
発行済数量	8,284,786,420口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2036円

新光J-REITマザーファンド

2024年4月30日現在

資産総額	72,416,700,338円
負債総額	274,235,876円
純資産総額（ - ）	72,142,464,462円
発行済数量	32,590,402,673口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2136円

新光外国株式インデックスマザーファンド

2024年4月30日現在

資産総額	1,814,666,438円
負債総額	9,651,550円
純資産総額（ - ）	1,805,014,888円
発行済数量	311,076,050口
1口当たり純資産額（ / ）	5.8025円

海外国債マザーファンド

2024年4月30日現在

資産総額	14,144,924,720円
負債総額	37,279,788円
純資産総額（ - ）	14,107,644,932円
発行済数量	4,731,876,831口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9814円

新光米国REITマザーファンド

2024年4月30日現在

資産総額	649,092,133円
負債総額	0円
純資産総額(-)	649,092,133円
発行済数量	229,354,163口
1口当たり純資産額(/)	2.8301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(2024年4月30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(2024年4月30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。

2024年4月30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	1,538,010,385,518
追加型株式投資信託	783	16,619,961,032,858
単位型公社債投資信託	21	34,507,348,590
単位型株式投資信託	200	1,056,210,076,663
合計	1,030	19,248,688,843,629

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第39期事業年度(自2023年4月1日至2024年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	33,770	41,183
金銭の信託	29,184	28,143
未収委託者報酬	16,279	19,018
未収運用受託報酬	3,307	3,577
未収投資助言報酬	283	315
未収収益	15	6
前払費用	1,129	1,510
その他	2,377	2,088
流動資産計	86,346	95,843
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,127	1,093
建物	1 1,001	1 918
器具備品	1 118	1 130
リース資産	1 7	1 5
建設仮勘定	-	39
無形固定資産		
ソフトウェア	5,021	4,495
ソフトウェア仮勘定	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産		
投資有価証券	9,768	8,935
投資有価証券	182	184
関係会社株式	5,810	4,447
長期差入保証金	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

(単位:百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
(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	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
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	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	95,739		102,113	
運用受託報酬	16,150		17,155	
投資助言報酬	2,048		2,211	
その他営業収益	23		26	
営業収益計		113,962		121,507
営業費用				
支払手数料	41,073		44,366	
広告宣伝費	216		329	
公告費	0		0	
調査費	33,177		35,468	
調査費	12,294		13,277	
委託調査費	20,882		22,190	
委託計算費	548		558	
営業雑経費	733		823	
通信費	36		36	
印刷費	504		598	
協会費	69		65	
諸会費	29		44	
支払販売手数料	92		78	
営業費用計		75,749		81,545
一般管理費				
給料	10,484		10,763	
役員報酬	168		164	
給料・手当	9,199		9,425	
賞与	1,115		1,173	
交際費	17		34	
寄付金	11		15	
旅費交通費	128		162	
租税公課	330		489	
不動産賃借料	1,006		1,030	
退職給付費用	437		412	
固定資産減価償却費	1,388		1,567	
福利厚生費	47		46	
修繕費	1		1	
賞与引当金繰入額	1,730		1,927	
役員賞与引当金繰入額	48		52	
機器リース料	0		0	
事務委託費	4,074		3,379	
事務用消耗品費	37		46	
器具備品費	1		3	
諸経費	334		240	
一般管理費計		20,078		20,172
営業利益		18,135		19,788

（単位：百万円）

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）		第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		10		4
受取配当金	1	2,400	1	899
時効成立分配金・償還金		0		0
雑収入		10		18
時効後支払損引当金戻入額		24		35
営業外収益計		2,446		959
営業外費用				
為替差損		3		19
金銭の信託運用損		1,003		1,008
早期割増退職金		24		6
雑損失		47		0
営業外費用計		1,079		1,034
経常利益		19,502		19,712
特別利益				
投資有価証券売却益		4		-
特別利益計		4		-
特別損失				
固定資産除却損		12		6
投資有価証券売却損		9		-
関係会社株式評価損		584		1,362
減損損失		-	2	231
特別損失計		606		1,601
税引前当期純利益		18,900		18,111
法人税、住民税及び事業税		4,881		5,769
法人税等調整額		197		510
法人税等合計		5,078		5,258
当期純利益		13,821		12,852

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							11,040	11,040	11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	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	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			11,040
当期純利益			12,852
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	1,812
当期末残高	0	0	80,846

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、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 収益及び費用の計上基準

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**（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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
建物	523	630
器具備品	934	769
リース資産	1	3

（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38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）
受取配当金	2,393	895

2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

当社は、キャッシュ・フローを生み出す最小単位として、主として事業別に資産をグルーピングしております。当社の資産運用業に係るソフトウェア開発計画の大幅な延期に伴い、当該計画に係るソフトウェア仮勘定について、回収可能額まで減額し、当該減少額231百万円を減損損失として特別損失に計上いたしました。なお、当該資産の回収可能額は使用価値により測定しており、使用価値については、将来キャッシュ・フローが見込まれないため、備忘価額の1円として評価しております。

（株主資本等変動計算書関係）

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

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(予定)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					

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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
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

2024年6月17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(予定)日
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第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	-

第39期(2024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	28,143	28,143	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,145	28,145	-

(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	-	-

第39期(2024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	41,183	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,143	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	19,018	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,577	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	91,923	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 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,186	-	29,186

第39期（2024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	-	28,143	-	28,143
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,145	-	28,145

（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（預金・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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	180	182
関係会社株式		
非上場株式	5,810	4,447

（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38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円）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。

第39期（2024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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、有価証券について1,362百万円(関係会社株式1,362百万円)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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	191	246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	44	40
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	22	13
過去勤務費用の費用処理額	34	0
その他	4	4
確定給付制度に係る退職給付費用	334	307

(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24百万円、当事業年度において6百万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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.56%	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103百万円、当事業年度104百万円であります。

(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38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	121	195
未払事業所税	9	9
賞与引当金	529	590
未払法定福利費	94	98
運用受託報酬	390	351
資産除去債務	15	17
減価償却超過額(一括償却資産)	21	12
減価償却超過額	198	91
繰延資産償却超過額(税法上)	297	331
退職給付引当金	812	832
時効後支払損引当金	33	22
ゴルフ会員権評価損	7	6
関係会社株式評価損	345	761
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	-	70
その他	13	8
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	2,895	3,406
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,895	3,406

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38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	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 %	1.44 %
その他	0.06 %	0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.87 %	29.04 %

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	68,921百万円	60,761百万円
資産合計	68,921百万円	60,761百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	3,643百万円	1,957百万円
負債合計	3,643百万円	1,957百万円
純資産	65,278百万円	58,804百万円

(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	51,451百万円	47,640百万円
顧客関連資産	20,947百万円	17,109百万円

(2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,039百万円	7,649百万円
経常利益	8,039百万円	7,649百万円
税引前当期純利益	8,039百万円	7,649百万円
当期純利益	6,744百万円	6,474百万円
1株当たり当期純利益	168,617円97銭	161,850円28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	4,228百万円	3,837百万円

（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38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
委託者報酬	95,739百万円	102,113百万円
運用受託報酬	14,651百万円	15,156百万円
投資助言報酬	2,048百万円	2,211百万円
成功報酬（注）	1,499百万円	1,999百万円
その他営業収益	23百万円	26百万円
合計	113,962百万円	121,507百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、当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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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	8,140	未払 手数料	1,870
	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	16,655	未払 手数料	3,137

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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
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	13,821百万円	12,852百万円
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種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社の関連会社である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（2023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

2024年5月23日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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

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2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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

2024年6月21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 森重俊寛
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10月21日から2024年4月22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2024年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。