

【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】	2025年1月21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】	積木 利浩
【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】

2025年1月22日から2025年7月18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
		債券
	海外	不動産投信
追加型	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

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

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

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

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

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

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

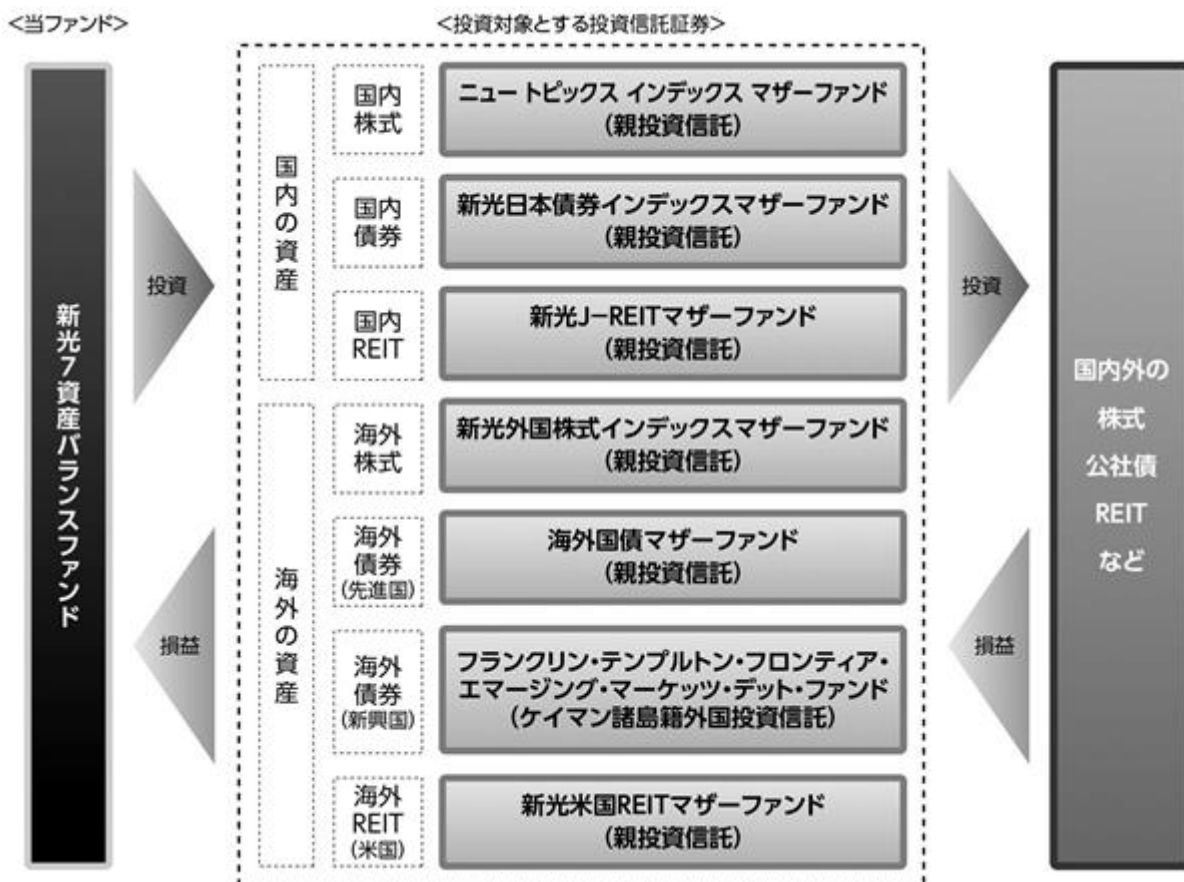
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



b. ファンドの特色

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

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

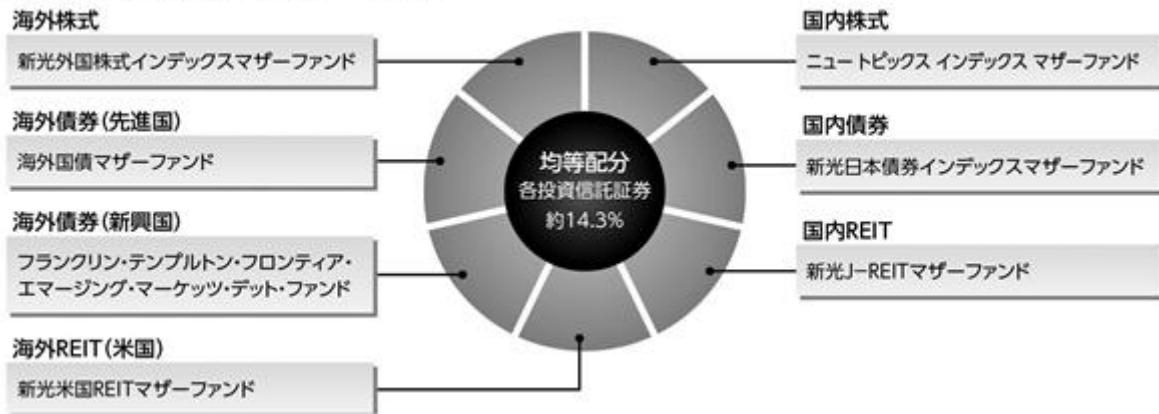


2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

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

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



■ 分配方針

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



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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

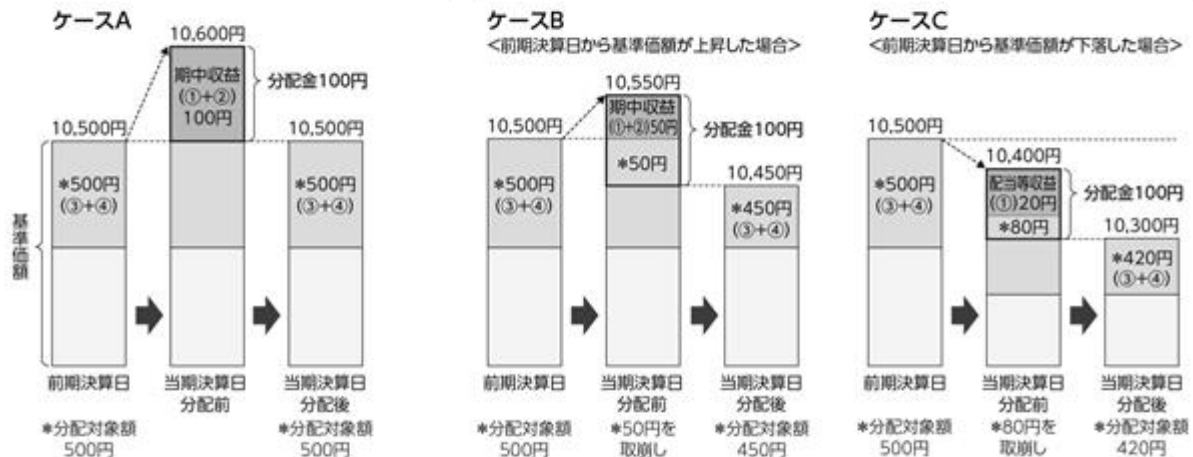
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

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

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

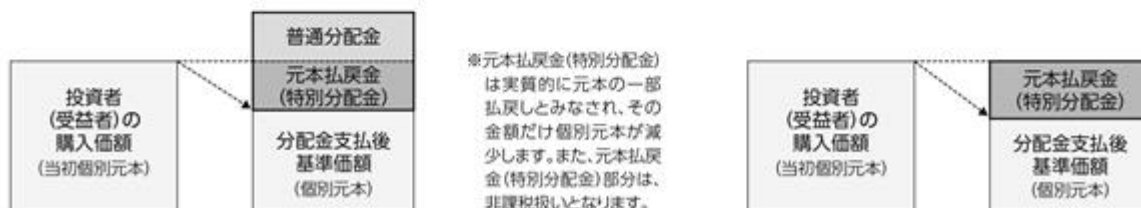
ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

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

◆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。

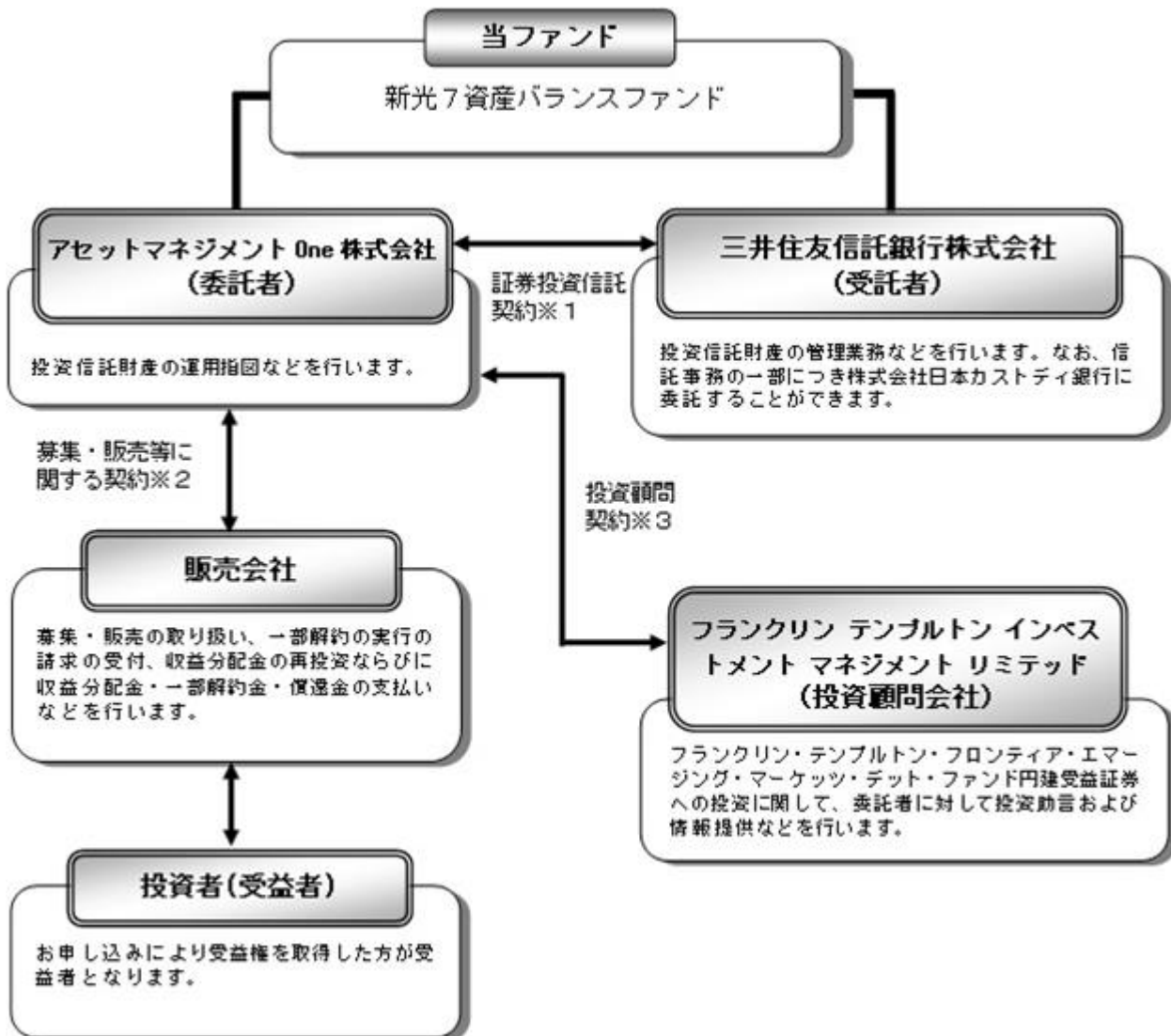
元本払戻金（特別分配金）: 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

(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

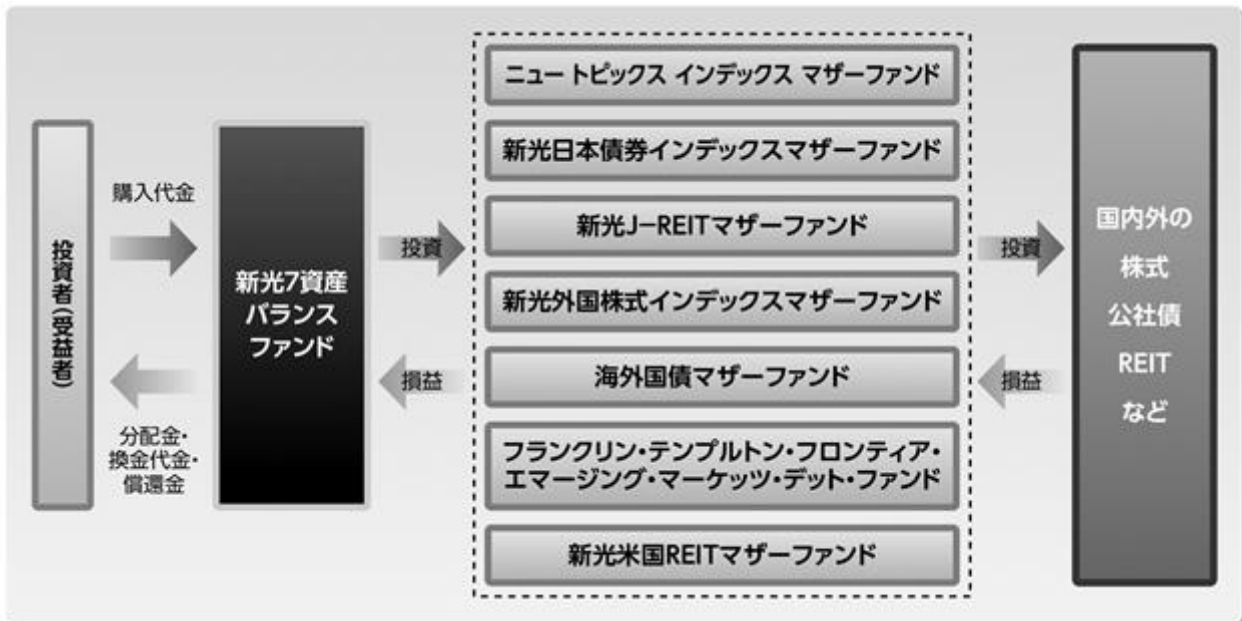
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

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10月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2024年10月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

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

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

（２）【投資対象】

a．投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

b．運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

8．コマーシャル・ペーパー

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

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

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ 東証株価指数(TOPIX)(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。 ・ わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)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(TOPIX)(配当込み)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(TOPIX)(配当込み)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(TOPIX)(配当込み)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(TOPIX)(配当込み)について

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

JPX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。

JPX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。

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

本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

JPX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。

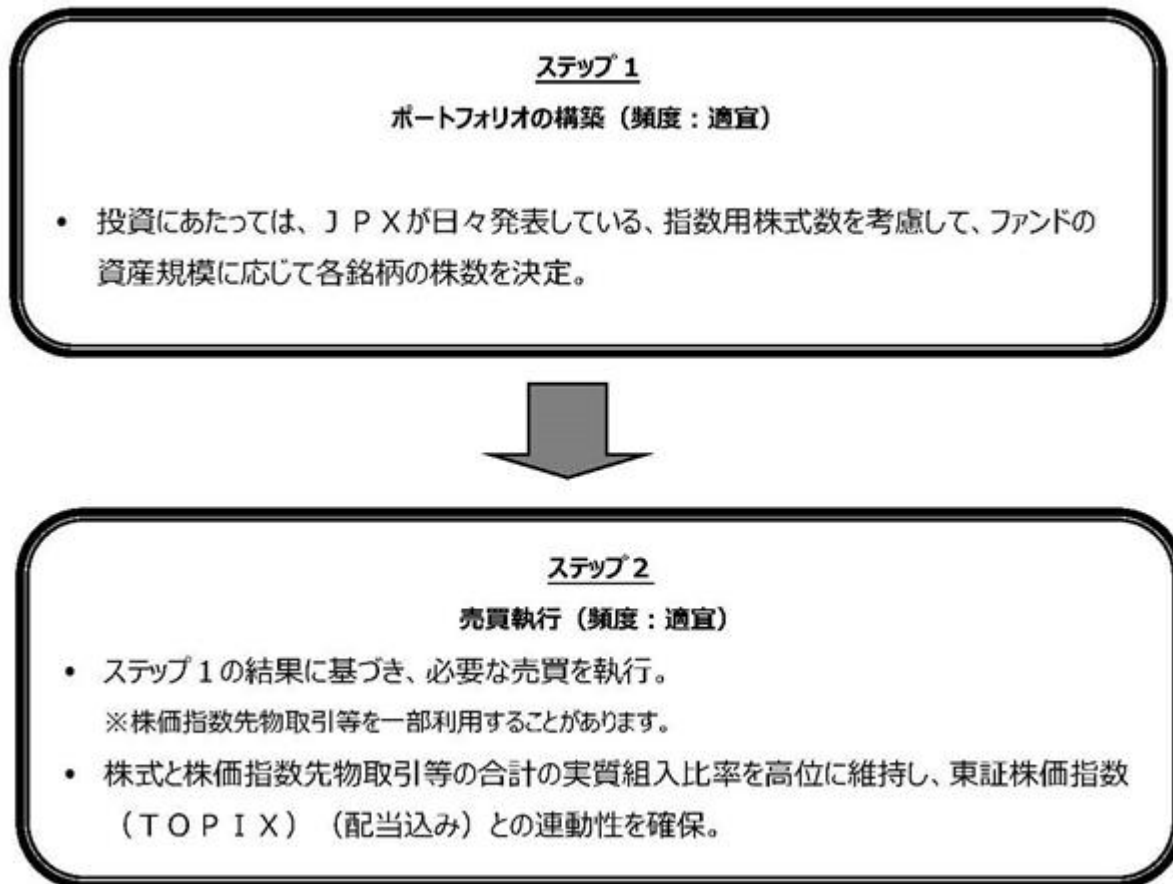
JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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

ニュー トピックス インデックス マザーファンドは、東証株価指数(TOPIX)(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、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東証株価指数(TOPIX)(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

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)(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。



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11月2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

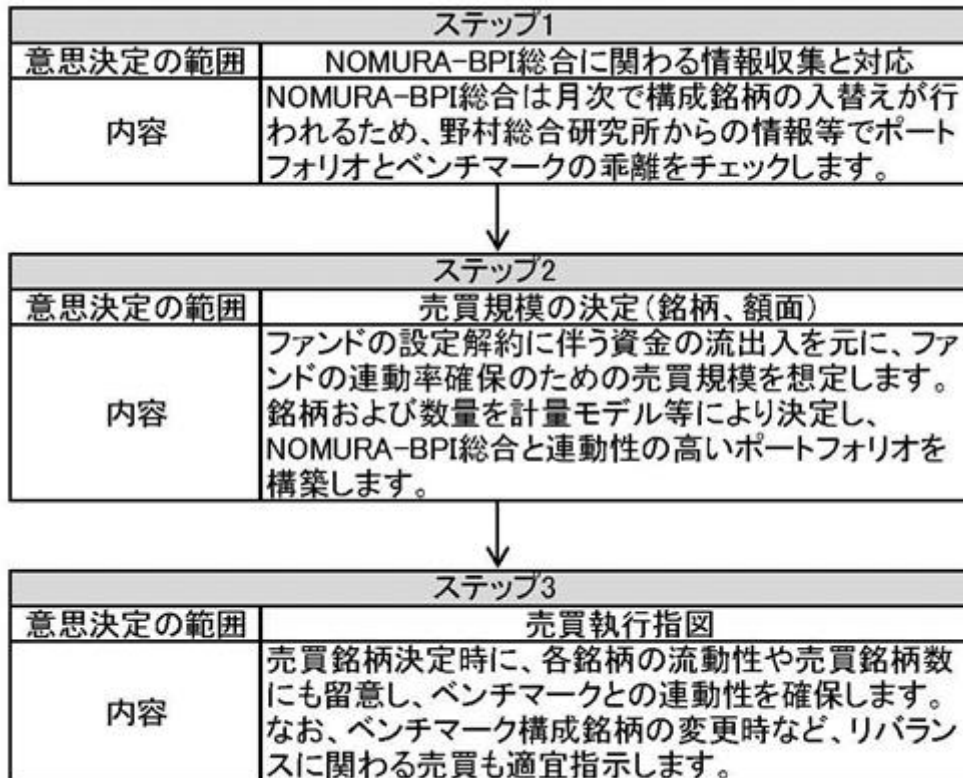
NOMURA - B P I 総合について

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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光J-REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・不動産投資信託証券の実質組入比率を調整するため、不動産投信指数先物取引を活用する場合があります。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）、不動産投信指数先物取引以外には投資を行いません。 ・不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができるものとします。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。 ・デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

東証REIT指数（配当込み）について

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

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

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

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

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

本件商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。

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

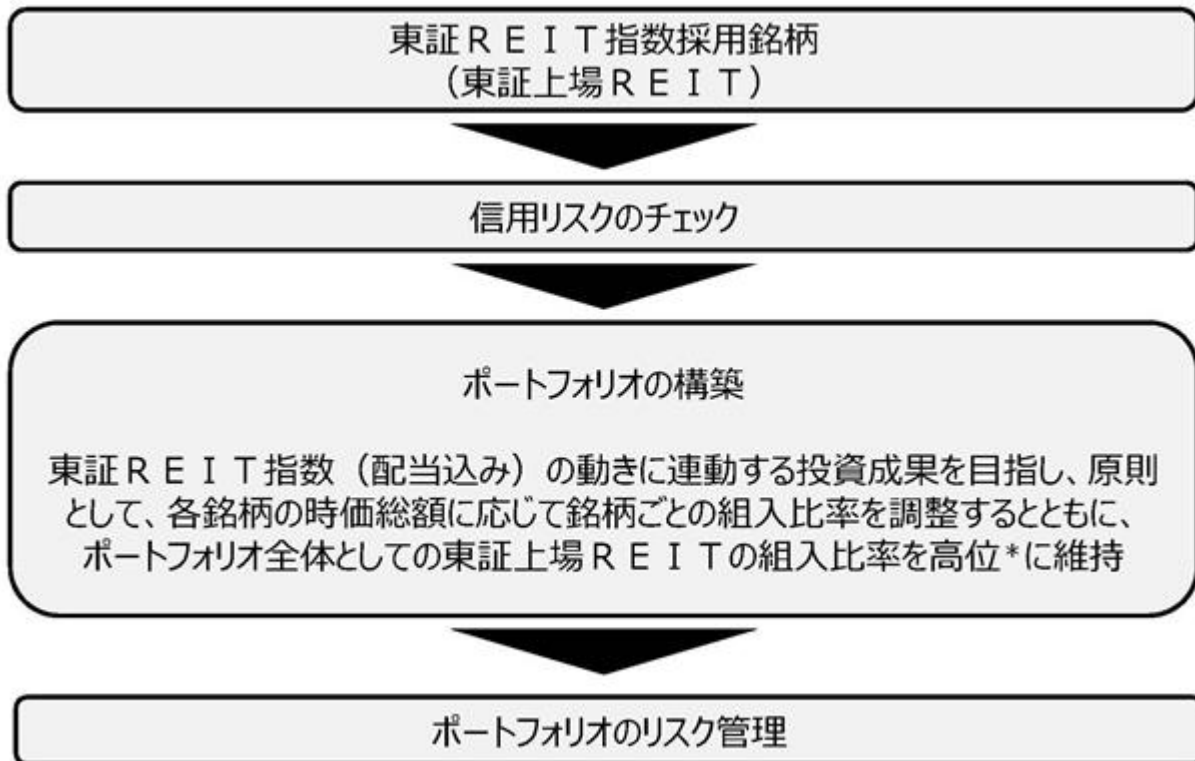
J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

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

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

運用プロセス

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



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

*不動産投信指数先物取引を一部利用することがあります。

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

運用プロセスは2024年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none">・主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、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（配当込み、円ベース）について

MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、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。

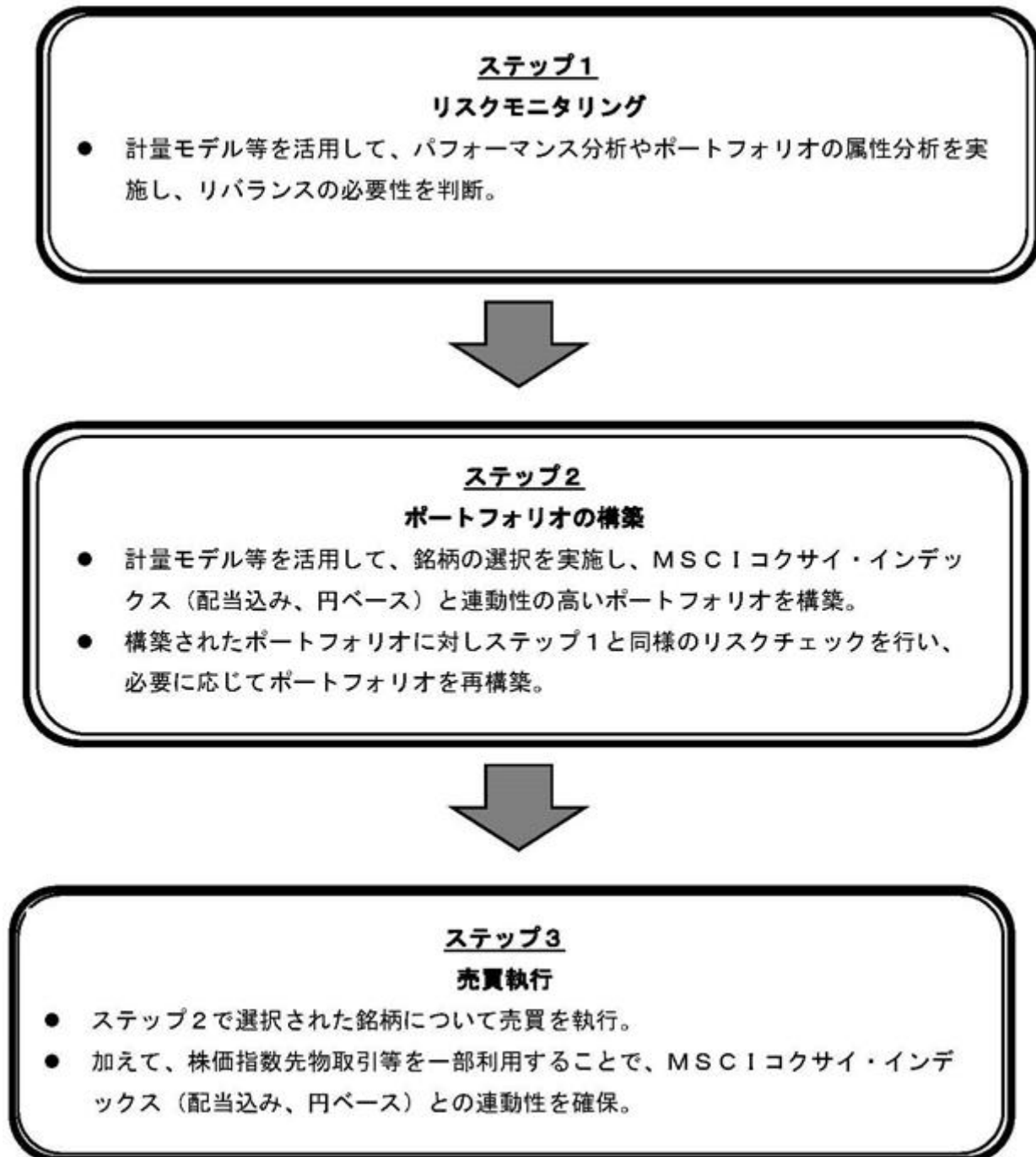
MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、アセットマネジメントOne株式会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、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（配当込み、円ベース）」に連動する投資成果をめざした運用を行います。



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2025年1月22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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

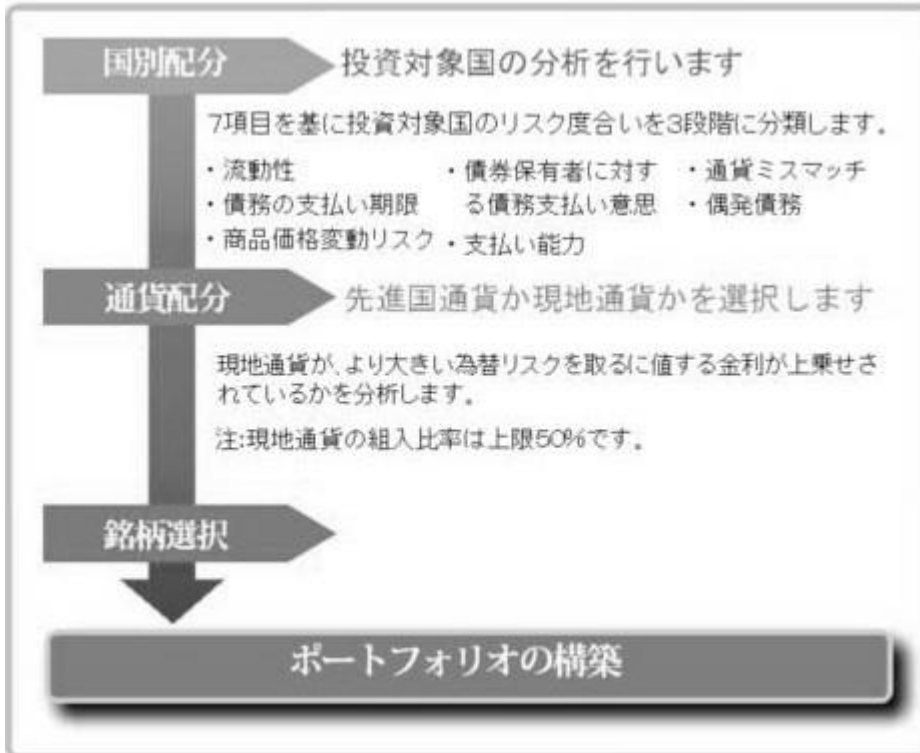
ファンド名	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・ 単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、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

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

フランクリン テンプレトン インベストメント マネジメント リミテッド (F T I M L 社) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン・テンプレトン (設立 : 1947年、運用総資産 : 約239.6兆円) の一員です。 F T I M L 社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2024年9月末現在、1米ドル = 142.73円で換算

運用プロセス



出所 : F T I M L 社資料を基にアセットマネジメントOne作成

運用プロセスは2024年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光米国REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none">・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックス（配当込み）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（配当込み）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（配当込み）について

FTSE NAREIT All Equity REITs インデックス（配当込み）（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。

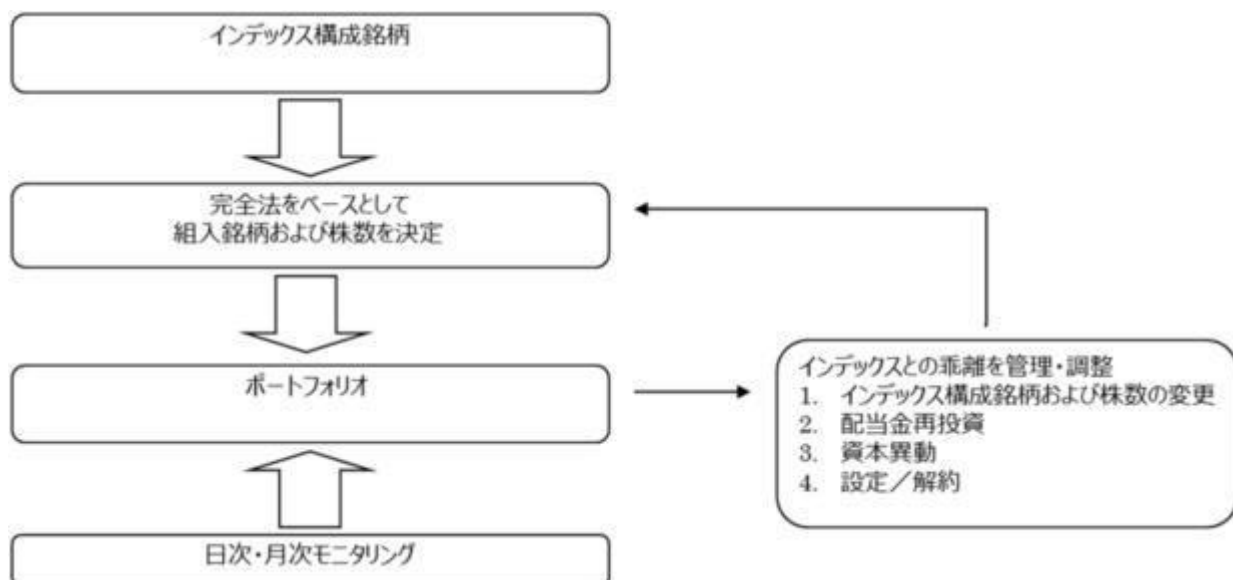
新光米国REITマザーファンド（以下「当マザーファンド」といいます。）は、アセットマネジメントOne株式会社によって単独で開発されたものです。当マザーファンドは、いかなる方法においても、FTSE、London Stock Exchange Group plcおよび、そのグループ企業（以下、総称して「LSE Group」といいます。）またはNareitによって出資、保証、販売または販売促進されることはありません。

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10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は2025年1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10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

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

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

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

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

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

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

(5) 【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c．公社債の借り入れ

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

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

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

(ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d．同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

e．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

f．外国為替予約の指図

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

g．資金の借り入れ

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

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

3【投資リスク】

（１）ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

a．資産配分リスク

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

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

b．株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

c．REITの価格変動リスク

REITの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

d．為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

e. カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

f. 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

g. 信用リスク

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

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

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

h. 流動性リスク

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

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

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

i. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

（ロ）当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が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。

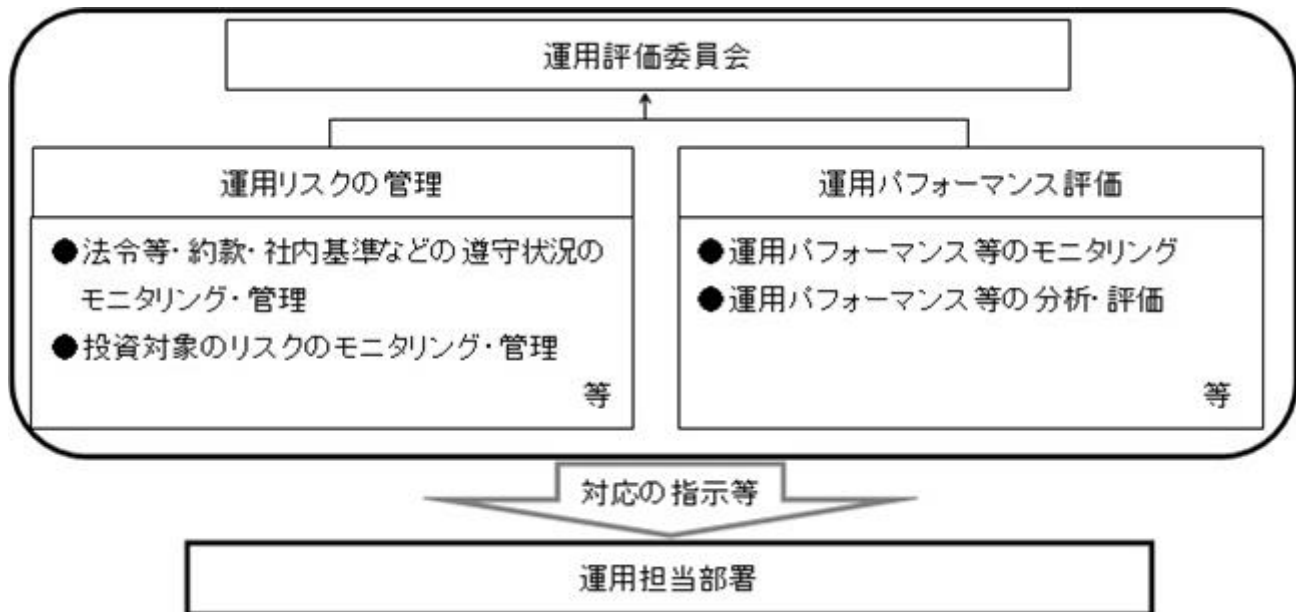
（ハ）有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

- (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。

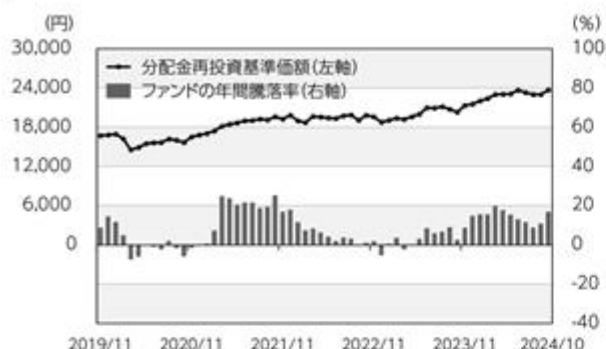


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

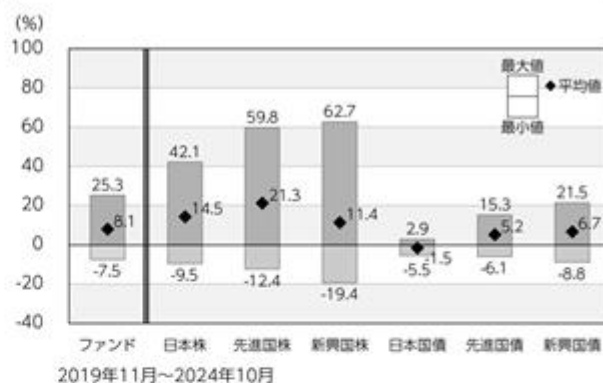
リスク管理体制は2024年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

*すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数 (TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、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・ディバースファイド (円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

<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 1375 1173"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円未満の部分</td> <td>年率0.42%</td> <td>年率0.45%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>300億円以上 500億円未満の部分</td> <td>年率0.37%</td> <td>年率0.50%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>500億円以上の部分</td> <td>年率0.32%</td> <td>年率0.55%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table> <p>委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド）に対する投資顧問報酬（投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうちファンドにおける保有分に対し年率0.05%）が含まれます。</p>	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）				各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社	300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%	300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%	500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%	主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）																									
各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社																						
300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%																						
300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%																						
500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%																						
主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価																						
投資対象とする外国投資信託	<p>フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865%</p> <p>当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</p>																								
実質的な負担	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.12365%（税抜1.02865%）程度</p> <p>上記は概算の数値です。実際の運用管理費用（信託報酬）は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。</p>																								

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

当ファンドは、少額投資非課税制度（NISA）の対象ではありません。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NISAの適用対象となります。

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10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
1.36%	1.04%	0.32%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2024年4月23日~2024年10月21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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	672,672,000	14.21
内 ケイマン諸島	672,672,000	14.21
親投資信託受益証券	3,924,408,563	82.89
内 日本	3,924,408,563	82.89
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	137,225,870	2.90
純資産総額	4,734,306,433	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,460,747,800	95.46
内 日本	1,460,747,800	95.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	69,467,664	4.54
純資産総額	1,530,215,464	100.00

その他資産の投資状況

2024年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	53,890,000	3.52
内 日本	53,890,000	3.52

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	8,916,591,300	86.33
内 日本	8,916,591,300	86.33
地方債証券	661,103,200	6.40
内 日本	661,103,200	6.40
特殊債券	502,297,000	4.86
内 日本	502,297,000	4.86
社債券	193,904,000	1.88
内 日本	193,904,000	1.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	54,205,812	0.52
純資産総額	10,328,101,312	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	61,850,421,534	96.68
内 日本	61,850,421,534	96.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,126,673,137	3.32
純資産総額	63,977,094,671	100.00

その他資産の投資状況

2024年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	2,006,290,000	3.14
内 日本	2,006,290,000	3.14

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,591,665,668	89.00
内 アメリカ	1,181,649,225	66.07
内 イギリス	57,947,852	3.24
内 カナダ	53,448,622	2.99
内 スイス	45,123,328	2.52
内 フランス	42,370,334	2.37
内 ドイツ	37,552,875	2.10
内 アイルランド	30,985,166	1.73
内 オーストラリア	28,581,710	1.60
内 オランダ	26,873,081	1.50
内 デンマーク	14,011,386	0.78
内 スウェーデン	13,462,657	0.75
内 スペイン	11,152,494	0.62
内 イタリア	9,209,009	0.51
内 香港	6,640,844	0.37
内 シンガポール	4,728,158	0.26
内 フィンランド	4,242,982	0.24
内 ジャージー	3,653,280	0.20
内 イスラエル	3,584,230	0.20
内 ベルギー	3,177,993	0.18
内 ノルウェー	2,396,047	0.13
内 ケイマン諸島	2,302,766	0.13
内 バミューダ	1,864,445	0.10
内 オランダ領キュラソー	1,424,957	0.08
内 リベリア	1,216,472	0.07
内 ニュージーランド	1,079,950	0.06
内 ルクセンブルグ	831,052	0.05
内 オーストリア	815,773	0.05
内 ポルトガル	673,449	0.04
内 パナマ	517,508	0.03
内 マン島	148,023	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		2,459,656	0.14
	内 オーストラリア	2,019,109	0.11
	内 シンガポール	440,547	0.02
投資証券		29,450,981	1.65
	内 アメリカ	27,915,248	1.56
	内 フランス	544,023	0.03
	内 イギリス	517,389	0.03
	内 香港	366,856	0.02
	内 ベルギー	55,371	0.00
	内 カナダ	52,094	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		164,786,311	9.21
純資産総額		1,788,362,616	100.00

その他資産の投資状況

2024年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	155,223,739	8.68
	内 アメリカ	89,910,128
	内 ドイツ	49,028,623
	内 イギリス	16,284,988

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	13,978,818,476	97.59
	内 アメリカ	5,813,505,747
	内 ドイツ	2,662,495,894
	内 イタリア	1,951,896,653
	内 フランス	1,314,379,815
	内 イギリス	1,175,076,618
	内 カナダ	1,061,463,749
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	345,545,716	2.41
純資産総額	14,324,364,192	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	692,035,204	99.11
	内 アメリカ	692,035,204
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,223,996	0.89
純資産総額	698,259,200	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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	新光外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	113,481,634	6.2217 706,060,030	6.3137 716,488,992	- -	15.13
2	新光米国REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	209,015,395	3.3123 692,342,594	3.3407 698,257,730	- -	14.75
3	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	3.0071 676,270,437	3.0391 683,444,228	- -	14.44
4	フランクリン・テンプレト ン・フロンティア・エマー ジング・マーケット・デッ ト・ファンド ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	323,400	2,038.0000 659,089,200	2,080.0000 672,672,000	- -	14.21
5	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	155,422,125	4.0756 633,453,954	4.1002 637,261,796	- -	13.46
6	新光日本債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	504,434,964	1.1971 603,909,538	1.1976 604,111,312	- -	12.76
7	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	2.1150 586,897,857	2.1077 584,844,505	- -	12.35

（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10月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	14.21
親投資信託受益証券	82.89
合計	97.10

（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10月31日現在

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

1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	20,800	2,890.70 60,126,582	2,682.50 55,796,000	- -	3.65
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	25,200	1,327.64 33,456,687	1,628.50 41,038,200	- -	2.68
3	日立製作所 日本	株式 電気機器	10,200	2,378.92 24,265,060	3,924.00 40,024,800	- -	2.62
4	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	13,700	2,882.92 39,496,116	2,723.50 37,311,950	- -	2.44
5	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	3,100	6,696.89 20,760,360	9,533.00 29,552,300	- -	1.93
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	400	66,970.00 26,788,000	69,780.00 27,912,000	- -	1.82
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	8,000	2,491.48 19,931,892	3,273.00 26,184,000	- -	1.71
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	7,900	2,551.54 20,157,223	2,835.50 22,400,450	- -	1.46
9	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	2,800	6,655.52 18,635,470	7,653.00 21,428,400	- -	1.40
10	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,800	3,956.85 15,036,039	5,568.00 21,158,400	- -	1.38
11	任天堂 日本	株式 その他製品	2,500	8,042.04 20,105,111	8,145.00 20,362,500	- -	1.33
12	信越化学工業 日本	株式 化学	3,500	5,810.71 20,337,509	5,755.00 20,142,500	- -	1.32
13	三井物産 日本	株式 卸売業	6,200	2,995.23 18,570,437	3,162.00 19,604,400	- -	1.28
14	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	2,000	6,727.45 13,454,912	9,498.00 18,996,000	- -	1.24
15	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	800	27,066.07 21,652,856	23,400.00 18,720,000	- -	1.22
16	第一三共 日本	株式 医薬品	3,700	4,623.90 17,108,448	4,981.00 18,429,700	- -	1.20
17	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	116,700	177.69 20,736,760	147.70 17,236,590	- -	1.13
18	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	5,100	2,604.06 13,280,732	3,212.00 16,381,200	- -	1.07
19	三菱重工業 日本	株式 機械	6,900	972.12 6,707,692	2,193.00 15,131,700	- -	0.99
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	3,500	4,307.97 15,077,921	4,264.00 14,924,000	- -	0.98
21	HOYA 日本	株式 精密機器	700	18,085.00 12,659,500	20,725.00 14,507,500	- -	0.95

22	本田技研工業	日本	株式 輸送用機器	9,300	1,580.60 14,699,654	1,557.50 14,484,750	- -	0.95
23	KDDI	日本	株式 情報・通信業	2,900	4,829.18 14,004,622	4,778.00 13,856,200	- -	0.91
24	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	62,700	188.44 11,815,461	192.80 12,088,560	- -	0.79
25	アドバンテスト	日本	株式 電気機器	1,200	5,338.90 6,406,684	9,148.00 10,977,600	- -	0.72
26	富士通	日本	株式 電気機器	3,600	2,134.76 7,685,158	2,963.00 10,666,800	- -	0.70
27	日本たばこ産業	日本	株式 食料品	2,400	3,855.06 9,252,148	4,281.00 10,274,400	- -	0.67
28	キヤノン	日本	株式 電気機器	2,000	3,857.03 7,714,069	5,004.00 10,008,000	- -	0.65
29	ファーストリテイリング	日本	株式 小売業	200	38,940.00 7,788,000	49,520.00 9,904,000	- -	0.65
30	セブン&アイ・ホールディングス	日本	株式 小売業	4,500	1,941.34 8,736,031	2,199.00 9,895,500	- -	0.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年10月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.46
合計	95.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.18
銀行業		7.57
輸送用機器		7.29
情報・通信業		6.98
卸売業		6.68
機械		5.24
化学		5.24
医薬品		4.78
サービス業		4.70
小売業		4.02
保険業		3.14
食料品		3.13
その他製品		2.43
精密機器		2.41
陸運業		2.19
建設業		1.96
不動産業		1.74

電気・ガス業	1.35
その他金融業	1.13
非鉄金属	0.79
証券、商品先物取引業	0.78
鉄鋼	0.76
海運業	0.65
ゴム製品	0.55
石油・石炭製品	0.52
ガラス・土石製品	0.52
金属製品	0.48
繊維製品	0.38
空運業	0.34
鉱業	0.24
パルプ・紙	0.11
倉庫・運輸関連業	0.10
水産・農林業	0.08
合計	95.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

新光日本債券インデックスマザーファンド

2024年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	147回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	120,000,000	99.74 119,690,400	99.51 119,422,800	0.005 2026/3/20	1.16
2	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	120,000,000	98.75 118,507,200	98.66 118,392,000	0.1 2028/6/20	1.15
3	375回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	110,000,000	101.84 112,030,000	101.81 111,999,800	1.1 2034/6/20	1.08
4	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	107.34 107,344,000	2.1 2029/12/28	1.04
5	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	106.87 106,870,000	2.22 2029/3/19	1.03
6	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	100.47 100,474,000	0.781 2030/12/6	0.97
7	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	99.74 99,746,000	0.195 2025/12/19	0.97
8	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	99.35 99,357,000	0.06 2026/3/18	0.96
9	374回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	100,000,000	97.71 97,714,700	99.34 99,349,000	0.8 2034/3/20	0.96

10	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	99.21 99,217,000	0.205 2027/4/23	0.96
11	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	98.98 98,982,000	0.17 2027/10/29	0.96
12	11回 プリヂストーン社債 日本	社債券	100,000,000	99.01 99,013,000	98.94 98,940,000	0.295 2027/4/21	0.96
13	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	100,000,000	99.14 99,149,000	98.93 98,933,000	0.1 2027/12/20	0.96
14	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	98.88 98,885,000	0.001 2026/12/25	0.96
15	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	100,000,000	98.95 98,952,800	98.80 98,801,000	0.1 2028/3/20	0.96
16	250回 住宅金融支援機 構 日本	特殊債 券	100,000,000	98.45 98,459,000	98.51 98,516,000	0.289 2028/11/20	0.95
17	147回 高速道路機構債 日本	特殊債 券	100,000,000	97.83 97,832,000	98.09 98,098,000	0.955 2034/12/20	0.95
18	373回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	100,000,000	98.69 98,690,000	97.88 97,880,000	0.6 2033/12/20	0.95
19	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	95.82 95,821,000	0.145 2031/10/29	0.93
20	494回 九州電力社債 日本	社債券	100,000,000	93.16 93,165,000	94.96 94,964,000	0.31 2031/5/23	0.92
21	372回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	90,000,000	100.77 90,701,700	99.91 89,925,300	0.8 2033/9/20	0.87
22	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	90,000,000	100.03 90,027,000	99.75 89,781,300	0.1 2025/12/20	0.87
23	148回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	90,000,000	99.65 89,685,000	99.35 89,423,100	0.005 2026/6/20	0.87
24	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	90,000,000	97.91 88,127,300	98.15 88,342,200	0.5 2032/12/20	0.86
25	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	90,000,000	95.62 86,063,200	96.40 86,766,300	0.1 2031/9/20	0.84
26	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	80,000,000	99.81 79,852,000	99.41 79,528,000	0.1 2026/9/20	0.77
27	149回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	80,000,000	99.54 79,636,000	99.23 79,386,400	0.005 2026/9/20	0.77

28	150回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	80,000,000	99.42 79,536,000	99.12 79,297,600	0.005 2026/12/20	0.77
29	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	80,000,000	99.31 79,448,000	99.04 79,236,000	0.1 2027/9/20	0.77
30	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	80,000,000	99.06 79,250,900	98.90 79,124,800	0.005 2027/6/20	0.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	86.33
地方債証券	6.40
特殊債券	4.86
社債券	1.88
合計	99.48

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	36,993	129,505.87 4,790,810,687	130,500.00 4,827,586,500	- -	7.55
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	6,515	560,999.86 3,654,914,103	554,000.00 3,609,310,000	- -	5.64
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	32,886	94,896.87 3,120,778,693	93,400.00 3,071,552,400	- -	4.80
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	20,302	144,894.16 2,941,641,355	144,000.00 2,923,488,000	- -	4.57
5	GLP投資法人 日本	投資証券	21,303	133,206.15 2,837,690,807	134,100.00 2,856,732,300	- -	4.47
6	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	11,048	242,404.86 2,678,088,902	245,000.00 2,706,760,000	- -	4.23
7	KDX不動産投資法人 日本	投資証券	17,743	149,189.12 2,647,062,578	145,100.00 2,574,509,300	- -	4.02
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	9,511	229,211.82 2,180,033,689	232,100.00 2,207,503,100	- -	3.45
9	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	34,943	61,403.07 2,145,607,600	62,300.00 2,176,948,900	- -	3.40

10	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	12,637	154,109.83 1,947,485,941	157,300.00 1,987,800,100	- -	3.11
11	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	14,187	136,999.03 1,943,605,326	136,700.00 1,939,362,900	- -	3.03
12	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	6,233	312,982.28 1,950,818,579	306,000.00 1,907,298,000	- -	2.98
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	23,300	70,798.43 1,649,603,616	70,500.00 1,642,650,000	- -	2.57
14	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	4,337	337,998.30 1,465,898,628	335,000.00 1,452,895,000	- -	2.27
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	19,058	74,893.17 1,427,314,132	72,500.00 1,381,705,000	- -	2.16
16	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	11,612	115,899.04 1,345,819,674	115,200.00 1,337,702,400	- -	2.09
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	2,190	609,015.81 1,333,744,641	610,000.00 1,335,900,000	- -	2.09
18	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	8,120	145,299.04 1,179,828,214	145,000.00 1,177,400,000	- -	1.84
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	4,261	272,306.33 1,160,297,296	272,900.00 1,162,826,900	- -	1.82
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	10,587	103,241.64 1,093,019,318	101,500.00 1,074,580,500	- -	1.68
21	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	3,083	327,995.54 1,011,210,269	325,000.00 1,001,975,000	- -	1.57
22	イオンリート投資法人 日本	投資証券	7,780	129,295.34 1,005,917,773	127,400.00 991,172,000	- -	1.55
23	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	3,211	304,485.91 977,704,289	298,900.00 959,767,900	- -	1.50
24	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	2,353	409,479.50 963,505,282	404,000.00 950,612,000	- -	1.49
25	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	7,458	127,899.66 953,875,666	126,800.00 945,674,400	- -	1.48
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	9,367	93,097.50 872,044,298	91,600.00 858,017,200	- -	1.34
27	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	2,628	301,996.88 793,647,811	301,000.00 791,028,000	- -	1.24
28	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	2,190	358,988.72 786,185,312	356,000.00 779,640,000	- -	1.22

29	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	12,225	62,697.18 766,473,132	61,500.00 751,837,500	- -	1.18
30	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	5,604	133,394.51 747,542,838	132,000.00 739,728,000	- -	1.16

（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10月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	96.68
合計	96.68

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	3,947	7,213.28 28,470,848	21,407.42 84,495,123	- -	4.72
2	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,337	28,025.47 65,495,528	35,352.56 82,618,942	- -	4.62
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,133	55,422.55 62,793,752	66,453.90 75,292,279	- -	4.21
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,502	21,609.73 32,457,828	29,611.03 44,475,777	- -	2.49
5	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	351	49,258.70 17,289,806	90,924.15 31,914,377	- -	1.78
6	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	941	20,095.08 18,909,471	26,804.03 25,222,596	- -	1.41

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	810	20,232.85 16,388,609	27,062.14 21,920,341	- -	1.23
8	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	709	14,020.20 9,940,323	27,138.96 19,241,529	- -	1.08
9	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	460	32,294.62 14,855,528	39,569.98 18,202,191	- -	1.02
10	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	130	90,850.17 11,810,523	130,106.95 16,913,904	- -	0.95
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	461	22,168.71 10,219,777	34,478.35 15,894,520	- -	0.89
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	213	53,494.37 11,394,301	69,900.05 14,888,711	- -	0.83
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	720	15,765.96 11,351,496	17,928.25 12,908,341	- -	0.72
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	148	82,811.95 12,256,170	86,493.16 12,800,989	- -	0.72
15	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	252	37,125.56 9,355,643	44,580.17 11,234,205	- -	0.63
16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	133	59,606.17 7,927,621	78,923.33 10,496,803	- -	0.59
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	379	23,099.77 8,754,814	25,528.82 9,675,423	- -	0.54
18	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	71	86,540.78 6,144,396	135,063.38 9,589,500	- -	0.54
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	159	44,228.34 7,032,307	60,306.76 9,588,776	- -	0.54
20	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	387	22,649.60 8,765,398	24,676.11 9,549,658	- -	0.53

21	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	515	15,544.42 8,005,378	17,243.02 8,880,157	- -	0.50
22	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・ 小売り	710	8,394.88 5,960,371	12,504.75 8,878,379	- -	0.50
23	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	282	21,208.46 5,980,787	30,958.45 8,730,285	- -	0.49
24	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	69	66,856.43 4,613,094	115,804.60 7,990,518	- -	0.45
25	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,126	4,229.70 4,762,652	6,500.50 7,319,572	- -	0.41
26	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	265	17,245.03 4,569,934	26,819.39 7,107,140	- -	0.40
27	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	155	32,265.93 5,001,220	45,538.89 7,058,528	- -	0.39
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	64	100,621.54 6,439,779	105,706.81 6,765,236	- -	0.38
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	662	8,705.24 5,762,870	10,127.94 6,704,702	- -	0.37
30	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	406	15,729.66 6,386,243	16,106.07 6,539,068	- -	0.37

（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10月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	89.00
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.14
投資証券	1.65
合計	90.79

（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10月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
半導体・半導体製造装置	外国	8.56
ソフトウェア		7.92
銀行		5.16
コンピュータ・周辺機器		4.91
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.54
医薬品		4.26
石油・ガス・消耗燃料		3.55
資本市場		3.13

大規模小売り	2.89
金融サービス	2.86
保険	2.83
ヘルスケア機器・用品	1.94
航空宇宙・防衛	1.84
ホテル・レストラン・レジャー	1.76
機械	1.65
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.61
バイオテクノロジー	1.60
生活必需品流通・小売り	1.59
化学	1.51
電力	1.50
専門小売り	1.46
自動車	1.46
飲料	1.20
金属・鉱業	1.16
情報技術サービス	1.13
電気設備	1.03
食品	1.00
娯楽	0.98
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.93
陸上運輸	0.91
家庭用品	0.90
専門サービス	0.89
各種電気通信サービス	0.85
繊維・アパレル・贅沢品	0.83
通信機器	0.67
総合公益事業	0.66
建設関連製品	0.61
商業サービス・用品	0.56
コングロマリット	0.55
タバコ	0.54
メディア	0.51
パーソナルケア用品	0.49
電子装置・機器・部品	0.45
商社・流通業	0.44
消費者金融	0.40
航空貨物・物流サービス	0.38
建設資材	0.31
建設・土木	0.29
不動産管理・開発	0.27
家庭用耐久財	0.26
無線通信サービス	0.21
容器・包装	0.20
エネルギー設備・サービス	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13
自動車用部品	0.08
水道	0.08
運送インフラ	0.08
ガス	0.07

紙製品・林産品	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
販売	0.05
旅客航空輸送	0.04
海上運輸	0.03
各種消費者サービス	0.01
レジャー用品	0.00
合計	89.00

（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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,404,269,600	89.96 1,263,374,100	91.29 1,282,026,834	2.875 2032/5/15	8.95
2	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証 券	952,568,000	93.76 893,194,368	94.80 903,079,119	3.5 2033/2/15	6.30
3	ITALY BTPS 4.2 03/01/34 イタリア	国債証 券	716,939,000	103.41 741,443,141	105.83 758,808,237	4.2 2034/3/1	5.30
4	DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 ドイツ	国債証 券	741,948,500	99.17 735,844,514	100.00 741,970,758	2.3 2033/2/15	5.18
5	DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34 ドイツ	国債証 券	723,608,200	99.09 717,075,418	98.75 714,620,986	2.2 2034/2/15	4.99
6	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証 券	629,924,000	103.58 652,532,487	101.72 640,800,028	4.5 2033/11/15	4.47
7	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証 券	660,652,000	99.01 654,171,003	96.78 639,438,872	3.875 2034/8/15	4.46
8	ITALY BTPS 4.4 05/01/33 イタリア	国債証 券	583,555,000	102.88 600,365,602	107.72 628,663,801	4.4 2033/5/1	4.39
9	FRANCE OAT 3.5 11/25/33 フランス	国債証 券	583,555,000	104.27 608,478,467	103.59 604,539,637	3.5 2033/11/25	4.22
10	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証 券	599,196,000	95.67 573,307,833	97.17 582,296,803	3.875 2033/8/15	4.07
11	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	645,288,000	80.41 518,921,250	85.35 550,763,386	1.875 2032/2/15	3.84
12	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証 券	531,594,400	89.48 475,693,925	93.75 498,390,512	3.375 2033/5/15	3.48
13	DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33 ドイツ	国債証 券	483,517,000	100.08 483,929,823	102.16 493,980,307	2.6 2033/8/15	3.45
14	CANADA 3.25 12/01/33 カナダ	国債証 券	386,295,000	97.56 376,879,494	100.08 386,629,604	3.25 2033/12/1	2.70
15	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証 券	384,100,000	98.33 377,708,336	97.91 376,087,912	4 2034/2/15	2.63
16	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証 券	338,008,000	104.83 354,353,856	100.77 340,622,281	4.375 2034/5/15	2.38
17	ITALY BTPS 0.95 06/01/32 イタリア	国債証 券	386,813,600	76.07 294,260,109	84.77 327,940,570	0.95 2032/6/1	2.29

18	FRANCE OAT 2.0 11/25/32 フランス	国債証券	333,460,000	90.16 300,654,705	93.19 310,759,043	2 2032/11/25	2.17
19	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 ドイツ	国債証券	316,787,000	82.72 262,064,880	85.10 269,611,079	- 2032/2/15	1.88
20	UK TREASURY 4.25 06/07/32 イギリス	国債証券	252,742,700	101.59 256,768,732	100.40 253,768,835	4.25 2032/6/7	1.77
21	FRANCE OAT 3.0 05/25/33 フランス	国債証券	250,095,000	99.32 248,407,692	99.96 250,014,969	3 2033/5/25	1.75
22	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 ドイツ	国債証券	266,768,000	84.91 226,534,050	86.19 229,930,006	- 2031/8/15	1.61
23	CANADA 1.5 12/01/31 カナダ	国債証券	247,228,800	84.56 209,069,040	89.44 221,145,972	1.5 2031/12/1	1.54
24	DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34 ドイツ	国債証券	208,412,500	103.42 215,558,964	101.90 212,382,758	2.6 2034/8/15	1.48
25	UK TREASURY 4.625 01/31/34 イギリス	国債証券	179,109,000	104.94 187,962,954	102.18 183,024,322	4.625 2034/1/31	1.28
26	UK TREASURY 3.25 01/31/33 イギリス	国債証券	187,069,400	94.06 175,975,547	92.86 173,723,869	3.25 2033/1/31	1.21
27	CANADA 2.5 12/01/32 カナダ	国債証券	176,592,000	88.97 157,124,552	94.97 167,714,208	2.5 2032/12/1	1.17
28	UK TREASURY 0.875 07/31/33 イギリス	国債証券	218,911,000	75.80 165,953,443	75.36 164,977,021	0.875 2033/7/31	1.15
29	UK TREASURY 0.25 07/31/31 イギリス	国債証券	204,980,300	77.56 158,998,939	77.41 158,695,543	0.25 2031/7/31	1.11
30	UK TREASURY 4.25 07/31/34 イギリス	国債証券	159,208,000	102.76 163,603,732	99.17 157,887,966	4.25 2034/7/31	1.10

（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10月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.59
合計	97.59

（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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	2,917	18,820.89 54,900,565	17,802.26 51,929,212	- -	7.44
2	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券	1,474	34,768.73 51,249,110	32,799.06 48,345,825	- -	6.92
3	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	299	137,538.52 41,124,019	139,846.20 41,814,014	- -	5.99

4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証 券	1,903	20,317.35 38,663,923	21,271.45 40,479,584	- -	5.80
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	1,019	25,408.98 25,891,753	27,988.59 28,520,382	- -	4.08
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証 券	1,021	27,181.98 27,752,810	26,438.37 26,993,576	- -	3.87
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証 券	499	53,101.05 26,497,427	51,596.91 25,746,863	- -	3.69
8	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証 券	2,750	9,942.04 27,340,622	9,292.14 25,553,404	- -	3.66
9	CROWN CASTLE INC アメリカ	投資証 券	1,372	17,266.06 23,689,038	16,563.92 22,725,709	- -	3.25
10	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証 券	919	19,321.76 17,756,703	19,610.60 18,022,150	- -	2.58
11	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	660	26,315.45 17,368,203	25,310.65 16,705,031	- -	2.39
12	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	3,290	5,099.31 16,776,735	4,981.00 16,387,518	- -	2.35
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	448	34,897.78 15,634,209	34,993.04 15,676,884	- -	2.25
14	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	1,192	11,619.79 13,850,793	11,361.67 13,543,120	- -	1.94
15	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	1,272	10,071.10 12,810,441	10,213.98 12,992,191	- -	1.86
16	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証 券	339	38,021.28 12,889,217	35,626.04 12,077,228	- -	1.73
17	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証 券	2,300	5,079.33 11,682,478	4,873.46 11,208,959	- -	1.61
18	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	1,931	5,243.73 10,125,648	5,105.45 9,858,637	- -	1.41
19	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証 券	547	18,711.81 10,235,363	17,424.31 9,531,098	- -	1.36
20	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	201	45,554.25 9,156,406	45,173.22 9,079,819	- -	1.30
21	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	366	23,751.20 8,692,941	23,376.32 8,555,735	- -	1.23
22	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	389	20,924.23 8,139,526	20,417.21 7,942,298	- -	1.14
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	2,204	3,478.40 7,666,414	3,490.70 7,693,504	- -	1.10
24	KIMCO REALTY アメリカ	投資証 券	2,078	3,782.61 7,860,277	3,690.43 7,668,719	- -	1.10
25	UDR INC アメリカ	投資証 券	1,036	6,878.46 7,126,087	6,691.02 6,931,898	- -	0.99
26	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証 券	580	11,149.65 6,466,799	11,169.62 6,478,384	- -	0.93
27	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	822	7,909.38 6,501,516	7,801.83 6,413,111	- -	0.92

28	BXP INC アメリカ	投資証券	493	13,784.58 6,795,798	12,713.70 6,267,859	- -	0.90
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	581	10,750.18 6,245,860	10,770.16 6,257,465	- -	0.90
30	AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ	投資証券	1,065	5,856.75 6,237,445	5,638.58 6,005,096	- -	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10月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	99.11
合計	99.11

（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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0612月	買建	2	52,600,660	53,890,000	3.52

（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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0612月	買建	1,196	2,014,064,000	2,006,290,000	3.14

（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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec24	買建	2	87,562,508	89,910,128	5.03
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec24	買建	6	49,641,356	49,028,623	2.74
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec24	買建	1	16,477,032	16,284,988	0.91

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第36特定期間末 (2024年10月21日)	4,697	4,705	1.1988	1.2008
2023年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	-
5月末日	4,738	-	1.1851	-
6月末日	4,837	-	1.2134	-
7月末日	4,731	-	1.1932	-
8月末日	4,651	-	1.1757	-
9月末日	4,613	-	1.1737	-
10月末日	4,734	-	1.2084	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
--	--------------

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
第36特定期間	0.0120

【収益率の推移】

	収益率（％）
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
第36特定期間	4.5

（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

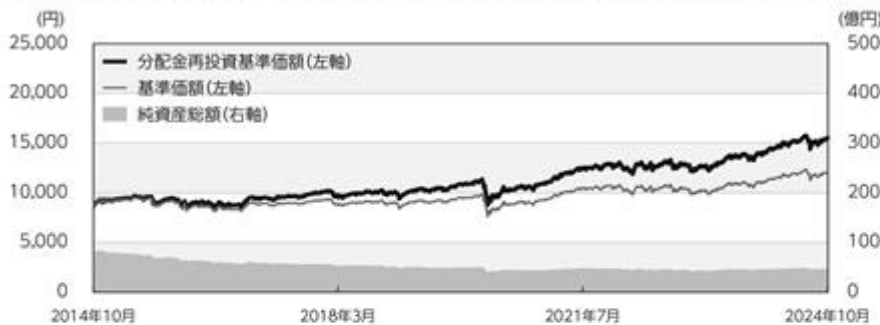
第18特定期間	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	5,348,676	374,412,075
第22特定期間	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	45,095,213	164,575,560
第24特定期間	4,817,074	285,434,876
第25特定期間	13,966,043	287,993,351
第26特定期間	34,127,005	222,623,381
第27特定期間	9,232,953	232,290,245
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
第36特定期間	3,595,527	101,097,604

(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10月31日

基準価額・純資産の推移 (2014年10月31日～2024年10月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

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

(設定日:2006年10月31日)

分配の推移(税引前)

2024年 6月	20円
2024年 7月	20円
2024年 8月	20円
2024年 9月	20円
2024年10月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	5,360円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	新光外国株式インデックスマザーファンド	15.13
2	新光米国REITマザーファンド	14.75
3	海外国債マザーファンド	14.44
4	フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	14.21
5	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	13.46
6	新光日本債券インデックスマザーファンド	12.76
7	新光J-REITマザーファンド	12.35

■ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.65
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.68
3	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.62
4	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.44
5	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.93

■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	147回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/3/20	1.16
2	351回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/6/20	1.15
3	375回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.1	2034/6/20	1.08
4	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	1.04
5	18回 東京都公債 20年	地方債証券	日本	2.22	2029/3/19	1.03

■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	7.55
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.64
3	日本都市ファンド投資法人	日本	4.80
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.57
5	GLP投資法人	日本	4.47

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2024年10月31日

■新光外国株式インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.72
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.62
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.21
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.49
5	META PLATFORMS INC	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	1.78

■海外国債マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	8.95
2	US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	アメリカ	3.5	2033/2/15	6.30
3	ITALY BTPS 4.2 03/01/34	国債証券	イタリア	4.2	2034/3/1	5.30
4	DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	ドイツ	2.3	2033/2/15	5.18
5	DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	国債証券	ドイツ	2.2	2034/2/15	4.99

■フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド(現地2024年10月14日現在)

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

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

①組入公社債の上位5通貨

順位	通貨	比率(%)
1	米ドル	55.5
2	ユーロ	6.8
3	メキシコペソ	4.9
4	南アフリカランド	4.2
5	ブラジルレアル	3.3

②組入公社債の上位5カ国

順位	国/地域	比率(%)
1	その他	10.2
2	南アフリカ	7.2
3	メキシコ	7.0
4	カザフスタン	5.2
5	コロンビア	4.8

■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	7.44
2	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	6.92
3	EQUINIX INC	アメリカ	5.99
4	WELLTOWER INC	アメリカ	5.80
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	4.08

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30分までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

ただし、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。

受付は原則として営業日の午後3時30分までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日の受付となります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

b. 投資信託約款の変更

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

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

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

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d. 運用報告書

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

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

e. 公告

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

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

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

f. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g. 信託事務処理の再信託

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

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

h. 信託業務の委託等

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

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

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

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

1. 投資信託財産の保存にかかる業務

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

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

4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

i. 関係法人との契約の更改

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

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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(2024年4月23日から2024年10月21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 2024年4月22日現在	当期 2024年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	101,691,061	153,365,853
投資信託受益証券	695,973,000	659,089,200
親投資信託受益証券	3,867,648,402	3,898,934,410
流動資産合計	4,665,312,463	4,711,389,463
資産合計	4,665,312,463	4,711,389,463
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	8,032,270	7,837,266
未払解約金	173,518	1,682,480
未払受託者報酬	364,241	349,020
未払委託者報酬	3,961,250	3,795,682
その他未払費用	16,191	15,522
流動負債合計	12,547,470	13,679,970
負債合計	12,547,470	13,679,970
純資産の部		
元本等		
元本	4,016,135,421	3,918,633,344
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	636,629,572	779,076,149
(分配準備積立金)	857,630,091	983,380,972
元本等合計	4,652,764,993	4,697,709,493
純資産合計	4,652,764,993	4,697,709,493
負債純資産合計	4,665,312,463	4,711,389,463

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2023年10月21日 至 2024年4月22日	当期 自 2024年4月23日 至 2024年10月21日
営業収益		
受取配当金	32,044,800	30,342,400
受取利息	6,340	81,215
有価証券売買等損益	440,405,511	202,455,808
営業収益合計	472,456,651	232,879,423
営業費用		
支払利息	4,440	-
受託者報酬	2,056,646	2,067,881
委託者報酬	22,366,509	22,488,707
その他費用	91,422	91,938
営業費用合計	24,519,017	24,648,526
営業利益又は営業損失()	447,937,634	208,230,897
経常利益又は経常損失()	447,937,634	208,230,897
当期純利益又は当期純損失()	447,937,634	208,230,897
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()	153,857	50,746
期首剰余金又は期首欠損金()	257,161,472	636,629,572
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,517,251	666,416
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,517,251	666,416
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,165,662	18,956,055
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,165,662	18,956,055
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	48,974,980	47,545,427
期末剰余金又は期末欠損金()	636,629,572	779,076,149

(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 2024年4月23日 至 2024年10月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>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、前特定期間末日を2024年4月22日、当特定期間末日を2024年10月21日としております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2024年4月22日現在	2024年10月21日現在
1. 期首元本額	4,170,970,134円	4,016,135,421円
期中追加設定元本額	13,061,456円	3,595,527円
期中一部解約元本額	167,896,169円	101,097,604円
2. 受益権の総数	4,016,135,421口	3,918,633,344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10月21日 至 2024年4月22日	自 2024年4月23日 至 2024年10月21日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2023年10月21日 至2023年11月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,571,974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>	<p>(自2024年4月23日 至2024年5月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,550,198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(67,988,692円)、信託約款に規定される収益調整金(31,092,530円)及び分配準備積立金(856,078,301円)より分配対象収益は966,709,721円(1万口当たり2,411.07円)であり、うち8,018,920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11月21日 至2023年12月20日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。

(自2023年12月21日 至2024年1月22日)

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。

(自2024年1月23日 至2024年2月20日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。

(自2024年5月21日 至2024年6月20日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,086,307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(31,047,525円)及び分配準備積立金(922,255,862円)より分配対象収益は962,389,694円(1万口当たり2,413.86円)であり、うち7,973,855円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2024年6月21日 至2024年7月22日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,240,068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(61,995,952円)、信託約款に規定される収益調整金(31,050,459円)及び分配準備積立金(918,842,304円)より分配対象収益は1,024,128,783円(1万口当たり2,580.94円)であり、うち7,936,064円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2024年7月23日 至2024年8月20日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,108,289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(31,107,611円)及び分配準備積立金(982,385,262円)より分配対象収益は1,020,601,162円(1万口当たり2,578.91円)であり、うち7,914,976円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

	<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>	<p>（自2024年8月21日 至2024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（10,827,399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（31,084,669円）及び分配準備積立金（975,124,147円）より分配対象収益は1,017,036,215円（1万口当たり2,586.44円）であり、うち7,864,346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9月21日 至2024年10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（16,626,950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（31,106,452円）及び分配準備積立金（974,591,288円）より分配対象収益は1,022,324,690円（1万口当たり2,608.88円）であり、うち7,837,266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10月21日 至 2024年4月22日	当期 自 2024年4月23日 至 2024年10月21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 2024年4月22日現在	当期 2024年10月21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 2024年4月22日現在	当期 2024年10月21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	4,673,200	19,080,600
親投資信託受益証券	77,928,608	85,637,915
合計	73,255,408	104,718,515

(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 2024年4月22日現在	当期 2024年10月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1585円 (11,585円)	1.1988円 (11,988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10月21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	323,400	659,089,200	
投資信託受益証券 合計		323,400	659,089,200	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	224,883,758	676,270,437	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	155,422,125	633,453,954	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	113,481,634	706,060,030	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	504,434,964	603,909,538	
	新光J-REITマザーファンド	277,479,957	586,897,857	
	新光米国REITマザーファンド	209,015,395	692,342,594	
親投資信託受益証券 合計		1,484,717,833	3,898,934,410	
合計			4,558,023,610	

（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10月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	46,376,898
株式	1,460,072,920
派生商品評価勘定	1,749,670
未収配当金	14,759,037
差入委託証拠金	3,485,336
流動資産合計	1,526,443,861
資産合計	1,526,443,861
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	700,330
前受金	1,200,000
未払解約金	11,000
流動負債合計	1,911,330
負債合計	1,911,330
純資産の部	
元本等	
元本	374,055,688
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,150,476,843
元本等合計	1,524,532,531
純資産合計	1,524,532,531
負債純資産合計	1,526,443,861

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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	391,510,481円
同期中追加設定元本額	30,584,850円
同期中一部解約元本額	48,039,643円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	155,422,125円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	35,159,270円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	173,076,847円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	2,938,189円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	7,077,996円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	381,261円
計	374,055,688円
2. 受益権の総数	374,055,688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 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	87,032,588
合計	87,032,588

（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10月21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10月21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	52,600,000	-	53,650,000	1,050,000
合計	52,600,000	-	53,650,000	1,050,000

(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10月21日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.0757円 (40,757円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年10月21日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
ニッセイ	600	918.70	551,220	
マルハニチロ	100	3,028.00	302,800	
サカタのタネ	100	3,585.00	358,500	
ショーボンドホールディングス	100	5,485.00	548,500	
ミライト・ワン	200	2,151.00	430,200	
robot home	100	136.00	13,600	
住石ホールディングス	100	854.00	85,400	
INPEX	1,600	1,999.00	3,198,400	
石油資源開発	500	1,143.00	571,500	
リョーサン菱洋ホールディングス	100	2,584.00	258,400	
安藤・間	300	1,135.00	340,500	
東急建設	200	700.00	140,000	
コムシスホールディングス	200	3,109.00	621,800	
ビーアールホールディングス	100	353.00	35,300	
オリエンタル白石	200	377.00	75,400	
大成建設	400	6,191.00	2,476,400	
大林組	1,300	1,858.00	2,415,400	
清水建設	1,000	979.30	979,300	
長谷工コーポレーション	400	1,898.50	759,400	
鹿島建設	900	2,655.00	2,389,500	
西松建設	100	4,991.00	499,100	

三井住友建設	300	395.00	118,500	
奥村組	100	4,410.00	441,000	
浅沼組	100	681.00	68,100	
戸田建設	500	934.80	467,400	
熊谷組	100	3,560.00	356,000	
矢作建設工業	100	1,512.00	151,200	
ピーエス・コンストラクション	100	1,016.00	101,600	
日本ハウスホールディングス	100	336.00	33,600	
大東建託	100	16,725.00	1,672,500	
新日本建設	100	1,599.00	159,900	
サムティホールディングス	100	3,295.00	329,500	
東亜道路工業	100	1,280.00	128,000	
東亜建設工業	100	1,010.00	101,000	
日本国土開発	100	510.00	51,000	
東洋建設	100	1,327.00	132,700	
五洋建設	600	643.20	385,920	
世紀東急工業	100	1,500.00	150,000	
住友林業	300	6,539.00	1,961,700	
大和ハウス工業	1,000	4,520.00	4,520,000	
ライト工業	100	2,264.00	226,400	
積水ハウス	1,100	3,835.00	4,218,500	
ユアテック	100	1,505.00	150,500	
中電工	100	3,255.00	325,500	
関電工	300	2,228.00	668,400	
きんでん	300	3,238.00	971,400	
日本電設工業	100	1,859.00	185,900	
エクシオグループ	400	1,555.50	622,200	
九電工	100	6,182.00	618,200	
三機工業	100	2,467.00	246,700	
日揮ホールディングス	400	1,305.50	522,200	
高砂熱学工業	100	4,900.00	490,000	
NEC ネットエスアイ	200	2,683.00	536,600	
明星工業	100	1,260.00	126,000	
ダイダン	100	3,035.00	303,500	
ニッポン	100	2,192.00	219,200	
日清製粉グループ本社	400	1,762.00	704,800	
中部飼料	100	1,401.00	140,100	
フィード・ワン	100	856.00	85,600	
LIFULL	100	150.00	15,000	
MIXI	100	2,819.00	281,900	
ジェイエイシーリクルートメント	200	739.00	147,800	
日本M&Aセンターホールディングス	700	614.60	430,220	
UTグループ	100	2,666.00	266,600	
ケアネット	100	675.00	67,500	
オープンアップグループ	100	1,970.00	197,000	
コシダカホールディングス	100	1,239.00	123,900	
パソナグループ	100	2,009.00	200,900	
リンクアンドモチベーション	100	599.00	59,900	
エス・エム・エス	100	2,155.00	215,500	
パーソルホールディングス	4,200	259.60	1,090,320	

クックパッド	100	177.00	17,700	
森永製菓	200	2,871.00	574,200	
江崎グリコ	100	4,436.00	443,600	
山崎製パン	300	2,717.50	815,250	
寿スピリッツ	200	1,992.00	398,400	
カルビー	200	3,395.00	679,000	
森永乳業	100	3,490.00	349,000	
ヤクルト本社	600	3,347.00	2,008,200	
明治ホールディングス	500	3,540.00	1,770,000	
雪印メグミルク	100	2,625.00	262,500	
プリマハム	100	2,263.00	226,300	
日本ハム	200	5,216.00	1,043,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	100	3,835.00	383,500	
システナ	600	370.00	222,000	
日鉄ソリューションズ	100	3,570.00	357,000	
総合警備保障	700	1,033.50	723,450	
いちご	400	396.00	158,400	
日本駐車場開発	500	228.00	114,000	
カカクコム	300	2,436.00	730,800	
ディップ	100	2,594.00	259,400	
エムスリー	800	1,760.50	1,408,400	
ディー・エヌ・エー	100	1,795.50	179,550	
博報堂D Yホールディングス	500	1,210.00	605,000	
ぐるなび	100	330.00	33,000	
タカミヤ	100	439.00	43,900	
ファンコミュニケーションズ	100	424.00	42,400	
エスプール	100	362.00	36,200	
アドウェイズ	100	333.00	33,300	
インフォマート	400	365.00	146,000	
サッポロホールディングス	100	7,317.00	731,700	
アサヒグループホールディングス	2,900	1,752.00	5,080,800	
麒麟ホールディングス	1,600	2,207.50	3,532,000	
宝ホールディングス	300	1,211.50	363,450	
オエノンホールディングス	100	415.00	41,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	300	1,941.00	582,300	
サントリー食品インターナショナル	300	5,255.00	1,576,500	
伊藤園	100	3,317.00	331,700	
日清オイリオグループ	100	5,250.00	525,000	
不二製油グループ本社	100	3,176.00	317,600	
サンエー	100	2,956.00	295,600	
エービーシー・マート	200	3,062.00	612,400	
アスクル	100	2,013.00	201,300	
アダストリア	100	3,935.00	393,500	
くら寿司	100	3,935.00	393,500	
パルグループホールディングス	100	3,220.00	322,000	
エディオン	200	1,775.00	355,000	
あらた	100	3,560.00	356,000	
サーラコーポレーション	100	868.00	86,800	
J Pホールディングス	100	701.00	70,100	

円谷フィールズホールディングス	100	2,312.00	231,200
双日	500	3,334.00	1,667,000
アルフレッサホールディングス	400	2,315.00	926,000
キッコーマン	1,200	1,671.50	2,005,800
味の素	900	5,629.00	5,066,100
キュービー	200	3,531.00	706,200
ハウス食品グループ本社	100	3,001.00	300,100
カゴメ	200	3,198.00	639,600
ニチレイ	200	4,285.00	857,000
横浜冷凍	100	957.00	95,700
東洋水産	200	8,795.00	1,759,000
日清食品ホールディングス	400	4,075.00	1,630,000
日本たばこ産業	2,300	4,094.00	9,416,200
ファーマフーズ	100	855.00	85,500
北の達人コーポレーション	200	161.00	32,200
ユーグレナ	300	429.00	128,700
ヒューリック	900	1,421.50	1,279,350
クオールホールディングス	100	1,475.00	147,500
アルコニックス	100	1,376.00	137,600
神戸物産	300	4,184.00	1,255,200
ビックカメラ	300	1,695.00	508,500
DCMホールディングス	200	1,481.00	296,200
MonotaRO	600	2,457.50	1,474,500
あいホールディングス	100	2,379.00	237,900
J.フロントリテイリング	500	1,573.50	786,750
ドトール・日レスホールディングス	100	2,228.00	222,800
マツキヨココカラ&カンパニー	800	2,096.00	1,676,800
ZOZO	300	5,382.00	1,614,600
物語コーポレーション	100	3,705.00	370,500
三越伊勢丹ホールディングス	700	2,215.50	1,550,850
東洋紡	200	976.00	195,200
ユニチカ	100	292.00	29,200
日清紡ホールディングス	300	975.60	292,680
ダイワボウホールディングス	200	2,790.00	558,000
日東紡績	100	6,960.00	696,000
トヨタ紡織	200	1,910.00	382,000
マクニカホールディングス	300	1,979.00	593,700
ウエルシアホールディングス	200	1,961.50	392,300
クリエイトSDホールディングス	100	3,120.00	312,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	100	1,313.00	131,300
TOKAIホールディングス	200	939.00	187,800
オイシックス・ラ・大地	100	1,339.00	133,900
ネクステージ	100	1,443.00	144,300
ジョイフル本田	100	2,024.00	202,400
すかいらーくホールディングス	600	2,322.00	1,393,200
日本毛織	100	1,268.00	126,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	100	827.00	82,700
野村不動産ホールディングス	200	3,779.00	755,800

三重交通グループホールディングス	100	497.00	49,700
ディア・ライフ	100	847.00	84,700
プレサンスコーポレーション	100	1,934.00	193,400
フージャースホールディングス	100	1,055.00	105,500
オープンハウスグループ	100	5,778.00	577,800
東急不動産ホールディングス	1,100	985.20	1,083,720
飯田グループホールディングス	400	2,234.00	893,600
日本コークス工業	400	96.00	38,400
コスモス薬品	100	7,847.00	784,700
シップヘルスケアホールディングス	200	2,351.50	470,300
セブン&アイ・ホールディングス	4,300	2,237.50	9,621,250
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	300	1,186.00	355,800
ツルハホールディングス	100	8,787.00	878,700
トリドールホールディングス	100	3,941.00	394,100
帝人	400	1,399.50	559,800
東レ	2,700	823.80	2,224,260
クラレ	600	2,037.00	1,222,200
旭化成	2,700	1,044.00	2,818,800
トーカロ	100	1,825.00	182,500
SUMCO	800	1,495.50	1,196,400
コメダホールディングス	100	2,816.00	281,600
クスリのアオキホールディングス	100	3,304.00	330,400
FOOD & LIFE COMPANIES	200	2,994.00	598,800
セーレン	100	2,572.00	257,200
小松マテーレ	100	771.00	77,100
ワコールホールディングス	100	4,642.00	464,200
T S Iホールディングス	100	976.00	97,600
ワールド	100	2,044.00	204,400
T I S	400	3,750.00	1,500,000
グリーン	100	483.00	48,300
コーエーテクモホールディングス	300	1,570.00	471,000
K L a b	100	190.00	19,000
ポールトゥウィンホールディングス	100	466.00	46,600
ネクソン	900	2,629.00	2,366,100
アイスタイル	100	465.00	46,500
エムアップホールディングス	100	1,322.00	132,200
エニグモ	100	315.00	31,500
コロブラ	100	538.00	53,800
ブロードリーフ	200	596.00	119,200
じげん	100	617.00	61,700
ブイキューブ	100	227.00	22,700
テクマトリックス	100	2,305.00	230,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	100	3,381.00	338,100
GMOペイメントゲートウェイ	100	9,171.00	917,100
インターネットイニシアティブ	200	2,945.50	589,100
さくらインターネット	100	4,130.00	413,000
e B A S E	100	662.00	66,200

アバントグループ	100	2,219.00	221,900	
コムチュア	100	1,904.00	190,400	
王子ホールディングス	1,600	568.00	908,800	
日本製紙	200	920.00	184,000	
北越コーポレーション	200	1,548.00	309,600	
大王製紙	200	893.30	178,660	
g u m i	100	310.00	31,000	
ラクス	200	2,107.00	421,400	
カナミックネットワーク	100	581.00	58,100	
レンゴー	400	943.90	377,560	
チェンジホールディングス	100	1,237.00	123,700	
マクロミル	100	821.00	82,100	
マネーフォワード	100	5,470.00	547,000	
レゾナック・ホールディングス	400	3,700.00	1,480,000	
住友化学	2,900	410.10	1,189,290	
日産化学	200	5,316.00	1,063,200	
クレハ	100	2,842.00	284,200	
石原産業	100	1,470.00	147,000	
東ソー	500	1,899.00	949,500	
トクヤマ	100	2,753.00	275,300	
東亜合成	200	1,610.00	322,000	
関東電化工業	100	970.00	97,000	
デンカ	100	2,159.50	215,950	
イビデン	200	4,952.00	990,400	
信越化学工業	3,600	5,935.00	21,366,000	
プラスアルファ・コンサルティング	100	2,126.00	212,600	
エア・ウォーター	400	1,950.50	780,200	
日本酸素ホールディングス	400	5,182.00	2,072,800	
日本パーカライズン	200	1,312.00	262,400	
高圧ガス工業	100	880.00	88,000	
日本触媒	200	1,737.50	347,500	
カネカ	100	3,750.00	375,000	
協和キリン	500	2,639.00	1,319,500	
A P P I E R G R O U P	100	1,748.00	174,800	
三菱瓦斯化学	300	2,692.50	807,750	
三井化学	300	3,547.00	1,064,100	
東京応化工業	200	3,598.00	719,600	
三菱ケミカルグループ	2,900	828.60	2,402,940	
K H ネオケム	100	2,041.00	204,100	
ダイセル	500	1,331.00	665,500	
住友ベークライト	100	3,960.00	396,000	
積水化学工業	800	2,194.00	1,755,200	
日本ゼオン	300	1,352.50	405,750	
アイカ工業	100	3,305.00	330,500	
U B E	200	2,550.00	510,000	
積水樹脂	100	2,324.00	232,400	
リケンテクノス	100	1,079.00	107,900	
積水化成成品工業	100	395.00	39,500	
ダイキョーニシカワ	100	629.00	62,900	
日本化薬	300	1,228.00	368,400	

プレステージ・インターナショナル	200	693.00	138,600
野村総合研究所	900	4,999.00	4,499,100
電通グループ	500	4,770.00	2,385,000
ソースネクスト	200	208.00	41,600
シーティーエス	100	944.00	94,400
シンプレクス・ホールディングス	100	2,357.00	235,700
ラクスル	100	1,281.00	128,100
メルカリ	200	2,372.00	474,400
ADEKA	100	2,782.50	278,250
日油	400	2,563.50	1,025,400
Sansan	100	2,315.00	231,500
花王	900	6,868.00	6,181,200
JMDC	100	4,567.00	456,700
武田薬品工業	3,500	4,294.00	15,029,000
アステラス製薬	3,500	1,785.00	6,247,500
住友ファーマ	300	623.00	186,900
塩野義製薬	1,400	2,098.00	2,937,200
日本新薬	100	4,203.00	420,300
中外製薬	1,200	7,003.00	8,403,600
科研製薬	100	3,869.00	386,900
エーザイ	500	5,263.00	2,631,500
ロート製薬	400	3,472.00	1,388,800
小野薬品工業	800	2,007.00	1,605,600
久光製薬	100	4,299.00	429,900
参天製薬	700	1,805.50	1,263,850
ツムラ	100	4,922.00	492,200
テルモ	2,200	2,945.00	6,479,000
H.U.グループホールディングス	100	2,638.00	263,800
キッセイ薬品工業	100	3,835.00	383,500
生化学工業	100	869.00	86,900
栄研化学	100	2,552.00	255,200
JCRファーマ	100	684.00	68,400
東和薬品	100	3,085.00	308,500
ゼリア新薬工業	100	2,326.00	232,600
ネクセラファーマ	200	1,231.00	246,200
第一三共	3,500	4,919.00	17,216,500
杏林製薬	100	1,517.00	151,700
大幸薬品	100	389.00	38,900
大塚ホールディングス	900	9,057.00	8,151,300
ペプチドリーム	200	2,968.00	593,600
日本ペイントホールディングス	1,700	1,038.50	1,765,450
関西ペイント	400	2,477.50	991,000
中国塗料	100	2,118.00	211,800
太陽ホールディングス	100	3,930.00	393,000
DIC	100	3,337.00	333,700
サカティンクス	100	1,573.00	157,300
artience	100	3,595.00	359,500
オリエンタルランド	2,100	3,609.00	7,578,900
ダスキン	100	4,127.00	412,700
パーク24	300	1,854.50	556,350

明光ネットワークジャパン	100	661.00	66,100
クレスコ	100	1,268.00	126,800
フジ・メディア・ホールディングス	400	1,692.50	677,000
ラウンドワン	400	984.00	393,600
リゾートトラスト	200	2,802.00	560,400
オービック	500	4,845.00	2,422,500
ジャストシステム	100	3,460.00	346,000
TDCソフト	100	1,225.00	122,500
LINEヤフー	5,600	427.90	2,396,240
ビー・エム・エル	100	2,713.00	271,300
トレンドマイクロ	200	8,058.00	1,611,600
リソー教育	200	277.00	55,400
日本オラクル	100	15,260.00	1,526,000
フューチャー	100	1,765.00	176,500
ユー・エス・エス	900	1,252.00	1,126,800
オービックビジネスコンサルタント	100	7,341.00	734,100
アイティフォー	100	1,344.00	134,400
サイバーエージェント	900	1,033.50	930,150
楽天グループ	2,900	952.10	2,761,090
SBIグローバルアセットマネジメント	100	590.00	59,000
テー・オー・ダブリュー	100	325.00	32,500
大塚商会	500	3,435.00	1,717,500
サイボウズ	100	2,140.00	214,000
デジタルガレージ	100	3,090.00	309,000
イーエムシステムズ	100	547.00	54,700
C I J	100	415.00	41,500
エン・ジャパン	100	2,432.00	243,200
サワイグループホールディングス	300	2,057.00	617,100
富士フイルムホールディングス	2,200	3,666.00	8,065,200
コニカミノルタ	900	486.80	438,120
資生堂	900	3,408.00	3,067,200
ライオン	500	1,683.00	841,500
マンダム	100	1,260.00	126,000
ミルボン	100	3,142.00	314,200
コーセー	100	8,470.00	847,000
ポーラ・オルビスホールディングス	200	1,519.00	303,800
コニシ	100	1,319.00	131,900
長谷川香料	100	3,365.00	336,500
小林製薬	100	5,762.00	576,200
タカラバイオ	100	1,050.00	105,000
デクセリアルズ	300	2,407.00	722,100
クミアイ化学工業	200	813.00	162,600
日本農薬	100	625.00	62,500
ニチレキグループ	100	2,402.00	240,200
富士石油	100	344.00	34,400
出光興産	2,000	1,042.00	2,084,000
ENEOSホールディングス	6,200	779.00	4,829,800
コスモエネルギーホールディングス	100	7,725.00	772,500
ANYCOLOR	100	2,249.00	224,900

テスホールディングス	100	288.00	28,800	
インフロニア・ホールディングス	500	1,178.50	589,250	
横浜ゴム	200	3,169.00	633,800	
TOYO TIRE	200	2,140.00	428,000	
ブリヂストン	1,100	5,630.00	6,193,000	
住友ゴム工業	400	1,545.50	618,200	
住友理工	100	1,453.00	145,300	
バンドー化学	100	1,780.00	178,000	
A G C	400	4,660.00	1,864,000	
日本板硝子	200	368.00	73,600	
有沢製作所	100	1,400.00	140,000	
日本電気硝子	200	3,361.00	672,200	
住友大阪セメント	100	3,968.00	396,800	
太平洋セメント	200	3,441.00	688,200	
日本コンクリート工業	100	331.00	33,100	
アジアパイルホールディングス	100	807.00	80,700	
東海カーボン	400	864.10	345,640	
T O T O	300	5,125.00	1,537,500	
日本碍子	500	1,874.50	937,250	
日本特殊陶業	300	4,167.00	1,250,100	
品川リフラクトリーズ	100	1,754.00	175,400	
フジインコーポレーテッド	100	2,353.00	235,300	
ニチアス	100	5,660.00	566,000	
日本製鉄	1,900	3,058.00	5,810,200	
神戸製鋼所	800	1,671.50	1,337,200	
中山製鋼所	100	765.00	76,500	
J F E ホールディングス	1,100	1,846.00	2,030,600	
東京製鉄	100	1,944.00	194,400	
大和工業	100	7,142.00	714,200	
丸一鋼管	100	3,323.00	332,300	
大同特殊鋼	300	1,353.50	406,050	
新日本電工	300	293.00	87,900	
日本製鋼所	100	5,575.00	557,500	
大紀アルミニウム工業所	100	1,116.00	111,600	
日本軽金属ホールディングス	100	1,625.00	162,500	
三井金属鉱業	100	4,896.00	489,600	
三菱マテリアル	300	2,528.50	758,550	
住友金属鉱山	500	4,424.00	2,212,000	
D O W A ホールディングス	100	5,223.00	522,300	
古河機械金属	100	1,675.00	167,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	2,422.00	242,200	
東邦チタニウム	100	1,121.00	112,100	
U A C J	100	5,140.00	514,000	
古河電気工業	100	3,580.00	358,000	
住友電気工業	1,500	2,320.50	3,480,750	
フジクラ	500	5,131.00	2,565,500	
いよぎんホールディングス	500	1,417.50	708,750	
しずおかフィナンシャルグループ	900	1,277.00	1,149,300	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	300	1,472.00	441,600	
楽天銀行	200	3,275.00	655,000	

京都フィナンシャルグループ	500	2,314.50	1,157,250	
A R Eホールディングス	200	1,813.00	362,600	
東洋製罐グループホールディングス	200	2,240.00	448,000	
横河ブリッジホールディングス	100	2,627.00	262,700	
三和ホールディングス	400	3,674.00	1,469,600	
文化シャッター	100	1,823.00	182,300	
三協立山	100	765.00	76,500	
L I X I L	700	1,646.00	1,152,200	
ノーリツ	100	1,813.00	181,300	
リンナイ	200	3,420.00	684,000	
ユニプレス	100	1,122.00	112,200	
日東精工	100	572.00	57,200	
岡部	100	784.00	78,400	
ジーテクト	100	1,558.00	155,800	
東プレ	100	1,759.00	175,900	
高周波熱錬	100	995.00	99,500	
パイオラックス	100	2,458.00	245,800	
日本発条	400	1,862.50	745,000	
三浦工業	200	3,641.00	728,200	
タクマ	100	1,608.00	160,800	
テクノプロ・ホールディングス	200	2,803.00	560,600	
ジャパンマテリアル	100	1,864.00	186,400	
ベクトル	100	966.00	96,600	
シグマクシス・ホールディングス	100	1,718.00	171,800	
リクルートホールディングス	2,900	9,677.00	28,063,300	
エラン	100	940.00	94,000	
ツガミ	100	1,446.00	144,600	
アマダ	600	1,541.00	924,600	
アイダエンジニアリング	100	780.00	78,000	
F U J I	200	2,264.00	452,800	
オーエスジー	200	1,823.50	364,700	
旭ダイヤモンド工業	100	856.00	85,600	
D M G森精機	300	2,902.00	870,600	
ソディック	100	788.00	78,800	
ディスコ	200	39,540.00	7,908,000	
日本郵政	4,300	1,411.00	6,067,300	
ソラスト	100	508.00	50,800	
インソース	100	1,041.00	104,100	
豊田自動織機	300	11,050.00	3,315,000	
島精機製作所	100	1,152.00	115,200	
オプトラン	100	1,906.00	190,600	
ヤマシンフィルタ	100	478.00	47,800	
やまびこ	100	2,555.00	255,500	
野村マイクロ・サイエンス	100	2,233.00	223,300	
ナブテスコ	300	2,464.50	739,350	
三井海洋開発	100	3,160.00	316,000	
S M C	100	64,250.00	6,425,000	
オイレス工業	100	1,969.00	196,900	
サトーホールディングス	100	2,160.00	216,000	
小松製作所	1,800	4,003.00	7,205,400	

住友重機械工業	200	3,494.00	698,800
日立建機	200	3,452.00	690,400
日工	100	697.00	69,700
ローツェ	200	2,076.00	415,200
クボタ	2,100	1,994.00	4,187,400
月島ホールディングス	100	1,381.00	138,100
新東工業	100	1,003.00	100,300
アイチコーポレーション	100	1,273.00	127,300
小森コーポレーション	100	1,113.00	111,300
荏原製作所	800	2,362.00	1,889,600
ダイキン工業	500	18,790.00	9,395,000
栗田工業	200	5,871.00	1,174,200
橋本チエイン	300	1,917.00	575,100
日機装	100	1,014.00	101,400
レイズネクスト	100	1,586.00	158,600
アネスト岩田	100	1,424.00	142,400
ダイフク	700	2,773.50	1,941,450
タダノ	200	958.40	191,680
フジテック	100	4,962.00	496,200
C K D	100	2,758.00	275,800
平和	100	2,149.00	214,900
S A N K Y O	400	2,130.00	852,000
竹内製作所	100	4,770.00	477,000
アマノ	100	4,454.00	445,400
J U K I	100	398.00	39,800
ブラザー工業	600	3,020.00	1,812,000
マックス	100	3,590.00	359,000
モリタホールディングス	100	1,989.00	198,900
グローリー	100	2,521.00	252,100
大和冷機工業	100	1,441.00	144,100
セガサミーホールディングス	400	2,942.00	1,176,800
T P R	100	2,284.00	228,400
ホシザキ	300	5,222.00	1,566,600
日本精工	800	699.50	559,600
NTN	900	252.10	226,890
ジェイテクト	400	1,012.00	404,800
ミネベアミツミ	700	2,800.50	1,960,350
日本トムソン	100	478.00	47,800
T H K	200	2,512.00	502,400
キッツ	100	1,070.00	107,000
日立製作所	9,600	3,955.00	37,968,000
三菱電機	4,400	2,368.00	10,419,200
富士電機	300	8,105.00	2,431,500
安川電機	400	4,383.00	1,753,200
明電舎	100	3,900.00	390,000
P H C ホールディングス	100	1,020.00	102,000
K O K U S A I E L E C T R I C	200	2,970.00	594,000
ソシオネクスト	300	2,962.00	888,600
ベイカレント	300	5,036.00	1,510,800
アイモバイル	100	525.00	52,500

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	100	3,115.00	311,500	
オープングループ	100	212.00	21,200	
三櫻工業	100	727.00	72,700	
マキタ	500	4,815.00	2,407,500	
東芝テック	100	3,475.00	347,500	
マブチモーター	200	2,230.00	446,000	
ニデック	1,700	2,889.00	4,911,300	
ダブル・スコープ	100	343.00	34,300	
ヤーマン	100	870.00	87,000	
JVCケンウッド	300	1,253.00	375,900	
大崎電気工業	100	795.00	79,500	
オムロン	300	6,230.00	1,869,000	
日東工業	100	2,973.00	297,300	
I D E C	100	2,506.00	250,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	200	2,761.00	552,200	
日本電気	500	13,330.00	6,665,000	
富士通	3,700	3,059.00	11,318,300	
沖電気工業	200	1,018.00	203,600	
ルネサスエレクトロニクス	3,000	2,053.00	6,159,000	
セイコーエプソン	500	2,791.00	1,395,500	
ワコム	300	684.00	205,200	
アルバック	100	7,272.00	727,200	
日本信号	100	952.00	95,200	
京三製作所	100	562.00	56,200	
能美防災	100	2,747.00	274,700	
エレコム	100	1,473.00	147,300	
パナソニック ホールディングス	4,700	1,276.00	5,997,200	
シャープ	700	991.20	693,840	
アンリツ	300	1,125.50	337,650	
富士通ゼネラル	100	2,040.00	204,000	
ソニーグループ	14,000	2,710.00	37,940,000	
T D K	2,900	1,798.50	5,215,650	
タムラ製作所	200	579.00	115,800	
アルプスアルパイン	400	1,557.50	623,000	
ホシデン	100	2,191.00	219,100	
ヒロセ電機	100	18,555.00	1,855,500	
日本航空電子工業	100	2,598.00	259,800	
マクセル	100	1,884.00	188,400	
古野電気	100	2,271.00	227,100	
スミダコーポレーション	100	933.00	93,300	
横河電機	500	3,581.00	1,790,500	
アズビル	1,100	1,222.00	1,344,200	
日本光電工業	300	2,210.50	663,150	
堀場製作所	100	9,433.00	943,300	
アドバンテスト	1,100	8,181.00	8,999,100	
キーエンス	400	66,890.00	26,756,000	
シスメックス	1,000	2,882.00	2,882,000	
日本マイクロニクス	100	3,790.00	379,000	
デンソー	3,300	2,083.50	6,875,550	

オブテックスグループ	100	1,632.00	163,200	
レーザーテック	200	21,745.00	4,349,000	
スタンレー電気	300	2,623.00	786,900	
ウシオ電機	200	2,062.50	412,500	
日本電子	100	5,578.00	557,800	
カシオ計算機	300	1,155.00	346,500	
ファナック	1,900	3,958.00	7,520,200	
日本シイエムケイ	100	412.00	41,200	
大真空	100	615.00	61,500	
ローム	700	1,710.00	1,197,000	
浜松ホトニクス	600	2,002.50	1,201,500	
三井ハイテック	200	879.90	175,980	
京セラ	2,400	1,698.50	4,076,400	
太陽誘電	200	2,857.50	571,500	
村田製作所	3,600	2,829.00	10,184,400	
双葉電子工業	100	508.00	50,800	
日東電工	1,400	2,433.50	3,406,900	
東海理化電機製作所	100	1,963.00	196,300	
ニチコン	100	980.00	98,000	
K O A	100	1,131.00	113,100	
カナデビア	400	1,017.00	406,800	
三菱重工業	6,900	2,219.00	15,311,100	
川崎重工業	300	6,182.00	1,854,600	
I H I	300	7,969.00	2,390,700	
名村造船所	100	1,538.00	153,800	
アンビスホールディングス	100	1,954.00	195,400	
カーブスホールディングス	100	808.00	80,800	
フォーラムエンジニアリング	100	906.00	90,600	
三菱ロジスネクスト	100	1,184.00	118,400	
F P G	100	2,472.00	247,200	
全国保証	100	5,601.00	560,100	
めぶきフィナンシャルグループ	1,800	582.20	1,047,960	
ジャパンインベストメントアドバイザー	100	1,036.00	103,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	4,220.00	422,000	
九州フィナンシャルグループ	800	726.60	581,280	
かんぽ生命保険	400	2,572.00	1,028,800	
ゆうちょ銀行	4,300	1,399.50	6,017,850	
富山第一銀行	100	1,089.00	108,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,000	781.00	1,562,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	200	1,712.00	342,400	
プレミアグループ	100	2,258.00	225,800	
日産自動車	5,200	399.10	2,075,320	
いすゞ自動車	1,000	1,965.50	1,965,500	
トヨタ自動車	20,900	2,541.50	53,117,350	
日野自動車	600	459.50	275,700	
三菱自動車工業	1,500	403.90	605,850	
武蔵精密工業	100	1,958.00	195,800	

新明和工業	100	1,401.00	140,100
極東開発工業	100	2,536.00	253,600
タチエス	100	1,790.00	179,000
N O K	200	2,204.00	440,800
フタバ産業	100	700.00	70,000
市光工業	100	444.00	44,400
大同メタル工業	100	496.00	49,600
プレス工業	200	555.00	111,000
太平洋工業	100	1,352.00	135,200
アイシン	900	1,598.50	1,438,650
マツダ	1,300	1,054.50	1,370,850
本田技研工業	9,400	1,525.50	14,339,700
スズキ	2,900	1,505.50	4,365,950
S U B A R U	1,200	2,611.50	3,133,800
ヤマハ発動機	1,700	1,353.50	2,300,950
小糸製作所	400	2,010.00	804,000
エクセディ	100	3,600.00	360,000
ミツバ	100	866.00	86,600
豊田合成	100	2,555.50	255,550
愛三工業	100	1,401.00	140,100
エフ・シー・シー	100	2,370.00	237,000
シマノ	200	24,390.00	4,878,000
ティ・エス テック	100	1,726.50	172,650
第四北越フィナンシャルグループ	200	2,425.00	485,000
ひろぎんホールディングス	600	1,157.50	694,500
ダイレクトマーケティングミックス	100	244.00	24,400
十六フィナンシャルグループ	100	4,075.00	407,500
ネットプロテクションズホールディングス	100	372.00	37,200
あいちフィナンシャルグループ	100	2,282.00	228,200
ノジマ	100	2,043.00	204,300
カッパ・クリエイト	100	1,643.00	164,300
ナガイレーベン	100	2,349.00	234,900
良品計画	500	2,520.00	1,260,000
第一興商	200	1,865.50	373,100
メディカルホールディングス	400	2,530.50	1,012,200
アズワン	100	3,040.00	304,000
イオン北海道	100	894.00	89,400
コジマ	100	1,074.00	107,400
コーナン商事	100	3,660.00	366,000
ネットワンシステムズ	200	3,493.00	698,600
システムソフト	100	62.00	6,200
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	900	3,769.00	3,392,100
西松屋チェーン	100	2,421.00	242,100
ゼンショーホールディングス	200	7,777.00	1,555,400
日本ライフライン	100	1,215.00	121,500
サイゼリヤ	100	5,300.00	530,000
V Tホールディングス	200	460.00	92,000
I D O M	100	1,283.00	128,300

ユナイテッドアローズ	100	2,374.00	237,400
ハイデイ日高	100	2,737.00	273,700
シークス	100	1,122.00	112,200
コロワイド	200	1,670.00	334,000
壱番屋	200	1,028.00	205,600
スギホールディングス	300	2,680.00	804,000
島津製作所	500	4,637.00	2,318,500
スター精密	100	1,975.00	197,500
東京精密	100	7,888.00	788,800
マニー	200	1,752.00	350,400
ニコン	600	1,840.00	1,104,000
トプコン	200	1,586.50	317,300
オリンパス	2,200	2,835.50	6,238,100
理研計器	100	4,325.00	432,500
S C R E E Nホールディングス	100	9,830.00	983,000
タムロン	100	4,450.00	445,000
H O Y A	800	20,330.00	16,264,000
A & Dホロンホールディングス	100	2,155.00	215,500
朝日インテック	500	2,492.00	1,246,000
キヤノン	1,900	5,022.00	9,541,800
リコー	900	1,641.50	1,477,350
シチズン時計	400	933.00	373,200
メニコン	100	1,575.00	157,500
パラマウントベッドホールディングス	100	2,528.00	252,800
前田工織	100	1,787.00	178,700
バンダイナムコホールディングス	1,000	3,194.00	3,194,000
S H O E I	100	2,337.00	233,700
フランスベッドホールディングス	100	1,280.00	128,000
マーベラス	100	575.00	57,500
パイロットコーポレーション	100	4,704.00	470,400
エイベックス	100	1,523.00	152,300
フジシールインターナショナル	100	2,541.00	254,100
タカラトミー	200	3,947.00	789,400
広済堂ホールディングス	100	530.00	53,000
レック	100	1,314.00	131,400
三光合成	100	609.00	60,900
T O P P A Nホールディングス	500	4,307.00	2,153,500
大日本印刷	800	2,592.00	2,073,600
N I S S H A	100	1,829.00	182,900
アシックス	1,400	2,727.00	3,817,800
ニチハ	100	3,505.00	350,500
エフピコ	100	2,722.00	272,200
ヤマハ	600	1,256.50	753,900
ピジョン	300	1,657.00	497,100
象印マホービン	100	1,641.00	164,100
リンテック	100	3,250.00	325,000
信越ポリマー	100	1,475.00	147,500
イトーキ	100	1,565.00	156,500
任天堂	2,500	8,051.00	20,127,500
三菱鉛筆	100	2,420.00	242,000

タカラスタンダード	100	1,650.00	165,000
コクヨ	200	2,618.50	523,700
ニフコ	100	3,457.00	345,700
オカムラ	100	1,997.00	199,700
伊藤忠商事	2,800	7,572.00	21,201,600
丸紅	3,500	2,394.50	8,380,750
スクロール	100	966.00	96,600
長瀬産業	200	3,167.00	633,400
豊田通商	1,000	2,655.50	2,655,500
オンワードホールディングス	200	526.00	105,200
三共生興	100	596.00	59,600
兼松	200	2,348.00	469,600
三井物産	6,200	3,145.00	19,499,000
東京エレクトロン	900	23,720.00	21,348,000
セイコーグループ	100	3,935.00	393,500
山善	100	1,342.00	134,200
住友商事	2,500	3,282.00	8,205,000
B I P R O G Y	100	4,827.00	482,700
三菱商事	8,000	2,840.00	22,720,000
キヤノンマーケティングジャパン	100	4,660.00	466,000
阪和興業	100	5,130.00	513,000
ニプロ	300	1,410.50	423,150
岩谷産業	400	2,023.00	809,200
アステナホールディングス	100	529.00	52,900
三愛オブリ	100	1,876.00	187,600
稲畑産業	100	3,290.00	329,000
明和産業	100	644.00	64,400
ゴールドウイン	100	8,422.00	842,200
ユニ・チャーム	900	4,878.00	4,390,200
ワキタ	100	1,622.00	162,200
東邦ホールディングス	100	4,768.00	476,800
サンゲツ	100	2,831.00	283,100
ミツウロコグループホールディングス	100	1,690.00	169,000
伊藤忠エネクス	100	1,559.00	155,900
サンリオ	400	4,096.00	1,638,400
新光商事	100	958.00	95,800
モスフードサービス	100	3,595.00	359,500
木曽路	100	2,270.00	227,000
S R Sホールディングス	100	1,196.00	119,600
リテールパートナーズ	100	1,261.00	126,100
日本瓦斯	200	2,190.00	438,000
ロイヤルホールディングス	100	2,472.00	247,200
リンガーハット	100	2,242.00	224,200
M r M a x H D	100	717.00	71,700
A O K Iホールディングス	100	1,217.00	121,700
オークワ	100	916.00	91,600
コメリ	100	3,560.00	356,000
青山商事	100	1,344.00	134,400
しまむら	100	8,325.00	832,500
高島屋	600	1,222.50	733,500

松屋	100	830.00	83,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	200	2,076.00	415,200	
丸井グループ	300	2,403.00	720,900	
クレディセゾン	300	3,529.00	1,058,700	
アクシアル リテイリング	100	896.00	89,600	
イオン	1,400	3,760.00	5,264,000	
イズミ	100	3,291.00	329,100	
平和堂	100	2,236.00	223,600	
フジ	100	2,027.00	202,700	
ヤオコー	100	9,371.00	937,100	
ゼビオホールディングス	100	1,161.00	116,100	
ケーズホールディングス	300	1,490.50	447,150	
PALTAC	100	4,331.00	433,100	
三谷産業	100	323.00	32,300	
あおぞら銀行	300	2,688.50	806,550	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	23,700	1,613.00	38,228,100	
りそなホールディングス	4,500	1,033.50	4,650,750	
三井住友トラストグループ	1,300	3,398.00	4,417,400	
三井住友フィナンシャルグループ	8,100	3,202.00	25,936,200	
千葉銀行	1,000	1,148.50	1,148,500	
群馬銀行	800	884.60	707,680	
武蔵野銀行	100	2,725.00	272,500	
千葉興業銀行	100	1,117.00	111,700	
筑波銀行	200	228.00	45,600	
七十七銀行	100	4,055.00	405,500	
東邦銀行	300	272.00	81,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	400	3,608.00	1,443,200	
スルガ銀行	300	1,124.00	337,200	
八十二銀行	900	849.70	764,730	
大垣共立銀行	100	1,830.00	183,000	
滋賀銀行	100	3,370.00	337,000	
南都銀行	100	3,020.00	302,000	
百五銀行	400	561.00	224,400	
紀陽銀行	100	1,798.00	179,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	200	1,645.50	329,100	
山陰合同銀行	300	1,237.00	371,100	
四国銀行	100	948.00	94,800	
阿波銀行	100	2,431.00	243,100	
琉球銀行	100	1,003.00	100,300	
セブン銀行	1,200	310.50	372,600	
みずほフィナンシャルグループ	5,200	3,180.00	16,536,000	
山口フィナンシャルグループ	400	1,544.00	617,600	
みずほリース	300	1,001.00	300,300	
東京センチュリー	300	1,592.50	477,750	
SBIホールディングス	600	3,374.00	2,024,400	
日本証券金融	100	2,086.00	208,600	
アイフル	600	318.00	190,800	
北洋銀行	600	407.00	244,200	
愛媛銀行	100	1,046.00	104,600	
京葉銀行	200	695.00	139,000	

栃木銀行	200	265.00	53,000
東和銀行	100	587.00	58,700
イオンフィナンシャルサービス	200	1,221.00	244,200
アコム	700	368.40	257,880
オリエントコーポレーション	100	926.00	92,600
オリックス	2,300	3,265.00	7,509,500
三菱HCキャピタル	1,700	1,005.00	1,708,500
ジャフコグループ	100	2,013.00	201,300
トモニホールディングス	400	401.00	160,400
大和証券グループ本社	3,000	1,052.50	3,157,500
野村ホールディングス	6,500	792.00	5,148,000
岡三証券グループ	400	628.00	251,200
丸三証券	100	940.00	94,000
東洋証券	100	483.00	48,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	500	489.00	244,500
水戸証券	100	468.00	46,800
いちよし証券	100	692.00	69,200
松井証券	200	801.00	160,200
SOMPOホールディングス	1,700	3,292.00	5,596,400
日本取引所グループ	1,900	1,825.00	3,467,500
マネックスグループ	400	667.00	266,800
極東証券	100	1,328.00	132,800
アイザワ証券グループ	100	1,799.00	179,900
池田泉州ホールディングス	600	331.00	198,600
アニコムホールディングス	100	691.00	69,100
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,700	3,507.00	9,468,900
第一生命ホールディングス	1,800	3,868.00	6,962,400
東京海上ホールディングス	3,800	5,655.00	21,489,000
イー・ギャランティ	100	1,526.00	152,600
T&Dホールディングス	1,000	2,535.50	2,535,500
三井不動産	5,400	1,354.00	7,311,600
三菱地所	2,400	2,335.00	5,604,000
平和不動産	100	4,065.00	406,500
東京建物	400	2,391.50	956,600
京阪神ビルディング	100	1,657.00	165,700
住友不動産	600	4,688.00	2,812,800
テーオーシー	100	619.00	61,900
スターツコーポレーション	100	3,555.00	355,500
フジ住宅	100	708.00	70,800
空港施設	100	576.00	57,600
リログループ	200	1,887.00	377,400
日神グループホールディングス	100	501.00	50,100
日本エスコン	100	997.00	99,700
MIRARTHホールディングス	200	500.00	100,000
イオンモール	200	2,053.00	410,600
ランド	2,200	8.00	17,600
カチタス	100	1,961.00	196,100
トーセイ	100	2,402.00	240,200

サンフロンティア不動産	100	1,841.00	184,100	
東武鉄道	400	2,462.00	984,800	
相鉄ホールディングス	100	2,319.50	231,950	
東急	1,000	1,835.50	1,835,500	
京浜急行電鉄	500	1,194.50	597,250	
小田急電鉄	700	1,593.00	1,115,100	
京王電鉄	200	3,443.00	688,600	
京成電鉄	300	3,885.00	1,165,500	
富士急行	100	2,536.00	253,600	
東日本旅客鉄道	2,200	3,011.00	6,624,200	
西日本旅客鉄道	900	2,718.50	2,446,650	
東海旅客鉄道	1,500	3,188.00	4,782,000	
西武ホールディングス	500	3,297.00	1,648,500	
鴻池運輸	100	2,556.00	255,600	
西日本鉄道	100	2,255.50	225,550	
近鉄グループホールディングス	400	3,602.00	1,440,800	
阪急阪神ホールディングス	500	4,196.00	2,098,000	
南海電気鉄道	200	2,277.50	455,500	
京阪ホールディングス	200	2,856.00	571,200	
名古屋鉄道	400	1,704.00	681,600	
ヤマトホールディングス	500	1,626.00	813,000	
山九	100	4,856.00	485,600	
センコーグループホールディングス	200	1,356.00	271,200	
ニッコンホールディングス	200	1,900.50	380,100	
セイノーホールディングス	200	2,412.50	482,500	
A Z - C O M 丸和ホールディングス	100	1,071.00	107,100	
日本郵船	1,000	5,238.00	5,238,000	
商船三井	900	5,055.00	4,549,500	
川崎汽船	900	2,161.00	1,944,900	
飯野海運	100	1,278.00	127,800	
九州旅客鉄道	300	3,965.00	1,189,500	
S Gホールディングス	700	1,509.00	1,056,300	
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	200	7,633.00	1,526,600	
日本航空	900	2,410.50	2,169,450	
A N A ホールディングス	1,000	2,942.50	2,942,500	
T R E ホールディングス	100	1,859.00	185,900	
K P P グループホールディングス	100	687.00	68,700	
三菱倉庫	100	5,207.00	520,700	
住友倉庫	100	2,707.00	270,700	
日本トランスシティ	100	966.00	96,600	
大栄環境	100	3,200.00	320,000	
上組	200	3,206.00	641,200	
T B S ホールディングス	200	3,881.00	776,200	
日本テレビホールディングス	400	2,389.50	955,800	
テレビ朝日ホールディングス	100	2,037.00	203,700	
スカパーJ S A Tホールディングス	300	882.00	264,600	
ビジョン	100	1,136.00	113,600	
日本通信	400	149.00	59,600	
日本電信電話	117,700	145.70	17,148,890	

KDDI	2,900	4,739.00	13,743,100
ソフトバンク	63,700	187.30	11,931,010
GMOインターネットグループ	100	2,573.00	257,300
KADOKAWA	200	3,377.00	675,400
学研ホールディングス	100	988.00	98,800
ゼンリン	100	845.00	84,500
東京電力ホールディングス	3,600	621.60	2,237,760
中部電力	1,400	1,699.50	2,379,300
関西電力	1,500	2,541.00	3,811,500
中国電力	700	1,048.50	733,950
北陸電力	400	924.00	369,600
東北電力	1,000	1,442.50	1,442,500
四国電力	400	1,236.00	494,400
九州電力	900	1,641.00	1,476,900
北海道電力	400	979.50	391,800
沖縄電力	100	1,013.00	101,300
電源開発	300	2,423.50	727,050
イーレックス	100	649.00	64,900
レノバ	100	871.00	87,100
東京瓦斯	800	3,203.00	2,562,400
大阪瓦斯	800	3,181.00	2,544,800
東邦瓦斯	200	3,811.00	762,200
広島ガス	100	383.00	38,300
静岡ガス	100	1,012.00	101,200
東宝	200	5,826.00	1,165,200
エイチ・アイ・エス	100	1,701.00	170,100
東映	100	4,775.00	477,500
NTTデータグループ	1,000	2,414.00	2,414,000
共立メンテナンス	100	2,449.50	244,950
アインホールディングス	100	5,080.00	508,000
カナモト	100	2,814.00	281,400
DTS	100	3,945.00	394,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	5,885.00	1,177,000
シーイーシー	100	1,841.00	184,100
カブコン	700	3,278.00	2,294,600
日本空港ビルデング	100	5,333.00	533,300
乃村工藝社	200	792.00	158,400
SCSK	300	2,876.50	862,950
セコム	800	5,280.00	4,224,000
丹青社	100	813.00	81,300
メイテックグループホールディングス	100	3,198.00	319,800
TKC	100	3,945.00	394,500
船井総研ホールディングス	100	2,499.00	249,900
NSD	100	3,265.00	326,500
コナミグループ	200	14,010.00	2,802,000
ダイセキ	100	3,890.00	389,000
トラスコ中山	100	2,304.00	230,400
ヤマダホールディングス	1,200	444.20	533,040
オートバックスセブン	200	1,453.50	290,700

アークランズ	100	1,685.00	168,500	
ニトリホールディングス	200	20,855.00	4,171,000	
吉野家ホールディングス	200	3,154.00	630,800	
加藤産業	100	4,165.00	416,500	
イエローハット	100	2,576.00	257,600	
サガミホールディングス	100	1,824.00	182,400	
因幡電機産業	100	3,775.00	377,500	
アークス	100	2,488.00	248,800	
パローホールディングス	100	2,113.00	211,300	
ミスミグループ本社	700	2,553.50	1,787,450	
ファーストリテイリング	200	53,120.00	10,624,000	
ソフトバンクグループ	1,900	9,135.00	17,356,500	
スズケン	200	5,233.00	1,046,600	
サンドラッグ	100	3,931.00	393,100	
ペルーナ	100	720.00	72,000	
合計	723,500		1,460,072,920	

(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10月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	26,804,172
国債証券	8,813,826,900
地方債証券	661,092,000
特殊債証券	502,483,000
社債証券	193,896,000
未収入金	31,055,500
未収利息	14,945,689
前払費用	793,426
流動資産合計	10,244,896,687
資産合計	10,244,896,687
負債の部	
流動負債	
未払解約金	19,238,000
流動負債合計	19,238,000
負債合計	19,238,000
純資産の部	
元本等	
元本	8,541,382,215
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,684,276,472
元本等合計	10,225,658,687
純資産合計	10,225,658,687
負債純資産合計	10,244,896,687

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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	8,281,249,365円
同期中追加設定元本額	939,108,048円
同期中一部解約元本額	678,975,198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	4,986,122,550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	2,592,204,328円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	458,620,373円
計	8,541,382,215円
2. 受益権の総数	8,541,382,215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 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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10月21日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		125,538,400
地方債証券		1,437,500
特殊債券		1,173,000
社債券		1,718,000
合計		126,430,900

(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10月21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10月21日現在
1口当たり純資産額		1.1972円
(1万口当たり純資産額)		(11,972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10月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	456回 利付国庫債券(2年)	10,000,000	9,973,200	
	457回 利付国庫債券(2年)	10,000,000	9,969,400	
	458回 利付国庫債券(2年)	40,000,000	39,913,600	

459回 利付国庫債券(2年)	50,000,000	49,871,000	
461回 利付国庫債券(2年)	40,000,000	40,000,000	
462回 利付国庫債券(2年)	70,000,000	69,988,100	
463回 利付国庫債券(2年)	50,000,000	49,986,500	
464回 利付国庫債券(2年)	10,000,000	9,996,300	
146回 利付国庫債券(5年)	120,000,000	119,701,200	
147回 利付国庫債券(5年)	120,000,000	119,385,600	
148回 利付国庫債券(5年)	90,000,000	89,406,000	
149回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	79,369,600	
150回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	79,288,000	
151回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,505,000	
152回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	39,694,800	
153回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	79,116,000	
154回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,518,000	
155回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	19,906,400	
156回 利付国庫債券(5年)	70,000,000	69,454,000	
157回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,728,200	
158回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,379,000	
159回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	19,723,000	
160回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,692,500	
161回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,800,200	
162回 利付国庫債券(5年)	70,000,000	69,449,100	
163回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	59,758,200	
164回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	19,739,200	
165回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,730,900	

166回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,853,300	
167回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	39,767,200	
168回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,111,600	
169回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	39,939,600	
170回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,102,000	
171回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,647,500	
172回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	29,925,000	
1回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	10,827,600	
2回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	10,396,200	
3回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	20,656,400	
4回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	20,513,800	
5回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	19,583,800	
6回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	19,050,800	
7回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	18,069,200	
8回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	16,630,200	
9回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	23,936,800	
10回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	28,089,200	
11回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	20,076,300	
12回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	17,584,200	
13回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	22,889,200	
14回 利付国庫債券(40年)	40,000,000	24,286,400	
15回 利付国庫債券(40年)	50,000,000	33,403,500	
16回 利付国庫債券(40年)	50,000,000	36,525,500	
341回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	69,987,400	
343回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	69,647,200	
344回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	79,513,600	
345回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	59,588,400	
346回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	39,694,800	
347回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	69,401,500	
348回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	89,132,400	

349回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	98,908,000	
350回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	98,758,000	
351回 利付国庫債券(10年)	120,000,000	118,338,000	
352回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,756,800	
353回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,631,200	
354回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,484,000	
355回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	68,553,100	
356回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	68,411,000	
357回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,075,200	
358回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	68,219,900	
359回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	77,852,800	
360回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	77,693,600	
361回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	67,859,400	
362回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	77,388,000	
363回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	57,911,400	
364回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	86,639,400	
365回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	48,003,000	
366回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	67,534,600	
367回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	57,713,400	
368回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	67,148,900	
369回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	88,200,900	
370回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	78,201,600	
371回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	77,313,600	
372回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	89,775,900	
373回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	97,750,000	

374回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	99,218,000	
375回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,477,800	
10回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,529,200	
11回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	10,750,600	
12回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,090,700	
15回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,457,600	
17回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,370,000	
19回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,268,600	
20回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,475,800	
21回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,271,300	
22回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,483,000	
23回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,482,400	
26回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,369,600	
27回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,472,600	
28回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,936,600	
29回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,645,200	
30回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,345,600	
31回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,028,200	
32回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	33,358,500	
33回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,988,400	
34回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	32,765,100	
35回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,808,700	
36回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,698,600	
37回 利付国庫債券(30年)	60,000,000	62,289,000	
38回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,366,000	

39回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	30,959,400	
40回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,271,600	
41回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,899,200	
42回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,840,600	
43回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,781,200	
44回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,721,200	
45回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	28,499,700	
46回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	28,423,200	
47回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	28,857,300	
48回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	27,734,100	
49回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	27,652,500	
50回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	16,268,200	
51回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	28,829,600	
52回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	22,559,700	
53回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,312,400	
54回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	23,929,500	
55回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	23,810,700	
56回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,806,800	
57回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	23,610,000	
58回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	23,510,400	
59回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,225,200	
60回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,913,400	
61回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	15,088,600	
62回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	14,249,800	
63回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	13,782,000	

64回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	20,549,400	
65回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	13,628,400	
66回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	13,547,600	
67回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,390,600	
68回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,270,600	
69回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,768,600	
70回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,668,700	
71回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,568,200	
72回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	21,467,700	
73回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	28,490,800	
74回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	23,151,600	
75回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	33,237,600	
76回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	25,496,700	
77回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	26,707,500	
78回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	25,382,700	
79回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	24,050,400	
80回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	27,830,100	
81回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	26,496,300	
82回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	9,252,700	
83回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,217,600	
84回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,195,000	
88回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,313,300	
90回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,338,600	
92回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	20,721,800	
95回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	20,991,800	

99回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,552,800	
105回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,236,000	
108回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,568,500	
110回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,680,800	
111回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,754,600	
112回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,418,200	
113回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,216,400	
114回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,775,200	
116回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,860,800	
117回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,616,600	
118回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,574,000	
120回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,129,400	
121回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,509,000	
122回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,697,300	
123回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,802,000	
124回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,841,500	
126回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,863,900	
127回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,802,200	
128回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,466,300	
129回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,758,100	
130回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,542,800	
131回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,705,200	
132回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,437,000	
133回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,573,800	
134回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,602,600	

135回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,730,700	
136回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,312,600	
137回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,204,400	
138回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,756,200	
139回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,648,000	
140回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,728,000	
141回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,735,500	
142回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	43,313,200	
143回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	32,004,000	
144回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,178,000	
145回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	75,254,200	
146回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,743,500	
147回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	63,933,000	
148回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,209,600	
149回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,666,000	
150回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,109,000	
151回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,850,800	
152回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,754,000	
153回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,056,800	
154回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,567,200	
155回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,641,600	
156回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,194,500	
157回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	44,885,500	
158回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,327,500	
159回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,353,600	

160回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,656,800	
161回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	37,036,400	
162回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	46,079,000	
163回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	45,885,500	
164回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	45,072,500	
165回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	44,839,500	
166回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	36,696,800	
167回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	44,393,000	
168回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	34,807,600	
169回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	42,610,000	
170回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,882,000	
171回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	25,272,000	
172回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	25,534,200	
173回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,840,800	
174回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,655,600	
175回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	42,554,500	
176回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	42,356,500	
177回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	33,119,600	
178回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	41,925,500	
179回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	41,723,500	
180回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	35,022,800	
181回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	44,356,000	
182回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	36,578,800	
183回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	38,308,000	
184回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	36,329,200	

	185回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	36,189,600	
	186回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	38,606,400	
	187回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	27,902,400	
	188回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,017,600	
	189回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,219,400	
国債証券 合計		9,240,000,000	8,813,826,900	
地方債証券	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	106,888,000	
	218回 神奈川県公募公債	100,000,000	99,751,000	
	412回 大阪府公募公債 10年	50,000,000	49,563,000	
	190回 大阪府公募公債 5年	100,000,000	98,892,000	
	12回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	100,441,000	
	令和3年度11回 愛知県公募公債	100,000,000	95,770,000	
	24年度1回 福岡県公募公債 30年	10,000,000	10,554,000	
	169回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,233,000	
地方債証券 合計		660,000,000	661,092,000	
特殊債券	147回 高速道路機構債	100,000,000	98,275,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,381,000	
	327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,002,000	
	250回 住宅金融支援機構	100,000,000	98,483,000	
	87回 中日本高速道路債券	100,000,000	99,342,000	
特殊債券 合計		500,000,000	502,483,000	
社債券	11回 プリヂストン社債	100,000,000	98,976,000	
	494回 九州電力社債	100,000,000	94,920,000	
社債券 合計		200,000,000	193,896,000	
合計			10,171,297,900	

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10月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,424,386,360
投資証券	62,159,806,950
未収入金	51,744,623
未収配当金	715,213,286
前払金	60,550,100
差入委託証拠金	116,763,467
流動資産合計	64,528,464,786
資産合計	64,528,464,786
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	63,739,520
未払金	65,331,344
未払解約金	60,796,000
流動負債合計	189,866,864
負債合計	189,866,864
純資産の部	
元本等	
元本	30,418,227,444
剰余金	
剰余金又は欠損金()	33,920,370,478
元本等合計	64,338,597,922
純資産合計	64,338,597,922
負債純資産合計	64,528,464,786

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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	32,609,489,021円
同期中追加設定元本額	681,312,413円
同期中一部解約元本額	2,872,573,990円
元本の内訳	
ファンド名	
J-REITパッケージ	1,399,227,030円
新光J-REITオープン	26,165,084,208円
One DC 国内リートインデックスファンド	1,860,670,366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）	715,765,883円
計	30,418,227,444円
2. 受益権の総数	30,418,227,444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 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,489,421,561
合計	4,489,421,561

(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10月21日から2024年10月21日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2024年10月21日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	2,121,453,100	-	2,057,848,000	63,605,100
合計	2,121,453,100	-	2,057,848,000	63,605,100

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年10月21日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1151円 (21,151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10月21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	2,726	382,457,800	
	GLP投資法人	21,269	2,833,030,800	
	KDX不動産投資法人	17,715	2,643,078,000	
	NTT都市開発リート投資法人	6,436	718,257,600	
	Oneリート投資法人	1,104	263,635,200	
	SOSILA物流リート投資法人	3,159	349,385,400	
	いちごオフィスリート投資法人	4,620	376,068,000	
	いちごホテルリート投資法人	1,048	138,755,200	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	3,078	1,009,584,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	6,223	1,947,799,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,774	328,996,400	
	イオンリート投資法人	7,767	1,004,273,100	
	インヴィンシブル投資法人	34,887	2,142,061,800	

エスコンジャパンリート投資法人	1,401	164,617,500	
オリックス不動産投資法人	12,616	1,944,125,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	4,675	466,565,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,206	976,227,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,725	163,875,000	
サンケイリアルエステート投資法人	2,028	164,876,400	
ザイマックス・リート投資法人	1,084	121,408,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	23,262	1,646,949,600	
ジャパンエクセレント投資法人	5,437	646,459,300	
ジャパンリアルエステイト投資法人	6,504	3,648,744,000	
スターアジア不動産投資法人	11,669	593,952,100	
スターツプロシード投資法人	1,098	200,385,000	
タカラレーベン不動産投資法人	4,135	349,821,000	
トーセイ・リート投資法人	1,377	180,800,100	
ヒューリックリート投資法人	5,595	746,373,000	
フロンティア不動産投資法人	2,349	961,915,500	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,561	176,705,200	
マリモ地方創生リート投資法人	1,150	129,835,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	14,164	1,940,468,000	
ラサールロジポート投資法人	8,107	1,177,947,100	
阪急阪神リート投資法人	3,019	366,808,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,640	1,090,320,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,186	784,774,000	
産業ファンド投資法人	11,593	1,343,628,700	
森トラストリート投資法人	12,205	765,253,500	
森ヒルズリート投資法人	7,446	952,343,400	
星野リゾート・リート投資法人	1,339	628,660,500	
積水ハウス・リート投資法人	19,027	1,425,122,300	
大和ハウスリート投資法人	9,496	2,176,483,200	
大和証券オフィス投資法人	2,623	792,146,000	
大和証券リビング投資法人	9,352	870,671,200	
投資法人みらい	8,719	365,762,050	
東海道リート投資法人	1,082	117,180,600	
東急リアル・エステート投資法人	4,245	656,701,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	2,186	1,331,274,000	
日本ビルファンド投資法人	36,933	4,782,823,500	
日本プライムリアルティ投資法人	4,330	1,463,540,000	
日本プロロジスリート投資法人	11,030	2,673,672,000	

日本ホテル&レジデンシャル投資法人	1,022	73,481,800	
日本リート投資法人	2,057	656,183,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,254	1,158,364,200	
日本都市ファンド投資法人	32,833	3,115,851,700	
福岡リート投資法人	3,573	515,226,600	
平和不動産リート投資法人	4,643	577,124,900	
野村不動産マスターファンド投資法人	20,269	2,936,978,100	
投資証券 合計	444,051	62,159,806,950	
合計		62,159,806,950	

(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10月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	37,096,724
コール・ローン	6,754,080
株式	1,621,084,186
投資信託受益証券	2,487,296
投資証券	30,258,183
派生商品評価勘定	3,337,811
未収配当金	1,028,515
差入委託証拠金	75,731,719
流動資産合計	1,777,778,514
資産合計	1,777,778,514
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,194
未払解約金	14,000
流動負債合計	45,194
負債合計	45,194
純資産の部	
元本等	
元本	285,727,164
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,492,006,156
元本等合計	1,777,733,320
純資産合計	1,777,733,320
負債純資産合計	1,777,778,514

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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	312,591,283円
同期中追加設定元本額	1,779,315円
同期中一部解約元本額	28,643,434円
元本の内訳 ファンド名	
新光7資産バランスファンド	113,481,634円
新光外国株式インデックスV A	124,963,003円

世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	47,282,527円
計	285,727,164円
2. 受益権の総数	285,727,164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 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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10月21日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	379,649,463	
投資信託受益証券	668,612	
投資証券	6,821,451	
合計	387,139,526	

（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10月21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10月21日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	117,545,080	-		120,851,697
合計	117,545,080	-		120,851,697

（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10月21日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	6.2218円 (62,218円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年10月21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	1,554	188.990	293,690.460	
	ABBOTT LABORATORIES	287	119.390	34,264.930	
	AES CORP	106	17.470	1,851.820	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	154	232.200	35,758.800	
	ADVANCED MICRO DEVICES	267	155.970	41,643.990	
	ADOBE INC	73	494.900	36,127.700	
	CHUBB LTD	64	301.660	19,306.240	

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	36	332.100	11,955.600	
ALLSTATE CORP	46	195.370	8,987.020	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	109	222.020	24,200.180	
AMGEN INC	90	321.660	28,949.400	
HESS CORP	49	139.420	6,831.580	
AMERICAN EXPRESS CO	97	276.790	26,848.630	
AMERICAN ELECTRIC POWER	89	100.690	8,961.410	
AFLAC INC	89	114.500	10,190.500	
AMERICAN INTL GROUP	110	78.550	8,640.500	
ANALOG DEVICES	83	228.330	18,951.390	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	112	77.440	8,673.280	
VALERO ENERGY CORP	54	137.040	7,400.160	
ANSYS INC	14	327.400	4,583.600	
APPLE INC	2,417	235.000	567,995.000	
APPLIED MATERIALS INC	136	186.360	25,344.960	
ALBEMARLE CORP	21	95.140	1,997.940	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81	56.400	4,568.400	
AMEREN CORP	48	88.840	4,264.320	
AUTODESK INC	34	292.990	9,961.660	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	68	292.290	19,875.720	
AUTOZONE INC	3	3,182.070	9,546.210	
AVERY DENNISON CORP	15	217.330	3,259.950	
BALL CORP	49	67.250	3,295.250	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	220	464.800	102,256.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	123	76.670	9,430.410	
BAXTER INTERNATIONAL INC	90	36.860	3,317.400	
BECTON DICKINSON & CO	48	243.750	11,700.000	
AMETEK INC	40	169.400	6,776.000	
VERIZON COMM INC	695	43.990	30,573.050	
WR BERKLEY CORP	48	61.260	2,940.480	
BEST BUY CO INC	36	96.140	3,461.040	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	4	346.370	1,385.480	
YUM! BRANDS INC	45	134.270	6,042.150	
FIRSTENERGY CORP	82	43.660	3,580.120	
BOEING CO	97	155.000	15,035.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	248	88.070	21,841.360	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	19	110.125	2,092.370	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	27	155.270	4,192.290	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3	1,373.980	4,121.940	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	335	53.220	17,828.700	
ONEOK INC	95	97.230	9,236.850	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10	136.320	1,363.200	
UNITED RENTALS INC	11	839.270	9,231.970	
SEMPRA	109	85.960	9,369.640	
FEDEX CORP	39	274.400	10,701.600	
VERISIGN INC	14	187.720	2,628.080	
AMPHENOL CORP	199	67.460	13,424.540	
BROWN-FORMAN CORP	23	48.970	1,126.310	
QUANTA SERVICES INC	24	314.270	7,542.480	
CSX CORP	328	34.120	11,191.360	
COTERRA ENERGY INC	129	23.780	3,067.620	
CAMPBELL SOUP CO	34	48.500	1,649.000	
CONSTELLATION BRANDS INC	27	241.520	6,521.040	
CARDINAL HEALTH INC	40	112.410	4,496.400	
CARLISLE COS INC	8	471.160	3,769.280	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	184	21.320	3,922.880	
CATERPILLAR INC	81	393.860	31,902.660	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	15	206.230	3,093.450	
JPMORGAN CHASE & CO	476	225.370	107,276.120	
CHURCH & DWIGHT CO INC	43	104.340	4,486.620	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	25	141.400	3,535.000	
CINTAS CORP	60	214.020	12,841.200	
CISCO SYSTEMS INC	667	56.760	37,858.920	
CLOROX COMPANY	22	161.960	3,563.120	
COCA-COLA CO/THE	679	70.440	47,828.760	
COPART INC	140	53.880	7,543.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	129	100.460	12,959.340	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	40	265.600	10,624.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	9	289.720	2,607.480	
NRG ENERGY, INC.	34	86.330	2,935.220	
COMCAST CORP-CL A	644	41.930	27,002.920	
CONAGRA BRANDS INC	71	30.320	2,152.720	
CONSOLIDATED EDISON INC	61	106.760	6,512.360	
CMS ENERGY CORP	45	71.290	3,208.050	
COOPER COS INC	32	108.260	3,464.320	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	28	56.000	1,568.000	
CORNING INC	133	46.660	6,205.780	
HEICO CORP-CL A	14	203.570	2,849.980	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9	298.280	2,684.520	
CUMMINS INC	22	335.510	7,381.220	
DR HORTON INC	53	194.560	10,311.680	

DANAHER CORP	110	274.380	30,181.800	
MOODY'S CORP	27	488.460	13,188.420	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	79	78.000	6,162.000	
TARGET CORP	77	156.840	12,076.680	
DEERE & CO	44	408.730	17,984.120	
MORGAN STANLEY	202	121.060	24,454.120	
REPUBLIC SERVICES INC	36	204.800	7,372.800	
COSTAR GROUP INC	72	79.250	5,706.000	
DECKERS OUTDOOR CORP	24	161.850	3,884.400	
THE WALT DISNEY CO	301	97.280	29,281.280	
DOLLAR TREE INC	36	68.200	2,455.200	
DOVER CORP	21	194.380	4,081.980	
OMNICOM GROUP	35	104.480	3,656.800	
DTE ENERGY CO	30	128.900	3,867.000	
DUKE ENERGY CORP	131	120.760	15,819.560	
DARDEN RESTAURANTS INC	19	164.590	3,127.210	
EBAY INC	81	64.950	5,260.950	
BANK OF AMERICA CORP	1,164	42.320	49,260.480	
CITIGROUP INC	317	62.850	19,923.450	
EASTMAN CHEMICAL CO	22	108.840	2,394.480	
EATON CORP PLC	67	348.180	23,328.060	
CADENCE DESIGN SYS INC	46	258.520	11,891.920	
ECOLAB INC	42	261.460	10,981.320	
REVVITY INC	18	119.670	2,154.060	
ELECTRONIC ARTS INC	41	144.350	5,918.350	
SALESFORCE INC	160	292.940	46,870.400	
ERIE INDEMNITY CO	5	481.680	2,408.400	
EMERSON ELECTRIC CO	94	110.440	10,381.360	
ATMOS ENERGY CORP	22	143.260	3,151.720	
ENTERGY CORP	38	135.280	5,140.640	
EOG RESOURCES INC	96	126.620	12,155.520	
EQUIFAX INC	20	281.990	5,639.800	
EQT CORP	89	36.490	3,247.610	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	40	90.040	3,601.600	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	25	120.500	3,012.500	
EXXON MOBIL CORP	744	120.010	89,287.440	
NEXTERA ENERGY INC	345	84.380	29,111.100	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6	471.530	2,829.180	
FAIR ISAAC CORP	4	1,973.460	7,893.840	
ASSURANT INC	9	197.500	1,777.500	
FASTENAL CO	93	77.900	7,244.700	
FIFTH THIRD BANCORP	107	44.670	4,779.690	
M&T BANK CORP	26	197.550	5,136.300	
FISERV INC	99	197.290	19,531.710	
FORD MOTOR CO	636	11.100	7,059.600	
FRANKLIN RESOURCES INC	42	20.980	881.160	
FREEMPORT-MCMORAN INC	240	48.180	11,563.200	

FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2	2,115.010	4,230.020	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	36	289.250	10,413.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	39	308.480	12,030.720	
GENERAL MILLS INC	92	69.930	6,433.560	
GENUINE PARTS CO	24	143.170	3,436.080	
GILEAD SCIENCES INC	208	86.720	18,037.760	
GARTNER INC	13	531.090	6,904.170	
MCKESSON CORP	21	509.200	10,693.200	
NVIDIA CORP	4,083	138.000	563,454.000	
GRACO INC	24	85.920	2,062.080	
GE AEROSPACE	182	192.610	35,055.020	
VW GRAINGER INC	7	1,127.000	7,889.000	
HALLIBURTON CO	138	28.330	3,909.540	
MONSTER BEVERAGE CORP	128	54.050	6,918.400	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	54	528.500	28,539.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	33	248.780	8,209.740	
HENRY SCHEIN INC	24	72.390	1,737.360	
HEICO CORP	7	260.890	1,826.230	
HERSHEY FOODS CORP	25	185.680	4,642.000	
HP INC	159	37.280	5,927.520	
F5 INC	9	217.480	1,957.320	
CROWN HOLDINGS INC NPR	22	97.750	2,150.500	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7	368.430	2,579.010	
JUNIPER NETWORKS INC	52	39.210	2,038.920	
HOLOGIC INC	34	81.570	2,773.380	
HOME DEPOT INC	164	415.000	68,060.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	33	70.110	2,313.630	
HORMEL FOODS CORP	45	32.190	1,448.550	
CENTERPOINT ENERGY INC	84	30.110	2,529.240	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6	603.050	3,618.300	
HUBBELL INC	9	456.810	4,111.290	
HUMANA INC	20	267.140	5,342.800	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15	176.870	2,653.050	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	243	15.360	3,732.480	
BIOGEN INC	23	190.160	4,373.680	
IDEX CORP	14	210.530	2,947.420	
ILLINOIS TOOL WORKS	50	261.030	13,051.500	
INTUIT INC	47	613.290	28,824.630	
IDEXX LABORATORIES INC	14	457.740	6,408.360	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	38	402.540	15,296.520	
INTEL CORP	715	22.770	16,280.550	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	46	104.500	4,807.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	56	46.780	2,619.680	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	72	32.030	2,306.160	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12	186.120	2,233.440	
JABIL CIRCUIT INC	18	126.300	2,273.400	
INCYTE CORP	28	66.390	1,858.920	
EMCOR GROUP INC	8	453.740	3,629.920	
JOHNSON & JOHNSON	398	165.120	65,717.760	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45	122.000	5,490.000	
KLA CORPORATION	22	678.520	14,927.440	
DEVON ENERGY CORP	95	40.660	3,862.700	
KELLANOVA	41	81.050	3,323.050	
KEYCORP	174	17.350	3,018.900	
KIMBERLY-CLARK CORP	55	145.410	7,997.550	
KROGER CO	112	56.530	6,331.360	
LAM RESEARCH CORP	210	72.840	15,296.400	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8	450.060	3,600.480	
PACKAGING CORP OF AMERICA	15	220.120	3,301.800	
AKAMAI TECHNOLOGIES	26	106.670	2,773.420	
LENNAR CORP	43	188.930	8,123.990	
ELI LILLY & CO	134	917.970	123,007.980	
BATH & BODY WORKS INC	38	31.940	1,213.720	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	123	135.930	16,719.390	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	48	138.830	6,663.840	
LOCKHEED MARTIN CORP	36	611.810	22,025.160	
LOEWS CORP	35	81.820	2,863.700	
LOWE'S COS INC	94	281.640	26,474.160	
DOMINION ENERGY INC	137	59.920	8,209.040	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33	41.190	1,359.270	
MCCORMICK & CO INC	46	80.180	3,688.280	
MCDONALD'S CORPORATION	120	316.560	37,987.200	
S&P GLOBAL INC	53	524.800	27,814.400	
EVEREST GROUP LTD	7	384.230	2,689.610	
MARKEL GROUP INC	2	1,590.650	3,181.300	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	99	70.270	6,956.730	
MARSH & MCLENNAN COS	82	224.660	18,422.120	
MASCO CORP	39	85.710	3,342.690	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	10	581.000	5,810.000	
METLIFE INC	101	85.320	8,617.320	
MEDTRONIC PLC	211	92.240	19,462.640	
CVS HEALTH CORP	209	60.340	12,611.060	
MERCK & CO. INC.	420	108.700	45,654.000	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	75	68.490	5,136.750	
MICROSOFT CORP	1,172	418.160	490,083.520	
MICRON TECH INC	186	111.150	20,673.900	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	89	77.340	6,883.260	
3M CO	90	135.140	12,162.600	
ENTEGRIS INC	27	103.230	2,787.210	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	8	197.770	1,582.160	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	28	475.200	13,305.600	
ILLUMINA INC	27	146.070	3,943.890	
XCEL ENERGY INC	92	64.070	5,894.440	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	16	118.010	1,888.160	
NETAPP INC	32	126.530	4,048.960	
NEWMONT CORP	188	57.620	10,832.560	
NIKE INC-CL B	202	82.920	16,749.840	
NORDSON CORP	10	257.170	2,571.700	
NORFOLK SOUTHERN CORP	38	252.370	9,590.060	
EVERSOURCE ENERGY	55	66.130	3,637.150	
NISOURCE INC	72	35.140	2,530.080	
NORTHERN TRUST CORP	37	96.400	3,566.800	
NORTHROP GRUMMAN CORP	23	530.790	12,208.170	
WELLS FARGO & CO	576	64.360	37,071.360	
NUCOR CORP	42	158.240	6,646.080	
CHENIERE ENERGY INC	36	182.190	6,558.840	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	63	159.030	10,018.890	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	106	51.660	5,475.960	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	32	199.540	6,385.280	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	10	1,210.960	12,109.600	
ORACLE CORP	275	174.690	48,039.750	
PACCAR INC	86	110.090	9,467.740	
PTC INC	22	184.400	4,056.800	
EXELON CORP	170	40.950	6,961.500	
PARKER HANNIFIN CORP	21	640.440	13,449.240	
PAYCHEX INC	52	141.530	7,359.560	
ALIGN TECHNOLOGY INC	13	219.700	2,856.100	
PPL CORPORATION	109	32.660	3,559.940	
PEPSICO INC	227	175.060	39,738.620	
PENTAIR PLC	28	99.040	2,773.120	
PFIZER INC	945	29.220	27,612.900	
ESSENTIAL UTILITIES INC	49	40.550	1,986.950	
CONOCOPHILLIPS	190	105.670	20,077.300	
PG&E CORP	357	20.380	7,275.660	
ALTRIA GROUP INC	288	49.610	14,287.680	

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	66	189.380	12,499.080	
BROWN & BROWN INC	40	106.390	4,255.600	
GARMIN LTD	25	167.580	4,189.500	
PPG INDUSTRIES INC	36	130.930	4,713.480	
COSTCO WHOLESALE CORP	74	889.560	65,827.440	
T ROWE PRICE GROUP INC	37	115.630	4,278.310	
QUEST DIAGNOSTICS	17	149.650	2,544.050	
PROCTER & GAMBLE CO	392	171.280	67,141.760	
PROGRESSIVE CORP	99	251.120	24,860.880	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	89	89.760	7,988.640	
PULTE GROUP INC	36	149.040	5,365.440	
GLOBAL PAYMENTS INC	41	102.310	4,194.710	
QUALCOMM INC	184	170.920	31,449.280	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	31	138.510	4,293.810	
EXACT SCIENCES CORP	32	71.930	2,301.760	
RELIANCE INC	9	296.920	2,672.280	
REGENERON PHARMACEUTICALS	18	990.680	17,832.240	
RESMED INC	25	240.000	6,000.000	
US BANCORP	255	49.160	12,535.800	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	62	108.530	6,728.860	
ROSS STORES INC	54	149.900	8,094.600	
ROLLINS INC	46	50.140	2,306.440	
ROPER TECHNOLOGIES INC	18	557.620	10,037.160	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18	272.820	4,910.760	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	42	199.940	8,397.480	
RPM INTERNATIONAL INC	21	133.510	2,803.710	
ACCENTURE PLC-CL A	104	376.860	39,193.440	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	227	71.580	16,248.660	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18	290.030	5,220.540	
AXON ENTERPRISE INC	12	438.050	5,256.600	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	38	265.450	10,087.100	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	95	90.950	8,640.250	
BOOKING HOLDINGS INC	6	4,350.820	26,104.920	
SCHLUMBERGER LTD	231	41.920	9,683.520	
SCHWAB (CHARLES) CORP	254	71.360	18,125.440	
POOL CORP	7	370.410	2,592.870	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	31	106.310	3,295.610	
SEI INVESTMENTS CO	22	73.350	1,613.700	
ELEVANCE HEALTH INC	39	430.770	16,800.030	
CENCORA INC	31	237.430	7,360.330	

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	38	90.460	3,437.480	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	40	388.360	15,534.400	
CENTENE CORP	85	62.020	5,271.700	
SMITH (A.O.) CORP	17	78.750	1,338.750	
SNAP-ON INC	9	326.090	2,934.810	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	59	127.400	7,516.600	
EDISON INTERNATIONAL	59	85.430	5,040.370	
SOUTHERN CO	190	93.240	17,715.600	
TRUIST FINANCIAL CORP	225	43.670	9,825.750	
SOUTHWEST AIRLINES	29	30.980	898.420	
AT&T INC	1,205	21.850	26,329.250	
CHEVRON CORP	289	150.750	43,566.750	
STANLEY BLACK & DECKER INC	29	106.400	3,085.600	
STATE STREET CORP	53	91.430	4,845.790	
STARBUCKS CORP	187	96.840	18,109.080	
STEEL DYNAMICS INC	23	136.570	3,141.110	
STRYKER CORP	57	369.560	21,064.920	
NETFLIX INC	71	763.890	54,236.190	
GEN DIGITAL INC	98	27.200	2,665.600	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30	51.950	1,558.500	
SYNOPSIS INC	25	507.030	12,675.750	
SYSCO CORP	79	75.540	5,967.660	
INTUITIVE SURGICAL INC	59	521.150	30,747.850	
TELEFLEX INC	8	239.940	1,919.520	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	199	17.950	3,572.050	
TERADYNE INC	26	126.040	3,277.040	
TEXAS INSTRUMENTS INC	150	198.470	29,770.500	
TEXTRON INC	32	90.050	2,881.600	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	63	601.710	37,907.730	
TORO CO	18	83.890	1,510.020	
DAVITA INC	6	161.970	971.820	
TRACTOR SUPPLY CO	17	297.620	5,059.540	
BIO-TECHNE CORP	27	71.240	1,923.480	
TRIMBLE INC	44	61.770	2,717.880	
TYLER TECHNOLOGIES INC	7	588.430	4,119.010	
TYSON FOODS INC	54	60.010	3,240.540	
MARATHON OIL CORP	108	26.720	2,885.760	
UNION PACIFIC CORP	101	244.100	24,654.100	
RTX CORP	223	125.920	28,080.160	
UNITEDHEALTH GROUP INC	152	569.610	86,580.720	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	11	236.670	2,603.370	
PARAMOUNT GLOBAL	70	10.450	731.500	

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	43	483.000	20,769.000	
VULCAN MATERIALS CO	23	261.720	6,019.560	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	137	10.790	1,478.230	
WALMART INC	735	81.310	59,762.850	
WASTE MANAGEMENT INC	66	212.750	14,041.500	
WATERS CORP	9	348.450	3,136.050	
WATSCO INC	6	502.730	3,016.380	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	13	293.320	3,813.160	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	16	121.730	1,947.680	
WESTERN DIGITAL CORP	57	67.030	3,820.710	
WABTEC CORP	28	191.150	5,352.200	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	29	98.610	2,859.690	
WYNN RESORTS LTD	19	99.440	1,889.360	
NASDAQ INC	70	74.910	5,243.700	
CME GROUP INC	59	228.320	13,470.880	
WILLIAMS COS INC	199	52.360	10,419.640	
WILLIAMS-SONOMA INC	20	144.030	2,880.600	
DICK'S SPORTING GOODS INC	11	218.660	2,405.260	
LKQ CORP	50	39.310	1,965.500	
ALLIANT ENERGY CORP	37	62.170	2,300.290	
WEC ENERGY GROUP INC	52	99.850	5,192.200	
MICROSTRATEGY INC-CL A	26	215.860	5,612.360	
CARMAX INC	26	74.700	1,942.200	
TJX COMPANIES INC	189	117.710	22,247.190	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	9	375.450	3,379.050	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	343	4.020	1,378.860	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21	295.930	6,214.530	
CBRE GROUP INC	49	125.680	6,158.320	
REGIONS FINANCIAL CORP	156	23.820	3,715.920	
DOMINO'S PIZZA INC	6	428.850	2,573.100	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8	916.290	7,330.320	
CRH PLC	114	93.480	10,656.720	
WESTLAKE CORP	4	139.340	557.360	
T-MOBILE US INC	90	223.210	20,088.900	
LAS VEGAS SANDS CORP	68	51.550	3,505.400	
MOSAIC CO/THE	57	26.260	1,496.820	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6	288.830	1,732.980	
CELANESE CORP	19	135.970	2,583.430	
DEXCOM INC	68	72.380	4,921.840	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	20	194.970	3,899.400	
EXPEDIA GROUP INC	23	159.610	3,671.030	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	34	83.990	2,855.660	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16	523.160	8,370.560	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	95	166.830	15,848.850	
LIVE NATION	29	114.940	3,333.260	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	225	59.390	13,362.750	
TRANSDIGM GROUP INC	9	1,397.160	12,574.440	
MASTERCARD INC	138	516.340	71,254.920	
CELSIUS HOLDINGS INC	28	33.850	947.800	
OWENS CORNING	13	189.600	2,464.800	
LEIDOS HOLDINGS INC	23	169.520	3,898.960	
AERCAP HOLDINGS NV	33	97.490	3,217.170	
FIRST SOLAR INC	18	200.550	3,609.900	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	21	219.100	4,601.100	
SUPER MICRO COMPUTER INC	90	47.260	4,253.400	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21	107.890	2,265.690	
DELTA AIR LINES INC	27	55.800	1,506.600	
INSULET CORP	12	236.590	2,839.080	
DISCOVER FINANCIAL	43	148.680	6,393.240	
LULULEMON ATHLETICA INC	20	291.630	5,832.600	
MERCADOLIBRE INC	8	2,079.790	16,638.320	
ULTA BEAUTY INC	7	368.920	2,582.440	
MSCI INC	13	608.020	7,904.260	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	258	120.210	31,014.180	
VISA INC	260	290.620	75,561.200	
KEURIG DR PEPPER INC	177	36.940	6,538.380	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	33	141.960	4,684.680	
MARATHON PETROLEUM CORP	59	158.300	9,339.700	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	23	90.010	2,070.230	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	325	24.950	8,108.750	
XYLEM INC	39	134.320	5,238.480	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	46	91.490	4,208.540	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	5	261.530	1,307.650	
EPAM SYSTEMS INC	10	201.580	2,015.800	
HCA HEALTHCARE INC	33	415.540	13,712.820	
VERISK ANALYTICS INC	23	267.620	6,155.260	
CORPAY INC	11	353.510	3,888.610	
NXP SEMICONDUCTOR NV	42	233.450	9,804.900	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	22	163.910	3,606.020	

TARGA RESOURCES CORP	35	162.750	5,696.250	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	18	209.275	3,766.950	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	40	76.680	3,067.200	
DOLLAR GENERAL CORP	35	80.600	2,821.000	
FORTINET INC	107	81.070	8,674.490	
HYATT HOTELS CORP	8	153.930	1,231.440	
TESLA INC	476	220.700	105,053.200	
ENPHASE ENERGY INC	23	91.640	2,107.720	
GENERAL MOTORS CO	188	49.180	9,245.840	
ALLY FINANCIAL INC	39	35.010	1,365.390	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	12	258.620	3,103.440	
APTIV PLC	42	71.760	3,013.920	
PHILLIPS 66	70	132.600	9,282.000	
META PLATFORMS INC	364	576.470	209,835.080	
IQVIA HOLDINGS INC	29	236.690	6,864.010	
DIAMONDBACK ENERGY INC	30	183.990	5,519.700	
SERVICENOW INC	34	921.750	31,339.500	
PALO ALTO NETWORKS INC	54	374.830	20,240.820	
WORKDAY INC	35	244.480	8,556.800	
ABBVIE INC	292	188.860	55,147.120	
ZOETIS INC	76	193.280	14,689.280	
NEWS CORP/NEW-CL A	58	26.330	1,527.140	
CDW CORP	24	218.310	5,239.440	
HOWMET AEROSPACE INC	64	105.540	6,754.560	
TWILIO INC	30	70.850	2,125.500	
SNAP INC	190	10.490	1,993.100	
TRADE DESK INC A	73	118.760	8,669.480	
OKTA INC	27	74.820	2,020.140	
BAKER HUGHES CO	176	36.400	6,406.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	25	78.220	1,955.500	
CNH INDUSTRIAL NV	118	11.160	1,316.880	
BROADCOM INC	734	179.890	132,039.260	
ARES MANAGEMENT CORP	28	169.890	4,756.920	
MONGODB INC	13	275.540	3,582.020	
BURLINGTON STORES INC	10	257.780	2,577.800	
VEEVA SYSTEMS INC	27	221.320	5,975.640	
EVERGY INC	37	61.120	2,261.440	
ALLEGION PLC	13	153.360	1,993.680	
DAYFORCE INC	25	65.000	1,625.000	
STERIS PLC	15	225.650	3,384.750	
DOCUSIGN INC	31	72.300	2,241.300	
WIX.COM LTD	8	173.390	1,387.120	
KKR & CO INC	100	139.810	13,981.000	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	10	93.260	932.600	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	39	70.520	2,750.280	
MODERNA INC	56	54.100	3,029.600	

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40	238.810	9,552.400	
CIGNA GROUP	48	336.000	16,128.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	43	126.460	5,437.780	
DOW INC	124	53.110	6,585.640	
OVINTIV INC	50	40.790	2,039.500	
AMCOR PLC	264	11.240	2,967.360	
PINTEREST INC	106	33.180	3,517.080	
FOX CORP-A	46	42.470	1,953.620	
FOX CORP-B	24	38.970	935.280	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	38	310.150	11,785.700	
AVANTOR INC	121	24.730	2,992.330	
DYNATRACE INC	42	54.860	2,304.120	
CLOUDFLARE INC	51	90.800	4,630.800	
TRADEWEB MARKETS INC	21	133.040	2,793.840	
CARRIER GLOBAL CORP	134	81.550	10,927.700	
OTIS WORLDWIDE CORP	71	106.010	7,526.710	
UBER TECHNOLOGIES INC	315	79.160	24,935.400	
CORTEVA INC	111	59.410	6,594.510	
MATCH GROUP INC	45	38.430	1,729.350	
BLACKSTONE INC	119	172.360	20,510.840	
CARLYLE GROUP INC	43	52.280	2,248.040	
DATADOG INC	49	128.120	6,277.880	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	32	112.120	3,587.840	
VERTIV HOLDINGS CO	58	112.250	6,510.500	
INGERSOLL RAND INC	64	100.400	6,425.600	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	74	91.340	6,759.160	
PAYCOM SOFTWARE INC	9	165.890	1,493.010	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	116	10.040	1,164.640	
DRAFTKINGS INC	74	38.460	2,846.040	
CHORD ENERGY CORP	10	129.980	1,299.800	
AON PLC	32	357.930	11,453.760	
WARNER BROS DISCOVERY INC	397	7.820	3,104.540	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	3	1,058.530	3,175.590	
BENTLEY SYSTEMS INC	22	49.940	1,098.680	
COINBASE GLOBAL INC	30	220.210	6,606.300	
AIRBNB INC	72	136.450	9,824.400	
CONSTELLATION ENERGY CORP	53	270.160	14,318.480	
MONDAY.COM LTD	6	287.310	1,723.860	
SOLVENTUM CORP	24	73.680	1,768.320	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	39	31.710	1,236.690	
APPLOVIN CORP	33	145.220	4,792.260	
ROYALTY PHARMA PLC	55	27.980	1,538.900	
ROBLOX CORP	74	39.930	2,954.820	
VIATRIS INC	201	11.760	2,363.760	

EXPAND ENERGY CORP	22	86.660	1,906.520	
BLACKROCK INC	25	1,007.020	25,175.500	
HF SINCLAIR CORP	31	44.270	1,372.370	
SNOWFLAKE INC	50	119.540	5,977.000	
DOORDASH INC	50	151.980	7,599.000	
ARISTA NETWORKS INC	44	402.000	17,688.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	69	145.010	10,005.690	
GLOBAL-E ONLINE LTD	18	38.110	685.980	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	331	42.970	14,223.070	
FNF GROUP	43	62.160	2,672.880	
JACOBS SOLUTIONS INC	20	143.900	2,878.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	142	79.850	11,338.700	
APA CORP	57	25.160	1,434.120	
LINDE PLC	80	486.450	38,916.000	
ROBINHOOD MARKETS INC	65	26.830	1,743.950	
U-HAUL HOLDING CO	18	67.530	1,215.540	
ASPEN TECHNOLOGY INC	6	239.080	1,434.480	
TOAST INC	48	30.320	1,455.360	
GE VERNOVA INC	45	272.720	12,272.400	
GRAB HOLDINGS LTD	357	3.730	1,331.610	
CATALENT INC	33	60.290	1,989.570	
SYNCHRONY FINANCIAL	68	56.420	3,836.560	
VERALTO CORP	43	113.600	4,884.800	
SAMSARA INC	27	50.000	1,350.000	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	29	80.280	2,328.120	
BUNGE GLOBAL SA	22	89.550	1,970.100	
KENVUE INC	316	21.720	6,863.520	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	79	42.470	3,355.130	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	299.980	2,399.840	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	28	159.950	4,478.600	
HUBSPOT INC	8	537.140	4,297.120	
QORVO INC	17	104.500	1,776.500	
TE CONNECTIVITY PLC	50	148.970	7,448.500	
SMURFIT WESTROCK PLC	79	44.350	3,503.650	
FERGUSON ENTERPRISES INC	33	204.480	6,747.840	
LABCORP HOLDINGS INC	15	215.770	3,236.550	
GODADDY INC	22	164.700	3,623.400	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	29	232.330	6,737.570	
TRANSUNION	35	107.860	3,775.100	
ALBERTSONS COS INC	55	19.000	1,045.000	
BLOCK INC	90	74.660	6,719.400	
DUPONT DE NEMOURS INC	65	85.090	5,530.850	

	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	32	78.720	2,519.040	
	KRAFT HEINZ CO	148	36.000	5,328.000	
	FORTIVE CORP	62	77.470	4,803.140	
	WASTE CONNECTIONS INC	45	182.600	8,217.000	
	ALPHABET INC-CL A	973	163.420	159,007.660	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	233	20.690	4,820.770	
	PAYPAL HOLDINGS INC	165	80.940	13,355.100	
	SEA LTD ADR	58	98.900	5,736.200	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	60	45.980	2,758.800	
	ZILLOW GROUP INC-C	29	63.710	1,847.590	
	ALPHABET INC-CL C	840	165.050	138,642.000	
	PURE STORAGE INC	49	57.070	2,796.430	
	ZSCALER INC	16	190.010	3,040.160	
	ATLASSIAN CORP PLC	28	191.700	5,367.600	
	ROKU INC	24	80.070	1,921.680	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	15	325.610	4,884.150	
	VISTRA CORP	61	131.160	8,000.760	
アメリカ・ドル	小計	61,226		8,333,668.900 (1,245,300,146)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	69	18.290	1,262.010	
	ASHTED GROUP	76	59.020	4,485.520	
	SEVERN TRENT PLC	53	27.140	1,438.420	
	BARCLAYS PLC	2,497	2.422	6,047.730	
	BARRATT REDROW PLC	208	4.881	1,015.240	
	BT GROUP PLC	1,139	1.462	1,665.210	
	BUNZL PLC	65	35.760	2,324.400	
	AVIVA PLC	389	4.880	1,898.320	
	CRODA INTERNATIONAL	25	37.420	935.500	
	DIAGEO PLC	370	26.515	9,810.550	
	SCHRODERS PLC	48	3.730	179.040	
	DCC PLC	18	52.450	944.100	
	NATIONAL GRID PLC	799	10.280	8,213.720	
	KINGFISHER PLC	275	3.134	861.850	
	BAE SYSTEMS PLC	502	13.245	6,648.990	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	331	26.400	8,738.400	
	HALMA PLC	74	24.940	1,845.560	
	NEXT PLC	20	102.450	2,049.000	
	IMPERIAL BRANDS PLC	133	23.080	3,069.640	
	ANGLO AMERICAN PLC	212	23.795	5,044.540	
	COMPASS GROUP PLC	279	25.170	7,022.430	
	HSBC HOLDINGS PLC	3,072	6.806	20,908.030	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	998	2.301	2,296.390	
	CENTRICA PLC	1,031	1.270	1,309.370	

UNILEVER PLC	414	48.310	20,000.340	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	96	10.870	1,043.520	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	66	23.480	1,549.680	
PEARSON PLC	99	10.385	1,028.110	
PERSIMMON PLC	64	16.595	1,062.080	
PRUDENTIAL PLC	433	6.734	2,915.820	
RIO TINTO PLC	190	49.955	9,491.450	
VODAFONE GROUP PLC	3,647	0.750	2,735.250	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	111	47.760	5,301.360	
RELX PLC	313	36.790	11,515.270	
RENTOKIL INITIAL PLC	395	3.720	1,469.400	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,401	5.674	7,949.270	
NATWEST GROUP PLC	1,059	3.607	3,819.810	
SSE PLC	186	19.050	3,543.300	
BP PLC	2,719	3.996	10,865.120	
SAGE GROUP PLC(THE)	196	10.405	2,039.380	
SMITHS GROUP PLC	36	16.330	587.880	
SPIRAX GROUP PLC	14	68.100	953.400	
STANDARD CHARTERED PLC	359	8.384	3,009.850	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,835	0.621	6,728.530	
TAYLOR WIMPLEY PLC	400	1.629	651.600	
TESCO PLC	1,146	3.618	4,146.220	
3I GROUP PLC	160	34.030	5,444.800	
SMITH & NEPHEW PLC	134	11.275	1,510.850	
GSK PLC	679	14.760	10,022.040	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	78	105.350	8,217.300	
WPP PLC	202	7.862	1,588.120	
ASTRAZENECA PLC	257	119.460	30,701.220	
WHITBREAD PLC	18	32.870	591.660	
INTERTEK GROUP PLC	29	51.150	1,483.350	
INTERCONTINENTAL HOTELS	29	86.180	2,499.220	
SAINSBURY (J) PLC	302	2.796	844.390	
ADMIRAL GROUP PLC	50	27.460	1,373.000	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11	48.370	532.070	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29	19.980	579.420	
EXPERIAN PLC	148	39.290	5,814.920	
MONDI PLC	60	12.830	769.800	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	76	10.860	825.360	
INFORMA PLC	253	8.384	2,121.150	
GLENORE PLC	1,731	4.087	7,074.590	
ENTAIN PLC	96	7.274	698.300	
COCA-COLA HBC AG	32	28.300	905.600	

	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	130	5.325	692.250	
	M&G PLC	366	2.083	762.370	
	ENDEAVOUR MINING PLC	18	18.720	336.960	
	WISE PLC	103	7.090	730.270	
	JD SPORTS FASHION PLC	595	1.366	812.770	
	HALEON PLC	1,200	3.817	4,580.400	
	SHELL PLC	1,046	25.365	26,531.790	
	AUTO TRADER GROUP PLC	134	8.854	1,186.430	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	201	4.416	887.610	
イギリス・ポンド 小計		45,029		322,538.610 (62,882,127)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	202	37.790	7,633.580	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	266	37.200	9,895.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	4	820.400	3,281.600	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	247	21.590	5,332.730	
	ICL GROUP LTD	193	15.790	3,047.470	
	NICE LTD	12	683.000	8,196.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17	150.700	2,561.900	
イスラエル・シュケル 小計		941		39,948.480 (1,606,364)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	30	42.360	1,270.800	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	570	32.410	18,473.700	
	FORTESCUE LTD	249	19.540	4,865.460	
	TELSTRA GROUP LTD	685	3.910	2,678.350	
	ASX LTD	26	67.260	1,748.760	
	BHP GROUP LTD	850	42.060	35,751.000	
	AMPOL LTD	49	28.640	1,403.360	
	COMPUTERSHARE LT	83	26.320	2,184.560	
	CSL LIMITED	80	300.580	24,046.400	
	REA GROUP LTD	6	223.810	1,342.860	
	TRANSURBAN GROUP	521	13.450	7,007.450	
	COCHLEAR LTD	11	283.500	3,118.500	
	ORIGIN ENERGY LTD	315	9.810	3,090.150	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	280	142.850	39,998.000	
	RIO TINTO LIMITED	63	117.620	7,410.060	
	APA GROUP	248	7.160	1,775.680	
	ARISTOCRAT LEISU	88	58.300	5,130.400	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	444	7.520	3,338.880	
	PRO MEDICUS LTD	9	192.810	1,735.290	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	76	53.190	4,042.440	
ORICA LTD	100	17.960	1,796.000		
BLUESCOPE STEEL LTD	51	21.600	1,101.600		

MACQUARIE GROUP LTD	62	236.030	14,633.860	
SUNCORP GROUP LTD	237	18.160	4,303.920	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	510	39.180	19,981.800	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	136	7.370	1,002.320	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	244	17.290	4,218.760	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	209	17.080	3,569.720	
REECE LTD	30	26.570	797.100	
SANTOS LTD	483	6.900	3,332.700	
SONIC HEALTHCARE	85	27.070	2,300.950	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	40	34.360	1,374.400	
WESFARMERS LTD	187	70.230	13,133.010	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	300	24.630	7,389.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	218	32.700	7,128.600	
SEEK LTD	49	24.960	1,223.040	
MINERAL RESOURCES LTD	27	45.860	1,238.220	
BRAMBLES LTD	256	19.080	4,884.480	
PILBARA MINERALS LTD	512	2.670	1,367.040	
CAR GROUP LTD	72	37.080	2,669.760	
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	32	43.040	1,377.280	
TREASURY WINE ESTATES LTD	123	11.540	1,419.420	
XERO LTD	27	147.650	3,986.550	
LOTTERY CORP LTD	433	5.130	2,221.290	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	193	4.790	924.470	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	520	31.590	16,426.800	
MEDIBANK PVT LTD	498	3.660	1,822.680	
SOUTH32 LTD(AUD)	667	3.700	2,467.900	
COLES GROUP LTD	188	17.880	3,361.440	
WISETECH GLOBAL LTD	27	122.480	3,306.960	
オーストラリア・ドル 小計	11,199		305,173.170 (30,575,300)	
カナダ・ドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	87	119.010	10,353.870	
BARRICK GOLD CORP	278	28.880	8,028.640	
BANK OF MONTREAL	117	129.870	15,194.790	
BANK OF NOVA SCOTIA	209	73.960	15,457.640	
NATIONAL BANK OF CANADA	56	131.320	7,353.920	
BCE INC	8	46.310	370.480	
BROOKFIELD CORP	222	77.890	17,291.580	
SAPUTO INC	46	27.820	1,279.720	
DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17	147.040	2,499.680	
CGI INC	37	160.580	5,941.460	
CCL INDUSTRIES INC	30	83.300	2,499.000	

CAE INC	67	26.490	1,774.830	
CAMECO CORP	74	80.130	5,929.620	
ROGERS COMM-CL B	63	53.970	3,400.110	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	151	86.480	13,058.480	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	356	49.060	17,465.360	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	11	159.720	1,756.920	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	87	156.840	13,645.080	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31	65.600	2,033.600	
OPEN TEXT CORP	50	46.960	2,348.000	
EMPIRE CO LTD	12	40.750	489.000	
KINROSS GOLD CORP	202	14.640	2,957.280	
RB GLOBAL INC	33	111.990	3,695.670	
FORTIS INC	80	62.090	4,967.200	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	116	18.300	2,122.800	
TELUS CORP	88	22.570	1,986.160	
GREAT WEST LIFECO INC	47	47.630	2,238.610	
IMPERIAL OIL LTD	34	106.310	3,614.540	
ENBRIDGE INC	364	57.970	21,101.080	
IGM FINANCIAL INC	10	42.490	424.900	
MANULIFE FINANCIAL CORP	291	42.100	12,251.100	
LOBLAW CO LTD	25	177.230	4,430.750	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	125	73.730	9,216.250	
MAGNA INTERNATIONAL INC	49	60.060	2,942.940	
SUN LIFE FINANCIAL INC	95	78.900	7,495.500	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	1,728.540	5,185.620	
METRO INC	39	84.760	3,305.640	
EMERA INC	46	53.600	2,465.600	
ONEX CORP	13	99.110	1,288.430	
PAN AMERICAN SILVER CORP	73	33.690	2,459.370	
POWER CORP OF CANADA	98	44.390	4,350.220	
QUEBECOR INC-B	38	34.340	1,304.920	
ROYAL BANK OF CANADA	234	174.080	40,734.720	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	157	110.570	17,359.490	
STANTEC INC	18	115.650	2,081.700	
SUNCOR ENERGY INC	211	54.000	11,394.000	
LUNDIN MINING CORP	58	14.470	839.260	
TECK RESOURCES LTD-CL B	84	69.660	5,851.440	
THOMSON REUTERS CORP	26	232.760	6,051.760	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	12	133.620	1,603.440	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	285	77.840	22,184.400	
TC ENERGY CORP	178	66.420	11,822.760	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	10	133.110	1,331.100	
WESTON (GEORGE) LTD	10	223.360	2,233.600	
INTACT FINANCIAL CORP	31	270.870	8,396.970	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	72	91.810	6,610.320	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3	4,431.060	13,293.180	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	34	182.460	6,203.640	
TOURMALINE OIL CORP	60	62.320	3,739.200	
KEYERA CORP	42	44.020	1,848.840	
PARKLAND CORP	18	35.430	637.740	
ALTAGAS LTD	34	35.700	1,213.800	
PEMBINA PIPELINE CORP	95	59.450	5,647.750	
DOLLARAMA INC	50	144.740	7,237.000	
MEG ENERGY CORP	43	25.660	1,103.380	
CENOVUS ENERGY INC W/I	237	23.380	5,541.060	
ARC RESOURCES LTD	94	22.870	2,149.780	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	70	29.500	2,065.000	
TMX GROUP LTD	40	43.690	1,747.600	
BRP INC	7	79.320	555.240	
IVANHOE MINES LTD	91	19.680	1,790.880	
NUTRIEN LTD	78	65.840	5,135.520	
TFI INTERNATIONAL INC	14	189.950	2,659.300	
WSP GLOBAL INC	20	250.490	5,009.800	
IA FINANCIAL CORP INC	17	118.440	2,013.480	
GFL ENVIRONMENTAL INC	34	57.070	1,940.380	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	18	45.840	825.120	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	58	71.150	4,126.700	
AIR CANADA	21	18.280	383.880	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	51	97.390	4,966.890	
SHOPIFY INC	201	114.200	22,954.200	
FIRSTSERVICE CORP	4	258.170	1,032.680	
HYDRO ONE LTD	48	46.320	2,223.360	
カナダ・ドル 小計	6,746		494,516.720 (53,511,654)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	300	4.810	1,443.000
	SEMBCORP INDUSTRIES	100	5.520	552.000
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	340	39.700	13,498.000
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	200	11.740	2,348.000
	GENTING SINGAPORE LTD	800	0.845	676.000
	KEPPEL LTD	300	6.470	1,941.000
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	600	15.400	9,240.000

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,400	3.260	4,564.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	200	6.500	1,300.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	200	32.600	6,520.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	300	3.280	984.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	400	3.000	1,200.000	
シンガポール・ドル 小計		5,140		44,266.000 (5,047,652)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	30	76.120	2,283.600	
	NESTLE SA-REGISTERED	444	85.980	38,175.120	
	CIE FINANC RICHEMONT	93	127.450	11,852.850	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	116	273.300	31,702.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5	260.000	1,300.000	
	SIKA INHABER	25	255.000	6,375.000	
	SGS SA-REG	27	96.740	2,611.980	
	NOVARTIS AG-REG SHS	326	100.980	32,919.480	
	BALOISE HOLDING AG -R	8	175.100	1,400.800	
	BARRY CALLEBAUT AG	1	1,581.000	1,581.000	
	CLARIANT AG-REG	45	12.480	561.600	
	SWISSCOM AG-REG	5	565.500	2,827.500	
	ABB LTD	270	49.540	13,375.800	
	ADECCO GROUP AG-REG	23	28.180	648.140	
	GEBERIT AG	6	532.400	3,194.400	
	LONZA GROUP AG-REG	12	552.000	6,624.000	
	GIVAUDAN-REG	2	4,342.000	8,684.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	24	527.400	12,657.600	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	5	299.800	1,499.000	
	HOLCIM LTD	87	84.780	7,375.860	
	TEMENOS GROUP	10	63.900	639.000	
	BACHEM HOLDING AG	5	69.300	346.500	
	SONOVA HOLDING AG	8	323.300	2,586.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8	224.900	1,799.200	
	STRAUMANN HOLDING AG	19	130.600	2,481.400	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6	171.850	1,031.100	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	21	34.000	714.000	
	HELVETIA HOLDING AG	5	152.700	763.500	
	SCHINDLER NAMEN	6	252.000	1,512.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5	722.400	3,612.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	8	90.850	726.800	
EMS-CHEMIE HOLDING	1	689.000	689.000		
SWISS PRIME SITE AG	12	96.000	1,152.000		
AVOLTA AG	9	34.660	311.940		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4	1,289.500	5,158.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	31	55.260	1,713.060		

	SWISS RE LTD	48	116.800	5,606.400	
	BKW AG	2	157.500	315.000	
	SIG GROUP AG	50	18.610	930.500	
	ALCON INC	83	82.380	6,837.540	
	SANDOZ GROUP AG	74	36.770	2,720.980	
	GALDERMA GROUP AG	7	78.920	552.440	
	UBS GROUP AG	552	28.460	15,709.920	
	VAT GROUP AG	5	374.300	1,871.500	
スイス・フラン	小計	2,533		247,430.710 (42,723,861)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	469	183.550	86,084.950	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	238	163.400	38,889.200	
	ERICSSON LM-B SHS	441	89.020	39,257.820	
	GETINGE AB-B SHS	49	199.150	9,758.350	
	LUNDBERGS B	9	553.000	4,977.000	
	SKF AB-B SHS	67	200.000	13,400.000	
	SANDVIK AB	184	217.600	40,038.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	281	155.000	43,555.000	
	SKANSKA AB-B SHS	48	220.300	10,574.400	
	SWEDBANK AB	126	207.200	26,107.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	84	140.500	11,802.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	265	102.800	27,242.000	
	TRELLEBORG AB-B SHS	31	366.800	11,370.800	
	VOLVO AB-A SHS	47	275.600	12,953.200	
	VOLVO AB-B SHS	249	274.300	68,300.700	
	HOLMEN AB-B SHS	8	429.400	3,435.200	
	TELE2 AB-B SHS	65	113.350	7,367.750	
	INDUSTRIVARDEN A	19	367.800	6,988.200	
	INDUSTRIVARDEN C	30	366.100	10,983.000	
	SAAB AB-B	52	219.600	11,419.200	
	SECURITAS AB-B SHS	101	131.100	13,241.100	
	INVESTOR AB-B SHS	290	309.950	89,885.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	87	175.700	15,285.900	
	ASSA ABLOY AB-B	170	340.000	57,800.000	
	TELIA CO AB	292	32.140	9,384.880	
	BOLIDEN AB	46	332.000	15,272.000	
	ALFA LAVAL AB	48	475.100	22,804.800	
	FASTIGHETS AB BALDER	144	83.320	11,998.080	
	INDUTRADE AB	40	300.800	12,032.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25	69.640	1,741.000	
	NIBE INDUSTRIER AB	276	50.320	13,888.320	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	41	318.800	13,070.800	
	HEXAGON AB-B SHS	359	103.300	37,084.700	
	SAGAX AB	37	271.000	10,027.000	

	EPIROC AB-A	126	212.900	26,825.400	
	EPIROC AB-B	56	190.000	10,640.000	
	ESSITY AB-B	109	313.500	34,171.500	
	EQT AB	68	325.000	22,100.000	
	ADDTECH AB	39	302.400	11,793.600	
	VOLVO CAR AB	144	23.540	3,389.760	
	BEIJER REF AB	40	167.800	6,712.000	
	LIFCO AB	43	331.400	14,250.200	
	EVOLUTION AB	32	957.800	30,649.600	
	INVESTMENT AB LATOUR	23	303.500	6,980.500	
スウェーデン・クローナ 小計		5,398		975,533.010 (13,842,813)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	18	805.600	14,500.800	
	AP MOLLER MAERSK A	1	10,170.000	10,170.000	
	DANSKE BANK A/S	124	200.500	24,862.000	
	GENMAB A/S	10	1,563.500	15,635.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	56	451.800	25,300.800	
	ROCKWOOL AS	2	3,132.000	6,264.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	534	807.200	431,044.800	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	173	129.500	22,403.500	
	COLOPLAST-B	20	896.400	17,928.000	
	DSV A/S	28	1,496.500	41,902.000	
	DEMANT A/S	22	269.000	5,918.000	
	TRYG A/S	68	162.300	11,036.400	
	ZEALAND PHARMA A/S	10	804.000	8,040.000	
	PANDORA A/S	15	1,073.500	16,102.500	
ORSTED A/S	34	442.400	15,041.600		
デンマーク・クローネ 小計		1,115		666,149.400 (14,502,072)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	191	7.540	1,440.140	
	FISHER & PAYKEL	93	37.010	3,441.930	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	235	3.055	717.920	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	87	6.910	601.170	
	MERIDIAN ENERGY LTD	226	6.125	1,384.250	
ニュージーランド・ドル 小計		832		7,585.410 (688,604)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	68	196.850	13,385.800	
	NORSK HYDRO ASA	235	68.720	16,149.200	
	TELENOR ASA	133	131.800	17,529.400	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	12	1,119.000	13,428.000	
	ORKLA ASA	135	102.500	13,837.500	
	EQUINOR ASA	134	263.000	35,242.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33	341.200	11,259.600	
	AKER BP ASA	61	229.800	14,017.800	
	SALMAR ASA	11	578.000	6,358.000	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24	198.300	4,759.200	
	DNB BANK ASA	129	221.900	28,625.100	
ノルウェー・クローネ 小計		975		174,591.600 (2,388,413)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	29	94.600	2,743.400	
	KINGSPAN GROUP PLC	26	83.300	2,165.800	
	AIR LIQUIDE	96	173.680	16,673.280	
	AIRBUS SE	99	139.560	13,816.440	
	AXA SA	303	36.080	10,932.240	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	117	30.570	3,576.690	
	ADIDAS AG	29	227.900	6,609.100	
	GENERALI	171	26.980	4,613.580	
	DASSAULT AVIATION SA	4	191.900	767.600	
	DANONE	112	64.800	7,257.600	
	SAFRAN SA	57	215.100	12,260.700	
	INTESA SANPAOLO	2,427	4.000	9,708.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	52	75.100	3,905.200	
	ACCOR SA	28	41.980	1,175.440	
	BOUYGUES	28	30.180	845.040	
	BNP PARIBAS	173	66.270	11,464.710	
	THALES SA	15	153.500	2,302.500	
	CAPGEMINI SA	25	184.550	4,613.750	
	UNICREDIT SPA	255	40.825	10,410.370	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	15	103.700	1,555.500	
	D' IETEREN TRDG	2	195.500	391.000	
	COMMERZBANK AG	164	16.590	2,720.760	
	EIFFAGE	15	89.860	1,347.900	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	76	33.450	2,542.200	
	PUBLICIS GROUPE	36	101.500	3,654.000	
	IBERDROLA SA	1,007	13.990	14,087.930	
	ENI SPA	369	14.102	5,203.630	
	JERONIMO MARTINS	51	16.950	864.450	
	KESKO OYJ-B	35	18.465	646.270	
	KBC GROUPE	43	67.980	2,923.140	
	HANNOVER RUECK SE	11	257.700	2,834.700	
	WARTSILA OYJ	90	20.020	1,801.800	
	L'OREAL	40	372.700	14,908.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	46	623.200	28,667.200		
GEA GROUP AG	28	47.000	1,316.000		
BOLLORE	81	5.910	478.710		
MEDIOBANCA SPA	73	16.125	1,177.120		
MICHELIN(CGDE) -B	120	34.320	4,118.400		
CONTINENTAL AG	17	60.440	1,027.480		
DEUTSCHE POST AG-REG	162	38.000	6,156.000		
OMV AG	27	38.760	1,046.520		

VERBUND AG	13	77.300	1,004.900	
PERNOD-RICARD	32	127.650	4,084.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	27	40.240	1,086.480	
RENAULT SA	36	40.480	1,457.280	
REPSOL SA	214	11.720	2,508.080	
MERCK KGAA	22	164.700	3,623.400	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	73	84.780	6,188.940	
RWE AG	113	31.490	3,558.370	
SEB SA	2	98.300	196.600	
SOCIETE GENERALE-A	114	23.955	2,730.870	
VINCI S.A.	82	107.300	8,798.600	
SODEXO	15	76.200	1,143.000	
SOFINA	3	239.000	717.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	91	246.050	22,390.550	
VIVENDI SE	106	10.560	1,119.360	
SAP SE	173	212.850	36,823.050	
TELEFONICA S.A	695	4.435	3,082.320	
TOTALENERGIES SE	359	59.660	21,417.940	
E.ON SE	346	13.025	4,506.650	
VOEST-ALPINE AG	26	20.280	527.280	
HENKEL AG & CO KGAA	16	76.900	1,230.400	
SIEMENS AG-REG	127	185.600	23,571.200	
UPM-KYMMENE OYJ	77	28.660	2,206.820	
ING GROEP NV-CVA	551	15.980	8,804.980	
PUMA AG	14	39.370	551.180	
BAYER AG	154	26.375	4,061.750	
STORA ENSO OYJ-R SHS	97	10.840	1,051.480	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	31	84.840	2,630.040	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	120	57.300	6,876.000	
BASF SE	144	46.990	6,766.560	
BEIERSDORF AG	16	131.800	2,108.800	
HEIDELBERG MATERIALS AG	26	98.700	2,566.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	38	37.770	1,435.260	
ASM INTERNATIONAL NV	8	518.800	4,150.400	
ORANGE	346	10.175	3,520.550	
SAMPO OYJ-A SHS	71	41.950	2,978.450	
RANDSTAD NV	20	43.590	871.800	
ALLIANZ SE	65	304.300	19,779.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	567	3.903	2,213.000	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	155	30.720	4,761.600	
HERMES INTL	5	2,089.000	10,445.000	
ENDESA S.A.	49	19.665	963.580	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	81	6.766	548.040	
ERSTE GROUP BANK AG	60	50.200	3,012.000	

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	22	505.200	11,114.400	
ARCELOR MITTAL (NL)	88	22.480	1,978.240	
DASSAULT SYSTEMES SA	107	33.310	3,564.170	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	25	43.880	1,097.000	
RHEINMETALL STAMM	7	488.100	3,416.700	
HEINEKEN NV	50	78.320	3,916.000	
AKZO NOBEL	33	63.400	2,092.200	
ASML HOLDING NV	66	664.500	43,857.000	
AEGON LTD	233	5.908	1,376.560	
VOLKSWAGEN AG PFD	36	91.920	3,309.120	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	954	9.290	8,862.660	
KERING	13	238.050	3,094.650	
ACCIONA S.A.	4	124.200	496.800	
FORTUM OYJ	90	14.565	1,310.850	
AGEAS	25	49.340	1,233.500	
UCB SA	23	173.400	3,988.200	
NEMETSCHEK SE	12	101.500	1,218.000	
CARREFOUR SA	95	15.130	1,437.350	
NOKIA OYJ	922	4.274	3,940.620	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	130	29.500	3,835.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	40	159.000	6,360.000	
SANOFI	191	100.820	19,256.620	
STMICROELECTRONICS NV	106	25.635	2,717.310	
ELISA OYJ	14	46.560	651.840	
BANCO SANTANDER SA	2,583	4.640	11,985.120	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	103	17.200	1,771.600	
QIAGEN N.V.	32	39.380	1,260.160	
DEUTSCHE BANK AG-REG	308	16.208	4,992.060	
BMW VORZUG	8	71.000	568.000	
ENEL SPA	1,372	7.332	10,059.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	559	28.280	15,808.520	
SARTORIUS AG	5	266.200	1,331.000	
LEONARDO SPA	76	21.990	1,671.240	
CTS EVENTIM AG	8	98.600	788.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	213	30.765	6,552.940	
RATIONAL AG	1	933.500	933.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG	5	64.800	324.000	
BECHTLE AG	15	36.500	547.500	
KONINKLIJKE KPN NV	551	3.800	2,093.800	
EUROFINS SCIENTIFIC	25	56.420	1,410.500	
TELEPERFORMANCE	9	99.120	892.080	
DEUTSCHE BOERSE AG	33	218.000	7,194.000	
EURAZEO	11	74.700	821.700	
BANCO SABADELL	796	1.869	1,487.720	

GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15	70.550	1,058.250	
HEINEKEN HOLDING NV-A	24	67.250	1,614.000	
INDITEX	176	53.700	9,451.200	
ESSILORLUXOTTICA	49	216.900	10,628.100	
SNAM SPA	307	4.579	1,405.750	
CREDIT AGRICOLE SA	179	14.315	2,562.380	
TENARIS SA	87	14.530	1,264.110	
TELECOM ITALIA SPA	1,698	0.253	429.590	
TERNA SPA	198	8.216	1,626.760	
BIOMERIEUX	8	105.900	847.200	
GRIFOLS SA	56	9.992	559.550	
NESTE OYJ	79	15.290	1,207.910	
RECORDATI SPA	19	54.200	1,029.800	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	89	7.780	692.420	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	10	311.000	3,110.000	
KONE OYJ	57	52.960	3,018.720	
ELIA GROUP	4	97.500	390.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	5	211.900	1,059.500	
ENGIE	322	15.930	5,129.460	
ALSTOM	49	20.510	1,004.990	
IPSEN SA	5	115.900	579.500	
ARKEMA SA	6	84.300	505.800	
LEGRAND SA	45	106.350	4,785.750	
AMPLIFON SPA	27	27.760	749.520	
ADP	4	113.100	452.400	
ORION OYJ	14	47.630	666.820	
METSO CORPORATION	125	9.442	1,180.250	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	72	16.545	1,191.240	
SYMRISE AG	23	118.450	2,724.350	
REXEL SA	25	25.930	648.250	
PRYSMIAN SPA	43	67.920	2,920.560	
DIASORIN ITALIA SPA	3	104.750	314.250	
CAIXABANK	653	5.540	3,617.620	
BUREAU VERITAS SA	49	30.340	1,486.660	
GETLINK	48	16.080	771.840	
EDP RENOVAVEIS SA	27	13.950	376.650	
AMADEUS IT GROUP SA	74	67.540	4,997.960	
BRENTAG SE	21	64.280	1,349.880	
EVONIK INDUSTRIES AG	39	21.070	821.730	
EDENRED	45	33.690	1,516.050	
TALANX AG	13	76.450	993.850	
LEG IMMOBILIEN SE	15	92.600	1,389.000	
VONOVIA SE	128	32.150	4,115.200	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	204	8.896	1,814.780	
KNORR-BREMSE AG	12	81.500	978.000	

OCI NV	17	25.150	427.550	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	50	52.440	2,622.000	
FERRARI NV	21	443.300	9,309.300	
ASR NEDERLAND NV	28	45.060	1,261.680	
AIB GROUP PLC	250	4.924	1,231.000	
NORDEA BANK ABP	507	11.080	5,617.560	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	13	36.820	478.660	
MONCLER SPA	39	55.200	2,152.800	
NEXI SPA	60	5.980	358.800	
PROSUS NV	233	39.340	9,166.220	
DR ING HC F PORSCHE AG	22	67.320	1,481.040	
JDE PEET'S BV	9	18.960	170.640	
EXOR NV	17	98.700	1,677.900	
SIEMENS ENERGY AG	96	36.520	3,505.920	
INPOST SA	31	18.720	580.320	
EURONEXT NV	16	102.500	1,640.000	
IMCD NV	7	152.000	1,064.000	
NN GROUP NV	39	46.450	1,811.550	
FINECOBANK SPA	76	15.460	1,174.960	
ARGENX SE	10	509.400	5,094.000	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	144	24.070	3,466.080	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	78	37.800	2,948.400	
DSM-FIRMENICH AG	27	118.100	3,188.700	
SYENSQO SA	10	74.030	740.300	
ZALANDO SE	43	29.910	1,286.130	
STELLANTIS NV	342	12.184	4,166.920	
FERROVIAL SE	80	38.960	3,116.800	
AENA SME SA	12	204.000	2,448.000	
CELLNEX TELECOM SAU	75	36.120	2,709.000	
BANCO BPM SPA	227	6.402	1,453.250	
ABN AMRO BANK NV	70	15.600	1,092.000	
SCOUT24 SE	16	80.500	1,288.000	
COVESTRO AG	30	58.440	1,753.200	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	154	60.720	9,350.880	
POSTE ITALIANE SPA	80	13.415	1,073.200	
AMUNDI SA	10	70.700	707.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	59	10.960	646.640	
ADYEN NV	4	1,420.600	5,682.400	
DELIVERY HERO SE	35	38.660	1,353.100	
ユーロ 小計	30,121		864,332.240 (140,332,982)	
香港・ドル				
CLP HOLDINGS LTD	235	67.000	15,745.000	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	166	317.000	52,622.000	
MTR CORP	403	29.050	11,707.150	
HANG SENG BANK LTD	100	97.750	9,775.000	

HENDERSON LAND DEVELOPMENT	86	26.400	2,270.400	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	67	51.350	3,440.450	
HONG KONG & CHINA GAS	1,515	6.200	9,393.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	35.000	18,795.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	684	25.600	17,510.400	
SINO LAND CO	576	8.630	4,970.880	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	87.350	43,675.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	273	116.500	31,804.500	
AIA GROUP LTD	1,951	63.400	123,693.400	
HKT TRUST / HKT LTD	1,080	9.810	10,594.800	
SANDS CHINA LTD	574	18.780	10,779.720	
WH GROUP LTD	1,500	6.100	9,150.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	534	42.000	22,428.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	34	33.400	1,135.600	
香港・ドル 小計	10,815		399,490.300 (7,682,198)	
合計	182,070		1,621,084,186 (1,621,084,186)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年10月21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	133.000	998.830	
		GOODMAN GROUP	288.000	10,529.280	
		GPT GROUP	219.000	1,099.380	
		MIRVAC GROUP	425.000	926.500	
		SCENTRE GROUP	735.000	2,653.350	
		STOCKLAND	473.000	2,521.090	
		VICINITY CENTRES	700.000	1,575.000	
	オーストラリア・ドル 小計		2,973.000	20,303.430 (2,034,200)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,079.000	2,287.480	
CAPLAND ASCENDAS REIT		600.000	1,686.000		
シンガポール・ドル 小計		1,679.000	3,973.480 (453,096)		
投資信託受益証券 合計			4,652	2,487,296 (2,487,296)	

投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28.000	3,410.120	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	60.000	2,287.200	
		AMERICAN TOWER CORP	77.000	17,425.100	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	87.000	1,764.360	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	26.000	5,905.640	
		BXP INC	28.000	2,512.160	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	14.000	1,690.360	
		CROWN CASTLE INC	70.000	7,866.600	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	54.000	8,930.520	
		EQUINIX INC	16.000	14,323.200	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30.000	2,099.100	
		EQUITY RESIDENTIAL	62.000	4,689.060	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10.000	2,965.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	35.000	5,994.800	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	50.000	2,574.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	112.000	2,535.680	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	118.000	2,096.860	
		INVITATION HOMES INC	93.000	3,174.090	
		IRON MOUNTAIN INC	49.000	6,162.240	
		KIMCO REALTY	119.000	2,929.780	
		MID AMERICA	17.000	2,628.030	
		PROLOGIS INC	154.000	18,865.000	
		PUBLIC STORAGE	26.000	8,986.120	
		REALTY INCOME CORP	150.000	9,706.500	
		REGENCY CENTERS CORP	33.000	2,394.810	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	16.000	3,959.520	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	54.000	9,553.680	
		SUN COMMUNITIES INC	21.000	2,859.990	
		UDR INC	56.000	2,507.120	
		VENTAS INC	73.000	4,785.150	
		VICI PROPERTIES INC	170.000	5,642.300	
		WELLTOWER INC	99.000	13,091.760	
		WEYERHAEUSER CO	109.000	3,603.540	
WP CAREY INC	36.000	2,160.360			
アメリカ・ドル	小計	2,152.000	192,079.750 (28,702,477)		
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	134.000	866.310		
	SEGRO PLC	218.000	1,822.040		
イギリス・ポンド	小計	352.000	2,688.350 (524,121)		
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	10.000	508.400		

カナダ・ドル 小計		10.000	508.400 (55,014)	
ユーロ	COVIVIO	4.000	218.400	
	GECINA SA	7.000	735.000	
	KLEPIERRE	31.000	936.820	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	19.000	1,492.640	
	WAREHOUSES DE PAUW	15.000	335.100	
ユーロ 小計		76.000	3,717.960 (603,648)	
香港・ドル	LINK REIT	507.000	19,392.750	
香港・ドル 小計		507.000	19,392.750 (372,923)	
投資証券 合計		3,097	30,258,183 (30,258,183)	
合計			32,745,479 (32,745,479)	

(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 570銘柄	70.05	-	-	-	77.03
	投資証券 34銘柄	-	-	-	1.61	
イギリス・ポンド	株式 75銘柄	3.54	-	-	-	3.83
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式 7銘柄	0.09	-	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式 50銘柄	1.72	-	-	-	1.97
	投資信託受益証券 7銘柄	-	-	0.11	-	
カナダ・ドル	株式 83銘柄	3.01	-	-	-	3.24
	新株予約権証券 1銘柄	-	0.00	-	-	
	投資証券 1銘柄	-	-	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式 12銘柄	0.28	-	-	-	0.33
	投資信託受益証券 2銘柄	-	-	0.03	-	
スイス・フラン	株式 44銘柄	2.40	-	-	-	2.58
スウェーデン・クローナ	株式 44銘柄	0.78	-	-	-	0.84
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.82	-	-	-	0.88
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.04	-	-	-	0.04
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.13	-	-	-	0.14

ユーロ	株式	213銘柄	7.89	-	-	-	8.52
	投資証券	5銘柄	-	-	-	0.03	
香港・ドル	株式	18銘柄	0.43	-	-	-	0.49
	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10月21日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	82,251,839
国債証券	13,966,983,468
未収入金	1,040,421,366
未収利息	113,852,038
前払費用	36,176,354
流動資産合計	15,239,685,065
資産合計	15,239,685,065
負債の部	
流動負債	
未払金	1,032,463,847
流動負債合計	1,032,463,847
負債合計	1,032,463,847
純資産の部	
元本等	
元本	4,724,326,283
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,482,894,935
元本等合計	14,207,221,218
純資産合計	14,207,221,218
負債純資産合計	15,239,685,065

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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	4,744,504,901円
同期中追加設定元本額	209,887,017円
同期中一部解約元本額	230,065,635円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	3,460,195,849円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	594,634,726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）	444,611,950円
計	4,724,326,283円
2. 受益権の総数	4,724,326,283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 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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10月21日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	433,445,359	
合計	433,445,359	

(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10月21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10月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.0072円 (30,072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10月21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 1.875 02/15/32	4,200,000.000	3,637,757.800	
		US T N/B 2.875 05/15/32	9,140,000.000	8,470,923.470	
		US T N/B 3.375 05/15/33	3,460,000.000	3,295,109.370	
		US T N/B 3.5 02/15/33	4,200,000.000	4,043,566.400	
		US T N/B 3.875 08/15/33	3,900,000.000	3,849,726.580	

	US T N/B 3.875 08/15/34	4,300,000.000	4,229,789.080	
	US T N/B 4.0 02/15/34	2,500,000.000	2,486,718.750	
	US T N/B 4.375 05/15/34	2,200,000.000	2,252,078.130	
	US T N/B 4.5 11/15/33	3,100,000.000	3,203,474.610	
アメリカ・ドル 小計		37,000,000.000 (5,528,910,000)	35,469,144.190 (5,300,154,216)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,030,000.000	811,868.240	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,100,000.000	848,485.000	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	520,000.000	424,958.560	
	UK TREASURY 3.25 01/31/33	940,000.000	891,010.770	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,270,000.000	1,299,189.680	
	UK TREASURY 4.25 07/31/34	800,000.000	811,906.960	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	900,000.000	940,050.000	
イギリス・ポンド 小計		6,560,000.000 (1,278,937,600)	6,027,469.210 (1,175,115,397)	
カナダ・ドル	CANADA 1.5 12/01/31	2,240,000.000	2,022,088.260	
	CANADA 2.0 06/01/32	800,000.000	743,197.230	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,600,000.000	1,535,149.770	
	CANADA 3.25 12/01/33	3,500,000.000	3,539,410.660	
	CANADA 3.25 12/01/34	980,000.000	987,899.690	
	CANADA 5.75 06/01/33	740,000.000	886,179.250	
カナダ・ドル 小計		9,860,000.000 (1,066,950,600)	9,713,924.860 (1,051,143,809)	
ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	4,970,000.000	4,292,216.250	
	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,600,000.000	1,398,160.000	
	DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	4,340,000.000	4,358,879.000	
	DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	4,450,000.000	4,520,532.500	
	DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	2,900,000.000	3,011,505.000	
	DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	1,250,000.000	1,295,250.000	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/31	850,000.000	707,344.500	
	FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,000,000.000	1,895,403.000	
	FRANCE OAT 3.0 05/25/33	1,500,000.000	1,525,656.000	
	FRANCE OAT 3.0 11/25/34	200,000.000	201,809.600	
	FRANCE OAT 3.5 11/25/33	3,800,000.000	4,007,252.000	
	ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,550,000.000	1,332,961.250	
	ITALY BTPS 0.95 06/01/32	2,320,000.000	2,002,624.000	
	ITALY BTPS 3.85 07/01/34	600,000.000	629,760.000	
	ITALY BTPS 4.2 03/01/34	4,300,000.000	4,644,000.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	3,500,000.000	3,845,100.000		
ユーロ 小計		40,130,000.000 (6,515,506,800)	39,668,453.100 (6,440,570,046)	
国債証券 合計		14,390,305,000 (14,390,305,000)	13,966,983,468 (13,966,983,468)	
合計			13,966,983,468	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 9銘柄	37.31	37.95
イギリス・ポンド	国債証券 7銘柄	8.27	8.41
カナダ・ドル	国債証券 6銘柄	7.40	7.53
ユーロ	国債証券 16銘柄	45.33	46.11

(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10月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,367,172
コール・ローン	2,052,141
投資証券	686,237,898
未収配当金	682,702
流動資産合計	692,339,913
資産合計	692,339,913
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	209,015,395
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	483,324,518
元本等合計	692,339,913
純資産合計	692,339,913
負債純資産合計	692,339,913

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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	229,354,163円
同期中追加設定元本額	- 円
同期中一部解約元本額	20,338,768円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	209,015,395円
計	209,015,395円
2. 受益権の総数	209,015,395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 2024年4月23日 至 2024年10月21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10月21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10月21日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		167,691,908
合計		167,691,908

(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10月21日から2024年10月21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10月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,3124円 (33,124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10月21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	316.000	7,817.840	
		AGREE REALTY CORP	312.000	23,580.960	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	228.000	4,213.440	
		ALEXANDER'S INC.	7.000	1,643.600	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	547.000	66,619.130	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	39.000	720.330	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	150.000	4,233.000	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	256.000	6,453.760	
AMERICAN HOMES 4 RENT	1,065.000	40,597.800	
AMERICAN TOWER CORP	1,474.000	333,566.200	
AMERICOLD REALTY TRUST	891.000	23,852.070	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	445.000	3,929.350	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	713.000	10,695.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	208.000	2,342.080	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	448.000	101,758.720	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	217.000	690.060	
BRANDYWINE REALTY TRUST	530.000	3,460.900	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	940.000	26,649.000	
BROADSTONE NET LEASE INC	590.000	11,038.900	
BRT APARTMENTS CORP	35.000	609.700	
BXP INC	493.000	44,231.960	
CAMDEN PROPERTY TRUST	326.000	39,361.240	
CARETRUST REIT INC	444.000	13,710.720	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	71.000	1,932.620	
CENTERSPACE	47.000	3,349.690	
CHATHAM LODGING TRUST	162.000	1,373.760	
CITY OFFICE REIT INC	121.000	689.700	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	748.000	4,203.760	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	89.000	1,579.750	
COPT DEFENCE PROPERTIES	352.000	11,390.720	
COUSINS PROPERTIES INC	478.000	15,209.960	
CROWN CASTLE INC	1,372.000	154,185.360	
CTO REALTY GROUTH INC	76.000	1,479.720	
CUBESMART	706.000	35,285.880	
CURBLINE PROPERTIES CORP	298.000	6,922.540	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	658.000	5,922.000	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,019.000	168,522.220	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	683.000	2,527.100	
DOUGLAS EMMETT INC	505.000	9,701.050	

EAST GROUP	152.000	27,790.160	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	304.000	4,398.880	
ELME COMMUNITIES	275.000	4,688.750	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	419.000	4,780.790	
EPR PROPERTIES	236.000	11,533.320	
EQUINIX INC	299.000	267,664.800	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	581.000	40,652.570	
EQUITY RESIDENTIAL	1,192.000	90,150.960	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	549.000	18,748.350	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	201.000	59,596.500	
EXTRA SPACE STORAGE INC	660.000	113,044.800	
FARMLAND PARTNERS INC	137.000	1,512.480	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	260.000	29,728.400	
FIRST INDUSTRIAL RT	416.000	22,984.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	287.000	8,532.510	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	822.000	42,316.560	
GETTY REALTY CORP	155.000	4,932.100	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	125.000	2,063.750	
GLADSTONE LAND CORP	105.000	1,417.500	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	190.000	1,822.100	
GLOBAL NET LEASE INC	628.000	5,281.480	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,199.000	21,845.780	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,204.000	49,898.560	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	329.000	11,965.730	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2,199.000	39,076.230	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	428.000	2,131.440	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	707.000	14,104.650	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	220.000	943.800	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	88.000	11,719.840	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	213.000	6,387.870	
INVITATION HOMES INC	1,931.000	65,905.030	
IRON MOUNTAIN INC	919.000	115,573.440	
JBG SMITH PROPERTIES	260.000	4,859.400	
KILROY REALTY CORP	368.000	16,030.080	

KIMCO REALTY	2,078.000	51,160.360	
KITE REALTY GROUP TRUST	679.000	17,952.760	
LAMAR ADVERTISING CO	275.000	37,441.250	
LINEAGE INC	193.000	14,967.150	
LTC PROPERTIES INC	134.000	4,838.740	
LXP INDUSTRIAL TRUST	910.000	8,918.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	1,871.000	9,336.290	
MID AMERICA	366.000	56,579.940	
NATIONAL HEALTH INVS INC	131.000	10,029.360	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	216.000	9,709.200	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	46.000	1,425.080	
NETSTREIT CORP	242.000	4,012.360	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	101.000	592.870	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	71.000	3,172.280	
NNN REIT INC	572.000	28,022.280	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	774.000	32,206.140	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	49.000	1,365.630	
ORION OFFICE REIT INC	193.000	816.390	
OUTFRONT MEDIA INC	463.000	8,861.820	
PARAMOUNT GROUP INC	577.000	3,092.720	
PARK HOTELS & RESORTS INC	655.000	9,163.450	
PEAKSTONE REALTY TRUST	114.000	1,594.860	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	374.000	4,731.100	
PHILLIPS EDISON & CO INC	384.000	14,334.720	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	386.000	4,273.020	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	125.000	2,697.500	
POSTAL REALTY TRUST INC	64.000	941.440	
POTLATCH CORP	249.000	10,948.530	
PROLOGIS INC	2,917.000	357,332.500	
PUBLIC STORAGE	499.000	172,464.380	
RAYONIER INC	466.000	15,079.760	
REALTY INCOME CORP	2,750.000	177,952.500	
REGENCY CENTERS CORP	580.000	42,090.600	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	388.000	6,270.080	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	676.000	31,116.280	
RLJ LODGING TRUST	477.000	4,340.700	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	184.000	20,102.000	

	SABRA HEALTH CARE REIT INC	724.000	13,524.320	
	SAFEHOLD INC	162.000	3,985.200	
	SAUL CENTERS INC	33.000	1,341.450	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	339.000	83,892.330	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	516.000	1,790.520	
	SILA REALTY TRUST INC	179.000	4,671.900	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,021.000	180,635.320	
	SITE CENTERS CORP	149.000	2,500.220	
	SL GREEN	204.000	16,069.080	
	STAG INDUSTRIAL INC	570.000	21,967.800	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	328.000	2,135.280	
	SUN COMMUNITIES INC	389.000	52,977.910	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	636.000	6,538.080	
	TANGER INC	333.000	11,555.100	
	TERRENO REALTY CORP	299.000	19,270.550	
	THE MACERICH COMPANY	678.000	12,807.420	
	UDR INC	1,036.000	46,381.720	
	UMH PROPERTIES INC	199.000	3,773.040	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	39.000	1,643.460	
	URBAN EDGE PROPERTIES	375.000	8,347.500	
	VENTAS INC	1,272.000	83,379.600	
	VERIS RESIDENTIAL INC	246.000	4,344.360	
	VICI PROPERTIES INC	3,290.000	109,195.100	
	VORNADO REALTY TRUST	552.000	23,945.760	
	WELLTOWER INC	1,903.000	251,652.720	
	WEYERHAEUSER CO	2,300.000	76,038.000	
	WHITESTONE REIT	150.000	2,173.500	
	WP CAREY INC	684.000	41,046.840	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	319.000	4,718.010	
	アメリカ・ドル 小計	77,271.000	4,592,370.330 (686,237,898)	
投資証券 合計		77,271	686,237,898 (686,237,898)	
合計			686,237,898 (686,237,898)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)

アメリカ・ドル	投資証券	139銘柄	99.12	100.00
---------	------	-------	-------	--------

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

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

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

財政状態計算書

2024年5月31日現在

	2024年 (日本円)	2023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	15,063,060,080	12,471,305,693
未収申込金	176,681,400	154,214,000
現金および現金同等物	1,124,760,986	720,574,601
その他の債権	4,974,713	4,996,679
資産合計	16,369,477,179	13,351,090,973
負債		
流動負債		
ブローカーに対する債務	-	102,005
未払費用	24,771,524	35,371,234
負債合計	24,771,524	35,473,239
受益証券保有者に帰属する純資産	16,344,705,655	13,315,617,734

要約投資明細表(無監査)

2024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	443,860,189	2.71%
Angolan Government International Bond 8.750% due 14/04/2032 REGS	85,928,003	0.53%
アンゴラ合計(取得原価:435,351,169円)	529,788,192	3.24%
アルメニア		
Republic Of International Armenian Bond 3.600% due 02/02/2031 REGS	358,164,687	2.19%
アルメニア合計(取得原価:293,276,618円)	358,164,687	2.19%
アゼルバイジャン		
Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026	192,321,775	1.18%
アゼルバイジャン合計(取得原価:137,102,958円)	192,321,775	1.18%
ベラルーシ		
Republic of Belarus International Bond 6.200% due 28/02/2030 REGS	30,732,112	0.19%
ベラルーシ合計(取得原価:53,476,370円)	30,732,112	0.19%
ベナン		
Benin, Republik 4.875% due 19/01/2032	341,154,029	2.09%
ベナン合計(取得原価:291,175,472円)	341,154,029	2.09%
ブラジル		
Brazilian Government International Bond 3.875% due 12/06/2030	319,512,634	1.96%
Brazilian Government International Bond 4.500% due 14/01/2050	175,342,250	1.07%
ブラジル合計(取得原価:455,026,607円)	494,854,884	3.03%
カメルーン		
Republic of Cameroon International Bank 5.950% due 07/07/2032 REGS	223,133,223	1.36%
カメルーン合計(取得原価:198,528,027円)	223,133,223	1.36%

	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	456,513,882	2.79%
Colombia Government International Bond 7.500% 02/02/2034	319,515,147	1.95%
コロンビア合計(取得原価: 658,675,171円)	776,029,029	4.74%
コスタリカ		
Costa Rica Government International Bond 7.158% due 12/03/2045	283,299,782	1.73%
Costa Rica Government International Bond 7.300% due 13/01/2054	32,772,238	0.20%
コスタリカ合計(取得原価: 205,730,652円)	316,072,020	1.93%
コートジボワール		
Ivory Coast Government International Bond 4.875% due 30/01/2032 REGS	399,461,866	2.44%
コートジボワール合計(取得原価: 282,841,672円)	399,461,866	2.44%
ドミニカ共和国		
Dominican Republic International Bond 9.750% due 05/06/2026 REGS	517,698,416	3.17%
ドミニカ共和国合計(取得原価: 395,474,016円)	517,698,416	3.17%
エジプト		
Egypt Treasury Bills 18/03/2025 TBLM	177,477,199	1.09%
エジプト合計(取得原価: 160,385,794円)	177,477,199	1.09%
エチオピア		
Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	250,771,179	1.53%
エチオピア合計(取得原価: 260,571,892円)	250,771,179	1.53%
ジョージア		
Georgia Treasury Bond 9.125% due 30/05/2025	71,542,272	0.44%
Georgian Railway JSC 4.000% due 17/06/2028 REGS	142,747,950	0.87%
ジョージア合計(取得原価: 181,903,925円)	214,290,222	1.31%
ガーナ		
Saderea DAC 12.500% due 30/11/2026 REGS	42,682,835	0.26%
ガーナ合計(取得原価: 62,226,345円)	42,682,835	0.26%

	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	239,141,867	1.46%
ホンジュラス合計(取得原価: 181,934,931円)	239,141,867	1.46%
ハンガリー		
Hungary Government International Bond 9.500% due 21/10/2026	160,092,099	0.98%
ハンガリー合計(取得原価: 145,660,289円)	160,092,099	0.98%
インドネシア		
Indonesia Government International Bond 4.150% due 20/09/2027	138,196,454	0.84%
Republic of Indonesia 4.350% due 08/01/2027	78,298,566	0.48%
インドネシア合計(取得原価: 181,726,783円)	216,495,020	1.32%
ジャマイカ		
Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045	223,934,500	1.37%
Government of Jamaica 9.625% due 03/11/2030	117,666,763	0.72%
ジャマイカ合計(取得原価: 259,258,171円)	341,601,263	2.09%
ヨルダン		
Jordan Kingdom due 7.375% due 10/10/2047 REGS	83,399,143	0.51%
Jordan Kingdom due 7.500% due 13/01/2029 REGS	365,352,375	2.24%
ヨルダン合計(取得原価: 394,516,487円)	448,751,518	2.75%
カザフスタン		
Kazakhstan Government Bond - MEOKAM 14.500% due 28/04/2025	270,914,067	1.66%
Kazakhstan Government Bond - MEUKAM 7.200% due 25/05/2025	32,508,103	0.20%
Kazakhstan Government Bond - MEOKAM 13.900% due 16/09/2026	116,756,036	0.71%
Kazakhstan Treasury Bill - MEKKAM due 11/04/2025 TBLM	25,670,450	0.16%
Kazakhstan Treasury Bill - MEKKAM due 11/01/2025 TBLM	21,091,715	0.13%
Kazmunaygas National Co JSC 5.750% due 19/04/2047 REGS	324,767,417	1.98%
カザフスタン合計(取得原価: 655,737,789円)	791,707,788	4.84%

	保有資産	公正価値 (日本円)	純資産比率
債券(続き)			
メキシコ			
Mexican Bonos 7.750% due 29/05/2031	28,420,000	245,764,223	1.50%
Mexican Bonos 8.000% due 07/11/2047	66,330,000	536,015,588	3.28%
Mexican Udibonos 4.000% due 30/11/2028	400,000	28,368,482	0.17%
Mexican Petroleos 6.700% due 16/02/2032	1,775,000	239,418,189	1.47%
Mexico Government International Bond 4.600% due 23/01/2046	1,400,000	175,858,940	1.08%
メキシコ合計(取得原価: 974,371,927円)		1,225,425,422	7.50%
モンテネグロ			
Montenegro Republic International Bond 7.250% due 12/03/2031			
REGS		32,169,231	0.20%
モンテネグロ合計(取得原価: 29,873,040円)		32,169,231	0.20%
モザンビーク			
Mozambique Republic International Bond 9.000% due 15/09/2031			
REGS		132,825,759	0.81%
モザンビーク合計(取得原価: 130,428,191円)		132,825,759	0.81%
ナイジェリア			
B01 Finance BV 7.500% due 16/02/2027		157,991,374	0.97%
ナイジェリア合計(取得原価: 125,429,100円)		157,991,374	0.97%
北マケドニア			
North Macedonia Government International Bond 6.960% 13/03/2027 REGS		144,447,424	0.88%
北マケドニア合計(取得原価: 115,399,214円)		144,447,424	0.88%
パキスタン			
Pakistan 7.375% due 08/04/2031		253,994,672	1.55%
パキスタン合計(取得原価: 204,286,336円)		253,994,672	1.55%
パラグアイ			
Rutas 2 and 7 Finance Ltd 0.000% due 30/09/2036		225,099,115	1.38%
パラグアイ合計(取得原価: 166,274,520円)		225,099,115	1.38%
ペルー			
Peru Government Bond 1.862% due 01/12/2032		154,503,735	0.94%
Peru Government Bond 5.400% 12/08/2034		251,586,217	1.54%
ペルー合計(取得原価: 324,908,067円)		406,089,952	2.48%

	保有資産	公正価値 (日本円)	純資産比率
債券（続き）			
セルビア共和国			
Serbia International Bond 2.125% due 01/12/2030 REGS		234,120,860	1.43%
Serbia International Bond 6.250% due 26/05/2028 REGS		159,215,295	0.98%
セルビア共和国合計（取得原価：342,004,030円）		393,336,155	2.41%
ルーマニア			
Romani 6.125% due 22/01/2044 REGS		581,423,853	3.56%
ルーマニア合計（取得原価：500,055,909円）		581,423,853	3.56%
南アフリカ			
Government of South Africa 4.300% due 12/10/2028	2,600,000	369,702,409	2.26%
Government of South Africa 7.000% due 28/02/2031	86,846,000	598,942,516	3.67%
南アフリカ合計（取得原価：902,855,343円）		968,644,925	5.93%
国際機関			
Asian Development Bank 8.175% due 15/09/2024	7,300,000	309,690,120	1.90%
Asian Development Bank 8.300% due 18/10/2024 REGS	2,100,000	88,642,336	0.54%
Asian Development Bank 13.600% due 17/04/2024	14,500,000	120,783,789	0.74%
Asian Infrastructure Investment 35.000% due 19/07/2024	9,300,000	62,142,822	0.38%
Asian Infrastructure Investment 30.000% due 19/07/2024	5,400,000	36,409,901	0.22%
European Bank For Reconstruction & Development 5.000% due 27/01/2025	18,950,000	562,825,739	3.44%
European Bank For Reconstruction & Development 6.170% due 10/03/2025	44,500,000,000	435,691,009	2.67%
国際機関合計（取得原価：1,336,610,682円）		1,616,185,716	9.89%
スリナム			
Suriname Government International Bond 0.000% due 31/12/2050 REGS		127,103,711	0.78%
Suriname Government International Bond 7.950% due 15/07/2033 REGS		196,999,948	1.20%
スリナム合計（取得原価：166,789,186円）		324,103,659	1.98%

	公正価値 (日本円)	純資産比率
債券(続き)		
トリニダード・トバゴ		
Heritage Petroleum Co. Ltd 9.000% due 12/08/2029 REGS	404,497,563	2.48%
トリニダード・トバゴ合計(取得原価: 311,925,865円)	404,497,563	2.48%
トルコ		
Istanbul Metropolitan Municipality 10.750% due 12/04/2027	128,222,631	0.79%
Turkey Government International Bond 5.950% due 15/01/2031 REGS	160,595,394	0.98%
Turkey Government International Bond 10.500% due 12/06/2028 REGS	150,660,351	0.92%
トルコ合計(取得原価: 346,287,254円)	439,478,376	2.69%
ウクライナ		
Ukraine Government International Bond 7.375% due 25/09/2034	125,459,557	0.77%
ウクライナ合計(取得原価: 319,446,591円)	125,459,557	0.77%
ウルグアイ		
Uruguay Republic of 3.700% due 26/06/2037 Index Linked	153,808,522	0.94%
ウルグアイ合計(取得原価: 38,030,020円)	153,808,522	0.94%
ウズベキスタン		
Republic of Uzbekistan Bond 16.250% due 10/12/2026 REGS	116,810,460	0.72%
Republic of Uzbekistan Bond 16.625% due 5/29/2027 REGS	243,865,667	1.49%
ウズベキスタン合計(取得原価: 349,392,967円)	360,676,127	2.21%
債券合計(取得原価: 12,574,949,380円)	15,008,078,625	91.82%

公正価値
(日本円)

純資産比率

原油ワラント

ベネズエラ

Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020

ベネズエラ合計(取得原価:1,683,204,644円)

54,981,455

0.34%

54,981,455

0.34%

原油ワラント合計(取得原価:1,683,204,644円)

54,981,455

0.34%

公正価値による有価証券合計(取得原価:14,258,154,024円)

15,063,060,080

92.16%

(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10月31日現在

資産総額	4,736,744,014円
負債総額	2,437,581円
純資産総額（ - ）	4,734,306,433円
発行済数量	3,917,706,196口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2084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10月31日現在

資産総額	1,530,806,794円
負債総額	591,330円
純資産総額（ - ）	1,530,215,464円
発行済数量	373,203,931口
1口当たり純資産額（ / ）	4.1002円

新光日本債券インデックスマザーファンド

2024年10月31日現在

資産総額	10,381,009,312円
負債総額	52,908,000円
純資産総額（ - ）	10,328,101,312円
発行済数量	8,624,238,046口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1976円

新光J-REITマザーファンド

2024年10月31日現在

資産総額	64,297,303,531円
負債総額	320,208,860円
純資産総額（ - ）	63,977,094,671円
発行済数量	30,353,879,013口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1077円

新光外国株式インデックスマザーファンド

2024年10月31日現在

資産総額	1,789,267,235円
負債総額	904,619円
純資産総額（ - ）	1,788,362,616円
発行済数量	283,250,141口
1口当たり純資産額（ / ）	6.3137円

海外国債マザーファンド

2024年10月31日現在

資産総額	14,324,364,192円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	14,324,364,192円
発行済数量	4,713,421,664口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0391円

新光米国REITマザーファンド

2024年10月31日現在

資産総額	698,259,200円
負債総額	0円
純資産総額(-)	698,259,200円
発行済数量	209,015,395口
1口当たり純資産額(/)	3.3407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10月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2024年10月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,472,662,569,272
追加型株式投資信託	759	17,228,359,180,836
単位型公社債投資信託	22	35,680,106,243
単位型株式投資信託	193	1,046,720,736,949
合計	1,000	19,783,422,593,300

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「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282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第40期中間会計期間（自2024年4月1日至2024年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第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	1,001	918
器具備品	118	130
リース資産	7	5
建設仮勘定	-	39
無形固定資産		
ソフトウェア	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	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おります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第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的主要原因別の内訳

	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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

	第40期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		30,451
有価証券		0
金銭の信託		31,850
未収委託者報酬		19,361
未収運用受託報酬		3,548
未収投資助言報酬		315
未収収益		9
前払費用		1,538
その他		2,282
	流動資産計	89,360
固定資産		
有形固定資産		1,040
建物	1	888
器具備品	1	146
リース資産	1	4
建設仮勘定		0
無形固定資産		4,122
ソフトウェア		3,011
ソフトウェア仮勘定		1,111
電話加入権		0
投資その他の資産		8,024
投資有価証券		183
関係会社株式		3,840
長期差入保証金		764
繰延税金資産		3,085
その他		150
	固定資産計	13,188
	資産合計	102,548

(単位:百万円)

	第40期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	552
リース債務	1
未払金	8,577
未払収益分配金	0
未払償還金	0
未払手数料	8,466
その他未払金	108
未払費用	7,321
未払法人税等	3,650
未払消費税等	2 1,191
契約負債	7
賞与引当金	916
役員賞与引当金	28
流動負債計	22,247
固定負債	
リース債務	3
退職給付引当金	2,720
時効後支払損引当金	64
固定負債計	2,787
負債合計	25,035
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	55,960
利益準備金	123
その他利益剰余金	55,837
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	24,157
株主資本計	77,513
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等計	0
純資産合計	77,513
負債・純資産合計	102,548

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	55,266	
運用受託報酬	8,186	
投資助言報酬	1,200	
その他営業収益	13	
		営業収益計 64,667
営業費用		
支払手数料	24,284	
広告宣伝費	157	
公告費	0	
調査費	18,581	
調査費	6,728	
委託調査費	11,853	
委託計算費	278	
営業雑経費	355	
通信費	19	
印刷費	234	
協会費	33	
諸会費	29	
支払販売手数料	39	
		営業費用計 43,658
一般管理費		
給料	5,154	
役員報酬	89	
給料・手当	5,002	
賞与	63	
交際費	27	
寄付金	5	
旅費交通費	105	
租税公課	298	
不動産賃借料	583	
退職給付費用	210	
固定資産減価償却費	1 790	
福利厚生費	29	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	916	
役員賞与引当金繰入額	28	
機器リース料	0	
事務委託費	1,607	
事務用消耗品費	19	
器具備品費	0	
諸経費	154	
		一般管理費計 9,933
営業利益		11,075

（単位：百万円）

	第40期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	2	
受取配当金	448	
時効成立分配金・償還金	0	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	2	
雑収入	6	
時効後支払損引当金戻入額	7	
	営業外収益計	494
営業外費用		
早期割増退職金	6	
	営業外費用計	6
経常利益		11,563
特別損失		
固定資産除却損	3	
関係会社株式評価損	31	
	特別損失計	35
税引前中間純利益		11,528
法人税、住民税及び事業税		3,685
法人税等調整額		320
法人税等合計		4,006
中間純利益		7,522

(3) 中間株主資本等変動計算書

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490
当中間期変動額							
剰余金の配当							10,855
中間純利益							7,522
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	3,333
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,157

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	59,294	80,846	0	0	80,846
当中間期変動額					
剰余金の配当	10,855	10,855			10,855
中間純利益	7,522	7,522			7,522
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)			0	0	0
当中間期変動額 合計	3,333	3,333	0	0	3,333
当中間期末残高	55,960	77,513	0	0	77,513

重要な会計方針

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

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第40期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 ... 685百万円 器具備品 ... 609百万円 リース資産 ... 4百万円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第40期中間会計期間 (自2024年4月1日至2024年9月30日)
1.減価償却実施額	有形固定資産 ... 76百万円 無形固定資産 ... 713百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金（財 産）の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2024年3月15日 みなし株主総会	普通株式	575	14,390	2024年4月1日	2024年4月1日
	A種種類 株式				
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式				

会社法第319条第1項に基づき、2024年3月15日に決議があったものとみなされた株主総会での配当決議は当社の子会社であったAsset Management One USA Inc.（以下「AM-One USA」という）の全株式の現物配当であります。

本現物配当は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）の子会社である米州みずほLLC（以下「米州みずほ」という）が、2024年10月1日に米国外国銀行規制上の中間持株会社へ移行することに伴う規制上の対応として実施したものです。

当社が100%保有していたAM-One USAの議決権は、本現物配当後、米州みずほが議決権の51%を、第一生命ホールディングス株式会社（以下「DL」という）が議決権の49%をそれぞれ保有します。当社を通じてMHFGとDLが間接的に保有していたAM-One USA株式の議決権比率と同等となります。

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

（金融商品関係）

第40期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2024年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 有価証券	0	0	-
(2) 金銭の信託	31,850	31,850	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	0	0	-
資産計	31,852	31,852	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	0	-	0
金銭の信託	-	31,850	-	31,850
投資有価証券				
其他有価証券	-	0	-	0
資産計	-	31,852	-	31,852

（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

有価証券

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。

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（銀行預金・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せん。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券（その他有価証券）	
非上場株式	182
関係会社株式	
非上場株式	3,840

（有価証券関係）

第40期中間会計期間末
(2024年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額3,840百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

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

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額182百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

（持分法損益等）

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2024年4月1日から2024年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	57,453百万円
資産合計	57,453百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	1,750百万円
負債合計	1,750百万円
純資産	55,702百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額45,734百万円及び顧客関連資産の金額15,385百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	3,629百万円
経常利益	3,629百万円
税引前中間純利益	3,629百万円
中間純利益	3,101百万円
1株当たり中間純利益	77,541円29銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額1,723百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第40期中間会計期間
(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

委託者報酬	55,266百万円
運用受託報酬	8,186百万円
投資助言報酬	1,200百万円
成功報酬	- 百万円
その他営業収益	13百万円
合計	64,667百万円

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第40期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,937,834円09銭
1株当たり中間純利益金額	188,050円89銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
中間純利益金額	7,522百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,522百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

- (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（2024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	54,323	「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	135,000	「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2024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) 2023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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、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12月13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2024年4月23日から2024年10月21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10月21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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲 葉 宏 和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。