

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年1月20日提出
【計算期間】	第28特定期間(自 2020年4月21日至 2020年10月20日)
【ファンド名】	新光7資産バランスファンド
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

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

#### 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
<b>追加型</b>	<b>内外</b>	不動産投信
		その他資産 ( )
		<b>資産複合</b>

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

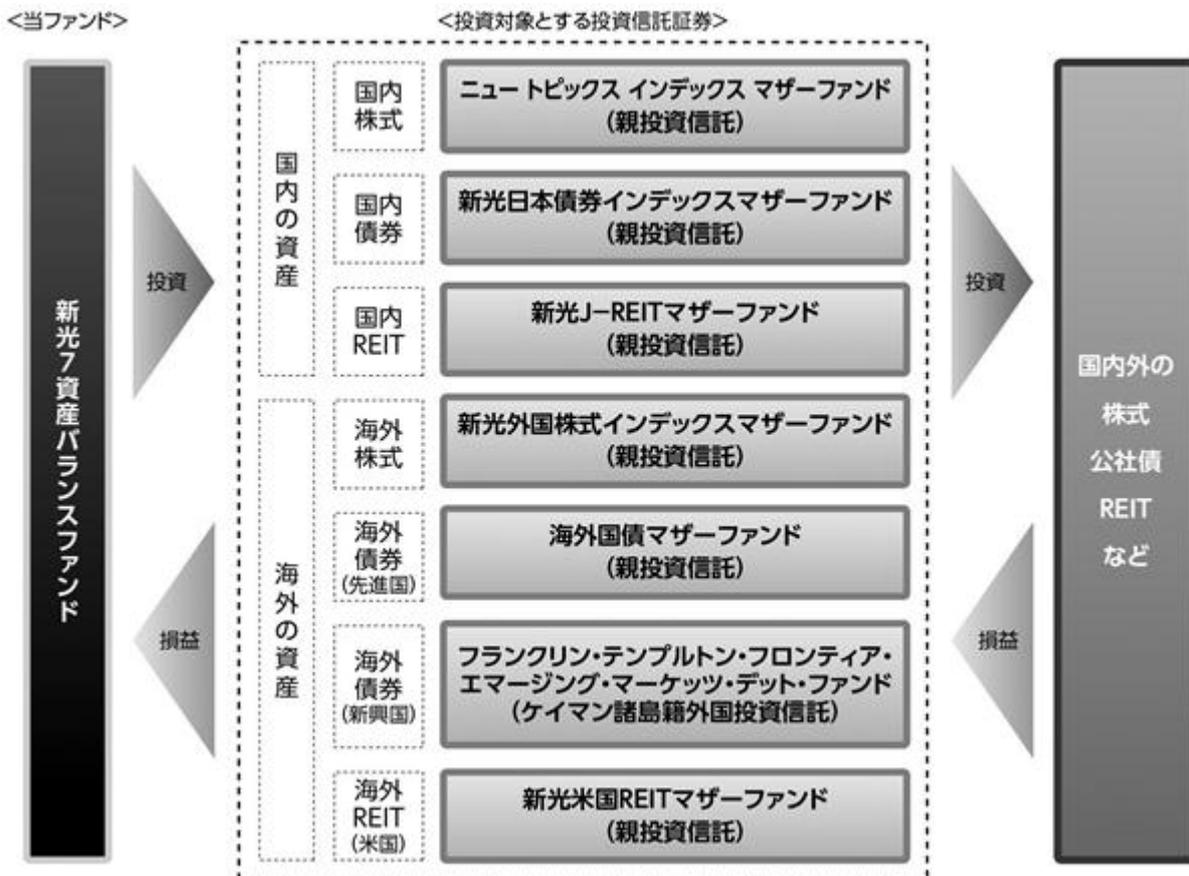
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



## 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。

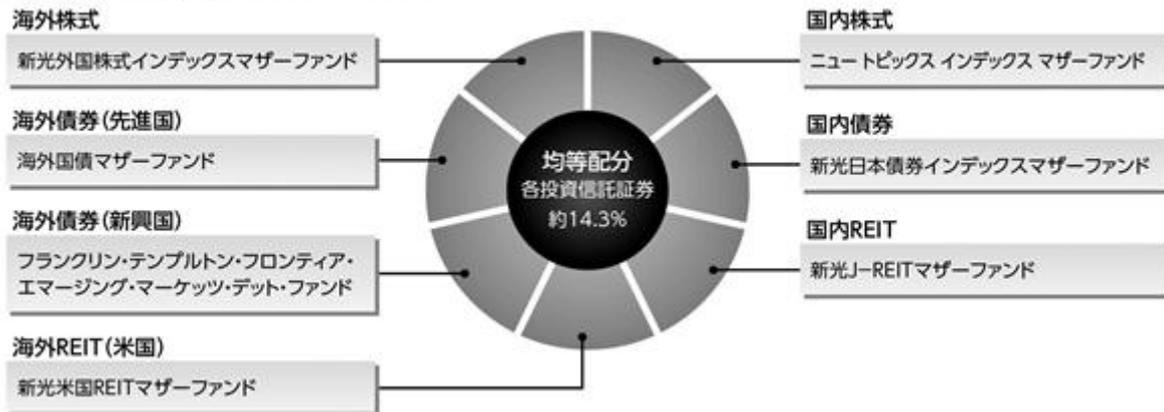


# 2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

- 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ヵ月ごとにチェックを行い、基本投資配分比率に対し±5%の範囲を超過している場合には調整を行います。

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

## <基本投資配分比率のイメージ図>



## ■ 分配方針

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



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

※運用状況により分配金額は変動します。

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

## 収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



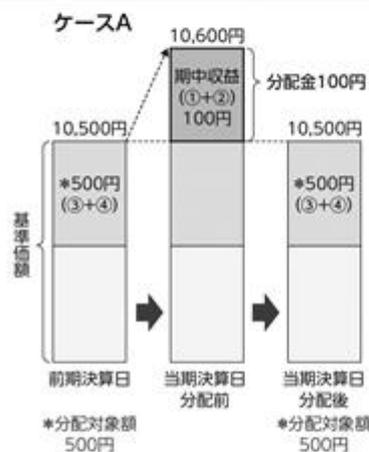
◆分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 分配金額と基準価額の関係(イメージ)

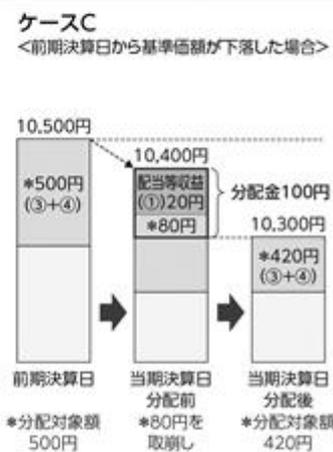
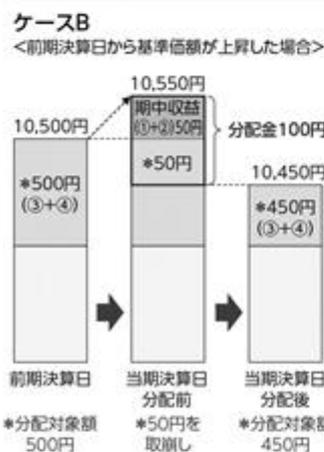
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

#### 計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



#### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上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

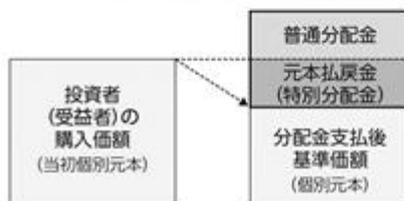
ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円

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小さかった場合も同様です。

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

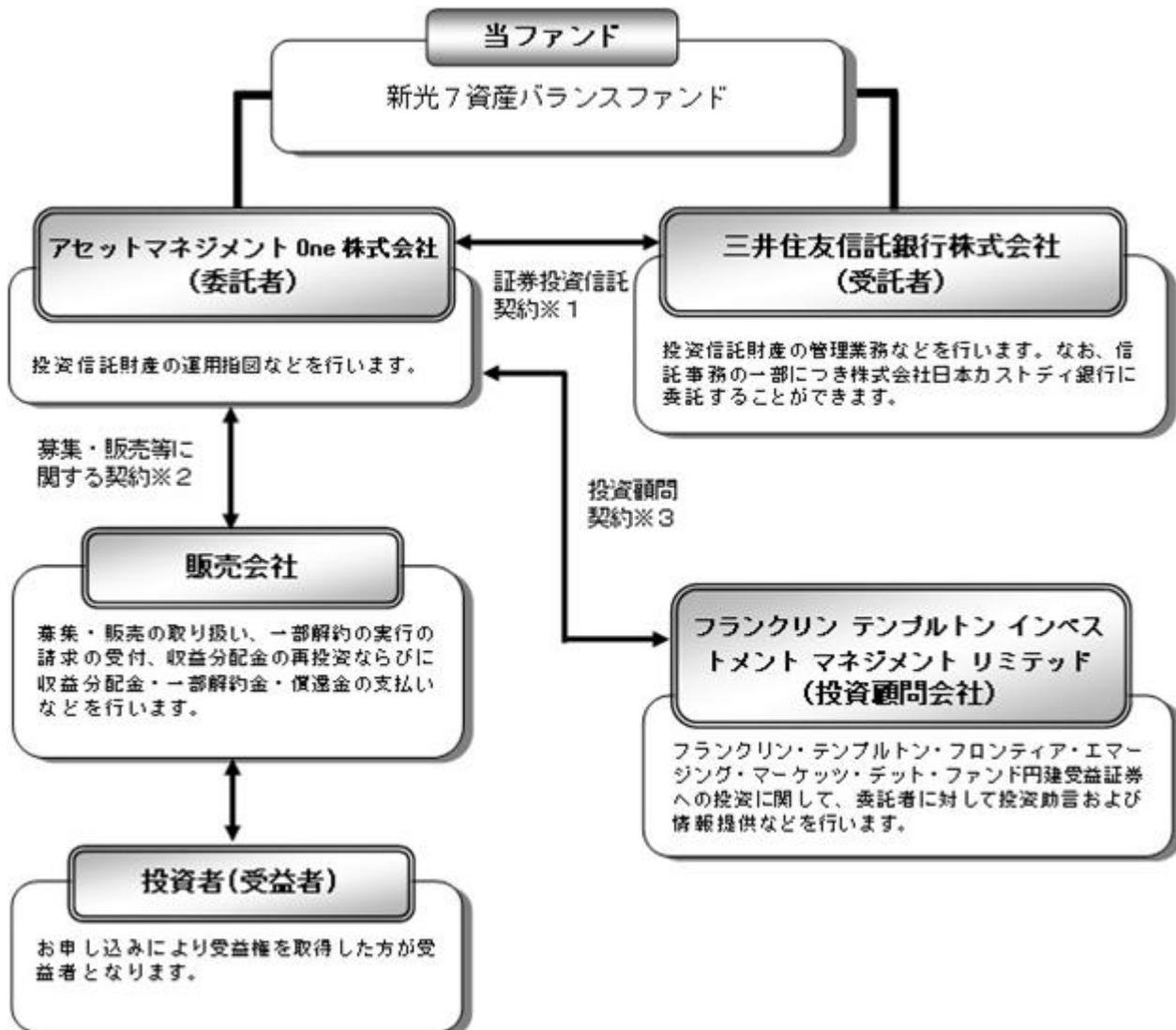
元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

## (2) 【ファンドの沿革】

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

## (3) 【ファンドの仕組み】

## a. ファンドの仕組み



## 1 証券投資信託契約

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

## 2 募集・販売等に関する契約

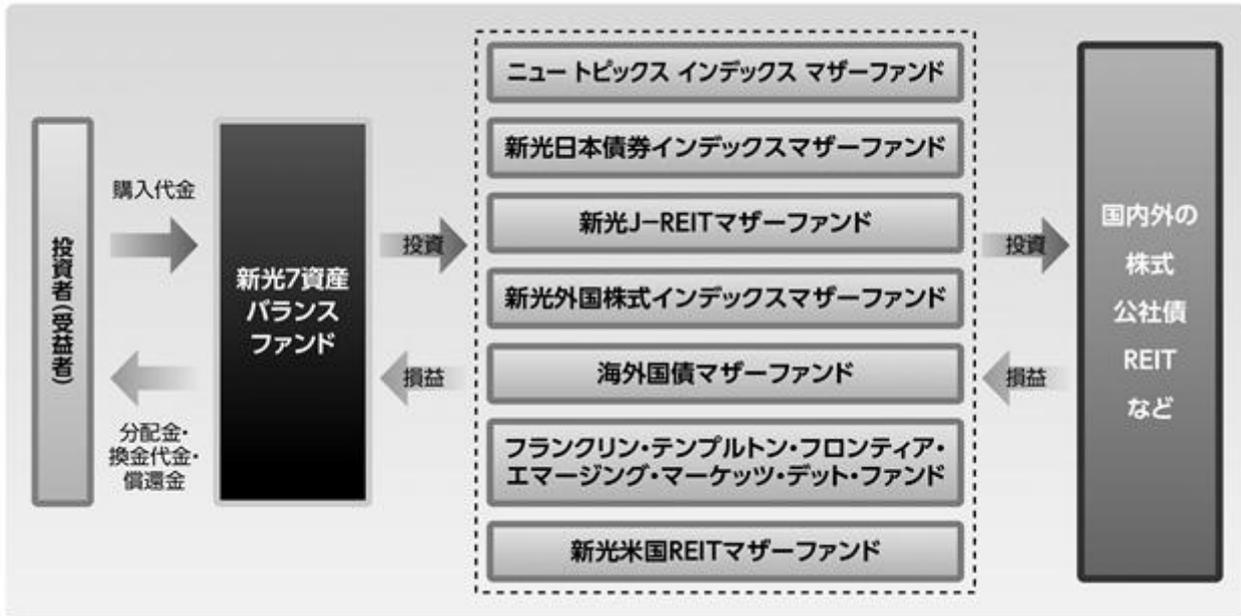
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

### 3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



## b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2020年10月30日現在）

## 委託会社の沿革

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

## 大株主の状況

（2020年10月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### a. 基本方針

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

#### b. 運用の方法

##### (イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

##### (ロ) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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"> <li>・ 東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。</li> <li>・ 東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。</li> <li>・ 投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引所における業種別、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。</li> <li>・ 資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、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。</li> <li>・ 株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>・ 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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年1月14日
収益配分方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2002年1月15日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 東証株価指数について

東証株価指数（TOPIX）とは、東京証券取引所第一部に上場しているすべての銘柄の時価総額を指数化することにより、市場全体の株価の変動を捉えようとする株価指数であり、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。）が算出、公表を行っています。

東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、株東京証券取引所の知的財産であり、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TOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、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TOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの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。

株東京証券取引所は、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、株東京証券取引所は、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。

ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

(株)東京証券取引所は、ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

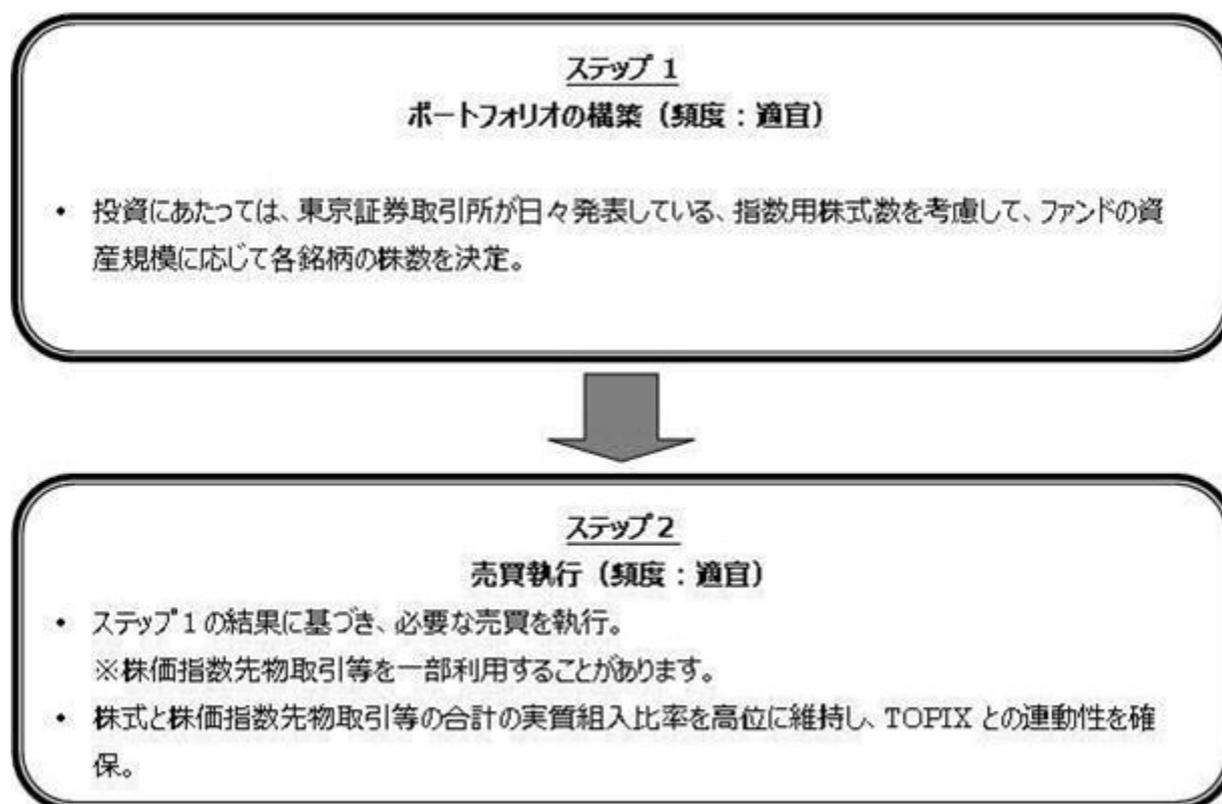
(株)東京証券取引所は、委託会社またはニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所はニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

#### 運用プロセス

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



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2020年10月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光日本債券インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2005年8月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

#### NOMURA - B P I 総合について

NOMURA - B P I 総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募利付債券市場全体の動向を表す投資収益指標で、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 運用プロセス

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



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2020年10月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光J-REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。）以外には投資を行いません。</li> <li>・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。</li> <li>・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ます。</li> <li>・外貨建資産への直接投資は行いません。</li> </ul>
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いえで表す指数です。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（配当込み）の指数値および東証REIT指数の商標は、株東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値および東証REIT指数の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（配当込み）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。

株東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）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、株東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）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。

新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

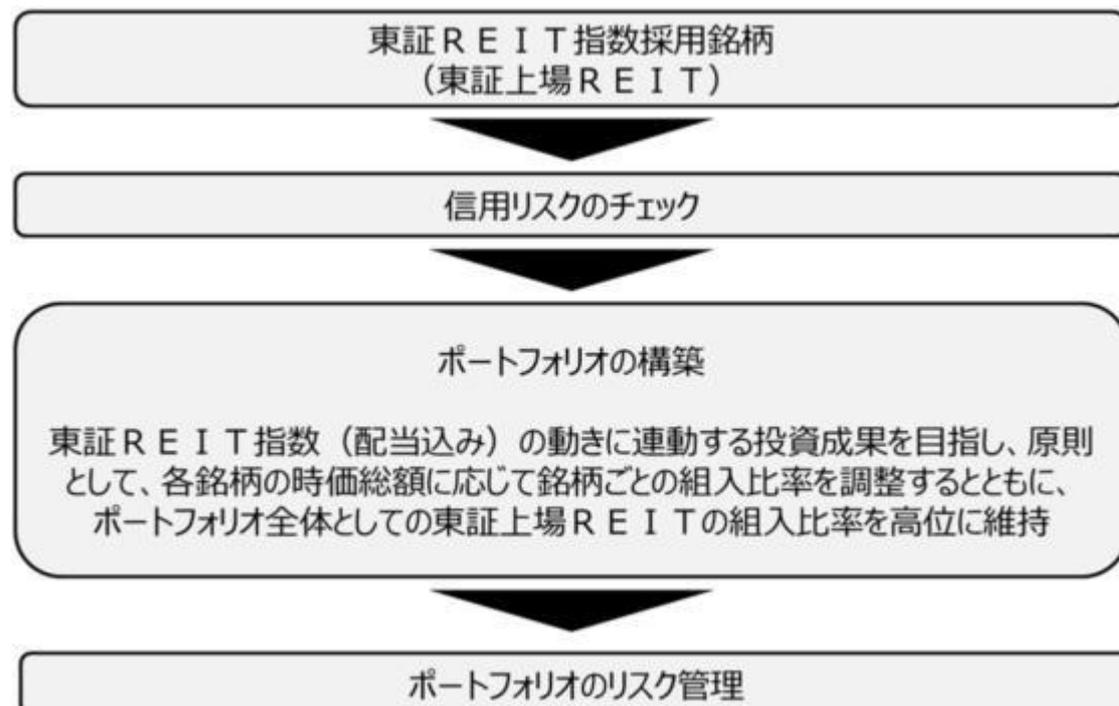
(株)東京証券取引所は、委託会社または新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

新光J-REITマザーファンドは、東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、新光J-REITマザーファンドの基準価額と東証REIT指数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。
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2020年10月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

#### MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

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

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

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

## 運用プロセス

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

### ステップ 1

#### リスクモニタリング

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



### ステップ 2

#### ポートフォリオの構築

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



### ステップ 3

#### 売買執行

- ステップ 2 で選択された銘柄について売買を執行。
- 加えて、株価指数先物取引等を一部利用することで、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）との連動性を確保。

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2020年10月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・債券ポートフォリオは、日本を除くG7構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6ヵ国）が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。</li> <li>・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"> <li>・通貨アロケーション</li> <li>・イールドカーブ戦略</li> <li>・セクターアロケーション</li> <li>・デュレーション調整</li> </ul> </li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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、）の行使により取得したものに限り、</li> <li>・外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。</li> </ul>
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2020年10月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

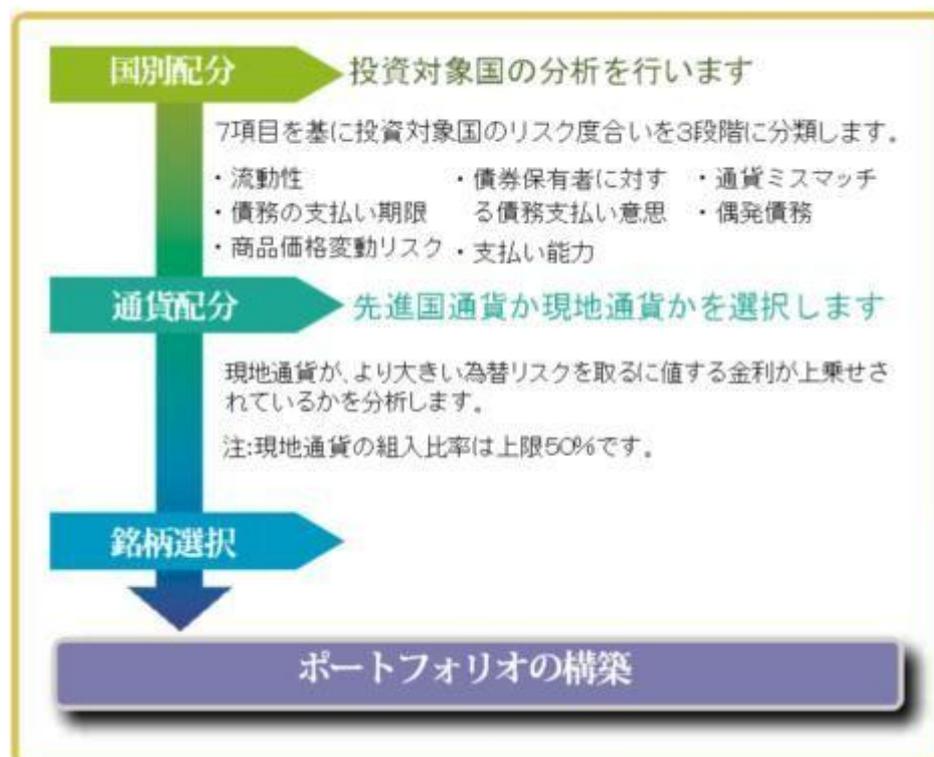
ファンド名	フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。</li> <li>・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、政府保証債は除きます。</li> <li>・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。</li> <li>・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 &amp; 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。</li> <li>・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 &amp; 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。</li> <li>・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。</li> </ul>
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 テンブルトン インターナショナル サービスーズ エス エー アール エル</p> <p>投資顧問会社 : 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</p>

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（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149.7兆円）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。

2020年9月末現在、1米ドル = 105.53円で換算（フランクリン・テンプレトンは2020年7月31日にレグ・メイソンの買収手続きを完了しており、当データはレグ・メイソンのグループの運用総資産を合算しています。）

## 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2020年10月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

ファンド名	新光米国REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。</li> <li>・REITの組入比率は原則として高位を保ちます。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・REITへの投資割合には制限を設けません。</li> <li>・同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2006年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

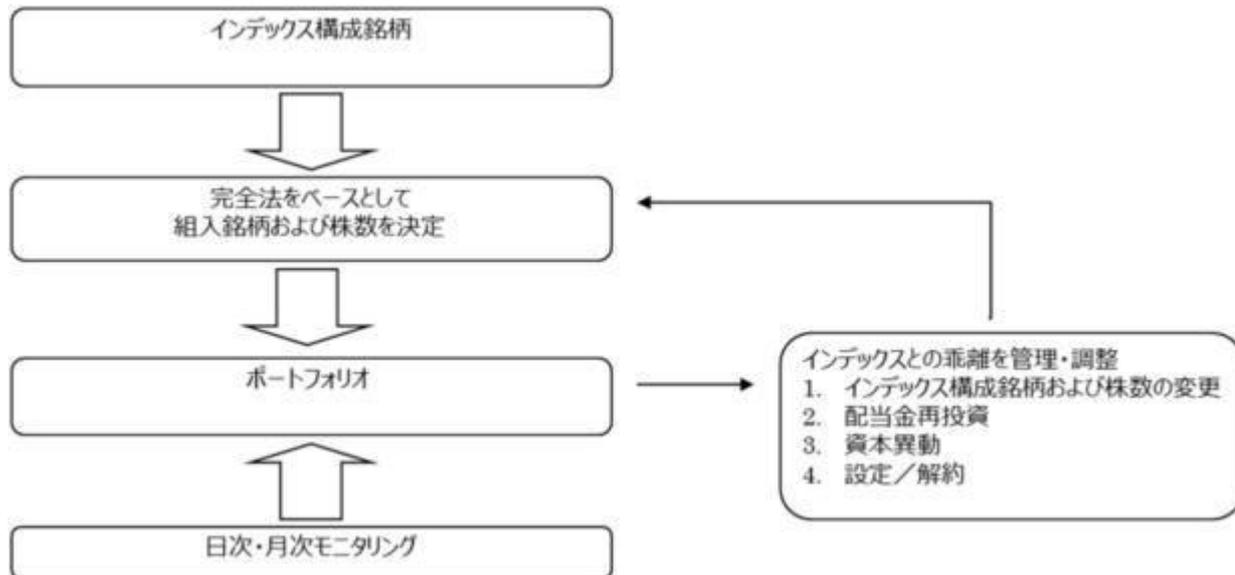
#### FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスについて

FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスとは、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。

“FTSE”及び“FTSE<sup>(R)</sup>”は、London Stock Exchange Groupの商標であり、ライセンスに基づいてFTSEが使用しています。FTSE NAREIT All Equity REITs インデックス（以下「本指数」）は、FTSEの商標であり、本指数の算出、指数値の公表、利用など、本指数に関するあらゆる権利はFTSE又はその関連パートナー会社に与えられています。FTSEは、本指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性について、明示的、黙示的を問わず保証するものではありません。また、算出又は公表の誤謬、遅延または中断に対し、一切責任を負いません。

## 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。



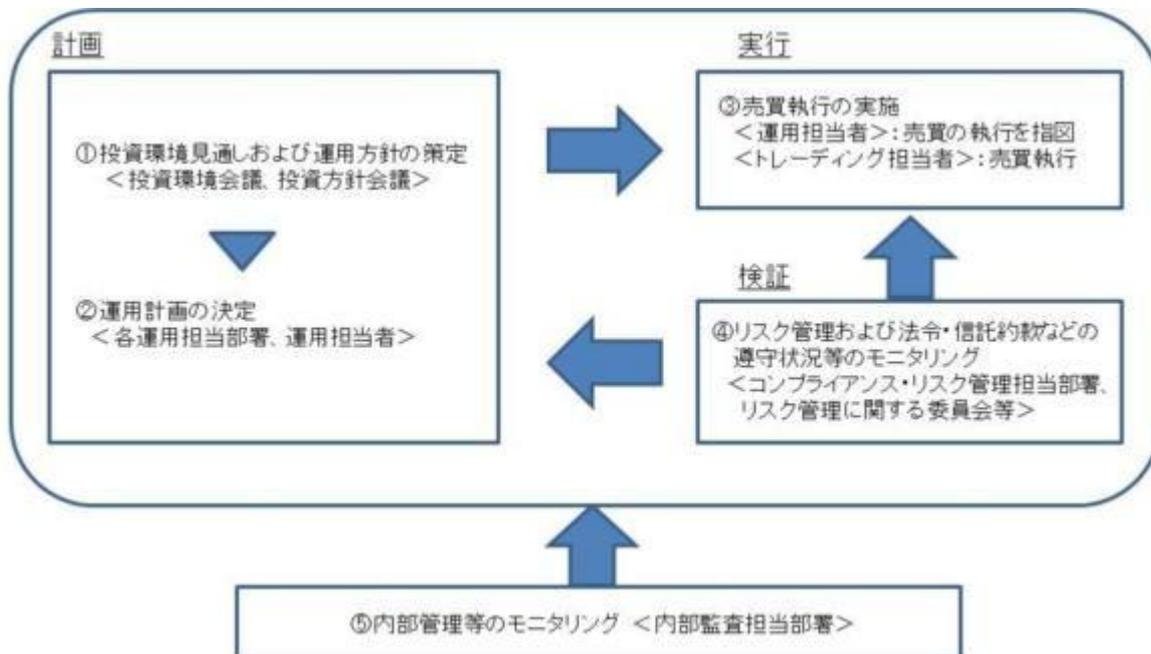
運用プロセスは2020年10月30日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は2021年1月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

## 内部管理等のモニタリング

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

### b．ファンドの関係法人に関する管理

当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2020年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

- a. 収益分配は原則として、毎月20日(該当日が休業日の場合は翌営業日。)の決算時に以下の方針に基づき収益の分配を行います。
1. 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みません。)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。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

#### h. 受託者の自己または利害関係人等との取引

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

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

#### i. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

#### j. 信用リスク集中回避のための投資制限

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

#### k. ファンドの投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### a. 資産配分リスク

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

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

## b. 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

## c. REITの価格変動リスク

REITの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

## d. 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

## e. カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

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

## f. 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

g. 信用リスク

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

公社債や短期金融商品の信用力の変化や格付けの変更により、債券価格が変動したり、財政難、経営不振、その他の理由により、利息や元本があらかじめ決められた条件で支払われなくなる(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もあり、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) 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。
- (ハ) 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。
- (ニ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ホ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。
- (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。

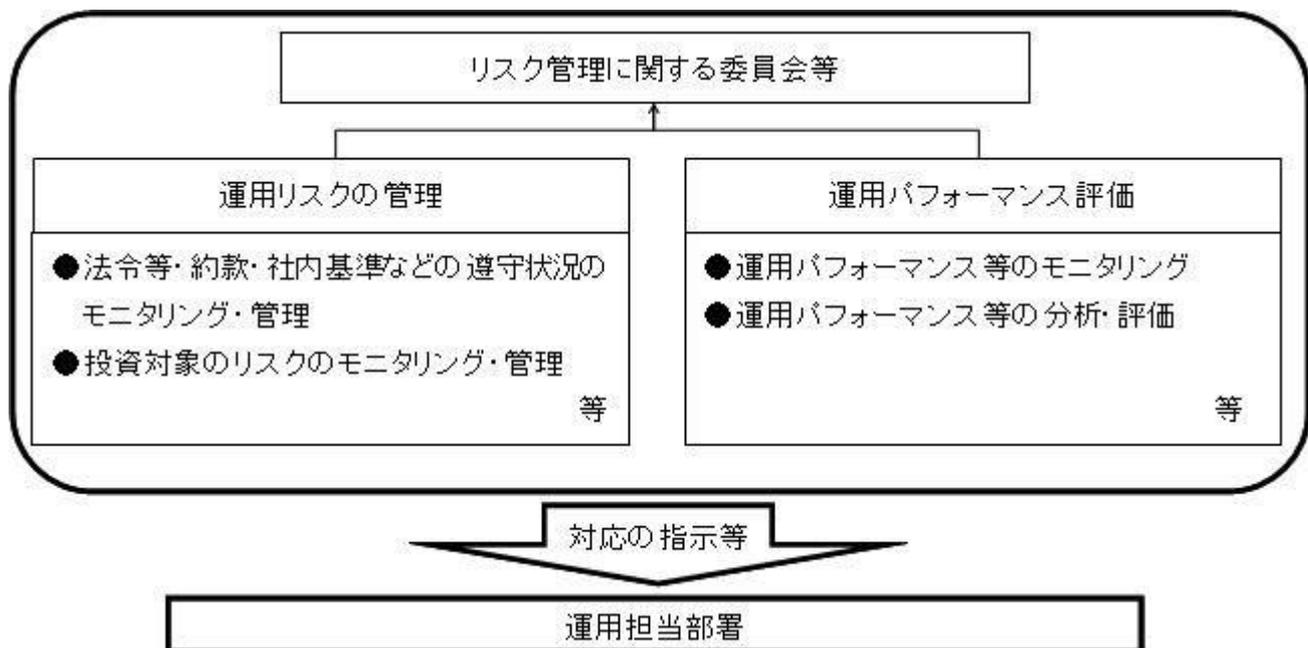
(チ) 投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券(ベビーファンド)が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券(ベビーファンド)の価額が変動する可能性があります。

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

## (2) リスク管理体制

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

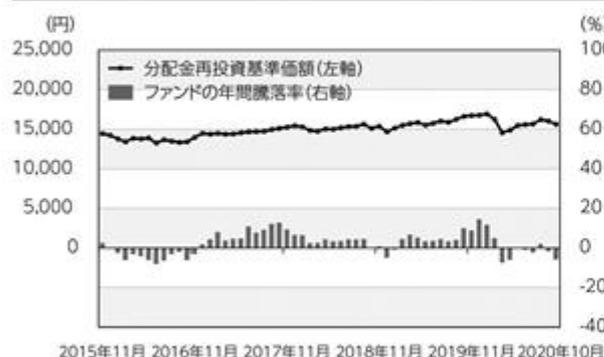
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



リスク管理体制は2020年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

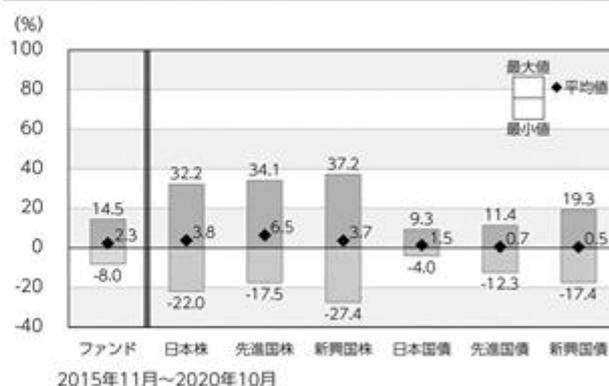
### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

\*全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、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(旧東京証券取引所)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は、旧東京証券取引所が有しています。
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、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

###### a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

###### b. 信託財産留保額

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

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

## (3) 【信託報酬等】

<p>ファンド</p>	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.045%（税抜0.95%）  信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率  運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。  運用管理費用（信託報酬）の配分は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。</p> <table border="1" data-bbox="376 434 1367 969"> <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、口座内でのファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </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、口座内で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、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価																						
<p>投資対象とする外国投資信託</p>	<p>フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865%  当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</p>																								
<p>実質的な負担</p>	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.12365%（税抜1.02865%）程度  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。

##### a. 個人の受益者に対する課税

###### (イ) 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。

###### (ロ) 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。

###### (ハ) 損益通算について

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

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

b．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、2020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。

c．個別元本について

（イ）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。

（ロ）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。

（ハ）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、「d．収益分配金の課税について」を参照。）

d．収益分配金の課税について

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	587,234,700	13.94
内 ケイマン諸島	587,234,700	13.94
親投資信託受益証券	3,568,182,860	84.69
内 日本	3,568,182,860	84.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	57,901,480	1.37
純資産総額	4,213,319,040	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

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	2,277,880,080	95.61
内 日本	2,277,880,080	95.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	104,673,456	4.39
純資産総額	2,382,553,536	100.00

その他資産の投資状況

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	94,380,000	3.96
内 日本	94,380,000	3.96

（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

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	6,650,919,000	75.67
内 日本	6,650,919,000	75.67
地方債証券	824,935,960	9.39
内 日本	824,935,960	9.39
特殊債券	728,887,000	8.29
内 日本	728,887,000	8.29
社債券	510,068,000	5.80
内 日本	510,068,000	5.80
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	74,095,990	0.84
純資産総額	8,788,905,950	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

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	1,436,403,990	98.66
内 日本	1,436,403,990	98.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	19,556,744	1.34
純資産総額	1,455,960,734	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。

#### 新光外国株式インデックスマザーファンド

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,710,536,234	92.33
内 アメリカ	1,197,975,260	64.67
内 イギリス	70,073,717	3.78
内 スイス	62,398,085	3.37
内 カナダ	58,811,203	3.17
内 フランス	54,786,729	2.96
内 ドイツ	50,333,043	2.72
内 オーストラリア	35,633,912	1.92
内 オランダ	33,792,455	1.82
内 アイルランド	31,836,098	1.72
内 スウェーデン	17,751,136	0.96
内 香港	15,110,122	0.82
内 デンマーク	14,557,834	0.79
内 スペイン	12,748,636	0.69
内 イタリア	9,576,363	0.52
内 フィンランド	6,687,377	0.36
内 バミューダ	6,053,283	0.33
内 ジェージア	5,686,280	0.31
内 シンガポール	5,185,168	0.28
内 ベルギー	4,970,400	0.27
内 イスラエル	3,442,401	0.19
内 ケイマン諸島	3,085,694	0.17
内 ノルウェー	3,030,527	0.16
内 ニューージーランド	1,892,634	0.10
内 ルクセンブルグ	1,378,815	0.07
内 ポルトガル	935,113	0.05
内 オランダ領キュラソー	925,019	0.05
内 オーストリア	643,836	0.03
内 リベリア	399,773	0.02
内 マン島	379,314	0.02
内 パナマ	290,549	0.02
内 パプアニューギニア	165,458	0.01
投資信託受益証券	2,989,211	0.16
内 オーストラリア	2,397,252	0.13
内 シンガポール	591,959	0.03
投資証券	37,697,011	2.03
内 アメリカ	34,987,639	1.89
内 イギリス	918,266	0.05
内 フランス	773,198	0.04

	内 香港	655,304	0.04
	内 オランダ	257,118	0.01
	内 カナダ	105,486	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		101,331,858	5.47
純資産総額		1,852,554,314	100.00

## その他資産の投資状況

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	98,199,543	5.30
内 アメリカ	69,083,070	3.73
内 ドイツ	21,611,451	1.17
内 イギリス	7,505,022	0.41

（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

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	16,668,858,282	98.41
内 アメリカ	6,711,113,093	39.62
内 フランス	3,324,291,829	19.63
内 イタリア	2,815,730,793	16.62
内 ドイツ	2,563,874,656	15.14
内 イギリス	818,241,032	4.83
内 カナダ	435,606,879	2.57
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	269,756,637	1.59
純資産総額	16,938,614,919	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

令和2年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	579,272,983	99.21
内 アメリカ	579,272,983	99.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,631,107	0.79
純資産総額	583,904,090	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】

令和2年10月30日現在

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

1	新光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	480,672,127	1.2864 618,384,691	1.2839 617,134,943	- -	14.65
2	海外国債マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	244,933,996	2.5231 618,017,458	2.4832 608,220,098	- -	14.44
3	ニュー トピックス イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	277,024,154	2.2416 621,005,046	2.1779 603,330,904	- -	14.32
4	フランクリン・テンブルト ン・フロンティア・エマー ジング・マーケット・デッ ト・ファンド ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	284,100	2,099.0000 596,325,900	2,067.0000 587,234,700	- -	13.94
5	新光J-REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	336,137,603	1.7869 600,677,896	1.7456 586,761,799	- -	13.93
6	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	226,917,284	2.6863 609,590,591	2.5473 578,026,397	- -	13.72
7	新光米国REITマザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	362,317,942	1.6529 598,911,558	1.5862 574,708,719	- -	13.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年10月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	13.94
親投資信託受益証券	84.69
合計	98.63

(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

令和2年10月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	11,600	7,682.98 89,122,642	6,803.00 78,914,800	- -	3.31
2	ソニー 日本	株式 電気機器	6,500	8,019.72 52,128,226	8,674.00 56,381,000	- -	2.37
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	8,100	5,133.63 41,582,437	6,793.00 55,023,300	- -	2.31
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	900	40,470.00 36,423,000	47,250.00 42,525,000	- -	1.78

5	任天堂 日本	株式 その他製品	600	43,200.00 25,920,000	56,980.00 34,188,000	- -	1.43
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	13,700	2,761.99 37,839,271	2,196.00 30,085,200	- -	1.26
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	70,300	570.23 40,087,545	410.20 28,837,060	- -	1.21
8	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	7,300	3,144.86 22,957,548	3,887.00 28,375,100	- -	1.19
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	7,100	4,216.56 29,937,644	3,970.00 28,187,000	- -	1.18
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	8,700	4,381.07 38,115,323	3,239.00 28,179,300	- -	1.18
11	日本電産 日本	株式 電気機器	2,500	7,861.20 19,653,000	10,500.00 26,250,000	- -	1.10
12	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,300	15,580.00 20,254,000	19,480.00 25,324,000	- -	1.06
13	信越化学工業 日本	株式 化学	1,800	12,451.94 22,413,500	13,890.00 25,002,000	- -	1.05
14	HOYA 日本	株式 精密機器	2,100	10,788.09 22,655,000	11,800.00 24,780,000	- -	1.04
15	第一三共 日本	株式 医薬品	8,900	2,458.20 21,877,980	2,748.00 24,457,200	- -	1.03
16	村田製作所 日本	株式 電気機器	3,100	6,872.51 21,304,800	7,267.00 22,527,700	- -	0.95
17	ファナック 日本	株式 電気機器	1,000	20,892.50 20,892,500	22,050.00 22,050,000	- -	0.93
18	KDDI 日本	株式 情報・通信業	7,500	3,250.04 24,375,300	2,792.50 20,943,750	- -	0.88
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	7,100	3,939.05 27,967,314	2,881.00 20,455,100	- -	0.86
20	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	8,200	3,044.68 24,966,400	2,435.00 19,967,000	- -	0.84
21	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	700	25,657.14 17,960,000	27,900.00 19,530,000	- -	0.82
22	花王 日本	株式 化学	2,500	9,089.80 22,724,500	7,420.00 18,550,000	- -	0.78
23	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	7,200	2,582.70 18,595,495	2,500.00 18,000,000	- -	0.76
24	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	14,000	1,647.68 23,067,570	1,281.50 17,941,000	- -	0.75

25	日立製作所 日本	株式 電気機器	5,000	4,532.81 22,664,060	3,502.00 17,510,000	- -	0.73
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,600	6,071.10 21,855,990	4,659.00 16,772,400	- -	0.70
27	S M C 日本	株式 機械	300	53,950.00 16,185,000	55,300.00 16,590,000	- -	0.70
28	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	1,100	15,918.18 17,510,000	14,585.00 16,043,500	- -	0.67
29	三菱商事 日本	株式 卸売業	6,700	2,875.40 19,265,245	2,325.50 15,580,850	- -	0.65
30	エムスリー 日本	株式 サービス業	2,200	3,510.22 7,722,500	7,027.00 15,459,400	- -	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

令和2年10月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.61
合計	95.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

令和2年10月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	15.60
情報・通信業		10.00
化学		7.23
輸送用機器		6.89
医薬品		5.62
サービス業		5.48
機械		5.06
小売業		4.66
銀行業		4.59
卸売業		4.35
食料品		3.52
陸運業		3.34
精密機器		2.59
その他製品		2.59
建設業		2.27
保険業		1.89
不動産業		1.83
電気・ガス業		1.35
その他金融業		1.05
証券、商品先物取引業		0.75
ガラス・土石製品		0.75
非鉄金属		0.65
金属製品		0.57
ゴム製品		0.55
鉄鋼		0.55

繊維製品	0.45
石油・石炭製品	0.37
空運業	0.30
パルプ・紙	0.22
倉庫・運輸関連業	0.17
海運業	0.16
鉱業	0.13
水産・農林業	0.09
合計	95.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

### 新光日本債券インデックスマザーファンド

令和2年10月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	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	120.84 120,847,000	118.32 118,329,000	2.1 2029/12/28	1.35
2	18回 東京都公募公債 20年 日本	地方債 証券	100,000,000	120.19 120,192,000	117.68 117,684,000	2.22 2029/3/19	1.34
3	36回 東日本旅客鉄道社 債 日本	社債券	100,000,000	110.15 110,159,000	108.31 108,310,000	2.11 2024/12/20	1.23
4	12回 兵庫県公募公債 15年 日本	地方債 証券	100,000,000	106.81 106,810,000	106.11 106,113,000	0.781 2030/12/6	1.21
5	49回 政保地方公共団体 金融機構債券 日本	特殊債 券	100,000,000	103.44 103,449,000	102.34 102,341,000	0.882 2023/6/16	1.16
6	249回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債 券	100,000,000	103.07 103,074,000	102.18 102,187,000	0.484 2025/6/30	1.16
7	58回 政保地方公共団体 金融機構債券 日本	特殊債 券	100,000,000	103.13 103,134,000	102.12 102,123,000	0.645 2024/3/15	1.16
8	4回 第一三共社債 日本	社債券	100,000,000	102.52 102,526,000	101.72 101,722,000	0.846 2023/9/15	1.16
9	104回 日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債 券	100,000,000	102.41 102,417,000	101.62 101,621,000	0.715 2023/3/20	1.16
10	24年度7回 広島県公募 公債 日本	地方債 証券	100,000,000	102.29 102,294,000	101.55 101,550,000	0.67 2023/3/27	1.16
11	24年度2回 広島市公募 公債 日本	地方債 証券	100,000,000	102.21 102,211,000	101.44 101,447,000	0.7 2022/12/22	1.15
12	34回 政保地方公共団体 金融機構債券 日本	特殊債 券	100,000,000	102.29 102,295,000	101.27 101,273,000	0.9 2022/3/14	1.15

13	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	101.75 101,758,000	101.01 101,013,000	0.17 2027/10/29	1.15
14	169回 共同発行市場公募地方債 日本	地方債証券	100,000,000	101.41 101,412,000	100.93 100,936,000	0.205 2027/4/23	1.15
15	218回 神奈川県公募公債 日本	地方債証券	100,000,000	101.22 101,220,000	100.69 100,691,000	0.195 2025/12/19	1.15
16	47回 野村ホールディングス社債 日本	社債券	100,000,000	100.56 100,566,000	100.28 100,286,000	0.472 2021/12/24	1.14
17	11回 プリヂェストン社債 日本	社債券	100,000,000	100.07 100,075,000	99.92 99,926,000	0.295 2027/4/21	1.14
18	44回 ホンダファイナンス社債 日本	社債券	100,000,000	99.84 99,844,000	99.82 99,824,000	0.08 2022/9/20	1.14
19	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	102.92 92,635,500	102.41 92,176,200	0.5 2024/9/20	1.05
20	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	103.39 93,059,100	102.37 92,135,700	0.4 2025/6/20	1.05
21	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	101.96 91,767,800	101.29 91,168,200	0.1 2028/3/20	1.04
22	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	90,000,000	101.64 91,477,800	101.13 91,018,800	0.1 2026/6/20	1.04
23	333回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	102.88 82,309,400	102.44 81,953,600	0.6 2024/3/20	0.93
24	338回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	103.24 82,596,000	102.28 81,830,400	0.4 2025/3/20	0.93
25	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.69 81,352,200	101.20 80,961,600	0.1 2026/12/20	0.92
26	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	80,000,000	101.77 81,421,600	101.18 80,946,400	0.1 2026/9/20	0.92
27	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	80,000,000	100.62 80,498,400	100.25 80,203,200	0.1 2021/12/20	0.91
28	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	70,000,000	103.59 72,513,700	102.44 71,708,000	0.8 2023/6/20	0.82
29	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	70,000,000	103.05 72,139,900	102.08 71,462,300	0.3 2025/12/20	0.81

30	328回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	70,000,000	102.68 71,876,700	101.74 71,218,700	0.6 2023/3/20	0.81
----	----------------------------	------	------------	----------------------	----------------------	------------------	------

(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

令和2年10月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	75.67
地方債証券	9.39
特殊債券	8.29
社債券	5.80
合計	99.16

(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

令和2年10月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	186	539,992.79 100,438,659	528,000.00 98,208,000	- -	6.75
2	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	250	337,513.42 84,378,357	344,000.00 86,000,000	- -	5.91
3	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	165	521,982.83 86,127,168	512,000.00 84,480,000	- -	5.80
4	GLP投資法人 日本	投資証券	475	159,491.74 75,758,581	161,000.00 76,475,000	- -	5.25
5	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	534	134,471.35 71,807,701	124,600.00 66,536,400	- -	4.57
6	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	236	250,173.30 59,040,899	241,900.00 57,088,400	- -	3.92
7	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	329	152,295.31 50,105,157	146,500.00 48,198,500	- -	3.31
8	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	157	293,183.39 46,029,793	305,000.00 47,885,000	- -	3.29
9	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	310	160,898.25 49,878,460	150,300.00 46,593,000	- -	3.20
10	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	233	176,096.45 41,030,475	177,600.00 41,380,800	- -	2.84
11	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	353	117,985.37 41,648,836	111,300.00 39,288,900	- -	2.70

12	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	486	74,991.50 36,445,869	73,000.00 35,478,000	- -	2.44
13	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	55	583,000.00 32,065,000	598,000.00 32,890,000	- -	2.26
14	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	108	289,597.65 31,276,547	293,100.00 31,654,800	- -	2.17
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	83	398,856.18 33,105,063	377,000.00 31,291,000	- -	2.15
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	51	624,000.00 31,824,000	604,000.00 30,804,000	- -	2.12
17	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	184	164,787.81 30,320,958	162,600.00 29,918,400	- -	2.05
18	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	103	305,966.49 31,514,549	282,500.00 29,097,500	- -	2.00
19	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	58	494,372.06 28,673,580	499,000.00 28,942,000	- -	1.99
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	532	54,500.86 28,994,461	50,300.00 26,759,600	- -	1.84
21	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	194	132,681.74 25,740,258	128,500.00 24,929,000	- -	1.71
22	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	691	35,308.70 24,398,313	33,250.00 22,975,750	- -	1.58
23	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	72	294,700.00 21,218,400	298,800.00 21,513,600	- -	1.48
24	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	208	100,291.41 20,860,615	102,100.00 21,236,800	- -	1.46
25	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	35	590,000.00 20,650,000	567,000.00 19,845,000	- -	1.36
26	イオンリート投資法人 日本	投資証券	168	120,391.77 20,225,818	118,000.00 19,824,000	- -	1.36
27	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	55	370,500.00 20,377,500	349,500.00 19,222,500	- -	1.32
28	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	108	169,944.70 18,354,028	170,700.00 18,435,600	- -	1.27
29	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	133	139,508.49 18,554,630	137,200.00 18,247,600	- -	1.25
30	日本リート投資法人 日本	投資証券	54	344,750.98 18,616,553	334,500.00 18,063,000	- -	1.24

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年10月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.66
合計	98.66

（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

令和2年10月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	7,624	6,752.21 51,478,923	12,062.47 91,964,286	- -	4.96
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	2,969	15,332.48 45,522,139	21,413.71 63,577,310	- -	3.43
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	175	188,109.37 32,919,141	335,871.64 58,777,538	- -	3.17
4	FACEBOOK 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	990	19,603.50 19,407,472	29,374.81 29,081,069	- -	1.57
5	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	125	134,747.00 16,843,376	163,933.30 20,491,663	- -	1.11
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	123	134,582.36 16,553,631	162,849.64 20,030,506	- -	1.08
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	1,087	13,867.33 15,073,794	14,350.07 15,598,530	- -	0.84

8	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	1,021	12,413.01 12,673,691	14,389.82 14,692,008	- -	0.79
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	1,234	11,852.28 14,625,716	11,783.29 14,540,590	- -	0.78
10	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	253	22,175.86 5,610,494	54,492.41 13,786,581	- -	0.74
11	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	320	7,497.34 2,399,151	42,972.81 13,751,301	- -	0.74
12	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	697	18,434.93 12,849,149	19,337.40 13,478,169	- -	0.73
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	1,251	13,182.36 16,491,135	10,163.98 12,715,141	- -	0.69
14	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	443	23,693.64 10,496,283	28,203.29 12,494,061	- -	0.67
15	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	390	26,651.82 10,394,210	31,764.92 12,388,321	- -	0.67
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	563	22,655.22 12,754,891	21,077.94 11,866,883	- -	0.64
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	369	28,212.08 10,410,258	30,666.62 11,315,985	- -	0.61
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	1,712	6,131.08 10,496,425	5,937.09 10,164,308	- -	0.55
19	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	290	34,229.53 9,926,564	33,589.82 9,741,050	- -	0.53
20	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	198	30,706.89 6,079,966	48,232.10 9,549,956	- -	0.52
21	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	180	31,384.50 5,649,211	52,740.36 9,493,265	- -	0.51
22	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	745	13,886.99 10,345,813	12,713.08 9,471,247	- -	0.51
23	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	459	10,459.94 4,801,114	20,401.18 9,364,143	- -	0.51

24	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	368	16,460.75 6,057,559	24,804.84 9,128,182	- -	0.49
25	WALMART INC アメリカ	株式 食品・生活必需品 小売り	589	12,437.25 7,325,545	14,635.63 8,620,387	- -	0.47
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	1,684	5,352.08 9,012,909	5,022.89 8,458,550	- -	0.46
27	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	2,292	3,813.67 8,740,949	3,690.28 8,458,140	- -	0.46
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	1,867	4,579.42 8,549,781	4,504.07 8,409,109	- -	0.45
29	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	1,041	8,627.76 8,981,499	7,938.09 8,263,555	- -	0.45
30	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サービス	2,930	3,988.18 11,685,396	2,799.09 8,201,351	- -	0.44

(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

令和2年10月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	92.33
投資信託受益証券	0.16
投資証券	2.03
合計	94.53

(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

令和2年10月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.12
コンピュータ・周辺機器		5.19
医薬品		4.82
銀行		4.77
情報技術サービス		4.41
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.16
半導体・半導体製造装置		3.87
インターネット販売・通信販売		3.86
ヘルスケア機器・用品		3.11
保険		2.78
資本市場		2.75
石油・ガス・消耗燃料		2.28
化学		2.10
電力		2.02
バイオテクノロジー		1.88
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.85
食品	1.77	
専門小売り	1.68	

飲料	1.66
機械	1.65
各種電気通信サービス	1.59
食品・生活必需品小売り	1.47
娯楽	1.47
ホテル・レストラン・レジャー	1.46
家庭用品	1.40
金属・鉱業	1.39
繊維・アパレル・贅沢品	1.39
自動車	1.31
航空宇宙・防衛	1.29
メディア	1.05
コングロマリット	1.04
陸運・鉄道	1.04
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.04
総合公益事業	0.99
各種金融サービス	0.87
電気設備	0.76
専門サービス	0.70
パーソナル用品	0.68
航空貨物・物流サービス	0.66
タバコ	0.65
通信機器	0.59
電子装置・機器・部品	0.54
建設関連製品	0.53
複合小売り	0.51
商業サービス・用品	0.44
不動産管理・開発	0.42
家庭用耐久財	0.34
消費者金融	0.31
容器・包装	0.30
商社・流通業	0.29
無線通信サービス	0.27
建設資材	0.24
建設・土木	0.23
自動車部品	0.22
ヘルスケア・テクノロジー	0.17
運送インフラ	0.16
ガス	0.16
水道	0.13
エネルギー設備・サービス	0.11
紙製品・林産品	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
レジャー用品	0.07
海運業	0.06
販売	0.05
旅客航空輸送業	0.04
合計	92.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 海外国債マザーファンド

令和2年10月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	523,000,000	111.69 584,178,282	119.00 622,370,000	3.125 2028/11/15	3.67
2	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証 券	523,000,000	109.85 574,563,040	116.66 610,153,043	2.875 2028/8/15	3.60
3	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	523,000,000	109.70 573,746,951	116.35 608,518,669	2.875 2028/5/15	3.59
4	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証 券	488,560,000	124.66 609,051,598	123.86 605,171,455	2.75 2027/10/25	3.57
5	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証 券	523,000,000	107.67 563,119,820	115.35 603,288,669	2.625 2029/2/15	3.56
6	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	523,000,000	108.57 567,863,463	115.10 602,022,031	2.75 2028/2/15	3.55
7	US T N/B 2.375 05/15/29 アメリカ	国債証 券	523,000,000	106.04 554,620,580	113.55 593,891,013	2.375 2029/5/15	3.51
8	US T N/B 1.75 11/15/29 アメリカ	国債証 券	523,000,000	104.19 544,916,805	108.60 567,986,169	1.75 2029/11/15	3.35
9	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証 券	523,000,000	102.85 537,929,819	107.43 561,898,125	1.625 2029/8/15	3.32
10	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証 券	366,420,000	154.42 565,827,229	152.10 557,347,538	5.5 2029/4/25	3.29
11	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証 券	523,000,000	97.89 511,964,700	98.28 514,051,794	0.625 2030/5/15	3.03
12	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	523,000,000	98.37 514,501,250	98.02 512,662,575	0.625 2030/8/15	3.03
13	FRANCE OAT 0.75 11/25/28 フランス	国債証 券	427,490,000	108.58 464,173,771	110.34 471,692,466	0.75 2028/11/25	2.78
14	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証 券	366,420,000	124.91 457,706,214	128.49 470,816,722	2.5 2030/5/25	2.78
15	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証 券	418,400,000	104.82 438,579,464	106.38 445,105,685	1.5 2030/2/15	2.63
16	FRANCE OAT 0.0 11/25/29 フランス	国債証 券	403,062,000	101.11 407,567,988	103.95 418,998,265	- 2029/11/25	2.47
17	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証 券	366,420,000	108.51 397,631,655	109.91 402,735,886	0.75 2028/5/25	2.38
18	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証 券	366,420,000	106.20 389,164,422	108.49 397,529,497	0.5 2029/5/25	2.35
19	DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 ドイツ	国債証 券	366,420,000	105.80 387,701,673	106.42 389,944,164	- 2030/8/15	2.30
20	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 ドイツ	国債証 券	232,066,000	166.39 386,149,640	166.22 385,763,311	6.25 2030/1/4	2.28
21	ITALY BTPS 0.95 08/01/30 イタリア	国債証 券	366,420,000	102.50 375,606,149	102.77 376,569,834	0.95 2030/8/1	2.22
22	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証 券	313,800,000	104.65 328,411,051	111.33 349,372,170	2.25 2027/11/15	2.06

23	ITALY BTPS 6.5 11/01/27 イタリア	国債証券	244,280,000	144.62 353,277,736	141.92 346,682,176	6.5 2027/11/1	2.05
24	ITALY BTPS 5.25 11/01/29 イタリア	国債証券	244,280,000	133.14 325,247,827	140.87 344,117,236	5.25 2029/11/1	2.03
25	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 ドイツ	国債証券	232,066,000	144.74 335,910,038	143.77 333,664,494	4.75 2028/7/4	1.97
26	DEUTSCHLAND 08/15/29 ドイツ	国債証券	305,350,000	102.74 313,742,605	106.38 324,843,544	- 2029/8/15	1.92
27	ITALY BTPS 4.75 09/01/28 イタリア	国債証券	244,280,000	131.74 321,818,869	132.63 324,000,778	4.75 2028/9/1	1.91
28	ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア	国債証券	244,280,000	114.58 279,900,909	126.14 308,139,677	3.5 2030/3/1	1.82
29	ITALY BTPS 3.0 08/01/29 イタリア	国債証券	244,280,000	117.63 287,346,564	120.84 295,209,937	3 2029/8/1	1.74
30	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証券	244,280,000	115.49 282,126,300	118.18 288,702,318	2.8 2028/12/1	1.70

（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

令和2年10月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.41
合計	98.41

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資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

令和2年10月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	AMERICAN TOWER CORP アメリカ	投資証券	2,371	25,061.91 59,421,795	24,230.58 57,450,728	- -	9.84
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	3,955	10,774.92 42,614,830	10,478.82 41,443,764	- -	7.10
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP アメリカ	投資証券	2,233	17,186.14 38,376,660	16,496.46 36,836,608	- -	6.31
4	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	472	84,719.12 39,987,425	77,475.12 36,568,260	- -	6.26
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,435	16,230.96 23,291,430	15,556.11 22,323,020	- -	3.82
6	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	809	24,184.83 19,565,534	24,147.95 19,535,696	- -	3.35
7	SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ	投資証券	593	32,192.27 19,090,020	30,859.09 18,299,441	- -	3.13
8	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	2,244	5,501.18 12,344,670	5,714.29 12,822,884	- -	2.20

9	WEYERHAEUSER CO アメリカ	投資証 券	4,009	3,064.36 12,285,059	2,971.68 11,913,489	- -	2.04
10	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証 券	1,846	6,145.78 11,345,112	6,121.19 11,299,720	- -	1.94
11	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証 券	1,633	6,685.04 10,916,672	6,632.68 10,831,176	- -	1.85
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	755	15,208.90 11,482,723	14,239.19 10,750,594	- -	1.84
13	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証 券	672	16,582.27 11,143,292	15,847.94 10,649,819	- -	1.82
14	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	1,972	5,304.16 10,459,820	4,838.79 9,542,105	- -	1.63
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	3,010	2,894.58 8,712,705	2,866.03 8,626,780	- -	1.48
16	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	2,003	4,316.72 8,646,399	4,173.53 8,359,600	- -	1.43
17	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	2,893	2,776.71 8,033,025	2,878.59 8,327,766	- -	1.43
18	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	676	11,897.72 8,042,862	12,167.07 8,224,940	- -	1.41
19	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証 券	1,976	4,016.55 7,936,711	3,957.01 7,819,067	- -	1.34
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	519	15,134.15 7,854,624	14,523.70 7,537,805	- -	1.29
21	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	611	12,309.00 7,520,799	11,875.23 7,255,770	- -	1.24
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	349	20,821.67 7,266,764	20,666.86 7,212,736	- -	1.24
23	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	2,868	2,421.57 6,945,089	2,431.94 6,974,832	- -	1.19
24	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	835	7,949.09 6,637,491	7,493.54 6,257,109	- -	1.07
25	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	918	6,852.94 6,291,000	6,496.70 5,963,976	- -	1.02
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	933	6,589.30 6,147,820	6,209.05 5,793,049	- -	0.99
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証 券	2,789	1,849.51 5,158,286	1,897.44 5,291,971	- -	0.91
28	UDR INC アメリカ	投資証 券	1,565	3,361.84 5,261,285	3,129.63 4,897,874	- -	0.84
29	CYRUSONE INC アメリカ	投資証 券	626	8,072.49 5,053,384	7,598.14 4,756,438	- -	0.81
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証 券	504	9,517.55 4,796,847	9,183.87 4,628,675	- -	0.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年10月30日現在

種類	投資比率(%)
----	---------

投資証券	99.21
合計	99.21

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率  
 該当事項はありません。

**【投資不動産物件】**

該当事項はありません。

(参考)

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

新光日本債券インデックスマザーファンド  
 該当事項はありません。

新光J - R E I Tマザーファンド  
 該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド  
 該当事項はありません。

海外国債マザーファンド  
 該当事項はありません。

新光米国R E I Tマザーファンド  
 該当事項はありません。

**【その他投資資産の主要なもの】**

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

令和2年10月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0212月	買建	6	97,381,980	94,380,000	3.96

(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 - R E I Tマザーファンド  
 該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和2年10月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Dec20	買建	4	70,630,104	69,083,070	3.73
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec20	買建	6	23,773,329	21,611,451	1.17
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec20	買建	1	8,185,330	7,505,022	0.41

(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(令和2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9特定期間末 (平成23年4月20日)	12,014	12,090	0.6284	0.6324
第10特定期間末 (平成23年10月20日)	9,331	9,365	0.5447	0.5467
第11特定期間末 (平成24年4月20日)	8,395	8,423	0.5983	0.6003
第12特定期間末 (平成24年10月22日)	7,563	7,588	0.5969	0.5989
第13特定期間末 (平成25年4月22日)	9,376	9,400	0.7854	0.7874
第14特定期間末 (平成25年10月21日)	8,609	8,631	0.7728	0.7748
第15特定期間末 (平成26年4月21日)	8,104	8,125	0.7970	0.7990
第16特定期間末 (平成26年10月20日)	7,644	7,663	0.8254	0.8274
第17特定期間末 (平成27年4月20日)	7,692	7,709	0.9283	0.9303
第18特定期間末 (平成27年10月20日)	6,937	6,952	0.8993	0.9013
第19特定期間末 (平成28年4月20日)	6,329	6,344	0.8666	0.8686
第20特定期間末 (平成28年10月20日)	5,699	5,713	0.8330	0.8350

第21特定期間末 (平成29年 4月20日)	5,622	5,635	0.8684	0.8704
第22特定期間末 (平成29年10月20日)	5,597	5,609	0.9138	0.9158
第23特定期間末 (平成30年 4月20日)	5,336	5,348	0.8885	0.8905
第24特定期間末 (平成30年10月22日)	5,115	5,126	0.8935	0.8955
第25特定期間末 (平成31年 4月22日)	5,013	5,024	0.9197	0.9217
第26特定期間末 (令和1年10月21日)	4,980	4,991	0.9464	0.9484
第27特定期間末 (令和2年4月20日)	4,234	4,244	0.8402	0.8422
第28特定期間末 (令和2年10月20日)	4,344	4,353	0.8946	0.8966
令和1年10月末日	5,007	-	0.9525	-
11月末日	4,970	-	0.9567	-
12月末日	4,956	-	0.9578	-
令和2年1月末日	4,964	-	0.9640	-
2月末日	4,704	-	0.9230	-
3月末日	4,185	-	0.8242	-
4月末日	4,239	-	0.8416	-
5月末日	4,388	-	0.8741	-
6月末日	4,386	-	0.8780	-
7月末日	4,343	-	0.8787	-
8月末日	4,447	-	0.9078	-
9月末日	4,362	-	0.8954	-
10月末日	4,213	-	0.8722	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第9特定期間	0.0240
第10特定期間	0.0220
第11特定期間	0.0120
第12特定期間	0.0120
第13特定期間	0.0120
第14特定期間	0.0120
第15特定期間	0.0120
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0120
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0120

第26特定期間	0.0120
第27特定期間	0.0120
第28特定期間	0.0120

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第9特定期間	6.7
第10特定期間	9.8
第11特定期間	12.0
第12特定期間	1.8
第13特定期間	33.6
第14特定期間	0.1
第15特定期間	4.7
第16特定期間	5.1
第17特定期間	13.9
第18特定期間	1.8
第19特定期間	2.3
第20特定期間	2.5
第21特定期間	5.7
第22特定期間	6.6
第23特定期間	1.5
第24特定期間	1.9
第25特定期間	4.3
第26特定期間	4.2
第27特定期間	10.0
第28特定期間	7.9

（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9特定期間	93,294,151	2,262,935,013
第10特定期間	55,270,668	2,043,398,766
第11特定期間	24,129,070	3,124,126,893
第12特定期間	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	22,407,208	820,891,392
第15特定期間	25,208,228	996,341,985
第16特定期間	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	13,815,643	989,033,927
第18特定期間	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	5,348,676	374,412,075
第22特定期間	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	45,095,213	164,575,560
第24特定期間	4,817,074	285,434,876
第25特定期間	13,966,043	287,993,351
第26特定期間	34,127,005	222,623,381

第27特定期間	9,232,953	232,290,245
第28特定期間	14,557,001	198,285,857

(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:2020年10月30日

## 基準価額・純資産の推移 (2010年10月29日~2020年10月30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)

2020年 6月	20円
2020年 7月	20円
2020年 8月	20円
2020年 9月	20円
2020年10月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	4,400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	新光日本債券インデックスマザーファンド	14.65
2	海外国債マザーファンド	14.44
3	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	14.32
4	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	13.94
5	新光J-REITマザーファンド	13.93
6	新光外国株式インデックスマザーファンド	13.72
7	新光米国REITマザーファンド	13.64

## ■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	3.31
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.37
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.31
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78
5	任天堂	株式	日本	その他製品	1.43

## ■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	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	1.35
2	18回 東京都公債 20年	地方債証券	日本	2.22	2029/3/19	1.34
3	36回 東日本旅客鉄道社債	社債券	日本	2.11	2024/12/20	1.23
4	12回 兵庫県公債 15年	地方債証券	日本	0.781	2030/12/6	1.21
5	49回 政保地方公共団体金融機構債券	特殊債券	日本	0.882	2023/6/16	1.16

## ■新光J-REITマザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.75
2	日本プロロジスリート投資法人	日本	5.91
3	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.80
4	GLP投資法人	日本	5.25
5	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.57

○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:2020年10月30日

## ■新光外国株式インデックスマザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.96
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.43
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	3.17
4	FACEBOOK 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	1.57
5	ALPHABET INC-CL C	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	1.11

## ■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 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	3.67
2	US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/8/15	3.60
3	US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/5/15	3.59
4	FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	フランス	2.75	2027/10/25	3.57
5	US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	アメリカ	2.625	2029/2/15	3.56

## ■フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド(現地2020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	57.5
2	南アフリカランド	5.3
3	メキシコペソ	5.2
4	ウルグアイペソ	4.7
5	コロンビアペソ	3.5

## ②組入公社債の上位5ヵ国

順位	国/地域	比率(%)
1	南アフリカ	7.0
2	メキシコ	6.8
3	その他	6.3
4	コロンビア	6.2
5	ウルグアイ	4.7

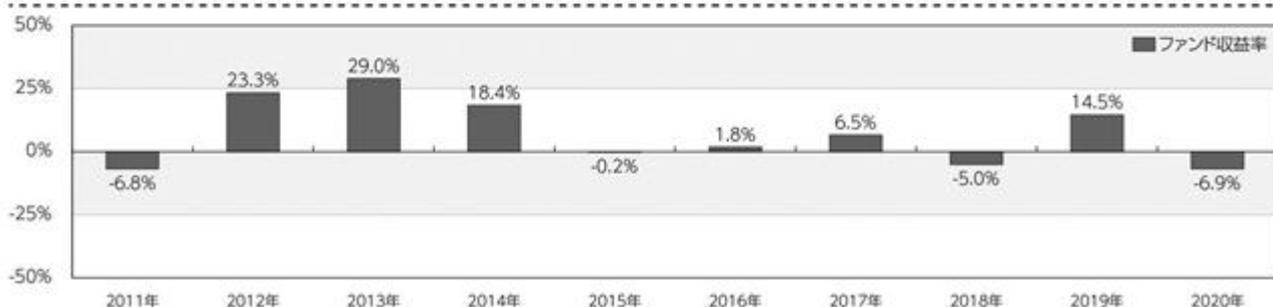
## ■新光米国REITマザーファンド

※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	AMERICAN TOWER CORP	アメリカ	9.84
2	PROLOGIS INC	アメリカ	7.10
3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	アメリカ	6.31
4	EQUINIX INC	アメリカ	6.26
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.82

## 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。

※2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

### 2【換金(解約)手続等】

一部解約(解約請求によるご解約)

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

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

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

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

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

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

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

- (ホ)一部解約金は、受益者の一部解約の実行の請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。ただし、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、一部解約金の支払いを延期する場合があります。
- (ヘ)受益者は、以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を行えないものとします。
- ニューヨーク証券取引所の休業日
  - ニューヨークの銀行の休業日
  - ロンドン証券取引所の休業日
  - ロンドンの銀行の休業日
- (ト)委託者は、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- (チ)上記(ト)により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合、またはすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付が取り消された場合には、受益者は当該受付中止または取消以前に行った一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止または取り消しを解除した後の最初の基準価額の計算日(この日が一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。)に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記(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～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

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

(4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5)【その他】

a. 信託の終了(投資信託契約の解約)

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

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

- (ハ) 上記(ロ)の投資信託契約の解約にかかる公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、投資信託契約の解約をしません。
- (ホ) 委託者は、上記(ニ)の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ヘ) 上記(ハ)から(ホ)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(ホ)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (ト) 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。
- (チ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

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

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

#### b. 投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

c．異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d．運用報告書

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

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

e．公告

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

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

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

f．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g．信託事務処理の再信託

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

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

h．信託業務の委託等

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

- 1．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
- 2．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
- 3．委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
- 4．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

1. 投資信託財産の保存にかかる業務
2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

i. 関係法人との契約の更改

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

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

#### 4【受益者の権利等】

a. 収益分配金請求権

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

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

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

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

b. 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

## c. 一部解約請求権

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

## d. 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

## 1【財務諸表】

## 【新光7資産バランスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 令和2年4月20日現在	当期 令和2年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	83,952,945	102,149,519
投資信託受益証券	533,745,600	596,325,900
親投資信託受益証券	3,630,118,594	3,666,587,240
流動資産合計	4,247,817,139	4,365,062,659
資産合計	4,247,817,139	4,365,062,659
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	10,079,405	9,711,948
未払解約金	100	7,815,050
未払受託者報酬	279,553	285,047
未払委託者報酬	3,040,239	3,099,999
その他未払費用	12,600	12,718
流動負債合計	13,411,897	20,924,762
負債合計	13,411,897	20,924,762
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,039,702,869	4,855,974,013
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	805,297,627	511,836,116
(分配準備積立金)	489,876,976	508,577,909
元本等合計	4,234,405,242	4,344,137,897
純資産合計	4,234,405,242	4,344,137,897
負債純資産合計	4,247,817,139	4,365,062,659

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 令和1年10月22日 至 令和2年4月20日	当期 自 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	65,808,000	66,883,500
有価証券売買等損益	519,167,719	288,130,746
営業収益合計	453,359,719	355,014,246
<b>営業費用</b>		
支払利息	28,155	29,906
受託者報酬	2,084,359	1,929,455
委託者報酬	22,667,862	20,983,402
その他費用	96,143	86,839
営業費用合計	24,876,519	23,029,602
営業利益又は営業損失( )	478,236,238	331,984,644
経常利益又は経常損失( )	478,236,238	331,984,644
当期純利益又は当期純損失( )	478,236,238	331,984,644
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( )	413,972	1,805,791
期首剰余金又は期首欠損金( )	282,136,469	805,297,627
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,100,418	24,258,882
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,100,418	24,258,882
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	784,713	1,677,741
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	784,713	1,677,741
分配金	61,654,597	59,298,483
期末剰余金又は期末欠損金( )	805,297,627	511,836,116

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	令和2年4月20日現在	令和2年10月20日現在
1. 期首元本額	5,262,760,161円	5,039,702,869円
期中追加設定元本額	9,232,953円	14,557,001円
期中一部解約元本額	232,290,245円	198,285,857円
2. 受益権の総数	5,039,702,869口	4,855,974,013口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は805,297,627円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は511,836,116円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 令和1年10月22日 至 令和2年4月20日	自 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 分配金の計算過程	<p>(自令和1年10月22日 至令和1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(14,721,515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(9,872,717円)及び分配準備積立金(466,664,952円)より分配対象収益は491,259,184円(1万口当たり939.91円)であり、うち10,453,236円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和2年4月21日 至令和2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(14,947,540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(10,355,465円)及び分配準備積立金(489,088,452円)より分配対象収益は514,391,457円(1万口当たり1,022.09円)であり、うち10,065,462円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>

(自令和1年11月21日 至令和1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(12,359,317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(10,014,123円)及び分配準備積立金

(466,633,685円)より分配対象収益は489,007,125円(1万口当たり943.77円)であり、うち10,362,785円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年12月21日 至令和2年1月20日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,292,029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(10,030,042円)及び分配準備積立金

(466,284,898円)より分配対象収益は495,606,969円(1万口当たり961.19円)であり、うち10,312,336円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和2年1月21日 至令和2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(15,866,813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(10,162,825円)及び分配準備積立金

(473,889,917円)より分配対象収益は499,919,555円(1万口当たり972.04円)であり、うち10,285,896円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和2年5月21日 至令和2年6月22日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,227,610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(11,112,209円)及び分配準備積立金

(489,859,785円)より分配対象収益は518,199,604円(1万口当たり1,036.58円)であり、うち9,998,199円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和2年6月23日 至令和2年7月20日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,723,195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(11,140,086円)及び分配準備積立金

(492,884,916円)より分配対象収益は520,748,197円(1万口当たり1,050.31円)であり、うち9,916,013円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和2年7月21日 至令和2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(16,085,042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(11,146,674円)及び分配準備積立金

(496,655,204円)より分配対象収益は523,886,920円(1万口当たり1,062.95円)であり、うち9,857,177円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

<p>(自令和2年2月21日 至令和2年3月23日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,539,349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(10,109,443円)及び分配準備積立金(473,576,951円)より分配対象収益は500,225,743円(1万口当たり984.60円)であり、うち10,160,939円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自令和2年3月24日 至令和2年4月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(24,077,188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(10,257,932円)及び分配準備積立金(475,879,193円)より分配対象収益は510,214,313円(1万口当たり1,012.38円)であり、うち10,079,405円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和2年8月21日 至令和2年9月23日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,185,136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(11,115,154円)及び分配準備積立金(497,310,044円)より分配対象収益は524,610,334円(1万口当たり1,076.15円)であり、うち9,749,684円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自令和2年9月24日 至令和2年10月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,736,689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(11,316,716円)及び分配準備積立金(501,553,168円)より分配対象収益は529,606,573円(1万口当たり1,090.62円)であり、うち9,711,948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 令和1年10月22日 至 令和2年4月20日	当期 自 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 令和2年4月20日現在	当期 令和2年10月20日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	17,724,000	9,943,500
親投資信託受益証券	375,045,873	36,249,355
合計	357,321,873	26,305,855

## (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 令和2年4月20日現在	当期 令和2年10月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8402円 (8,402円)	0.8946円 (8,946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

令和2年10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	284,100	596,325,900	
投資信託受益証券 合計		284,100	596,325,900	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	244,933,996	618,017,458	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	277,024,154	621,005,046	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	226,917,284	609,590,591	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	480,672,127	618,384,691	
	新光J-REITマザーファンド	336,137,603	600,677,896	
	新光米国REITマザーファンド	362,317,942	598,911,558	
親投資信託受益証券 合計		1,928,003,106	3,666,587,240	
合計			4,262,913,140	

（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)

令和2年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	79,667,326
株式	2,357,041,590
派生商品評価勘定	88,020
未収入金	1,430,000
未収配当金	19,647,021
流動資産合計	2,457,873,957
資産合計	2,457,873,957
負債の部	
流動負債	
前受金	810,000
未払解約金	69,000
流動負債合計	879,000
負債合計	879,000
純資産の部	
元本等	
元本	1,096,045,401
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,360,949,556
元本等合計	2,456,994,957
純資産合計	2,456,994,957
負債純資産合計	2,457,873,957

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,145,344,367円
同期中追加設定元本額	72,870,352円
同期中一部解約元本額	122,169,318円
元本の内訳	
ファンド名	
ニュー トピックス インデックス	219,592,102円
新光7資産バランスファンド	277,024,154円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	75,186,887円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	422,665,457円
新光ワールドバランスファンドVA(適格機関投資家私募)	19,620,257円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	31,889,772円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	12,790,748円
グローバル・ナビ	17,652,948円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,947,636円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	13,237,193円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	1,438,247円
計	1,096,045,401円
2. 受益権の総数	1,096,045,401口
3. 差入代用有価証券	
株式	142,017,500円

(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 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
----	-----------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	令和2年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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	令和2年10月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	159,387,473
合計	159,387,473

(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(令和2年1月15日から令和2年10月20日まで)に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	令和2年10月20日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	97,380,000	-	97,470,000	90,000
合計	97,380,000	-	97,470,000	90,000

## （注）時価の算定方法

## 株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （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）

令和2年10月20日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2417円 (22,417円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

令和2年10月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本水産	1,400	412.00	576,800	
マルハニチロ	200	2,193.00	438,600	
サカタのタネ	200	3,795.00	759,000	
ホクト	100	2,229.00	222,900	
ショーボンドホールディングス	200	5,210.00	1,042,000	
ミライト・ホールディングス	400	1,552.00	620,800	
タマホーム	100	1,496.00	149,600	
日本アクア	100	706.00	70,600	
TATERU	300	199.00	59,700	
スペースバリューホールディングス	200	580.00	116,000	
住石ホールディングス	300	124.00	37,200	
三井松島ホールディングス	100	718.00	71,800	
国際石油開発帝石	5,200	522.90	2,719,080	
石油資源開発	200	1,686.00	337,200	
K&Oエナジーグループ	100	1,454.00	145,400	
安藤・間	800	688.00	550,400	
東急建設	400	469.00	187,600	
コムシスホールディングス	500	2,760.00	1,380,000	

ビーアールホールディングス	200	729.00	145,800	
高松コンストラクショングループ	100	2,168.00	216,800	
ヤマウラ	100	903.00	90,300	
大成建設	1,100	3,410.00	3,751,000	
大林組	3,300	887.00	2,927,100	
清水建設	3,300	743.00	2,451,900	
飛鳥建設	100	1,078.00	107,800	
長谷工コーポレーション	1,300	1,297.00	1,686,100	
松井建設	100	704.00	70,400	
鹿島建設	2,600	1,167.00	3,034,200	
不動テトラ	100	1,521.00	152,100	
鉄建建設	100	1,990.00	199,000	
西松建設	300	2,031.00	609,300	
三井住友建設	800	423.00	338,400	
大豊建設	100	3,225.00	322,500	
前田建設工業	800	746.00	596,800	
佐田建設	100	446.00	44,600	
ナカノフドー建設	100	411.00	41,100	
奥村組	200	2,457.00	491,400	
東鉄工業	100	2,685.00	268,500	
戸田建設	1,400	620.00	868,000	
熊谷組	200	2,458.00	491,600	
矢作建設工業	100	847.00	84,700	
ピーエス三菱	100	589.00	58,900	
日本ハウスホールディングス	200	268.00	53,600	
大東建託	400	9,656.00	3,862,400	
新日本建設	100	913.00	91,300	
N I P P O	300	2,779.00	833,700	
前田道路	300	1,792.00	537,600	
東亜建設工業	100	1,831.00	183,100	
日本国土開発	300	567.00	170,100	
若築建設	100	1,174.00	117,400	
東洋建設	400	412.00	164,800	
五洋建設	1,300	650.00	845,000	
世紀東急工業	200	799.00	159,800	
住友林業	800	1,731.00	1,384,800	
日本基礎技術	100	453.00	45,300	
巴コーポレーション	100	360.00	36,000	
大和ハウス工業	3,200	2,839.50	9,086,400	
ライト工業	200	1,554.00	310,800	
積水ハウス	3,600	1,777.00	6,397,200	
日特建設	100	785.00	78,500	
北陸電気工事	100	1,156.00	115,600	
ユアテック	200	625.00	125,000	
日本リーテック	100	2,393.00	239,300	
中電工	100	2,158.00	215,800	
関電工	500	815.00	407,500	
きんでん	800	1,733.00	1,386,400	
東京エネシス	100	740.00	74,000	
住友電設	100	2,492.00	249,200	

日本電設工業	200	2,041.00	408,200
協和エクシオ	500	2,518.00	1,259,000
新日本空調	100	2,167.00	216,700
日本工営	100	2,760.00	276,000
九電工	200	2,887.00	577,400
三機工業	200	1,148.00	229,600
日揮ホールディングス	1,000	923.00	923,000
ヤマト	100	664.00	66,400
太平電業	100	2,217.00	221,700
高砂熱学工業	300	1,443.00	432,900
N E C ネットズエスアイ	300	1,988.00	596,400
明星工業	200	807.00	161,400
大気社	200	2,761.00	552,200
ダイダン	100	2,598.00	259,800
日比谷総合設備	100	1,723.00	172,300
日本製粉	300	1,702.00	510,600
日清製粉グループ本社	1,200	1,606.00	1,927,200
昭和産業	100	3,235.00	323,500
鳥越製粉	100	1,010.00	101,000
中部飼料	100	1,548.00	154,800
フィード・ワン	100	911.00	91,100
日本甜菜製糖	100	1,784.00	178,400
三井製糖	100	1,882.00	188,200
塩水港精糖	100	222.00	22,200
L I F U L L	300	427.00	128,100
ミクシィ	200	2,930.00	586,000
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,382.00	138,200
日本M&Aセンター	800	6,560.00	5,248,000
UTグループ	200	3,870.00	774,000
タケエイ	100	1,083.00	108,300
ビーネックスグループ	100	1,175.00	117,500
コシダカホールディングス	200	460.00	92,000
パソナグループ	100	1,898.00	189,800
リンクアンドモチベーション	200	424.00	84,800
G C A	100	694.00	69,400
エス・エム・エス	300	3,305.00	991,500
パーソルホールディングス	1,000	1,815.00	1,815,000
クックパッド	300	407.00	122,100
森永製菓	200	4,055.00	811,000
江崎グリコ	300	4,480.00	1,344,000
名糖産業	100	1,435.00	143,500
井村屋グループ	100	2,326.00	232,600
不二家	100	2,286.00	228,600
山崎製パン	800	1,793.00	1,434,400
亀田製菓	100	5,100.00	510,000
寿スピリッツ	100	5,080.00	508,000
カルビー	500	3,355.00	1,677,500
森永乳業	200	5,120.00	1,024,000
六甲バター	100	1,740.00	174,000
ヤクルト本社	700	5,160.00	3,612,000

明治ホールディングス	700	7,530.00	5,271,000	
雪印メグミルク	300	2,265.00	679,500	
プリマハム	200	3,120.00	624,000	
日本ハム	400	4,435.00	1,774,000	
丸大食品	100	1,675.00	167,500	
S Foods	100	3,515.00	351,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	700	725.00	507,500	
スタジオアリス	100	1,951.00	195,100	
システナ	400	2,067.00	826,800	
デジタルアーツ	100	8,010.00	801,000	
日鉄ソリューションズ	200	3,145.00	629,000	
総合警備保障	400	5,160.00	2,064,000	
キューブシステム	100	1,665.00	166,500	
いちご	1,300	316.00	410,800	
日本駐車場開発	1,000	132.00	132,000	
カカクコム	700	2,980.00	2,086,000	
セントケア・ホールディング	100	741.00	74,100	
ルネサンス	100	872.00	87,200	
ディップ	100	2,169.00	216,900	
SBSホールディングス	100	2,404.00	240,400	
デジタルホールディングス	100	1,388.00	138,800	
新日本科学	100	705.00	70,500	
ツクイホールディングス	200	546.00	109,200	
ベネフィット・ワン	400	2,930.00	1,172,000	
エムスリー	2,200	7,240.00	15,928,000	
ツカダ・グローバルホールディング	100	259.00	25,900	
アウトソーシング	600	1,130.00	678,000	
ウェルネット	100	576.00	57,600	
ディー・エヌ・エー	400	1,863.00	745,200	
博報堂DYホールディングス	1,400	1,421.00	1,989,400	
ぐるなび	200	704.00	140,800	
タカミヤ	100	550.00	55,000	
ジャパンベストレスキューシステム	100	1,078.00	107,800	
ファンコミュニケーションズ	300	488.00	146,400	
エスプール	300	769.00	230,700	
ティア	100	399.00	39,900	
バリューコマース	100	3,875.00	387,500	
インフォマート	1,000	946.00	946,000	
サッポロホールディングス	400	1,817.00	726,800	
アサヒグループホールディングス	2,300	3,587.00	8,250,100	
麒麟ホールディングス	4,500	1,927.00	8,671,500	
宝ホールディングス	800	1,082.00	865,600	
オエノンホールディングス	300	414.00	124,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	800	1,641.00	1,312,800	
サントリー食品インターナショナル	700	3,850.00	2,695,000	
ダイドーグループホールディングス	100	5,180.00	518,000	
伊藤園	300	6,970.00	2,091,000	
キーコーヒー	100	2,187.00	218,700	
日清オイリオグループ	100	3,000.00	300,000	

不二製油グループ本社	300	3,295.00	988,500
J-オイルミルズ	100	3,775.00	377,500
ローソン	300	5,090.00	1,527,000
サンエー	100	4,290.00	429,000
カワチ薬品	100	2,886.00	288,600
エービーシー・マート	200	5,280.00	1,056,000
アスクル	100	4,450.00	445,000
ゲオホールディングス	200	1,615.00	323,000
アダストリア	100	1,700.00	170,000
ジーフット	100	462.00	46,200
くら寿司	100	6,410.00	641,000
エレマテック	100	967.00	96,700
パルグループホールディングス	100	1,121.00	112,100
エディオン	500	1,070.00	535,000
あらた	100	5,040.00	504,000
サーラコーポレーション	200	580.00	116,000
J Pホールディングス	300	312.00	93,600
フジオフードグループ本社	100	1,449.00	144,900
ひらまつ	200	196.00	39,200
フィールズ	100	326.00	32,600
双日	5,700	233.00	1,328,100
アルフレッサホールディングス	1,100	2,044.00	2,248,400
ハニーズホールディングス	100	979.00	97,900
キッコーマン	800	5,250.00	4,200,000
味の素	2,300	2,111.50	4,856,450
キュービー	600	2,160.00	1,296,000
ハウス食品グループ本社	400	3,460.00	1,384,000
カゴメ	400	3,585.00	1,434,000
焼津水産化学工業	100	990.00	99,000
アリアケジャパン	100	7,000.00	700,000
ニチレイ	500	2,644.00	1,322,000
横浜冷凍	300	849.00	254,700
東洋水産	500	5,370.00	2,685,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	801.00	80,100
日清食品ホールディングス	400	9,390.00	3,756,000
永谷園ホールディングス	100	2,369.00	236,900
フジッコ	100	2,004.00	200,400
ロック・フィールド	100	1,460.00	146,000
日本たばこ産業	5,600	1,984.50	11,113,200
ケンコーマヨネーズ	100	1,780.00	178,000
わらべや日洋ホールディングス	100	1,508.00	150,800
なとり	100	2,036.00	203,600
北の達人コーポレーション	400	498.00	199,200
ユーグレナ	500	889.00	444,500
スター・マイカ・ホールディングス	100	1,381.00	138,100
A Dワークスグループ	200	155.00	31,000
片倉工業	100	1,186.00	118,600
グンゼ	100	3,855.00	385,500
ヒューリック	2,200	1,013.00	2,228,600
ラサ商事	100	913.00	91,300

アルペン	100	2,032.00	203,200
クオールホールディングス	200	1,179.00	235,800
アルコニックス	100	1,524.00	152,400
神戸物産	400	5,790.00	2,316,000
ソリトンシステムズ	100	2,187.00	218,700
ジーンズホールディングス	100	8,220.00	822,000
ピックカメラ	600	1,170.00	702,000
DCMホールディングス	600	1,469.00	881,400
ペッパーフードサービス	100	315.00	31,500
Monotaro	700	5,900.00	4,130,000
あいホールディングス	100	1,925.00	192,500
アークランドサービスホールディングス	100	2,043.00	204,300
J.フロントリテイリング	1,200	829.00	994,800
ドトール・日レスホールディングス	100	1,506.00	150,600
マツモトキヨシホールディングス	400	4,135.00	1,654,000
ブロンコビリー	100	2,307.00	230,700
Zozo	700	3,115.00	2,180,500
ココカラファイン	100	7,060.00	706,000
三越伊勢丹ホールディングス	1,800	534.00	961,200
東洋紡	400	1,480.00	592,000
ユニチカ	300	400.00	120,000
日清紡ホールディングス	600	710.00	426,000
倉敷紡績	100	1,857.00	185,700
ダイワボウホールディングス	100	6,600.00	660,000
シキボウ	100	950.00	95,000
日東紡績	200	4,265.00	853,000
トヨタ紡織	300	1,512.00	453,600
マクニカ・富士エレホールディングス	200	1,850.00	370,000
ウエルシアホールディングス	600	4,435.00	2,661,000
クリエイトSDホールディングス	200	3,440.00	688,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	1,021.00	204,200
八洲電機	100	915.00	91,500
メディアスホールディングス	100	881.00	88,100
レスターホールディングス	100	2,215.00	221,500
丸善CHIホールディングス	100	370.00	37,000
TOKAIホールディングス	500	1,081.00	540,500
三洋貿易	100	1,006.00	100,600
シュッピン	100	950.00	95,000
オイシックス・ラ・大地	100	3,955.00	395,500
ウイン・パートナーズ	100	1,077.00	107,700
ネクステージ	200	1,463.00	292,600
ジョイフル本田	300	1,540.00	462,000
ホットランド	100	1,216.00	121,600
すかいらーくホールディングス	1,200	1,534.00	1,840,800
SFPホールディングス	100	1,351.00	135,100
綿半ホールディングス	100	1,394.00	139,400
日本毛織	300	1,022.00	306,600
ダイトウボウ	200	106.00	21,200

ダイドーリミテッド	100	198.00	19,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	1,102.00	330,600	
野村不動産ホールディングス	600	1,983.00	1,189,800	
三重交通グループホールディングス	200	445.00	89,000	
サムティ	100	1,729.00	172,900	
ディア・ライフ	100	414.00	41,400	
日本商業開発	100	1,802.00	180,200	
プレサンスコーポレーション	200	1,501.00	300,200	
日本管理センター	100	1,284.00	128,400	
フージャースホールディングス	200	665.00	133,000	
オープンハウス	300	3,810.00	1,143,000	
東急不動産ホールディングス	2,800	472.00	1,321,600	
飯田グループホールディングス	900	2,026.00	1,823,400	
ムゲンエステート	100	513.00	51,300	
帝国繊維	100	2,590.00	259,000	
日本コークス工業	900	68.00	61,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	814.00	81,400	
あさひ	100	1,771.00	177,100	
日本調剤	100	1,767.00	176,700	
コスモス薬品	100	18,450.00	1,845,000	
シップヘルスケアホールディングス	200	5,220.00	1,044,000	
セブン&アイ・ホールディングス	4,000	3,540.00	14,160,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	600	587.00	352,200	
ツルハホールディングス	200	14,970.00	2,994,000	
サンマルクホールディングス	100	1,606.00	160,600	
トリドールホールディングス	300	1,392.00	417,600	
帝人	800	1,654.00	1,323,200	
東レ	7,400	491.60	3,637,840	
クラレ	1,600	1,028.00	1,644,800	
旭化成	6,800	924.30	6,285,240	
T O K Y O B A S E	100	381.00	38,100	
稲葉製作所	100	1,356.00	135,600	
トーカロ	300	1,095.00	328,500	
S U M C O	1,300	1,601.00	2,081,300	
信和	100	674.00	67,400	
ハウスドゥ	100	1,409.00	140,900	
日本フェルト	100	477.00	47,700	
エコナックホールディングス	200	91.00	18,200	
アツギ	100	565.00	56,500	
J Mホールディングス	100	2,484.00	248,400	
コメダホールディングス	200	1,858.00	371,600	
アレンザホールディングス	100	1,487.00	148,700	
パロックジャパンリミテッド	100	682.00	68,200	
クスリのアオキホールディングス	100	8,300.00	830,000	
共和レザー	100	593.00	59,300	
スシローグローバルホールディングス	600	2,850.00	1,710,000	
セーレン	300	1,571.00	471,300	
小松マテーレ	200	820.00	164,000	

ワコールホールディングス	300	1,964.00	589,200
ホギメディカル	100	3,380.00	338,000
T S Iホールディングス	300	272.00	81,600
ワールド	100	1,348.00	134,800
T I S	1,000	2,218.00	2,218,000
グリー	600	522.00	313,200
コーエーテクモホールディングス	200	5,210.00	1,042,000
A G S	100	917.00	91,700
ファインデックス	100	1,592.00	159,200
K L a b	200	954.00	190,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	100	1,014.00	101,400
ネクソン	2,600	2,546.00	6,619,600
アイスタイル	300	438.00	131,400
エイチーム	100	872.00	87,200
エニグモ	100	1,658.00	165,800
テクノスジャパン	100	873.00	87,300
e n i s h	100	548.00	54,800
コロブラ	300	922.00	276,600
オルトプラス	100	463.00	46,300
ブロードリーフ	500	548.00	274,000
デジタルハーツホールディングス	100	1,154.00	115,400
システム情報	100	1,344.00	134,400
じげん	300	343.00	102,900
ビィキューブ	100	2,774.00	277,400
ディー・エル・イー	100	410.00	41,000
フィックスターズ	100	1,064.00	106,400
オブティム	100	3,310.00	331,000
特種東海製紙	100	4,490.00	449,000
ティーガイア	100	1,949.00	194,900
日本アジアグループ	100	310.00	31,000
テクマトリックス	100	2,524.00	252,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	2,281.00	456,200
GMOペイメントゲートウェイ	200	13,360.00	2,672,000
インターネットイニシアティブ	200	5,020.00	1,004,000
さくらインターネット	100	808.00	80,800
S R Aホールディングス	100	2,343.00	234,300
朝日ネット	100	1,028.00	102,800
e B A S E	100	1,258.00	125,800
アバント	100	1,224.00	122,400
フリービット	100	1,016.00	101,600
コムチュア	100	2,911.00	291,100
アステリア	100	875.00	87,500
アイル	100	1,480.00	148,000
王子ホールディングス	4,300	451.00	1,939,300
日本製紙	500	1,217.00	608,500
三菱製紙	100	324.00	32,400
北越コーポレーション	600	352.00	211,200
大王製紙	500	1,483.00	741,500

メディカル・データ・ビジョン	100	3,400.00	340,000	
gumi	100	937.00	93,700	
オープンドア	100	1,351.00	135,100	
カナミックネットワーク	100	889.00	88,900	
レンゴー	1,000	838.00	838,000	
トーモク	100	1,652.00	165,200	
ザ・パック	100	2,905.00	290,500	
チェンジ	100	8,710.00	871,000	
オークネット	100	1,513.00	151,300	
AOI TYO HOLDINGS	100	420.00	42,000	
マクロミル	200	745.00	149,000	
昭和電工	800	1,856.00	1,484,800	
住友化学	7,500	355.00	2,662,500	
日産化学	600	5,510.00	3,306,000	
クレハ	100	4,510.00	451,000	
テイカ	100	1,398.00	139,800	
石原産業	200	707.00	141,400	
日本曹達	200	2,792.00	558,400	
東ソー	1,600	1,737.00	2,779,200	
トクヤマ	300	2,540.00	762,000	
セントラル硝子	200	2,278.00	455,600	
東亜合成	600	1,097.00	658,200	
大阪ソーダ	100	2,544.00	254,400	
関東電化工業	200	720.00	144,000	
デンカ	400	3,230.00	1,292,000	
イビデン	600	4,260.00	2,556,000	
信越化学工業	1,800	14,290.00	25,722,000	
堺化学工業	100	1,949.00	194,900	
第一稀元素化学工業	100	717.00	71,700	
エア・ウォーター	1,000	1,455.00	1,455,000	
日本酸素ホールディングス	1,000	1,556.00	1,556,000	
日本パーカライジング	500	1,030.00	515,000	
高圧ガス工業	200	797.00	159,400	
四国化成工業	100	1,155.00	115,500	
ステラ ケミファ	100	2,976.00	297,600	
日本触媒	200	5,380.00	1,076,000	
大日精化工業	100	2,237.00	223,700	
カネカ	300	3,000.00	900,000	
協和キリン	1,100	2,651.00	2,916,100	
三菱瓦斯化学	1,000	2,003.00	2,003,000	
三井化学	1,000	2,693.00	2,693,000	
JSR	1,000	2,517.00	2,517,000	
東京応化工業	200	6,250.00	1,250,000	
大阪有機化学工業	100	2,618.00	261,800	
三菱ケミカルホールディングス	6,900	606.70	4,186,230	
KHネオケム	200	2,636.00	527,200	
ダイセル	1,300	779.00	1,012,700	
住友ベークライト	200	2,970.00	594,000	
積水化学工業	2,200	1,725.00	3,795,000	
日本ゼオン	900	1,247.00	1,122,300	

アイカ工業	300	3,640.00	1,092,000	
宇部興産	500	1,898.00	949,000	
積水樹脂	200	2,047.00	409,400	
タキロンシーアイ	200	690.00	138,000	
旭有機材	100	1,328.00	132,800	
ニチバン	100	1,667.00	166,700	
リケンテクノス	200	404.00	80,800	
積水化成成品工業	100	569.00	56,900	
タイガースポリマー	100	420.00	42,000	
ダイキョーニシカワ	200	634.00	126,800	
森六ホールディングス	100	1,749.00	174,900	
日本化薬	600	910.00	546,000	
カーリットホールディングス	100	504.00	50,400	
E P Sホールディングス	100	962.00	96,200	
プレステージ・インターナショナル	400	890.00	356,000	
プロトコーポレーション	100	1,316.00	131,600	
アミューズ	100	2,723.00	272,300	
野村総合研究所	1,500	3,135.00	4,702,500	
サイバネットシステム	100	968.00	96,800	
クイック	100	1,089.00	108,900	
T A C	100	219.00	21,900	
C Eホールディングス	100	681.00	68,100	
ケネディクス	900	534.00	480,600	
電通グループ	1,100	3,070.00	3,377,000	
インテージホールディングス	100	965.00	96,500	
ソースネクスト	500	319.00	159,500	
シーティーエス	100	961.00	96,100	
インフォコム	100	4,350.00	435,000	
メディカルシステムネットワーク	100	456.00	45,600	
日本精化	100	1,581.00	158,100	
扶桑化学工業	100	3,805.00	380,500	
ラクスル	100	4,560.00	456,000	
F I G	100	273.00	27,300	
A D E K A	500	1,389.00	694,500	
日油	400	3,960.00	1,584,000	
新日本理化	200	162.00	32,400	
ハリマ化成グループ	100	1,091.00	109,100	
イーソル	100	1,277.00	127,700	
アルテリア・ネットワークス	100	1,797.00	179,700	
花王	2,500	7,754.00	19,385,000	
三洋化成工業	100	4,760.00	476,000	
武田薬品工業	8,700	3,541.00	30,806,700	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	9,100	1,486.50	13,527,150	
大日本住友製薬	800	1,218.00	974,400	
塩野義製薬	1,300	5,217.00	6,782,100	
わかもと製薬	100	257.00	25,700	
あすか製薬	100	1,388.00	138,800	
日本新薬	300	8,330.00	2,499,000	
中外製薬	3,300	4,353.00	14,364,900	

科研製薬	200	4,450.00	890,000
エーザイ	1,300	8,638.00	11,229,400
理研ビタミン	100	1,427.00	142,700
ロート製薬	500	3,395.00	1,697,500
小野薬品工業	2,400	3,320.00	7,968,000
久光製薬	300	5,130.00	1,539,000
有機合成薬品工業	100	322.00	32,200
持田製薬	100	3,855.00	385,500
参天製薬	1,900	2,084.00	3,959,600
ツムラ	300	3,200.00	960,000
日医工	300	1,082.00	324,600
テルモ	3,000	4,005.00	12,015,000
H.U.グループホールディングス	300	2,800.00	840,000
キッセイ薬品工業	200	2,131.00	426,200
生化学工業	200	975.00	195,000
栄研化学	200	2,257.00	451,400
鳥居薬品	100	2,991.00	299,100
JCRファーマ	300	2,718.00	815,400
東和薬品	100	2,026.00	202,600
富士製薬工業	100	1,197.00	119,700
沢井製薬	200	5,030.00	1,006,000
ゼリア新薬工業	200	1,847.00	369,400
第一三共	9,000	2,745.00	24,705,000
キョーリン製薬ホールディングス	200	1,984.00	396,800
大幸薬品	100	1,960.00	196,000
ダイト	100	4,040.00	404,000
大塚ホールディングス	2,200	4,109.00	9,039,800
大正製薬ホールディングス	200	6,730.00	1,346,000
ペプチドリーム	500	4,880.00	2,440,000
大日本塗料	100	900.00	90,000
日本ペイントホールディングス	800	10,130.00	8,104,000
関西ペイント	1,200	2,800.00	3,360,000
神東塗料	100	172.00	17,200
中国塗料	300	992.00	297,600
日本特殊塗料	100	965.00	96,500
藤倉化成	100	481.00	48,100
太陽ホールディングス	100	5,580.00	558,000
DIC	400	2,635.00	1,054,000
サカタインクス	200	1,149.00	229,800
東洋インキSCホールディングス	200	2,006.00	401,200
T&K TOKA	100	811.00	81,100
アルプス技研	100	2,093.00	209,300
サニックス	200	249.00	49,800
日本空調サービス	100	730.00	73,000
オリエンタルランド	1,100	14,900.00	16,390,000
フォーカスシステムズ	100	992.00	99,200
ダスキン	200	2,693.00	538,600
パーク24	600	1,567.00	940,200
明光ネットワークジャパン	100	652.00	65,200
ファルコホールディングス	100	1,465.00	146,500

クレスコ	100	1,306.00	130,600
フジ・メディア・ホールディングス	1,000	1,042.00	1,042,000
ラウンドワン	300	919.00	275,700
リゾートトラスト	500	1,728.00	864,000
オービック	400	18,020.00	7,208,000
ジャストシステム	200	7,120.00	1,424,000
TDCソフト	100	1,108.00	110,800
Zホールディングス	14,100	770.00	10,857,000
ビー・エム・エル	100	3,020.00	302,000
トレンドマイクロ	500	6,220.00	3,110,000
りらいあコミュニケーションズ	200	1,253.00	250,600
リソー教育	500	328.00	164,000
日本オラクル	200	10,620.00	2,124,000
フューチャー	100	2,287.00	228,700
CAC Holdings	100	1,409.00	140,900
ユー・エス・エス	1,100	1,991.00	2,190,100
オービックビジネスコンサルタント	100	5,490.00	549,000
伊藤忠テクノソリューションズ	500	3,850.00	1,925,000
アイティフォー	100	911.00	91,100
サイバーエージェント	600	6,790.00	4,074,000
楽天	4,700	1,122.00	5,273,400
クリーク・アンド・リバー社	100	1,120.00	112,000
テー・オー・ダブリュー	200	298.00	59,600
大塚商会	600	5,040.00	3,024,000
サイボウズ	100	3,515.00	351,500
ソフトブレーン	100	868.00	86,800
山田コンサルティンググループ	100	1,134.00	113,400
電通国際情報サービス	100	6,810.00	681,000
ACCESS	100	831.00	83,100
デジタルガレージ	200	3,735.00	747,000
イーエムシステムズ	100	818.00	81,800
CIJ	100	890.00	89,000
日本エンタープライズ	100	257.00	25,700
スカラ	100	1,013.00	101,300
インテリジェント ウェイブ	100	781.00	78,100
フルキャストホールディングス	100	1,790.00	179,000
エン・ジャパン	200	2,756.00	551,200
富士フイルムホールディングス	2,000	5,323.00	10,646,000
コニカミノルタ	2,300	250.00	575,000
資生堂	2,100	6,865.00	14,416,500
ライオン	1,400	2,149.00	3,008,600
高砂香料工業	100	2,139.00	213,900
マンダム	200	1,796.00	359,200
ミルボン	100	5,400.00	540,000
ファンケル	400	3,470.00	1,388,000
コーセー	200	14,710.00	2,942,000
コタ	100	1,321.00	132,100
ポーラ・オルビスホールディングス	400	2,085.00	834,000
ノエビアホールディングス	100	4,700.00	470,000
エステー	100	2,130.00	213,000

コニシ	200	1,460.00	292,000
長谷川香料	200	2,091.00	418,200
星光PMC	100	646.00	64,600
小林製薬	300	10,350.00	3,105,000
荒川化学工業	100	1,201.00	120,100
メック	100	2,318.00	231,800
タカラバイオ	300	2,765.00	829,500
JCU	100	3,315.00	331,500
新田ゼラチン	100	665.00	66,500
デクセリアルズ	300	1,153.00	345,900
アース製薬	100	6,850.00	685,000
北興化学工業	100	839.00	83,900
クミアイ化学工業	400	1,035.00	414,000
日本農薬	200	492.00	98,400
ニチレキ	100	1,663.00	166,300
ユシロ化学工業	100	1,318.00	131,800
富士石油	300	183.00	54,900
出光興産	1,200	2,171.00	2,605,200
E N E O Sホールディングス	15,700	367.70	5,772,890
コスモエネルギーホールディングス	300	1,533.00	459,900
横浜ゴム	600	1,449.00	869,400
TOYO TIRE	600	1,673.00	1,003,800
ブリヂストン	2,800	3,363.00	9,416,400
住友ゴム工業	900	925.00	832,500
藤倉コンポジット	100	341.00	34,100
オカモト	100	4,210.00	421,000
アキレス	100	1,678.00	167,800
ニッタ	100	2,239.00	223,900
住友理工	200	552.00	110,400
三ツ星ベルト	100	1,630.00	163,000
バンドー化学	200	582.00	116,400
AGC	1,000	3,285.00	3,285,000
日本板硝子	500	379.00	189,500
有沢製作所	200	934.00	186,800
日本電気硝子	400	1,946.00	778,400
住友大阪セメント	200	3,325.00	665,000
太平洋セメント	700	2,639.00	1,847,300
日本ヒューム	100	774.00	77,400
日本コンクリート工業	200	310.00	62,000
アジアパイルホールディングス	100	470.00	47,000
東海カーボン	1,000	1,226.00	1,226,000
日本カーボン	100	3,715.00	371,500
東洋炭素	100	1,805.00	180,500
ノリタケカンパニーリミテド	100	3,080.00	308,000
TOTO	700	4,645.00	3,251,500
日本碍子	1,300	1,501.00	1,951,300
日本特殊陶業	800	1,941.00	1,552,800
ダントーホールディングス	100	685.00	68,500
ヨータイ	100	796.00	79,600
イソライト工業	100	468.00	46,800

東京窯業	100	312.00	31,200	
フジインコーポレーテッド	100	3,905.00	390,500	
ニチアス	300	2,400.00	720,000	
日本製鉄	4,600	1,091.00	5,018,600	
神戸製鋼所	1,900	417.00	792,300	
中山製鋼所	100	358.00	35,800	
合同製鐵	100	1,991.00	199,100	
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,800	763.00	2,136,400	
東京製鐵	500	739.00	369,500	
共英製鋼	100	1,424.00	142,400	
大和工業	200	2,542.00	508,400	
大阪製鐵	100	1,123.00	112,300	
淀川製鋼所	100	1,955.00	195,500	
丸一鋼管	300	2,540.00	762,000	
大同特殊鋼	200	3,315.00	663,000	
日本冶金工業	100	1,535.00	153,500	
山陽特殊製鋼	100	1,088.00	108,800	
愛知製鋼	100	2,523.00	252,300	
日立金属	1,100	1,597.00	1,756,700	
大平洋金属	100	1,606.00	160,600	
新日本電工	700	234.00	163,800	
栗本鐵工所	100	1,851.00	185,100	
日本製鋼所	300	2,123.00	636,900	
三菱製鋼	100	535.00	53,500	
日亜鋼業	200	294.00	58,800	
大紀アルミニウム工業所	200	614.00	122,800	
日本軽金属ホールディングス	200	1,679.00	335,800	
三井金属鉱業	300	2,537.00	761,100	
東邦亜鉛	100	1,959.00	195,900	
三菱マテリアル	700	1,880.00	1,316,000	
住友金属鉱山	1,300	3,314.00	4,308,200	
DOWAホールディングス	300	3,095.00	928,500	
古河機械金属	200	1,112.00	222,400	
エス・サイエンス	500	45.00	22,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	862.00	86,200	
東邦チタニウム	200	658.00	131,600	
UACJ	200	1,715.00	343,000	
古河電気工業	300	2,497.00	749,100	
住友電気工業	3,900	1,136.50	4,432,350	
フジクラ	1,200	280.00	336,000	
昭和電線ホールディングス	100	1,175.00	117,500	
タツタ電線	200	600.00	120,000	
平河ヒューテック	100	1,081.00	108,100	
リョービ	100	1,183.00	118,300	
アーレスティ	100	327.00	32,700	
アサヒホールディングス	200	3,665.00	733,000	
東洋製罐グループホールディングス	700	1,011.00	707,700	
ホッカンホールディングス	100	1,385.00	138,500	
コロナ	100	1,009.00	100,900	

横河ブリッジホールディングス	200	1,878.00	375,600
OSJBホールディングス	500	243.00	121,500
三和ホールディングス	1,000	1,212.00	1,212,000
文化シャッター	300	847.00	254,100
三協立山	100	981.00	98,100
アルインコ	100	953.00	95,300
LIXILグループ	1,500	2,198.00	3,297,000
日本フィルコン	100	548.00	54,800
ノーリツ	200	1,527.00	305,400
長府製作所	100	2,104.00	210,400
リンナイ	200	10,530.00	2,106,000
ユニプレス	200	838.00	167,600
ダイニチ工業	100	759.00	75,900
日東精工	100	472.00	47,200
岡部	200	788.00	157,600
ジーテクト	100	1,186.00	118,600
東プレ	200	1,108.00	221,600
高周波熱錬	200	515.00	103,000
東京製綱	100	509.00	50,900
サンコール	100	447.00	44,700
モリテックスチール	100	287.00	28,700
パイオラックス	200	1,514.00	302,800
エイチワン	100	578.00	57,800
日本発条	1,100	647.00	711,700
三浦工業	400	4,900.00	1,960,000
タクマ	400	1,634.00	653,600
テクノプロ・ホールディングス	200	7,170.00	1,434,000
Keeper 技研	100	1,478.00	147,800
Gunosy	100	800.00	80,000
リブセンス	100	273.00	27,300
ジャパンマテリアル	300	1,420.00	426,000
ベクトル	100	1,055.00	105,500
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,337.00	133,700
IBJ	100	991.00	99,100
N・フィールド	100	748.00	74,800
M&Aキャピタルパートナーズ	100	5,390.00	539,000
シグマクシス	100	1,732.00	173,200
ウィルグループ	100	884.00	88,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	371.00	37,100
リクルートホールディングス	7,200	4,345.00	31,284,000
エラン	100	2,826.00	282,600
ツガミ	200	1,492.00	298,400
オークマ	100	5,090.00	509,000
芝浦機械	100	2,132.00	213,200
アマダ	1,300	948.00	1,232,400
アイダエンジニアリング	300	779.00	233,700
FUJI	400	2,128.00	851,200
牧野フライス製作所	100	3,675.00	367,500
オーエスジー	500	1,655.00	827,500
旭ダイヤモンド工業	300	480.00	144,000

DMG森精機	700	1,479.00	1,035,300
ソディック	200	780.00	156,000
ディスコ	100	28,990.00	2,899,000
日東工器	100	1,973.00	197,300
パンチ工業	100	399.00	39,900
日本郵政	8,200	723.40	5,931,880
ベルシステム24ホールディングス	200	1,694.00	338,800
鎌倉新書	100	1,062.00	106,200
エアトリ	100	1,477.00	147,700
ハイアス・アンド・カンパニー	100	166.00	16,600
ソラスト	300	1,377.00	413,100
豊田自動織機	800	6,700.00	5,360,000
豊和工業	100	813.00	81,300
東洋機械金属	100	402.00	40,200
島精機製作所	200	1,710.00	342,000
オプトラン	100	2,174.00	217,400
イワキ	100	868.00	86,800
フリー	100	1,365.00	136,500
ヤマシンフィルタ	200	1,129.00	225,800
日阪製作所	100	895.00	89,500
やまびこ	200	1,350.00	270,000
ペガサスマシン製造	100	287.00	28,700
ナブテスコ	600	3,900.00	2,340,000
三井海洋開発	100	1,535.00	153,500
レオン自動機	100	1,029.00	102,900
S M C	300	57,870.00	17,361,000
オイレス工業	100	1,475.00	147,500
サトーホールディングス	100	2,174.00	217,400
技研製作所	100	3,875.00	387,500
日精樹脂工業	100	873.00	87,300
小松製作所	4,700	2,415.50	11,352,850
住友重機械工業	600	2,349.00	1,409,400
日立建機	400	3,630.00	1,452,000
日工	100	673.00	67,300
井関農機	100	1,391.00	139,100
T O W A	100	1,226.00	122,600
シンニッタン	200	203.00	40,600
クボタ	5,600	1,929.50	10,805,200
東洋エンジニアリング	100	318.00	31,800
月島機械	200	1,219.00	243,800
帝国電機製作所	100	1,075.00	107,500
新東工業	200	704.00	140,800
澁谷工業	100	3,330.00	333,000
アイチコーポレーション	200	916.00	183,200
小森コーポレーション	300	721.00	216,300
鶴見製作所	100	1,707.00	170,700
荏原製作所	400	2,911.00	1,164,400
西島製作所	100	802.00	80,200
北越工業	100	1,018.00	101,800
ダイキン工業	1,300	19,615.00	25,499,500

栗田工業	600	3,320.00	1,992,000	
椿本チエイン	100	2,317.00	231,700	
日機装	300	1,038.00	311,400	
木村化工機	100	417.00	41,700	
レイズネクスト	200	1,239.00	247,800	
アネスト岩田	200	843.00	168,600	
ダイフク	500	11,230.00	5,615,000	
加藤製作所	100	1,018.00	101,800	
タダノ	500	863.00	431,500	
フジテック	400	2,493.00	997,200	
C K D	300	1,794.00	538,200	
キトー	100	1,316.00	131,600	
平和	300	1,697.00	509,100	
理想科学工業	100	1,303.00	130,300	
S A N K Y O	200	2,654.00	530,800	
日本金銭機械	100	532.00	53,200	
マースグループホールディングス	100	1,628.00	162,800	
フクシマガリレイ	100	3,950.00	395,000	
竹内製作所	200	2,462.00	492,400	
アマノ	300	2,448.00	734,400	
J U K I	100	442.00	44,200	
サンデンホールディングス	100	326.00	32,600	
蛇の目ミシン工業	100	587.00	58,700	
ブラザー工業	1,300	1,552.00	2,017,600	
マックス	200	1,465.00	293,000	
モリタホールディングス	200	1,935.00	387,000	
グローリー	300	2,241.00	672,300	
新晃工業	100	1,496.00	149,600	
大和冷機工業	200	901.00	180,200	
セガサミーホールディングス	1,000	1,307.00	1,307,000	
T P R	100	1,288.00	128,800	
ツバキ・ナカシマ	200	848.00	169,600	
ホシザキ	300	8,900.00	2,670,000	
大豊工業	100	576.00	57,600	
日本精工	2,000	834.00	1,668,000	
N T N	2,400	201.00	482,400	
ジェイテクト	1,000	824.00	824,000	
不二越	100	4,020.00	402,000	
ミネベアミツミ	1,900	1,958.00	3,720,200	
日本トムソン	300	354.00	106,200	
T H K	700	2,658.00	1,860,600	
ユーシン精機	100	693.00	69,300	
イーグル工業	100	792.00	79,200	
前澤工業	100	451.00	45,100	
日本ピラー工業	100	1,519.00	151,900	
キッツ	400	566.00	226,400	
日立製作所	5,000	3,530.00	17,650,000	
三菱電機	10,500	1,361.50	14,295,750	
富士電機	600	3,220.00	1,932,000	
安川電機	1,100	4,090.00	4,499,000	

シンフォニアテクノロジー	100	1,151.00	115,100	
明電舎	200	1,559.00	311,800	
山洋電気	100	4,555.00	455,500	
デンヨー	100	2,329.00	232,900	
ペイカレント・コンサルティング	100	17,140.00	1,714,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	100	4,295.00	429,500	
日総工産	100	833.00	83,300	
RPAホールディングス	100	804.00	80,400	
三櫻工業	100	608.00	60,800	
マキタ	1,400	4,890.00	6,846,000	
東芝テック	100	4,250.00	425,000	
マブチモーター	300	4,255.00	1,276,500	
日本電産	2,500	10,240.00	25,600,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	325.00	32,500	
トレックス・セミコンダクター	100	1,299.00	129,900	
東光高岳	100	1,055.00	105,500	
ダブル・スコープ	200	780.00	156,000	
ダイヘン	100	4,010.00	401,000	
ヤーマン	200	1,530.00	306,000	
JVCケンウッド	900	142.00	127,800	
ミマキエンジニアリング	100	414.00	41,400	
日新電機	200	1,092.00	218,400	
大崎電気工業	200	625.00	125,000	
オムロン	900	7,840.00	7,056,000	
日東工業	200	1,957.00	391,400	
I D E C	200	1,843.00	368,600	
ジーエス・ユアサコーポレーション	300	1,856.00	556,800	
日本電気	1,300	5,770.00	7,501,000	
富士通	1,000	13,855.00	13,855,000	
沖電気工業	400	1,089.00	435,600	
電気興業	100	2,525.00	252,500	
サンケン電気	100	2,702.00	270,200	
アイホン	100	1,469.00	146,900	
ルネサスエレクトロニクス	4,500	893.00	4,018,500	
セイコーエプソン	1,300	1,037.00	1,348,100	
ワコム	700	667.00	466,900	
アルバック	200	3,960.00	792,000	
E I Z O	100	3,745.00	374,500	
ジャパンディスプレイ	3,000	50.00	150,000	
日本信号	300	968.00	290,400	
京三製作所	200	418.00	83,600	
能美防災	100	2,250.00	225,000	
ホーチキ	100	1,219.00	121,900	
星和電機	100	620.00	62,000	
エレコム	100	4,855.00	485,500	
パナソニック	12,000	877.00	10,524,000	代用有価証券 7,500株
シャープ	1,200	1,253.00	1,503,600	
アンリツ	700	2,492.00	1,744,400	

富士通ゼネラル	300	2,969.00	890,700	
ソニー	6,600	7,900.00	52,140,000	代用有価証券 3,700株
T D K	500	12,290.00	6,145,000	
タムラ製作所	300	543.00	162,900	
アルプスアルパイン	900	1,503.00	1,352,700	
日本電波工業	100	470.00	47,000	
鈴木	100	676.00	67,600	
ローランド ディー . ジー .	100	1,302.00	130,200	
フォスター電機	100	1,232.00	123,200	
ヨコオ	100	2,556.00	255,600	
ティアック	100	119.00	11,900	
ホシデン	300	943.00	282,900	
ヒロセ電機	200	14,910.00	2,982,000	
日本航空電子工業	200	1,516.00	303,200	
T O A	100	811.00	81,100	
マクセルホールディングス	200	1,041.00	208,200	
古野電気	100	1,185.00	118,500	
スミダコーポレーション	100	894.00	89,400	
アイコム	100	2,708.00	270,800	
本多通信工業	100	514.00	51,400	
船井電機	100	452.00	45,200	
横河電機	1,000	1,644.00	1,644,000	
アズビル	700	4,385.00	3,069,500	
東亜ディーケーケー	100	839.00	83,900	
日本光電工業	400	3,380.00	1,352,000	
共和電業	100	415.00	41,500	
堀場製作所	200	5,300.00	1,060,000	
アドバンテスト	800	5,610.00	4,488,000	
エスベック	100	1,749.00	174,900	
キーエンス	900	49,860.00	44,874,000	
日置電機	100	3,665.00	366,500	
シスメックス	700	10,235.00	7,164,500	
日本マイクロニクス	200	1,078.00	215,600	
メガチップス	100	3,025.00	302,500	
O B A R A G R O U P	100	3,685.00	368,500	
I M A G I C A G R O U P	100	377.00	37,700	
デンソー	2,300	4,836.00	11,122,800	
コーセル	100	1,039.00	103,900	
イリソ電子工業	100	4,390.00	439,000	
オブテックスグループ	200	1,612.00	322,400	
レーザーテック	500	9,430.00	4,715,000	
スタンレー電気	700	3,000.00	2,100,000	
ウシオ電機	600	1,234.00	740,400	
岡谷電機産業	100	352.00	35,200	
ヘリオス テクノ ホールディング	100	315.00	31,500	
日本セラミック	100	2,544.00	254,400	
遠藤照明	100	622.00	62,200	
古河電池	100	1,072.00	107,200	
双信電機	100	405.00	40,500	

山一電機	100	1,392.00	139,200	
図研	100	2,692.00	269,200	
日本電子	200	3,495.00	699,000	
カシオ計算機	900	1,544.00	1,389,600	
ファナック	1,000	20,835.00	20,835,000	
日本シイエムケイ	200	483.00	96,600	
エンプラス	100	2,224.00	222,400	
ローム	400	8,350.00	3,340,000	
浜松ホトニクス	800	5,200.00	4,160,000	
三井ハイテック	100	2,110.00	211,000	
新光電気工業	400	1,991.00	796,400	
京セラ	1,500	6,024.00	9,036,000	
太陽誘電	500	3,860.00	1,930,000	
村田製作所	3,100	7,268.00	22,530,800	
双葉電子工業	200	901.00	180,200	
日東電工	700	7,270.00	5,089,000	
東海理化電機製作所	300	1,622.00	486,600	
ニチコン	400	843.00	337,200	
日本ケミコン	100	1,335.00	133,500	
K O A	200	1,222.00	244,400	
三井E & S ホールディングス	400	363.00	145,200	
日立造船	800	422.00	337,600	
三菱重工業	1,800	2,192.00	3,945,600	
川崎重工業	800	1,292.00	1,033,600	
I H I	800	1,348.00	1,078,400	
名村造船所	300	157.00	47,100	
サノヤスホールディングス	100	166.00	16,600	
カーブスホールディングス	300	642.00	192,600	
フォーラムエンジニアリング	100	825.00	82,500	
三菱ロジスネクスト	100	939.00	93,900	
F P G	300	535.00	160,500	
全国保証	300	4,220.00	1,266,000	
めぶきフィナンシャルグループ	5,400	210.00	1,134,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	1,136.00	113,600	
九州フィナンシャルグループ	2,300	483.00	1,110,900	
かんぼ生命保険	400	1,731.00	692,400	
ゆうちょ銀行	2,900	811.00	2,351,900	
富山第一銀行	200	295.00	59,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,900	369.00	2,177,100	
西日本フィナンシャルホールディングス	700	714.00	499,800	
アルヒ	200	1,887.00	377,400	
プレミアグループ	100	2,149.00	214,900	
日産自動車	12,300	368.00	4,526,400	
いすゞ自動車	3,000	899.10	2,697,300	
トヨタ自動車	11,700	6,897.00	80,694,900	代用有価証券 9,000株
日野自動車	1,300	745.00	968,500	
三菱自動車工業	3,900	212.00	826,800	

エフテック	100	527.00	52,700	
武蔵精密工業	200	1,154.00	230,800	
日産車体	200	897.00	179,400	
新明和工業	300	856.00	256,800	
極東開発工業	200	1,361.00	272,200	
トビー工業	100	1,078.00	107,800	
曙ブレーキ工業	600	144.00	86,400	
タチエス	200	1,103.00	220,600	
NOK	600	1,058.00	634,800	
フタバ産業	300	551.00	165,300	
KYB	100	2,126.00	212,600	
市光工業	200	479.00	95,800	
大同メタル工業	200	523.00	104,600	
プレス工業	500	291.00	145,500	
ミクニ	100	260.00	26,000	
太平洋工業	200	985.00	197,000	
河西工業	100	374.00	37,400	
アイシン精機	900	3,370.00	3,033,000	
マツダ	3,100	603.00	1,869,300	
今仙電機製作所	100	650.00	65,000	
本田技研工業	8,200	2,565.00	21,033,000	代用有価証券 6,000株
スズキ	2,100	4,635.00	9,733,500	
SUBARU	3,200	2,027.50	6,488,000	
安永	100	1,136.00	113,600	
ヤマハ発動機	1,500	1,519.00	2,278,500	
小糸製作所	600	5,130.00	3,078,000	
TBK	100	425.00	42,500	
エクセディ	100	1,283.00	128,300	
ミツバ	200	379.00	75,800	
豊田合成	300	2,458.00	737,400	
愛三工業	200	473.00	94,600	
日本プラスト	100	420.00	42,000	
ヨロズ	100	1,128.00	112,800	
エフ・シー・シー	200	2,033.00	406,600	
シマノ	400	20,610.00	8,244,000	
テイ・エス テック	200	2,886.00	577,200	
関西みらいフィナンシャルグループ	600	416.00	249,600	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,330.00	133,000	
第四北越フィナンシャルグループ	200	2,080.00	416,000	
ひろぎんホールディングス	1,500	585.00	877,500	
ジャムコ	100	644.00	64,400	
小野建	100	1,165.00	116,500	
ノジマ	200	2,805.00	561,000	
佐鳥電機	100	826.00	82,600	
カッパ・クリエイト	100	1,465.00	146,500	
伯東	100	1,154.00	115,400	
コンドーテック	100	1,052.00	105,200	
中山福	100	499.00	49,900	
ライトオン	100	612.00	61,200	

ナガイレーベン	100	2,627.00	262,700
三菱食品	100	2,812.00	281,200
良品計画	1,400	2,219.00	3,106,600
三城ホールディングス	100	268.00	26,800
松田産業	100	1,492.00	149,200
第一興商	200	3,710.00	742,000
メディカルホールディングス	1,100	1,928.00	2,120,800
アドヴァン	200	1,347.00	269,400
アズワン	100	15,530.00	1,553,000
シモジマ	100	1,402.00	140,200
ドウシシャ	100	2,017.00	201,700
コナカ	100	250.00	25,000
高速	100	1,503.00	150,300
G-7ホールディングス	100	2,391.00	239,100
イオン北海道	100	875.00	87,500
コジマ	200	682.00	136,400
コーナン商事	100	3,590.00	359,000
ネットワンシステムズ	400	4,775.00	1,910,000
ワタミ	100	969.00	96,900
システムソフト	200	100.00	20,000
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	2,300	2,381.00	5,476,300
丸文	100	516.00	51,600
西松屋チェーン	200	1,648.00	329,600
ゼンショーホールディングス	500	2,429.00	1,214,500
ハビネット	100	1,442.00	144,200
幸楽苑ホールディングス	100	1,730.00	173,000
日本ライフライン	300	1,353.00	405,900
サイゼリヤ	200	1,958.00	391,600
タカショー	100	699.00	69,900
VTホールディングス	400	394.00	157,600
アルゴグラフィックス	100	3,335.00	333,500
IDOM	300	649.00	194,700
日本エム・ディ・エム	100	2,194.00	219,400
ユナイテッドアローズ	100	1,421.00	142,100
進和	100	1,954.00	195,400
ハイデイ日高	100	1,698.00	169,800
シークス	100	1,278.00	127,800
京都きもの友禅	100	224.00	22,400
コロワイド	300	1,627.00	488,100
ピーシーデポコーポレーション	100	673.00	67,300
オーハシテクニカ	100	1,420.00	142,000
壱番屋	100	5,360.00	536,000
スギホールディングス	200	7,040.00	1,408,000
島津製作所	1,300	2,989.00	3,885,700
JMS	100	897.00	89,700
長野計器	100	844.00	84,400
スター精密	200	1,432.00	286,400
東京計器	100	898.00	89,800
インターアクション	100	1,742.00	174,200

オーバル	100	219.00	21,900	
東京精密	200	3,645.00	729,000	
マニー	400	2,808.00	1,123,200	
ニコン	1,600	622.00	995,200	
トプコン	500	1,073.00	536,500	
オリンパス	5,800	2,064.00	11,971,200	
理研計器	100	2,746.00	274,600	
S C R E E Nホールディングス	200	5,950.00	1,190,000	
キヤノン電子	100	1,387.00	138,700	
タムロン	100	1,506.00	150,600	
H O Y A	2,100	12,370.00	25,977,000	
ノーリツ鋼機	100	1,968.00	196,800	
エー・アンド・デイ	100	648.00	64,800	
朝日インテック	1,200	3,395.00	4,074,000	
キヤノン	5,200	1,632.00	8,486,400	代用有価証券 4,100株
リコー	2,700	662.00	1,787,400	
シチズン時計	1,200	262.00	314,400	
大研医器	100	517.00	51,700	
メニコン	100	7,130.00	713,000	
スノーピーク	100	2,020.00	202,000	
パラマウントベッドホールディングス	100	4,205.00	420,500	
トランザクション	100	979.00	97,900	
ニホンフラッシュ	100	1,298.00	129,800	
前田工織	100	2,765.00	276,500	
永大産業	100	301.00	30,100	
アートネイチャー	100	629.00	62,900	
バンダイナムコホールディングス	1,100	7,860.00	8,646,000	
共立印刷	200	129.00	25,800	
S H O E I	100	3,170.00	317,000	
フランスベッドホールディングス	100	867.00	86,700	
マーベラス	200	793.00	158,600	
パイロットコーポレーション	200	3,020.00	604,000	
萩原工業	100	1,569.00	156,900	
エイベックス	200	1,072.00	214,400	
トッパン・フォームズ	200	1,015.00	203,000	
フジシールインターナショナル	200	2,012.00	402,400	
タカラトミー	500	950.00	475,000	
廣濟堂	100	642.00	64,200	
レック	100	1,508.00	150,800	
三光合成	100	299.00	29,900	
プロネクス	100	1,104.00	110,400	
ホクシン	100	116.00	11,600	
大建工業	100	1,876.00	187,600	
きもと	200	163.00	32,600	
凸版印刷	1,500	1,422.00	2,133,000	
大日本印刷	1,400	2,088.00	2,923,200	
N I S S H A	200	1,290.00	258,000	
藤森工業	100	4,320.00	432,000	
ヴィア・ホールディングス	100	290.00	29,000	

TAKARA & COMPANY	100	2,096.00	209,600	
前澤化成工業	100	978.00	97,800	
未来工業	100	1,922.00	192,200	
アシックス	900	1,381.00	1,242,900	
JSP	100	1,612.00	161,200	
ニチハ	100	3,285.00	328,500	
エフピコ	200	4,130.00	826,000	
ヤマハ	600	4,845.00	2,907,000	
クリナップ	100	495.00	49,500	
ピジョン	700	4,925.00	3,447,500	
天馬	100	1,830.00	183,000	
キングジム	100	871.00	87,100	
象印マホービン	300	1,800.00	540,000	
リンテック	200	2,322.00	464,400	
信越ポリマー	200	918.00	183,600	
東リ	300	256.00	76,800	
イトーキ	200	335.00	67,000	
任天堂	600	57,220.00	34,332,000	
三菱鉛筆	200	1,306.00	261,200	
タカラスタANDARD	200	1,421.00	284,200	
コクヨ	500	1,308.00	654,000	
ナカバヤシ	100	646.00	64,600	
ニフコ	400	3,120.00	1,248,000	
オカムラ	400	722.00	288,800	
バルカー	100	1,829.00	182,900	
伊藤忠商事	7,200	2,602.50	18,738,000	
丸紅	10,700	587.40	6,285,180	
スクロール	200	1,025.00	205,000	
ヨンドシーホールディングス	100	1,833.00	183,300	
三陽商会	100	479.00	47,900	
長瀬産業	600	1,387.00	832,200	
蝶理	100	1,625.00	162,500	
豊田通商	1,200	2,939.00	3,526,800	
オンワードホールディングス	600	213.00	127,800	
三共生興	200	434.00	86,800	
兼松	400	1,287.00	514,800	
美津濃	100	1,816.00	181,600	
ファミリーマート	800	2,305.00	1,844,000	
三井物産	8,900	1,784.50	15,882,050	
日本紙パルプ商事	100	3,700.00	370,000	
東京エレクトロン	700	29,315.00	20,520,500	
カメイ	100	1,054.00	105,400	
セイコーホールディングス	100	1,313.00	131,300	
山善	400	1,102.00	440,800	
住友商事	6,500	1,211.50	7,874,750	
日本ユニシス	300	3,325.00	997,500	
三菱商事	6,800	2,471.00	16,802,800	代用有価証券 5,200株
第一実業	100	3,710.00	371,000	
キヤノンマーケティングジャパン	300	1,977.00	593,100	

西華産業	100	1,377.00	137,700
佐藤商事	100	962.00	96,200
菱洋エレクトロ	100	2,935.00	293,500
東京産業	100	547.00	54,700
ユアサ商事	100	3,280.00	328,000
トルク	100	284.00	28,400
阪和興業	200	2,058.00	411,600
正栄食品工業	100	4,000.00	400,000
カナデン	100	1,482.00	148,200
菱電商事	100	1,537.00	153,700
ニプロ	700	1,134.00	793,800
フルサト工業	100	1,371.00	137,100
岩谷産業	200	4,225.00	845,000
イワキ	100	539.00	53,900
兼松エレクトロニクス	100	4,295.00	429,500
三愛石油	300	1,057.00	317,100
稲畑産業	200	1,289.00	257,800
明和産業	100	409.00	40,900
キムラタン	600	26.00	15,600
ヤマエ久野	100	1,223.00	122,300
ゴールドウイン	200	8,280.00	1,656,000
ユニ・チャーム	2,200	5,079.00	11,173,800
デサント	200	1,649.00	329,800
ワキタ	200	1,047.00	209,400
ヤマトインターナショナル	100	331.00	33,100
東邦ホールディングス	300	2,000.00	600,000
サンゲツ	300	1,522.00	456,600
ミツウロコグループホールディングス	200	1,243.00	248,600
伊藤忠エネクス	200	983.00	196,600
サンリオ	300	1,899.00	569,700
サンワテクノス	100	851.00	85,100
リョーサン	100	1,997.00	199,700
新光商事	200	854.00	170,800
三信電気	100	2,023.00	202,300
東陽テクニカ	100	983.00	98,300
モスフードサービス	100	2,815.00	281,500
加賀電子	100	2,153.00	215,300
三益半導体工業	100	2,390.00	239,000
ソーダニッカ	100	557.00	55,700
立花エレテック	100	1,718.00	171,800
木曽路	100	2,530.00	253,000
SRSホールディングス	100	906.00	90,600
千趣会	200	373.00	74,600
タカキュー	100	142.00	14,200
リテールパートナーズ	100	1,456.00	145,600
ケーヨー	200	718.00	143,600
上新電機	100	2,630.00	263,000
日本瓦斯	200	5,060.00	1,012,000
ロイヤルホールディングス	200	1,839.00	367,800
いなげや	100	1,859.00	185,900

島忠	200	4,195.00	839,000
チヨダ	100	943.00	94,300
ライフコーポレーション	100	3,830.00	383,000
リンガーハット	100	2,199.00	219,900
MrMaxHD	100	767.00	76,700
テナアライド	100	355.00	35,500
AOKIホールディングス	200	476.00	95,200
オークワ	200	1,406.00	281,200
コメリ	200	3,035.00	607,000
青山商事	200	512.00	102,400
しまむら	100	10,910.00	1,091,000
はせがわ	100	296.00	29,600
高島屋	800	813.00	650,400
松屋	200	690.00	138,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	500	710.00	355,000
丸井グループ	900	2,025.00	1,822,500
クレディセゾン	700	1,188.00	831,600
アクシアル リテイリング	100	4,615.00	461,500
井筒屋	100	177.00	17,700
イオン	4,000	2,830.50	11,322,000
イズミ	200	3,740.00	748,000
平和堂	200	2,268.00	453,600
フジ	100	1,928.00	192,800
ヤオコー	100	7,480.00	748,000
ゼビオホールディングス	100	713.00	71,300
ケーズホールディングス	1,000	1,382.00	1,382,000
PALTAC	200	5,750.00	1,150,000
三谷産業	100	396.00	39,600
Olympicグループ	100	976.00	97,600
日産東京販売ホールディングス	200	252.00	50,400
新生銀行	800	1,342.00	1,073,600
あおぞら銀行	600	1,755.00	1,053,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	70,600	417.60	29,482,560
りそなホールディングス	11,200	351.50	3,936,800
三井住友トラスト・ホールディングス	2,000	2,859.50	5,719,000
三井住友フィナンシャルグループ	7,100	2,945.00	20,909,500
千葉銀行	3,400	570.00	1,938,000
群馬銀行	2,000	338.00	676,000
武蔵野銀行	200	1,582.00	316,400
千葉興業銀行	300	260.00	78,000
筑波銀行	400	188.00	75,200
七十七銀行	300	1,530.00	459,000
青森銀行	100	2,332.00	233,200
秋田銀行	100	1,496.00	149,600
山形銀行	100	1,332.00	133,200
岩手銀行	100	2,396.00	239,600
東邦銀行	900	228.00	205,200
みちのく銀行	100	1,246.00	124,600
ふくおかフィナンシャルグループ	900	1,766.00	1,589,400
静岡銀行	2,500	718.00	1,795,000

十六銀行	100	1,934.00	193,400	
スルガ銀行	1,100	367.00	403,700	
八十二銀行	2,500	398.00	995,000	
山梨中央銀行	100	840.00	84,000	
大垣共立銀行	200	2,314.00	462,800	
福井銀行	100	1,850.00	185,000	
北國銀行	100	2,964.00	296,400	
滋賀銀行	200	2,292.00	458,400	
南都銀行	200	1,914.00	382,800	
百五銀行	900	327.00	294,300	
京都銀行	400	4,760.00	1,904,000	
紀陽銀行	400	1,542.00	616,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	700	995.00	696,500	
山陰合同銀行	600	533.00	319,800	
中国銀行	900	918.00	826,200	
伊予銀行	1,500	673.00	1,009,500	
百十四銀行	100	1,720.00	172,000	
四国銀行	200	726.00	145,200	
阿波銀行	200	2,499.00	499,800	
大分銀行	100	2,498.00	249,800	
宮崎銀行	100	2,290.00	229,000	
佐賀銀行	100	1,314.00	131,400	
沖縄銀行	100	2,944.00	294,400	
琉球銀行	200	879.00	175,800	
セブン銀行	3,400	244.00	829,600	
みずほフィナンシャルグループ	14,000	1,288.50	18,039,000	
山口フィナンシャルグループ	1,300	681.00	885,300	
芙蓉総合リース	100	6,070.00	607,000	
みずほリース	200	2,745.00	549,000	
東京センチュリー	200	5,570.00	1,114,000	
SBIホールディングス	1,200	2,563.00	3,075,600	
日本証券金融	500	505.00	252,500	
アイフル	1,600	295.00	472,000	
日本アジア投資	100	220.00	22,000	
名古屋銀行	100	2,699.00	269,900	
北洋銀行	1,600	226.00	361,600	
愛媛銀行	100	1,164.00	116,400	
京葉銀行	400	478.00	191,200	
栃木銀行	500	194.00	97,000	
東和銀行	200	702.00	140,400	
福島銀行	100	229.00	22,900	
大東銀行	100	621.00	62,100	
リコーリース	100	2,771.00	277,100	
イオンフィナンシャルサービス	600	1,086.00	651,600	
アコム	2,100	455.00	955,500	
ジャックス	100	1,708.00	170,800	
オリエントコーポレーション	2,800	115.00	322,000	
日立キャピタル	200	2,327.00	465,400	
アプラスフィナンシャル	500	81.00	40,500	
オリックス	6,400	1,320.50	8,451,200	

三菱UFJリース	2,600	465.00	1,209,000
ジャフコグループ	200	4,575.00	915,000
九州リースサービス	100	611.00	61,100
トモニホールディングス	800	323.00	258,400
大和証券グループ本社	8,300	453.10	3,760,730
野村ホールディングス	18,200	487.30	8,868,860
岡三証券グループ	900	360.00	324,000
丸三証券	300	498.00	149,400
東洋証券	400	120.00	48,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,200	288.00	345,600
水戸証券	300	221.00	66,300
いちよし証券	200	464.00	92,800
松井証券	600	909.00	545,400
SOMPOホールディングス	1,900	3,881.00	7,373,900
日本取引所グループ	3,000	2,669.00	8,007,000
マネックスグループ	800	275.00	220,000
極東証券	100	707.00	70,700
岩井コスモホールディングス	100	1,353.00	135,300
藍澤證券	200	690.00	138,000
フィデアホールディングス	1,000	107.00	107,000
池田泉州ホールディングス	1,200	165.00	198,000
アニコムホールディングス	300	1,204.00	361,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,700	2,924.50	7,896,150
マネーパートナーズグループ	100	202.00	20,200
スパークス・グループ	500	254.00	127,000
第一生命ホールディングス	5,800	1,574.50	9,132,100
東京海上ホールディングス	3,600	4,786.00	17,229,600
アドバンテッジリスクマネジメント	100	745.00	74,500
イー・ギャランティ	100	2,298.00	229,800
アサックス	100	748.00	74,800
T&Dホールディングス	3,100	1,061.00	3,289,100
三井不動産	5,000	1,887.50	9,437,500
三菱地所	7,200	1,608.50	11,581,200
平和不動産	200	3,040.00	608,000
東京建物	1,000	1,236.00	1,236,000
ダイビル	300	1,249.00	374,700
京阪神ビルディング	200	1,768.00	353,600
住友不動産	2,300	2,909.50	6,691,850
テーオーシー	200	655.00	131,000
レオパレス21	1,400	172.00	240,800
スターツコーポレーション	100	2,428.00	242,800
フジ住宅	100	535.00	53,500
空港施設	100	464.00	46,400
明和地所	100	487.00	48,700
ゴールドクレスト	100	1,317.00	131,700
リログループ	500	2,689.00	1,344,500
日神グループホールディングス	200	410.00	82,000
日本エスコン	200	976.00	195,200

タカラレーベン	500	306.00	153,000
A V A N T I A	100	866.00	86,600
イオンモール	500	1,655.00	827,500
ランド	5,600	9.00	50,400
カチタス	300	3,340.00	1,002,000
東祥	100	1,385.00	138,500
トーセイ	100	1,091.00	109,100
サンフロンティア不動産	100	894.00	89,400
エフ・ジェー・ネクスト	100	943.00	94,300
グランディハウス	100	375.00	37,500
東武鉄道	1,100	2,980.00	3,278,000
相鉄ホールディングス	300	2,628.00	788,400
東急	2,600	1,238.00	3,218,800
京浜急行電鉄	1,300	1,523.00	1,979,900
小田急電鉄	1,600	2,484.00	3,974,400
京王電鉄	500	6,020.00	3,010,000
京成電鉄	700	2,899.00	2,029,300
富士急行	100	4,330.00	433,000
東日本旅客鉄道	1,800	5,887.00	10,596,600
西日本旅客鉄道	900	4,697.00	4,227,300
東海旅客鉄道	900	13,900.00	12,510,000
西武ホールディングス	1,400	1,097.00	1,535,800
鴻池運輸	200	1,101.00	220,200
西日本鉄道	300	2,779.00	833,700
ハマキョウレックス	100	3,155.00	315,500
サカイ引越センター	100	5,020.00	502,000
近鉄グループホールディングス	1,000	4,165.00	4,165,000
阪急阪神ホールディングス	1,300	3,130.00	4,069,000
南海電気鉄道	500	2,204.00	1,102,000
京阪ホールディングス	400	4,025.00	1,610,000
名古屋鉄道	800	2,754.00	2,203,200
山陽電気鉄道	100	2,075.00	207,500
日本通運	300	5,930.00	1,779,000
ヤマトホールディングス	1,700	2,821.00	4,795,700
山九	300	3,965.00	1,189,500
日新	100	1,496.00	149,600
丸運	100	245.00	24,500
丸全昭和運輸	100	3,300.00	330,000
センコーグループホールディングス	500	963.00	481,500
ニッコンホールディングス	400	2,131.00	852,400
福山通運	100	4,570.00	457,000
セイノーホールディングス	700	1,376.00	963,200
日立物流	200	3,335.00	667,000
丸和運輸機関	100	4,550.00	455,000
C & F ロジホールディングス	100	1,699.00	169,900
日本郵船	800	1,965.00	1,572,000
商船三井	600	2,366.00	1,419,600
川崎汽船	300	1,328.00	398,400
N S ユナイテッド海運	100	1,476.00	147,600
明治海運	100	382.00	38,200

飯野海運	500	375.00	187,500	
九州旅客鉄道	900	2,139.00	1,925,100	
S Gホールディングス	1,000	5,600.00	5,600,000	
日本航空	1,800	1,980.00	3,564,000	
A N Aホールディングス	1,800	2,373.00	4,271,400	
国際紙パルプ商事	200	275.00	55,000	
ブックオフグループホールディングス	100	838.00	83,800	
三菱倉庫	300	2,857.00	857,100	
三井倉庫ホールディングス	100	1,926.00	192,600	
住友倉庫	400	1,260.00	504,000	
澁澤倉庫	100	2,148.00	214,800	
ヤマタネ	100	1,370.00	137,000	
東陽倉庫	200	318.00	63,600	
乾汽船	100	903.00	90,300	
日本トランスシティ	200	590.00	118,000	
中央倉庫	100	1,167.00	116,700	
安田倉庫	100	956.00	95,600	
宇徳	100	492.00	49,200	
上組	600	1,866.00	1,119,600	
近鉄エクスプレス	200	2,379.00	475,800	
東海運	100	307.00	30,700	
エーアイテイー	100	1,049.00	104,900	
T B Sホールディングス	600	1,738.00	1,042,800	
日本テレビホールディングス	900	1,130.00	1,017,000	
朝日放送グループホールディングス	100	698.00	69,800	
テレビ朝日ホールディングス	300	1,639.00	491,700	
スカパーJ S A Tホールディングス	700	458.00	320,600	
テレビ東京ホールディングス	100	2,355.00	235,500	
ビジョン	100	1,035.00	103,500	
コネクシオ	100	1,232.00	123,200	
日本通信	800	211.00	168,800	
日本電信電話	13,700	2,204.50	30,201,650	
K D D I	7,500	2,725.00	20,437,500	
ソフトバンク	9,300	1,213.00	11,280,900	
光通信	100	23,810.00	2,381,000	
N T Tドコモ	7,300	3,885.00	28,360,500	
エムティーアイ	100	923.00	92,300	
G M Oインターネット	400	2,981.00	1,192,400	
K A D O K A W A	300	2,885.00	865,500	
学研ホールディングス	100	1,504.00	150,400	
ゼンリン	200	1,192.00	238,400	
インプレスホールディングス	100	188.00	18,800	
東京電力ホールディングス	8,400	286.00	2,402,400	
中部電力	3,200	1,238.50	3,963,200	
関西電力	4,000	1,000.50	4,002,000	
中国電力	1,500	1,339.00	2,008,500	
北陸電力	1,000	745.00	745,000	
東北電力	2,600	962.00	2,501,200	
四国電力	900	790.00	711,000	
九州電力	2,200	929.00	2,043,800	

北海道電力	1,000	455.00	455,000	
沖縄電力	200	1,592.00	318,400	
電源開発	800	1,531.00	1,224,800	
エフオン	100	912.00	91,200	
イーレックス	100	1,334.00	133,400	
レノバ	200	1,622.00	324,400	
東京瓦斯	2,000	2,326.50	4,653,000	
大阪瓦斯	2,000	1,988.00	3,976,000	
東邦瓦斯	500	5,320.00	2,660,000	
北海道瓦斯	100	1,520.00	152,000	
広島ガス	200	361.00	72,200	
西部瓦斯	100	2,568.00	256,800	
静岡ガス	300	920.00	276,000	
メタウォーター	100	2,302.00	230,200	
アイネット	100	1,520.00	152,000	
松竹	100	12,510.00	1,251,000	
東宝	600	4,520.00	2,712,000	
エイチ・アイ・エス	200	1,651.00	330,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	2,700	1,312.00	3,542,400	
共立メンテナンス	200	4,050.00	810,000	
イチネンホールディングス	100	1,262.00	126,200	
建設技術研究所	100	1,884.00	188,400	
スペース	100	786.00	78,600	
アインホールディングス	100	7,190.00	719,000	
東京都競馬	100	5,610.00	561,000	
カナモト	200	2,318.00	463,600	
東京ドーム	400	814.00	325,600	
D T S	200	2,278.00	455,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	6,470.00	2,588,000	
シーイーシー	100	1,641.00	164,100	
カブコン	500	6,220.00	3,110,000	
西尾レントオール	100	2,165.00	216,500	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	500	27.00	13,500	
日本空港ビルディング	300	4,650.00	1,395,000	
トランス・コスモス	100	2,798.00	279,800	
乃村工藝社	400	728.00	291,200	
ジャステック	100	1,507.00	150,700	
S C S K	200	5,760.00	1,152,000	
K N T - C Tホールディングス	100	1,084.00	108,400	
日本管財	100	2,059.00	205,900	
トーカイ	100	2,054.00	205,400	
セコム	1,100	9,093.00	10,002,300	
アイネス	100	1,623.00	162,300	
丹青社	200	764.00	152,800	
メイテック	100	5,480.00	548,000	
T K C	100	6,860.00	686,000	
富士ソフト	100	5,780.00	578,000	
応用地質	100	1,253.00	125,300	

船井総研ホールディングス	200	2,370.00	474,000	
NSD	300	1,943.00	582,900	
オオバ	100	730.00	73,000	
コナミホールディングス	400	4,275.00	1,710,000	
ベネッセホールディングス	300	2,605.00	781,500	
イオンディライト	100	2,935.00	293,500	
ナック	100	945.00	94,500	
ダイセキ	200	2,825.00	565,000	
日鉄物産	100	3,095.00	309,500	
トラスコ中山	200	2,713.00	542,600	
ヤマダホールディングス	3,100	517.00	1,602,700	
オートバックスセブン	400	1,380.00	552,000	
モリト	100	683.00	68,300	
アーランドサカモト	200	2,233.00	446,600	
ニトリホールディングス	400	22,415.00	8,966,000	
グルメ杵屋	100	954.00	95,400	
愛眼	100	227.00	22,700	
ケーユーホールディングス	100	806.00	80,600	
吉野家ホールディングス	300	1,873.00	561,900	
加藤産業	100	3,635.00	363,500	
イノテック	100	1,013.00	101,300	
イエローハット	200	1,768.00	353,600	
JBCホールディングス	100	1,583.00	158,300	
JKホールディングス	100	795.00	79,500	
サガミホールディングス	100	1,294.00	129,400	
日伝	100	2,207.00	220,700	
関西スーパーマーケット	100	1,269.00	126,900	
ミロク情報サービス	100	2,242.00	224,200	
北沢産業	100	284.00	28,400	
杉本商事	100	1,864.00	186,400	
因幡電機産業	300	2,590.00	777,000	
王将フードサービス	100	5,930.00	593,000	
プレナス	100	1,700.00	170,000	
ミニストップ	100	1,385.00	138,500	
アークス	200	2,398.00	479,600	
バローホールディングス	200	2,650.00	530,000	
ミスミグループ本社	1,300	2,918.00	3,793,400	
アルテック	100	300.00	30,000	
ベルク	100	6,750.00	675,000	
大庄	100	1,170.00	117,000	
ファーストリテイリング	100	73,150.00	7,315,000	
ソフトバンクグループ	8,100	7,140.00	57,834,000	
スズケン	400	3,720.00	1,488,000	
サンドラッグ	400	4,120.00	1,648,000	
サックスパーホールディングス	100	564.00	56,400	
ジェコス	100	919.00	91,900	
グローセル	100	405.00	40,500	
ペルーナ	200	986.00	197,200	
合計	1,107,200		2,357,041,590	

## (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)

令和2年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	82,147,875
国債証券	6,668,230,900
地方債証券	825,757,920
特殊債証券	729,484,000
社債証券	510,406,000
未収利息	12,705,635
前払費用	130,322
流動資産合計	8,828,862,652
資産合計	8,828,862,652
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	6,862,940,764
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,965,921,888
元本等合計	8,828,862,652
純資産合計	8,828,862,652
負債純資産合計	8,828,862,652

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,214,435,719円
同期中追加設定元本額	740,342,384円
同期中一部解約元本額	91,837,339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	286,846,239円
新光7資産バランスファンド	480,672,127円
日本債券ファンド	5,333,368,194円
世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	591,468,579円
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	35,126,159円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	74,827,438円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	37,185,786円
グローバル・ナビ	23,446,242円
計	6,862,940,764円
2. 受益権の総数	6,862,940,764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 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	令和2年10月20日現在
----	--------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	令和2年10月20日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	97,285,500	
地方債証券	6,619,410	
特殊債券	7,490,000	
社債券	2,764,000	
合計	114,158,910	

(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(令和1年11月12日から令和2年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年10月20日現在	
1口当たり純資産額	1.2865円
(1万口当たり純資産額)	(12,865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

令和2年10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考

国債証券	130回 利付国庫債券(5年)	80,000,000	80,219,200	
	131回 利付国庫債券(5年)	60,000,000	60,199,200	
	132回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,160,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,230,000	
	134回 利付国庫債券(5年)	20,000,000	20,102,000	
	135回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,174,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,320,500	
	137回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,365,500	
	138回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,243,000	
	139回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	50,437,000	
	140回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,375,600	
	141回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,401,600	
	142回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,418,800	
	143回 利付国庫債券(5年)	30,000,000	30,326,100	
	144回 利付国庫債券(5年)	40,000,000	40,431,600	
	1回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,704,300	
	2回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,264,500	
	3回 利付国庫債券(40年)	10,000,000	14,340,400	
	4回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	28,860,600	
	5回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	27,954,400	
	6回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	27,578,600	
	7回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	26,566,600	
	8回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	24,882,800	
	9回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	27,961,800	
	10回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	32,787,300	
	11回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	21,222,000	
12回 利付国庫債券(40年)	30,000,000	28,793,700		
13回 利付国庫債券(40年)	20,000,000	19,179,000		
319回 利付国庫債券(10年)	30,000,000	30,432,000		
320回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,661,500		

3 2 1回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,802,000	
3 2 2回 利付国庫債券(10年)	20,000,000	20,292,600	
3 2 4回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,783,000	
3 2 5回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,722,000	
3 2 6回 利付国庫債券(10年)	10,000,000	10,181,200	
3 2 7回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,811,600	
3 2 8回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,253,000	
3 2 9回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,758,400	
3 3 0回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	41,106,400	
3 3 2回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,430,400	
3 3 3回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	82,056,800	
3 3 4回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,657,200	
3 3 5回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	92,285,100	
3 3 6回 利付国庫債券(10年)	30,000,000	30,810,600	
3 3 7回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,745,600	
3 3 8回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,916,800	
3 3 9回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	92,237,400	
3 4 0回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	61,527,000	
3 4 1回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,546,300	
3 4 2回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,718,800	
3 4 3回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,128,600	
3 4 4回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,048,000	
3 4 5回 利付国庫債券(10年)	80,000,000	81,067,200	
3 4 6回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,971,600	
3 4 7回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,986,300	

348回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	71,024,100	
349回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,887,400	
350回 利付国庫債券(10年)	90,000,000	91,309,500	
351回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,855,600	
352回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,975,100	
353回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,677,000	
354回 利付国庫債券(10年)	70,000,000	70,916,300	
355回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,730,200	
356回 利付国庫債券(10年)	40,000,000	40,464,800	
357回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,633,000	
358回 利付国庫債券(10年)	60,000,000	60,592,800	
359回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	50,434,000	
10回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	22,355,800	
11回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	11,941,000	
12回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,478,400	
15回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,222,400	
17回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,039,200	
19回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	12,973,000	
20回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,302,200	
21回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,042,700	
22回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,378,500	
23回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,411,500	
26回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,357,700	
27回 利付国庫債券(30年)	10,000,000	13,585,300	
28回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,325,600	

29回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	27,094,400	
30回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,327,500	
31回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,682,200	
32回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,781,100	
33回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,215,400	
34回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	40,533,900	
35回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,492,600	
36回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,622,500	
37回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	39,145,800	
38回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,758,800	
39回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	26,206,400	
40回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,823,200	
41回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,431,000	
42回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,456,600	
43回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,482,600	
44回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,508,000	
45回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,630,400	
46回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	36,969,000	
47回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	25,133,600	
48回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	36,344,100	
49回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	24,240,000	
50回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,401,000	
51回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,982,200	
52回 利付国庫債券(30年)	40,000,000	39,817,200	
53回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,368,400	

54回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,325,000	
55回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,311,200	
56回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,297,000	
57回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,282,200	
58回 利付国庫債券(30年)	30,000,000	31,900,200	
59回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,745,200	
60回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	21,746,600	
61回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,706,200	
62回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,633,600	
63回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,068,200	
64回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,037,800	
65回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	19,007,000	
66回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	18,976,200	
67回 利付国庫債券(30年)	20,000,000	20,000,000	
53回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,260,600	
55回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,302,400	
59回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,398,300	
64回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,597,100	
70回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,878,400	
72回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,767,800	
78回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	21,899,400	
81回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,042,700	
84回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,101,600	
88回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,379,800	
90回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,382,100	

92回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	34,125,300	
95回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,227,400	
99回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,587,500	
105回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,727,100	
108回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,612,800	
110回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,820,900	
111回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,947,200	
112回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,720,600	
113回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,712,000	
114回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,940,900	
116回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,076,000	
117回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,963,800	
118回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,926,800	
120回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,081,000	
121回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,720,600	
122回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,522,600	
123回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,195,200	
124回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,992,400	
125回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,233,000	
126回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	12,025,800	
127回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,922,200	
128回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,911,600	
129回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,699,600	
130回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,760,800	
131回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,772,000	

132回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,799,100	
133回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,819,600	
134回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,814,300	
135回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,825,100	
136回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,424,200	
137回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,702,800	
138回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,620,600	
139回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,472,000	
140回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	35,609,700	
141回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,788,600	
142回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	24,028,400	
143回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,181,600	
144回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	23,346,600	
145回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,764,000	
146回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	59,818,500	
147回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,426,000	
148回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,975,200	
149回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	47,040,800	
150回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,561,200	
151回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,478,000	
152回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,507,200	
153回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	46,136,400	
154回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	45,594,800	
155回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	44,448,000	
156回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,622,200	

	157回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	39,549,200	
	158回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,340,400	
	159回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,914,400	
	160回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,901,700	
	161回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,403,100	
	162回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,372,800	
	163回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,788,000	
	164回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,119,600	
	165回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,066,000	
	166回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,796,700	
	167回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	40,989,600	
	168回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,180,900	
	169回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,633,100	
	170回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,602,500	
	171回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	29,571,000	
	172回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	20,072,200	
	173回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,054,600	
	<b>国債証券 合計</b>	<b>6,150,000,000</b>	<b>6,668,230,900</b>	
地方債証券	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	117,974,000	
	200回 神奈川県公募公債	35,000,000	35,821,100	
	218回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,772,000	
	412回 大阪府公募公債 10年	50,000,000	50,013,000	
	12回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	106,295,000	
	24年度3回 広島県公募公債	66,000,000	67,021,020	
	24年度7回 広島県公募公債	100,000,000	101,580,000	
	24年度1回 福岡県公募公債 30年	10,000,000	13,186,100	
	169回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,005,000	
	485回 名古屋市公募公債 10年	30,000,000	30,614,700	

	24年度2回 広島市公募公債	100,000,000	101,476,000	
地方債証券 合計		791,000,000	825,757,920	
特殊債券	104回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,652,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	118,588,000	
	249回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,275,000	
	327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,087,000	
	34回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,307,000	
	49回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,382,000	
	58回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,193,000	
特殊債券 合計		700,000,000	729,484,000	
社債券	4回 第一三共社債	100,000,000	101,796,000	
	11回 プリヂストーン社債	100,000,000	100,051,000	
	44回 ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,827,000	
	47回 野村ホールディングス社債	100,000,000	100,302,000	
	36回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,430,000	
社債券 合計		500,000,000	510,406,000	
合計			8,733,878,820	

## 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)

令和2年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	21,445,972
投資証券	1,461,139,750
未収配当金	15,161,634
流動資産合計	1,497,747,356
資産合計	1,497,747,356
負債の部	
流動負債	
未払金	17,688,853
流動負債合計	17,688,853
負債合計	17,688,853
純資産の部	
元本等	
元本	828,220,828
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	651,837,675
元本等合計	1,480,058,503
純資産合計	1,480,058,503
負債純資産合計	1,497,747,356

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	860,376,939円
同期中追加設定元本額	44,550,186円
同期中一部解約元本額	76,706,297円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	336,137,603円
グローバル・ナビ	5,451,512円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	486,631,713円
計	828,220,828円
2. 受益権の総数	828,220,828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 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	令和2年10月20日現在
----	--------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年10月20日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	394,189,255	
合計	394,189,255	

(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(令和1年10月22日から令和2年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年10月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7870円 (17,870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

令和2年10月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	45	7,182,000	
	GLP投資法人	475	75,762,500	

MCUBS MidCity投資法人	202	16,099,400	
Oneリート投資法人	26	6,539,000	
SOSILA物流リート投資法人	37	4,969,100	
いちごオフィスリート投資法人	137	10,192,800	
いちごホテルリート投資法人	29	2,146,000	
アクティブア・プロパティーズ投資法人	83	33,117,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	157	46,016,700	
イオンリート投資法人	168	20,227,200	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,062	14,475,060	
インヴィンシブル投資法人	691	24,392,300	
エスコンジャパンリート投資法人	27	3,053,700	
オリックス不動産投資法人	329	50,106,700	
グローバル・ワン不動産投資法人	115	11,189,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	51	31,824,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	108	18,349,200	
ケネディクス商業リート投資法人	61	12,614,800	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	72	21,218,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	32	3,283,200	
サンケイリアルエステート投資法人	40	3,928,000	
ザイマックス・リート投資法人	25	2,292,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	533	29,048,500	
ジャパンエクセレント投資法人	153	18,237,600	
ジャパンリアルエステイト投資法人	165	86,130,000	
スターアジア不動産投資法人	170	7,951,240	
スターツプロシード投資法人	26	5,332,600	
タカラレーベン不動産投資法人	50	4,405,000	
トーセイ・リート投資法人	37	4,184,700	
ヒューリックリート投資法人	133	18,553,500	
フロンティア不動産投資法人	55	20,377,500	
プレミア投資法人	149	18,073,700	
ヘルスケア&メディカル投資法人	35	4,469,500	
マリモ地方創生リート投資法人	15	1,659,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	354	41,772,000	
ラサールロジポート投資法人	184	30,323,200	

伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	52	7,347,600	
阪急阪神リート投資法人	75	9,007,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	58	28,681,000	
三菱地所物流リート投資法人	37	15,429,000	
産業ファンド投資法人	234	41,207,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	36	4,219,200	
森トラスト総合リート投資法人	118	15,363,600	
森ヒルズリート投資法人	194	25,743,800	
星野リゾート・リート投資法人	25	13,075,000	
積水ハウス・リート投資法人	486	36,450,000	
大江戸温泉リート投資法人	27	1,944,000	
大和ハウスリート投資法人	236	59,047,200	
大和証券オフィス投資法人	35	20,650,000	
大和証券リビング投資法人	209	20,962,700	
投資法人みらい	179	7,115,250	
東急リアル・エステート投資法人	111	16,095,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	55	32,065,000	
日本ビルファンド投資法人	160	86,080,000	
日本プライムリアルティ投資法人	103	31,518,000	
日本プロロジスリート投資法人	250	84,375,000	
日本リート投資法人	54	18,630,000	
日本リテールファンド投資法人	311	50,039,900	
日本ロジスティクスファンド投資法人	108	31,276,800	
福岡リート投資法人	86	11,558,400	
平和不動産リート投資法人	103	11,803,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	535	71,957,500	
投資証券 合計	9,908	1,461,139,750	
合計		1,461,139,750	

(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

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

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	27,853,662
コール・ローン	5,329,290
株式	1,803,957,997
投資信託受益証券	3,186,756
投資証券	39,430,614
派生商品評価勘定	1,119,806
未収入金	142,335
未収配当金	1,176,803
差入委託証拠金	72,081,478
流動資産合計	1,954,278,741
資産合計	1,954,278,741
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	454,290
流動負債合計	454,290
負債合計	454,290
純資産の部	
元本等	
元本	727,308,528
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,226,515,923
元本等合計	1,953,824,451
純資産合計	1,953,824,451
負債純資産合計	1,954,278,741

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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本となる重要な事項	<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	令和2年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	874,534,772円
同期中追加設定元本額	24,849,833円
同期中一部解約元本額	172,076,077円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	226,917,284円
新光外国株式インデックスVA	312,792,023円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	142,625,664円
新光ワールドバランスファンドVA(適格機関投資家私募)	5,496,000円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	17,655,054円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	10,893,800円
グローバル・ナビ	10,928,703円
計	727,308,528円

2. 受益権の総数	727,308,528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 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	令和2年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年10月20日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	148,837,886	
投資信託受益証券	530,629	
投資証券	3,792,548	
合計	144,514,709	

（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（令和1年11月12日から令和2年10月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	令和2年10月20日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	103,776,712	-	104,442,228	665,516
合計	103,776,712	-	104,442,228	665,516

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

令和2年10月20日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6864円 (26,864円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年10月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	175	3,207.210	561,261.750	
	ABBOTT LABORATORIES	726	108.040	78,437.040	
	AES CORP	310	19.900	6,169.000	
	ABIOMED INC	20	281.470	5,629.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	365	125.520	45,814.800	
	ADVANCED MICRO DEVICES	478	82.000	39,196.000	
	ADOBE INC	198	495.200	98,049.600	

CHUBB LTD	180	116.920	21,045.600	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	89	294.160	26,180.240	
ALLEGHANY CORP	7	542.310	3,796.170	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	34	140.790	4,786.860	
RALPH LAUREN CORP	7	74.360	520.520	
ALLSTATE CORP	121	91.420	11,061.820	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	292	171.590	50,104.280	
AMGEN INC	242	230.710	55,831.820	
HESS CORP	110	36.600	4,026.000	
AMERICAN EXPRESS CO	275	102.470	28,179.250	
AMERICAN ELECTRIC POWER	193	91.280	17,617.040	
AFLAC INC	256	36.480	9,338.880	
AMERICAN INTL GROUP	324	30.090	9,749.160	
AMERCO	2	354.850	709.700	
ANALOG DEVICES	146	122.610	17,901.060	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	98	121.760	11,932.480	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	294	42.420	12,471.480	
JONES LANG LASALLE INC	21	109.120	2,291.520	
VALERO ENERGY CORP	158	39.290	6,207.820	
ANSYS INC	34	336.250	11,432.500	
APPLE INC	7,624	115.980	884,231.520	
APPLIED MATERIALS INC	365	62.050	22,648.250	
ALBEMARLE CORP	49	92.570	4,535.930	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	234	50.310	11,772.540	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	34	81.810	2,781.540	
AMEREN CORP	112	81.640	9,143.680	
ARROW ELECTRONICS INC	21	83.700	1,757.700	
AUTOLIV INC	26	81.880	2,128.880	
AUTODESK INC	89	259.940	23,134.660	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	183	145.050	26,544.150	
AUTOZONE INC	10	1,176.420	11,764.200	
AVERY DENNISON CORP	39	133.740	5,215.860	
BALL CORP	142	91.180	12,947.560	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	563	208.990	117,661.370	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	310	36.960	11,457.600	
BAXTER INTERNATIONAL INC	203	81.190	16,481.570	
BECTON DICKINSON & CO	119	237.380	28,248.220	
AMETEK INC	88	107.550	9,464.400	
VERIZON COMM INC	1,712	57.300	98,097.600	
WR BERKLEY CORP	47	61.210	2,876.870	

BEST BUY CO INC	100	120.830	12,083.000	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	8	554.340	4,434.720	
YUM! BRANDS INC	120	97.250	11,670.000	
FIRSTENERGY CORP	236	31.730	7,488.280	
BOEING CO	223	167.110	37,265.530	
ROBERT HALF INTL INC	53	55.430	2,937.790	
BORGWARNER INC	67	38.660	2,590.220	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	607	37.770	22,926.390	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	46	100.000	4,600.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	52	165.530	8,607.560	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	10	1,018.700	10,187.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	933	60.770	56,698.410	
INGREDION INC	34	78.560	2,671.040	
ONEOK INC	206	28.290	5,827.740	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24	70.790	1,698.960	
UNITED RENTALS INC	26	187.440	4,873.440	
SEMPRA ENERGY	126	127.970	16,124.220	
FEDEX CORP	102	281.970	28,760.940	
VERISIGN INC	44	203.170	8,939.480	
AMPHENOL CORP	127	113.100	14,363.700	
BROWN-FORMAN CORP	126	74.340	9,366.840	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	494	5.730	2,830.620	
CSX CORP	312	79.050	24,663.600	
CABOT OIL & GAS CORP	185	19.080	3,529.800	
CAMPBELL SOUP CO	87	48.630	4,230.810	
SEAGATE TECHNOLOGY	97	52.150	5,058.550	
CONSTELLATION BRANDS INC	73	180.640	13,186.720	
CARDINAL HEALTH INC	123	47.900	5,891.700	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	214	14.150	3,028.100	
CATERPILLAR INC	222	167.530	37,191.660	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	54	126.490	6,830.460	
CITRIX SYSTEMS INC	54	134.840	7,281.360	
CENTURYLINK INC	422	9.610	4,055.420	
CERNER CORP	136	72.360	9,840.960	
JPMORGAN CHASE & CO	1,251	99.800	124,849.800	
CHURCH & DWIGHT CO INC	110	92.340	10,157.400	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	69	77.670	5,359.230	
CINTAS CORP	37	341.320	12,628.840	
CISCO SYSTEMS INC	1,731	39.300	68,028.300	
CLOROX COMPANY	54	212.500	11,475.000	
COCA-COLA CO/THE	1,684	49.620	83,560.080	

COPART INC	91	115.260	10,488.660	
COGNEX CORP	82	68.700	5,633.400	
COLGATE-PALMOLIVE CO	332	79.210	26,297.720	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	112	93.940	10,521.280	
MOLINA HEALTHCARE INC	27	206.690	5,580.630	
COMERICA INC	75	41.220	3,091.500	
NRG ENERGY, INC.	115	33.400	3,841.000	
COMCAST CORP-CL A	1,867	44.330	82,764.110	
CONAGRA BRANDS INC	193	37.470	7,231.710	
CONSOLIDATED EDISON INC	126	80.790	10,179.540	
CMS ENERGY CORP	110	64.750	7,122.500	
COOPER COS INC	24	348.420	8,362.080	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	66	34.720	2,291.520	
CORNING INC	300	34.600	10,380.000	
SEALED AIR CORP	49	41.380	2,027.620	
HEICO CORP-CL A	43	95.920	4,124.560	
CUMMINS INC	57	221.150	12,605.550	
DR HORTON INC	152	75.790	11,520.080	
DANAHER CORP	265	223.830	59,314.950	
MOODY'S CORP	68	284.530	19,348.040	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	221	72.200	15,956.200	
TARGET CORP	204	164.050	33,466.200	
DEERE & CO	122	238.170	29,056.740	
MORGAN STANLEY	572	50.950	29,143.400	
REPUBLIC SERVICES INC	90	92.100	8,289.000	
COSTAR GROUP INC	17	836.010	14,212.170	
THE WALT DISNEY CO	745	124.230	92,551.350	
DOLLAR TREE INC	104	95.000	9,880.000	
DOVER CORP	66	112.770	7,442.820	
OMNICOM GROUP	94	50.840	4,778.960	
DTE ENERGY CO	81	118.170	9,571.770	
DUKE ENERGY CORP	298	92.070	27,436.860	
DARDEN RESTAURANTS INC	61	96.610	5,893.210	
EBAY INC	280	54.320	15,209.600	
BANK OF AMERICA CORP	3,210	23.720	76,141.200	
CITIGROUP INC	856	42.900	36,722.400	
EASTMAN CHEMICAL CO	55	85.780	4,717.900	
EATON CORP PLC	164	107.890	17,693.960	
CADENCE DESIGN SYS INC	120	113.560	13,627.200	
DISH NETWORK CORP	103	26.560	2,735.680	
ECOLAB INC	109	201.790	21,995.110	
PERKINELMER INC	41	122.300	5,014.300	
ELECTRONIC ARTS INC	119	129.870	15,454.530	
SALESFORCE.COM INC	368	255.010	93,843.680	
ERIE INDEMNITY CO	6	225.740	1,354.440	
EMERSON ELECTRIC CO	243	69.960	17,000.280	
ATMOS ENERGY CORP	44	94.240	4,146.560	

ENTERGY CORP	73	105.340	7,689.820	
EOG RESOURCES INC	233	36.190	8,432.270	
EQUIFAX INC	53	158.580	8,404.740	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	96	222.340	21,344.640	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	50	92.560	4,628.000	
EXXON MOBIL CORP	1,737	33.420	58,050.540	
FMC CORP	59	107.870	6,364.330	
NEXTERA ENERGY INC	202	299.550	60,509.100	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	11	333.930	3,673.230	
FAIR ISAAC CORP	14	432.430	6,054.020	
ASSURANT INC	17	121.790	2,070.430	
FASTENAL CO	227	44.430	10,085.610	
FIFTH THIRD BANCORP	285	23.045	6,567.820	
M&T BANK CORP	58	97.960	5,681.680	
FISERV INC	230	98.740	22,710.200	
FLIR SYSTEMS INC	65	37.010	2,405.650	
FORD MOTOR CO	1,582	7.590	12,007.380	
FRANKLIN RESOURCES INC	142	23.200	3,294.400	
FREEPORT-MCMORAN INC	607	17.140	10,403.980	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	72	107.060	7,708.320	
DENTSPLY SIRONA INC	89	44.600	3,969.400	
GENERAL DYNAMICS CORP	102	138.680	14,145.360	
GENERAL MILLS INC	241	61.290	14,770.890	
GENUINE PARTS CO	62	100.610	6,237.820	
GILEAD SCIENCES INC	511	60.570	30,951.270	
GARTNER INC	31	124.340	3,854.540	
MCKESSON CORP	66	152.420	10,059.720	
NVIDIA CORP	253	539.910	136,597.230	
GENERAL ELECTRIC CO	3,630	7.290	26,462.700	
VW GRAINGER INC	17	374.740	6,370.580	
HALLIBURTON CO	348	12.170	4,235.160	
MONSTER BEVERAGE CORP	161	80.010	12,881.610	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	133	205.690	27,356.770	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	89	171.430	15,257.270	
HASBRO INC	54	86.550	4,673.700	
HENRY SCHEIN INC	59	61.870	3,650.330	
HEICO CORP	10	110.570	1,105.700	
HERSHEY FOODS CORP	55	147.500	8,112.500	
HP INC	567	19.360	10,977.120	
F5 NETWORKS INC	19	132.280	2,513.320	
CROWN HOLDINGS INC NPR	52	82.160	4,272.320	
JUNIPER NETWORKS INC	161	22.070	3,553.270	
HOLOGIC INC	119	67.010	7,974.190	
HOME DEPOT INC	443	283.730	125,692.390	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	81	77.330	6,263.730	
HORMEL FOODS CORP	102	49.020	5,000.040	

CENTERPOINT ENERGY INC	182	20.800	3,785.600	
LENNOX INTERNATIONAL INC	15	278.450	4,176.750	
HUMANA INC	54	433.080	23,386.320	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	38	123.940	4,709.720	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	459	9.520	4,369.680	
BIOGEN INC	66	268.770	17,738.820	
IDEX CORP	26	189.740	4,933.240	
ILLINOIS TOOL WORKS	129	202.420	26,112.180	
INTUIT INC	107	335.270	35,873.890	
IDEXX LABORATORIES INC	37	419.270	15,512.990	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	63	47.200	2,973.600	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	96	127.500	12,240.000	
INTEL CORP	1,742	54.580	95,078.360	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	29	113.550	3,292.950	
INTERNATIONAL PAPER CO	129	46.690	6,023.010	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	144	17.740	2,554.560	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	48	97.730	4,691.040	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	29	158.070	4,584.030	
INCYTE CORP	83	87.760	7,284.080	
JOHNSON & JOHNSON	1,087	144.320	156,875.840	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	167	37.190	6,210.730	
KLA CORPORATION	68	206.810	14,063.080	
KELLOGG CO	98	66.690	6,535.620	
EAST WEST BANCORP INC	67	36.660	2,456.220	
KEYCORP	333	12.780	4,255.740	
KIMBERLY-CLARK CORP	136	150.810	20,510.160	
BLACKROCK INC/NEW YORK	63	634.890	39,998.070	
KROGER CO	316	33.880	10,706.080	
LAM RESEARCH CORP	62	363.570	22,541.340	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	13	334.300	4,345.900	
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	117.260	4,104.100	
AKAMAI TECHNOLOGIES	73	109.410	7,986.930	
LENNAR CORP	118	82.540	9,739.720	
ELI LILLY & CO	355	142.800	50,694.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	95	33.720	3,203.400	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	289	172.100	49,736.900	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	126	105.490	13,291.740	
LOCKHEED MARTIN CORP	105	383.710	40,289.550	

LOEWS CORP	66	34.940	2,306.040	
LOWE'S COS INC	310	175.130	54,290.300	
DOMINION ENERGY INC	339	80.900	27,425.100	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	181	20.800	3,764.800	
MCCORMICK & CO INC	54	197.530	10,666.620	
MCDONALD'S CORPORATION	308	226.000	69,608.000	
S&P GLOBAL INC	98	341.150	33,432.700	
EVEREST RE GROUP LTD	19	197.290	3,748.510	
MARKEL CORPORATION	5	954.220	4,771.100	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	246	84.000	20,664.000	
MARSH & MCLENNAN COS	211	113.030	23,849.330	
MASCO CORP	94	55.870	5,251.780	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	26	256.700	6,674.200	
METLIFE INC	325	39.070	12,697.750	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	103	72.320	7,448.960	
MEDTRONIC PLC	552	108.480	59,880.960	
ACTIVISION BLIZZARD INC	317	80.080	25,385.360	
CVS HEALTH CORP	537	58.780	31,564.860	
MERCK & CO. INC.	1,041	78.670	81,895.470	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	184	26.210	4,822.640	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	43	199.910	8,596.130	
MICROSOFT CORP	2,969	214.220	636,019.180	
MICRON TECH INC	454	52.630	23,894.020	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	103	111.660	11,500.980	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	293	41.850	12,262.050	
3M CO	235	169.550	39,844.250	
MOHAWK INDUSTRIES INC	31	101.580	3,148.980	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	68	170.160	11,570.880	
KANSAS CITY SOUTHERN	37	179.590	6,644.830	
MYLAN NV	248	15.420	3,824.160	
ILLUMINA INC	60	321.260	19,275.600	
XCEL ENERGY INC	228	71.690	16,345.320	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	40	100.690	4,027.600	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	198	8.700	1,722.600	
NETAPP INC	94	48.000	4,512.000	
NEWELL BRANDS INC	181	17.590	3,183.790	
NEWMONT CORP	344	61.710	21,228.240	
NVR INC	1	4,251.180	4,251.180	
NIKE INC-CL B	511	127.430	65,116.730	
NORDSON CORP	27	207.330	5,597.910	

NORFOLK SOUTHERN CORP	105	213.670	22,435.350	
EVERSOURCE ENERGY	149	91.080	13,570.920	
NISOURCE INC	157	23.470	3,684.790	
NORTHERN TRUST CORP	88	85.410	7,516.080	
NORTHROP GRUMMAN CORP	65	311.330	20,236.450	
WELLS FARGO & CO	1,582	22.540	35,658.280	
NUCOR CORP	125	48.970	6,121.250	
CHENIERE ENERGY INC	73	49.000	3,577.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	176	77.120	13,573.120	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	370	9.820	3,633.400	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	35	196.900	6,891.500	
OGE ENERGY CORP	108	31.540	3,406.320	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	32	463.750	14,840.000	
ORACLE CORP	852	59.620	50,796.240	
PACCAR INC	136	91.060	12,384.160	
PTC INC	40	86.440	3,457.600	
EXELON CORP	385	41.860	16,116.100	
PARKER HANNIFIN CORP	52	221.570	11,521.640	
PAYCHEX INC	121	81.930	9,913.530	
ALIGN TECHNOLOGY INC	32	326.840	10,458.880	
PPL CORPORATION	332	27.770	9,219.640	
PEPSICO INC	572	139.680	79,896.960	
PENTAIR PLC	39	49.260	1,921.140	
PFIZER INC	2,292	37.800	86,637.600	
ESSENTIAL UTILITIES INC	111	41.550	4,612.050	
CONOCOPHILLIPS	437	32.700	14,289.900	
PG&E CORP	388	10.820	4,198.160	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	64	87.050	5,571.200	
ALTRIA GROUP INC	755	39.180	29,580.900	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	176	109.990	19,358.240	
BROWN & BROWN INC	112	46.460	5,203.520	
GARMIN LTD	58	97.720	5,667.760	
PPG INDUSTRIES INC	103	134.320	13,834.960	
IPG PHOTONICS CORP	18	186.500	3,357.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	182	375.560	68,351.920	
T ROWE PRICE GROUP INC	93	144.270	13,417.110	
QUEST DIAGNOSTICS	46	120.830	5,558.180	
PROCTER & GAMBLE CO	1,021	141.910	144,890.110	
PROGRESSIVE CORP	238	95.780	22,795.640	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	220	59.500	13,090.000	
PULTE GROUP INC	98	46.420	4,549.160	
GLOBAL PAYMENTS INC	121	171.970	20,808.370	
QUALCOMM INC	463	128.420	59,458.460	

RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	54	78.550	4,241.700	
EXACT SCIENCES CORP	65	107.140	6,964.100	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	24	169.900	4,077.600	
REGENERON PHARMACEUTICALS	41	583.140	23,908.740	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	15	104.260	1,563.900	
RESMED INC	64	179.410	11,482.240	
US BANCORP	549	38.970	21,394.530	
SEAGEN INC	50	198.220	9,911.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	145	29.890	4,334.050	
ROSS STORES INC	141	90.960	12,825.360	
ROLLINS INC	75	59.220	4,441.500	
ROPER TECHNOLOGIES INC	43	424.900	18,270.700	
ROCKWELL AUTOMATION INC	46	244.460	11,245.160	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	71	59.710	4,239.410	
RPM INTERNATIONAL INC	63	88.190	5,555.970	
ACCENTURE PLC-CL A	265	226.240	59,953.600	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	592	57.170	33,844.640	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	57	212.710	12,124.470	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	112	111.840	12,526.080	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	255	139.780	35,643.900	
BOOKING HOLDINGS INC	17	1,653.020	28,101.340	
SCHLUMBERGER LTD	612	15.010	9,186.120	
SCHWAB (CHARLES) CORP	595	38.890	23,139.550	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	89	142.000	12,638.000	
BUNGE LTD	45	54.600	2,457.000	
SEI INVESTMENTS CO	23	56.290	1,294.670	
ANTHEM INC	103	292.210	30,097.630	
AMERISOURCEBERGEN CORP	69	97.800	6,748.200	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	118	40.870	4,822.660	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	33	681.830	22,500.390	
CENTENE CORP	231	65.730	15,183.630	
SVB FINANCIAL GROUP	20	270.630	5,412.600	
SMITH (A.O.) CORP	63	54.960	3,462.480	
SNAP-ON INC	10	155.960	1,559.600	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	151	65.600	9,905.600	
ADVANCE AUTO PARTS	31	153.250	4,750.750	
EDISON INTERNATIONAL	159	58.260	9,263.340	
SOUTHERN CO	418	58.040	24,260.720	
TRUIST FINANCIAL CORP	554	41.570	23,029.780	

SOUTHWEST AIRLINES	68	39.850	2,709.800	
AT&T INC	2,930	26.880	78,758.400	
CHEVRON CORP	770	71.280	54,885.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	68	173.590	11,804.120	
STATE STREET CORP	142	64.350	9,137.700	
STARBUCKS CORP	472	87.600	41,347.200	
STEEL DYNAMICS INC	67	33.120	2,219.040	
STRYKER CORP	136	220.890	30,041.040	
NETFLIX INC	180	530.720	95,529.600	
NORTONLIFELOCK INC	249	20.700	5,154.300	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	58	39.200	2,273.600	
SYNOPSIS INC	64	224.370	14,359.680	
SYSCO CORP	192	64.340	12,353.280	
INTUITIVE SURGICAL INC	47	736.120	34,597.640	
TELEFLEX INC	17	361.630	6,147.710	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	357	9.290	3,316.530	
TERADYNE INC	58	86.670	5,026.860	
TEXAS INSTRUMENTS INC	376	150.760	56,685.760	
TEXTRON INC	91	35.490	3,229.590	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	164	461.290	75,651.560	
TIFFANY & CO	49	122.190	5,987.310	
GLOBE LIFE INC	31	82.680	2,563.080	
DAVITA INC	29	89.560	2,597.240	
TRACTOR SUPPLY CO	47	150.980	7,096.060	
TRIMBLE INC	102	51.970	5,300.940	
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	394.140	5,912.100	
TYSON FOODS INC	131	58.310	7,638.610	
UGI CORP	101	33.650	3,398.650	
UNION PACIFIC CORP	281	205.660	57,790.460	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	635	61.460	39,027.100	
UNITEDHEALTH GROUP INC	390	324.220	126,445.800	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	37	110.350	4,082.950	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	35	171.510	6,002.850	
VF CORP	146	72.540	10,590.840	
VIACOMCBS INC	241	27.130	6,538.330	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	104	220.510	22,933.040	
VULCAN MATERIALS CO	58	145.620	8,445.960	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	298	36.970	11,017.060	
WALMART INC	589	142.950	84,197.550	

WASTE MANAGEMENT INC	169	113.700	19,215.300	
WATERS CORP	23	209.870	4,827.010	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	33	286.060	9,439.980	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	42	115.210	4,838.820	
VAIL RESORTS INC	19	230.670	4,382.730	
WESTERN DIGITAL CORP	124	40.920	5,074.080	
WABTEC CORP	80	62.100	4,968.000	
WHIRLPOOL CORP	21	198.880	4,176.480	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	66	151.140	9,975.240	
WYNN RESORTS LTD	43	69.670	2,995.810	
NASDAQ INC	53	127.480	6,756.440	
CME GROUP INC	146	163.340	23,847.640	
WILLIAMS COS INC	497	19.290	9,587.130	
LKQ CORP	82	31.470	2,580.540	
ALLIANT ENERGY CORP	119	54.720	6,511.680	
WEC ENERGY GROUP INC	120	100.400	12,048.000	
CARMAX INC	63	92.040	5,798.520	
XILINX INC	108	116.380	12,569.040	
TJX COMPANIES INC	489	55.130	26,958.570	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	24	291.570	6,997.680	
ZIONS BANCORP NA	36	30.220	1,087.920	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	643	3.830	2,462.690	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	100	41.960	4,196.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	100	20.210	2,021.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	44	140.640	6,188.160	
SIGNATURE BANK	19	85.920	1,632.480	
CBRE GROUP INC	156	47.580	7,422.480	
LIBERTY GLOBAL PLC	59	21.275	1,255.220	
REGIONS FINANCIAL CORP	392	12.340	4,837.280	
DOMINO'S PIZZA INC	17	394.890	6,713.130	
T-MOBILE US INC	222	112.750	25,030.500	
LAS VEGAS SANDS CORP	149	44.960	6,699.040	
MOSAIC CO/THE	166	19.070	3,165.620	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	16	539.260	8,628.160	
CELANESE CORP	56	117.700	6,591.200	
DEXCOM INC	40	397.500	15,900.000	
DISCOVERY INC-A	95	20.200	1,919.000	
EXPEDIA GROUP INC	62	92.140	5,712.680	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	98	28.880	2,830.240	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	45	169.040	7,606.800	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	177	21.000	3,717.000	

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	217	98.450	21,363.650	
LIVE NATION	79	53.970	4,263.630	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11	1,335.590	14,691.490	
TRANSDIGM GROUP INC	21	484.160	10,167.360	
MASTERCARD INC	369	331.670	122,386.230	
WESTERN UNION CO	179	21.700	3,884.300	
OWENS CORNING	51	74.260	3,787.260	
LEIDOS HOLDINGS INC	61	86.360	5,267.960	
AERCAP HOLDINGS NV	77	28.540	2,197.580	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	126	14.630	1,843.380	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	52	141.790	7,373.080	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	256	10.370	2,654.720	
DELTA AIR LINES INC	71	31.500	2,236.500	
INSULET CORP	31	248.520	7,704.120	
DISCOVER FINANCIAL	135	63.560	8,580.600	
TE CONNECTIVITY LTD	142	105.430	14,971.060	
MASIMO CORP	22	235.740	5,186.280	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	78	47.260	3,686.280	
LULULEMON ATHLETICA INC	53	336.460	17,832.380	
VMWARE INC	37	149.920	5,547.040	
MERCADOLIBRE INC	19	1,284.050	24,396.950	
ULTA BEAUTY INC	26	235.450	6,121.700	
INVESCO LTD	193	13.910	2,684.630	
MSCI INC	37	362.670	13,418.790	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	639	77.840	49,739.760	
VISA INC	697	196.970	137,288.090	
KEURIG DR PEPPER INC	165	29.200	4,818.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	77	154.520	11,898.040	
DISCOVERY INC-C	176	18.270	3,215.520	
MARATHON PETROLEUM CORP	256	28.250	7,232.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	57	86.920	4,954.440	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	854	12.710	10,854.340	
XYLEM INC	78	90.420	7,052.760	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	109	77.050	8,398.450	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	22	146.960	3,233.120	
SPLUNK INC	68	207.215	14,090.620	
EPAM SYSTEMS INC	18	342.580	6,166.440	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	89	38.980	3,469.220	
HCA HEALTHCARE INC	118	134.330	15,850.940	
VERISK ANALYTICS INC	66	188.500	12,441.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	147.720	2,363.520	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	37	241.550	8,937.350	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	67	125.920	8,436.640	
NXP SEMICONDUCTOR NV	113	136.330	15,405.290	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	62	79.950	4,956.900	
LEAR CORP	21	129.080	2,710.680	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	52	81.990	4,263.480	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	101	64.110	6,475.110	
DOLLAR GENERAL CORP	102	218.070	22,243.140	
FORTINET INC	62	128.820	7,986.840	
TESLA INC	320	430.830	137,865.600	
GENERAL MOTORS CO	527	33.350	17,575.450	
XPO LOGISTICS INC	42	96.040	4,033.680	
ALLY FINANCIAL INC	107	28.450	3,044.150	
VOYA FINANCIAL INC	35	50.600	1,771.000	
APTIV PLC	109	99.400	10,834.600	
PHILLIPS 66	172	48.950	8,419.400	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	42	103.390	4,342.380	
FACEBOOK INC	990	261.400	258,786.000	
IQVIA HOLDINGS INC	84	164.050	13,780.200	
DIAMONDBACK ENERGY INC	61	28.040	1,710.440	
SERVICENOW INC	77	521.950	40,190.150	
PALO ALTO NETWORKS INC	38	242.340	9,208.920	
WORKDAY INC	69	227.640	15,707.160	
ABBVIE INC	726	84.310	61,209.060	
ZOETIS INC	195	159.990	31,198.050	
NEWS CORP/NEW-CL A	202	13.770	2,781.540	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	59	41.700	2,460.300	
CDW CORP	55	128.860	7,087.300	
HOWMET AEROSPACE INC	117	18.610	2,177.370	
TWILIO INC	52	329.590	17,138.680	
COUPA SOFTWARE INC	29	301.965	8,756.980	
SNAP INC	322	28.660	9,228.520	
TRADE DESK INC A	17	618.290	10,510.930	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	90	35.530	3,197.700	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	39	34.370	1,340.430	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	47	34.140	1,604.580	
OKTA INC	48	242.090	11,620.320	
BLACK KNIGHT INC	68	94.970	6,457.960	
BAKER HUGHES CO	258	13.110	3,382.380	

LAMB WESTON HOLDINGS INC	62	71.660	4,442.920	
ALTICE USA INC-A	156	28.200	4,399.200	
BROADCOM INC	163	375.770	61,250.510	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	32	282.870	9,051.840	
MONGODB INC	20	265.240	5,304.800	
BURLINGTON STORES INC	24	203.420	4,882.080	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	157	30.910	4,852.870	
VEEVA SYSTEMS INC	53	302.190	16,016.070	
TWITTER INC	321	45.820	14,708.220	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	49	46.850	2,295.650	
EVERGY INC	109	54.600	5,951.400	
ALLEGION PLC	42	103.930	4,365.060	
STERIS PLC	37	186.430	6,897.910	
DOCUSIGN INC	74	228.410	16,902.340	
WIX.COM LTD	22	278.300	6,122.600	
DROPBOX INC	115	19.890	2,287.350	
KKR & CO INC	194	36.800	7,139.200	
PERRIGO CO PLC	50	45.660	2,283.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	63	568.340	35,805.420	
MODERNA INC	110	70.960	7,805.600	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	116	87.550	10,155.800	
ARAMARK	70	27.970	1,957.900	
CIGNA CORP	150	171.660	25,749.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	106	69.500	7,367.000	
DOW INC	318	48.840	15,531.120	
AMCOR PLC	709	11.280	7,997.520	
PINTEREST INC	140	45.820	6,414.800	
PELOTON INTERACTIVE INC	72	133.010	9,576.720	
FOX CORP-A	156	26.020	4,059.120	
FOX CORP-B	87	26.250	2,283.750	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	49	144.660	7,088.340	
AVANTOR INC	206	24.260	4,997.560	
DYNATRACE INC	62	43.870	2,719.940	
TRADEWEB MARKETS INC	39	58.040	2,263.560	
CARRIER GLOBAL CORP	358	32.320	11,570.560	
OTIS WORLDWIDE CORP	179	64.360	11,520.440	
UBER TECHNOLOGIES INC	413	34.220	14,132.860	
CORTEVA INC	335	33.520	11,229.200	
MATCH GROUP INC	98	113.000	11,074.000	
SLACK TECHNOLOGIES INC	148	32.250	4,773.000	
BLACKSTONE GROUP INC	291	54.910	15,978.810	
CARLYLE GROUP INC	75	27.700	2,077.500	
DATADOG INC	50	111.660	5,583.000	
INGERSOLL RAND INC	169	36.600	6,185.400	
PAYCOM SOFTWARE INC	18	383.120	6,896.160	
AON PLC	110	209.190	23,010.900	

IAC/INTERACTIVECORP	39	120.670	4,706.130	
SNOWFLAKE INC	3	246.780	740.340	
ARISTA NETWORKS INC	23	221.630	5,097.490	
IHS MARKIT LTD	151	81.050	12,238.550	
FNF GROUP	127	32.160	4,084.320	
CATALENT INC	59	91.260	5,384.340	
SYNCHRONY FINANCIAL	246	29.080	7,153.680	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	144	26.640	3,836.160	
CYBERARK SOFTWARE LTD	8	112.040	896.320	
CDK GLOBAL INC	31	44.790	1,388.490	
WAYFAIR INC	26	299.950	7,798.700	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	84	106.680	8,961.120	
QORVO INC	44	134.540	5,919.760	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	53	145.030	7,686.590	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	124	25.170	3,121.080	
GODADDY INC	63	77.490	4,881.870	
NIELSEN HOLDINGS PLC	131	13.610	1,782.910	
TRANSUNION	69	84.720	5,845.680	
SQUARE INC	147	186.960	27,483.120	
DUPONT DE NEMOURS INC	301	58.440	17,590.440	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	87	37.670	3,277.290	
TELADOC HEALTH INC	27	223.690	6,039.630	
WESTROCK CO	120	41.080	4,929.600	
KRAFT HEINZ CO	298	31.750	9,461.500	
FORTIVE CORP	121	65.770	7,958.170	
WASTE CONNECTIONS INC	104	102.330	10,642.320	
ALPHABET INC-CL A	123	1,529.950	188,183.850	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	464	9.350	4,338.400	
PAYPAL HOLDINGS INC	459	200.060	91,827.540	
EQUITABLE HOLDINGS INC	196	19.890	3,898.440	
ZILLOW GROUP INC-C	50	98.450	4,922.500	
ALPHABET INC-CL C	125	1,534.610	191,826.250	
BEIGENE LTD ADR	18	301.520	5,427.360	
ZSCALER INC	23	153.170	3,522.910	
CABLE ONE INC	2	1,786.120	3,572.240	
LINDE PLC	214	229.870	49,192.180	
ATHENE HOLDING LTD	44	34.460	1,516.240	
ROKU INC	40	222.140	8,885.600	
AVALARA INC	36	153.500	5,526.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	58	617.660	35,824.280	
VISTRA CORP	208	18.810	3,912.480	
アメリカ・ドル 小計	127,939		12,335,870.760	

(1,302,544,592)

イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	144	10.420	1,500.480	
	ASHTAD GROUP	207	29.870	6,183.090	
	SEVERN TRENT PLC	102	24.920	2,541.840	
	BHP GROUP PLC	861	16.140	13,896.540	
	BARCLAYS PLC	7,429	1.033	7,674.150	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	512	5.372	2,750.460	
	BT GROUP PLC	4,143	0.988	4,093.280	
	BUNZL PLC	165	25.440	4,197.600	
	AVIVA PLC	1,384	2.822	3,905.640	
	CRODA INTERNATIONAL	44	63.600	2,798.400	
	DIAGEO PLC	954	26.265	25,056.810	
	SCHRODERS PLC	69	28.370	1,957.530	
	DCC PLC	46	52.300	2,405.800	
	NATIONAL GRID PLC	1,516	9.372	14,207.950	
	KINGFISHER PLC	1,004	3.133	3,145.530	
	BAE SYSTEMS PLC	1,215	4.821	5,857.510	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	933	26.030	24,285.990	
	HALMA PLC	175	24.520	4,291.000	
	NEXT PLC	64	61.660	3,946.240	
	IMPERIAL BRANDS PLC	416	12.880	5,358.080	
	JOHNSON MATTHEY PLC	52	23.810	1,238.120	
	ANGLO AMERICAN PLC	520	19.652	10,219.040	
	COMPASS GROUP PLC	702	12.010	8,431.020	
	HSBC HOLDINGS PLC	8,390	3.092	25,941.880	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,405	1.909	4,591.140	
	UNILEVER PLC	469	48.020	22,521.380	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	706	1.715	1,210.790	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	304	8.736	2,655.740	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	523	4.261	2,228.500	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	145	17.465	2,532.420	
	PEARSON PLC	373	5.356	1,997.780	
	PERSIMMON PLC	154	25.010	3,851.540	
	PRUDENTIAL PLC	1,126	10.985	12,369.110	
	RIO TINTO PLC	471	46.070	21,698.970	
VODAFONE GROUP PLC	10,724	1.091	11,699.880		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	290	72.040	20,891.600		
RELX PLC	831	16.815	13,973.260		
RENTOKIL INITIAL PLC	662	5.290	3,501.980		
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	672	2.200	1,478.400		
NATWEST GROUP PLC	2,193	1.150	2,521.950		

ST JAMES'S PLACE PLC	267	9.308	2,485.230	
SSE PLC	439	13.260	5,821.140	
BP PLC	8,207	2.077	17,045.930	
SAGE GROUP PLC(THE)	445	7.122	3,169.290	
SMITHS GROUP PLC	175	13.805	2,415.870	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	114.250	3,313.250	
STANDARD CHARTERED PLC	1,162	3.786	4,399.330	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	27,809	0.271	7,536.230	
TAYLOR WIMPLEY PLC	1,666	1.173	1,954.210	
TESCO PLC	4,253	2.117	9,003.600	
3I GROUP PLC	329	10.615	3,492.330	
SMITH & NEPHEW PLC	383	14.905	5,708.610	
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,038	13.966	28,462.700	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	125	88.080	11,010.000	
WPP PLC	398	6.582	2,619.630	
ASTRAZENECA PLC	539	81.090	43,707.510	
WHITBREAD PLC	54	22.550	1,217.700	
INTERTEK GROUP PLC	73	61.400	4,482.200	
BURBERRY GROUP PLC	184	15.350	2,824.400	
INTERCONTINENTAL HOTELS	84	41.800	3,511.200	
SAINSBURY (J) PLC	1,073	2.026	2,173.890	
ADMIRAL GROUP PLC	59	27.390	1,616.010	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	37	42.640	1,577.680	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,673	9.702	16,231.440	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,566	9.394	14,711.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	43	26.390	1,134.770	
AVEVA GROUP PLC	13	45.090	586.170	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,109	2.466	2,734.790	
EXPERIAN PLC	392	30.730	12,046.160	
MONDI PLC	236	16.075	3,793.700	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	162	14.090	2,282.580	
OCADO GROUP PLC	213	24.670	5,254.710	
INFORMA PLC	667	4.176	2,785.390	
GLENCORE PLC	4,234	1.654	7,003.030	
GVC HOLDINGS PLC	288	10.395	2,993.760	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	372	2.773	1,031.550	
COCA-COLA HBC AG	72	19.250	1,386.000	
FERGUSON PLC	101	80.540	8,134.540	
M&G PLC	858	1.668	1,431.140	
JD SPORTS FASHION PLC	87	8.086	703.480	
AUTO TRADER GROUP PLC	284	5.872	1,667.640	

	MELROSE INDUSTRIES PLC	1,277	1.296	1,654.990	
イギリス・ポンド	小計	116,570		572,723.200 (78,342,807)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	566	19.690	11,144.540	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	760	16.180	12,296.800	
	ELBIT SYSTEMS LTD	8	403.000	3,224.000	
	ICL GROUP LTD	193	12.660	2,443.380	
	NICE LTD	26	805.600	20,945.600	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	85	65.930	5,604.050	
	AZRIELI GROUP	17	166.600	2,832.200	
イスラエル・シュケル	小計	1,655		58,490.570 (1,823,736)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	65	65.810	4,277.650	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,217	19.510	23,743.670	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,493	18.780	28,038.540	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	746	16.820	12,547.720	
	TELSTRA CORP LTD	1,589	2.850	4,528.650	
	AMP LTD	697	1.455	1,014.130	
	ASX LTD	70	83.970	5,877.900	
	BHP GROUP LTD	1,235	36.500	45,077.500	
	AMPOL LTD	130	25.420	3,304.600	
	COMPUTERSHARE LT	212	13.180	2,794.160	
	CSL LIMITED	188	304.130	57,176.440	
	REA GROUP LTD	17	122.650	2,085.050	
	TRANSURBAN GROUP	1,206	13.880	16,739.280	
	COCHLEAR LTD	22	217.800	4,791.600	
	ORIGIN ENERGY LTD	776	4.540	3,523.040	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	739	70.010	51,737.390	
	RIO TINTO LIMITED	160	95.560	15,289.600	
	APA GROUP	564	11.010	6,209.640	
	ARISTOCRAT LEISU	199	30.960	6,161.040	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	925	4.870	4,504.750	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	219	36.190	7,925.610	
	ORICA LTD	100	16.790	1,679.000	
	CIMIC GROUP LTD	36	22.590	813.240	
	LEND LEASE CORP LTD	336	12.470	4,189.920	
BLUESCOPE STEEL LTD	224	14.770	3,308.480		
SYDNEY AIRPORT	525	5.950	3,123.750		
MACQUARIE GROUP LTD	136	136.040	18,501.440		
SUNCORP GROUP LTD	547	9.000	4,923.000		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,297	19.400	25,161.800	
	NEWCREST MINING LTD	355	31.820	11,296.100	
	OIL SEARCH LTD	865	2.860	2,473.900	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	678	8.960	6,074.880	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	333	16.250	5,411.250	
	SANTOS LTD	714	5.160	3,684.240	
	SONIC HEALTHCARE	211	36.750	7,754.250	
	TABCORP HOLDINGS LTD	899	3.410	3,065.590	
	WESFARMERS LTD	488	48.210	23,526.480	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	439	18.550	8,143.450	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	521	39.400	20,527.400	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	35	60.690	2,124.150	
	SEEK LTD	158	23.320	3,684.560	
	AUSNET SERVICES	648	2.080	1,347.840	
	AGL ENERGY LTD	269	13.510	3,634.190	
	BRAMBLES LTD	669	10.680	7,144.920	
	CROWN RESORTS LTD	251	8.250	2,070.750	
	EVOLUTION MINING LTD	688	6.020	4,141.760	
	AURIZON HOLDINGS LTD	934	4.180	3,904.120	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	355	9.170	3,255.350	
	AFTERPAY LTD	85	97.540	8,290.900	
	MEDIBANK PVT LTD	807	2.740	2,211.180	
	SOUTH32 LTD(AUD)	1,797	2.200	3,953.400	
	COLES GROUP LTD	541	17.850	9,656.850	
	オーストラリア・ドル 小計	28,410		516,426.100 (38,468,580)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	91	104.910	9,546.810	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	358	44.090	15,784.220	
	BARRICK GOLD CORP	717	35.580	25,510.860	
	ATCO LTD	31	38.700	1,199.700	
	BANK OF MONTREAL	276	79.780	22,019.280	
	BANK OF NOVA SCOTIA	495	55.760	27,601.200	
	NATIONAL BANK OF CANADA	145	66.450	9,635.250	
	BCE INC	82	55.210	4,527.220	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	551	44.400	24,464.400	
	BAUSCH HEALTH COS INC	143	22.730	3,250.390	
	SAPUTO INC	133	34.600	4,601.800	
	BLACKBERRY LTD	332	6.850	2,274.200	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	248	20.390	5,056.720	
	CGI INC	97	90.250	8,754.250	
	CCL INDUSTRIES INC	53	51.660	2,737.980	

CAE INC	111	22.080	2,450.880	
CAMECO CORP	227	12.360	2,805.720	
ROGERS COMM-CL B	165	52.740	8,702.100	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	176	100.130	17,622.880	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	513	22.970	11,783.610	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	18	152.410	2,743.380	
CANADIAN UTILITIES LTD	69	33.710	2,325.990	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	301	146.470	44,087.470	
YAMANA GOLD INC	384	7.680	2,949.120	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	38	28.420	1,079.960	
OPEN TEXT CORP	111	55.020	6,107.220	
EMPIRE CO LTD	48	38.280	1,837.440	
KINROSS GOLD CORP	533	11.710	6,241.430	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	52	82.470	4,288.440	
FORTIS INC	186	53.920	10,029.120	
TELUS CORP	88	23.670	2,082.960	
GREAT WEST LIFECO INC	46	27.580	1,268.680	
IMPERIAL OIL LTD	76	16.500	1,254.000	
ENBRIDGE INC	829	38.310	31,758.990	
IGM FINANCIAL INC	35	31.880	1,115.800	
MANULIFE FINANCIAL CORP	855	18.480	15,800.400	
LOBLAW CO LTD	91	68.550	6,238.050	
MAGNA INTERNATIONAL INC	117	70.710	8,273.070	
SUN LIFE FINANCIAL INC	252	54.370	13,701.240	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	381.430	4,577.160	
METRO INC	77	63.240	4,869.480	
EMERA INC	100	55.650	5,565.000	
ONEX CORP	45	59.030	2,656.350	
PAN AMERICAN SILVER CORP	107	42.190	4,514.330	
POWER CORP OF CANADA	202	26.380	5,328.760	
QUEBECOR INC-B	38	32.960	1,252.480	
ROYAL BANK OF CANADA	598	96.150	57,497.700	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	57	425.710	24,265.470	
SHAW COMM INC-B	192	23.090	4,433.280	
SUNCOR ENERGY INC	648	15.560	10,082.880	
LUNDIN MINING CORP	321	7.610	2,442.810	
TECK RESOURCES LTD-CL B	268	17.830	4,778.440	
THOMSON REUTERS CORP	65	108.140	7,029.100	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	744	59.350	44,156.400	
TC ENERGY CORP	380	55.630	21,139.400	
WESTON (GEORGE) LTD	36	96.490	3,473.640	
INTACT FINANCIAL CORP	66	142.000	9,372.000	

	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	172	63.960	11,001.120	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	9	1,530.690	13,776.210	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	75	181.260	13,594.500	
	B2GOLD CORP	413	8.950	3,696.350	
	CI FINANCIAL CORP	68	17.580	1,195.440	
	KEYERA CORP	42	20.850	875.700	
	PARKLAND CORP	80	37.850	3,028.000	
	ALTAGAS LTD	171	17.210	2,942.910	
	PEMBINA PIPELINE CORP	249	28.450	7,084.050	
	DOLLARAMA INC	126	51.400	6,476.400	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	223	4.820	1,074.860	
	TMX GROUP LTD	29	136.160	3,948.640	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	118	64.040	7,556.720	
	INTER PIPELINE LTD	188	12.740	2,395.120	
	NUTRIEN LTD	231	52.760	12,187.560	
	WSP GLOBAL INC	50	88.140	4,407.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	57	46.380	2,643.660	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	115	74.130	8,524.950	
	SHOPIFY INC	44	1,397.760	61,501.440	
	CANOPY GROWTH CORP	109	26.100	2,844.900	
	HYDRO ONE LTD	137	29.650	4,062.050	
カナダ・ドル 小計		15,735		765,764.490 (61,322,420)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	600	3.610	2,166.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	800	21.570	17,256.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	400	7.740	3,096.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	300	9.170	2,751.000	
	CAPITALAND LTD	1,000	2.770	2,770.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	4,200	0.680	2,856.000	
	KEPPEL CORP LTD	300	4.580	1,374.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,400	8.750	12,250.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,300	2.150	9,245.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	900	3.530	3,177.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	500	19.700	9,850.000	
	UOL GROUP LIMITED	300	6.800	2,040.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	500	4.410	2,205.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	69	0.970	66.930	
シンガポール・ドル 小計		15,569		71,102.930 (5,532,519)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	986	9.816	9,678.570	
	LOGITECH INTL-REG	79	73.400	5,798.600	
	NESTLE SA-REGISTERED	1,234	107.280	132,383.520	

	CIE FINANC RICHEMONT	228	62.640	14,281.920	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	290	311.450	90,320.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	21	249.300	5,235.300	
	SIKA INHABER	57	229.900	13,104.300	
	SGS SA-REG	2	2,429.000	4,858.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	922	78.590	72,459.980	
	BALOISE HOLDING AG -R	26	132.400	3,442.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	2	2,024.000	4,048.000	
	CLARIANT AG-REG	69	17.625	1,216.120	
	SWISSCOM AG-REG	13	482.400	6,271.200	
	ABB LTD	831	24.300	20,193.300	
	ADECCO GROUP AG-REG	74	51.180	3,787.320	
	GEBERIT AG	13	545.400	7,090.200	
	LONZA GROUP AG-REG	30	582.000	17,460.000	
	GIVAUDAN-REG	4	3,935.000	15,740.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	63	313.300	19,737.900	
	LAFARGEHOLCIM LTD	201	43.020	8,647.020	
	TEMENOS GROUP	30	111.500	3,345.000	
	SONOVA HOLDING AG	22	244.800	5,385.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	21	185.100	3,887.100	
	STRAUMANN HOLDING AG	4	976.600	3,906.400	
	THE SWATCH GROUP AG-B	12	210.700	2,528.400	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10	40.380	403.800	
	SCHINDLER NAMEN	12	246.000	2,952.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	13	341.100	4,434.300	
	VIFOR PHARMA AG	16	120.350	1,925.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING	3	847.000	2,541.000	
	SWISS PRIME SITE AG	22	82.050	1,805.100	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	7	861.000	6,027.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	106	44.060	4,670.360	
	SWISS RE LTD	131	68.680	8,997.080	
	ALCON INC	200	56.340	11,268.000	
	UBS GROUP AG	1,523	10.930	16,646.390	
スイス・フラン	小計	7,277		536,477.280 (62,258,188)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	272	417.800	113,641.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	175	362.600	63,455.000	
	ERICSSON LM-B SHS	1,275	97.420	124,210.500	
	LUNDBERGS B	37	429.800	15,902.600	
	SKF AB-B SHS	111	191.400	21,245.400	
	SANDVIK AB	458	174.900	80,104.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	714	85.120	60,775.680	
	SKANSKA AB-B SHS	112	190.000	21,280.000	

	SWEDBANK AB	320	148.480	47,513.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	263	119.200	31,349.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	686	78.900	54,125.400	
	VOLVO AB-B SHS	651	185.250	120,597.750	
	SWEDISH MATCH AB	78	721.000	56,238.000	
	TELE2 AB-B SHS	145	117.750	17,073.750	
	INDUSTRIVARDEN C	40	241.800	9,672.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	58	210.300	12,197.400	
	SECURITAS AB-B SHS	164	135.950	22,295.800	
	INVESTOR AB-B SHS	198	567.000	112,266.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	355	157.100	55,770.500	
	ASSA ABLOY AB-B	401	212.800	85,332.800	
	TELIA CO AB	1,188	38.630	45,892.440	
	LUNDIN ENERGY AB	81	190.200	15,406.200	
	BOLIDEN AB	92	254.500	23,414.000	
	ALFA LAVAL AB	160	197.800	31,648.000	
	KINNEVIK AB-B	133	379.700	50,500.100	
	ICA GRUPPEN AB	38	458.700	17,430.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	213	102.800	21,896.400	
	NIBE INDUSTRIER AB	111	232.000	25,752.000	
	HEXAGON AB	111	684.800	76,012.800	
	EPIROC AB-A	354	129.450	45,825.300	
	EPIROC AB-B	60	124.850	7,491.000	
	ESSITY AB-B	274	299.400	82,035.600	
	EQT AB	52	188.350	9,794.200	
	EVOLUTION GAMING GROUP AB	62	708.000	43,896.000	
	NORDEA BANK ABP	1,323	69.710	92,226.330	
	スウェーデン・クローナ 小計	10,765		1,714,268.550 (20,502,652)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	40	870.800	34,832.000	
	A P MOLLER A/S	3	10,710.000	32,130.000	
	AP MOLLER MAERSK A	1	9,950.000	9,950.000	
	DANSKE BANK A/S	314	92.920	29,176.880	
	GENMAB A/S	26	2,306.000	59,956.000	
	NOVOZYMES-B SHS	61	408.700	24,930.700	
	NOVO NORDISK A/S-B	723	451.150	326,181.450	
	GN STORE NORD A/S	59	500.800	29,547.200	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	80	1,122.500	89,800.000	
	COLOPLAST-B	48	980.000	47,040.000	
	DSV PANALPINA A S	85	1,054.500	89,632.500	
	DEMANT A/S	33	204.000	6,732.000	
	H LUNDBECK A/S	15	195.100	2,926.500	
	TRYG A/S	44	200.600	8,826.400	
	PANDORA A/S	45	541.400	24,363.000	

	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	35	664.200	23,247.000	
	AMBU A/S B	75	202.800	15,210.000	
	ORSTED A/S	78	1,021.000	79,638.000	
デンマーク・クローネ 小計		1,765		934,119.630 (15,609,139)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	693	7.270	5,038.110	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	101	14.500	1,464.500	
	A2 MILK CO LTD	367	15.700	5,761.900	
	FISHER & PAYKEL	259	35.240	9,127.160	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	789	4.695	3,704.350	
	MERIDIAN ENERGY LTD	456	5.450	2,485.200	
ニュージーランド・ドル 小計		2,665		27,581.220 (1,920,205)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	203	170.350	34,581.050	
	DNB ASA	398	138.300	55,043.400	
	NORSK HYDRO ASA	270	26.200	7,074.000	
	TELENOR ASA	268	151.150	40,508.200	
	ORKLA ASA	375	92.860	34,822.500	
	EQUINOR ASA	454	133.550	60,631.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	35	344.800	12,068.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	84	194.300	16,321.200	
	ADEVINTA ASA	72	165.300	11,901.600	
	SCHIBSTED ASA	58	385.400	22,353.200	
	ノルウェー・クローネ 小計		2,217		295,304.850 (3,342,851)
ユーロ	CRH PLC	301	32.440	9,764.440	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	67	143.400	9,607.800	
	KERRY GROUP PLC-A	71	109.900	7,802.900	
	KINGSPAN GROUP PLC	70	76.250	5,337.500	
	UMICORE	99	36.190	3,582.810	
	AIR LIQUIDE	192	134.800	25,881.600	
	AIRBUS SE	245	65.720	16,101.400	
	AXA SA	773	15.028	11,616.640	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	227	17.600	3,995.200	
	ADIDAS AG	76	284.100	21,591.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	386	12.205	4,711.130	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.000	0.000	
	DANONE	245	53.440	13,092.800	
	SAFRAN SA	135	91.580	12,363.300	
	INTESA SANPAOLO	6,375	1.559	9,938.620	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	140	63.620	8,906.800	
	ACCOR SA	56	23.240	1,301.440	
	BOUYGUES	81	30.830	2,497.230	

BNP PARIBAS	458	32.600	14,930.800	
THALES SA	36	65.180	2,346.480	
CAPGEMINI SA	65	110.700	7,195.500	
INGENICO GROUP	27	134.250	3,624.750	
UNICREDIT SPA	834	6.896	5,751.260	
NATIXIS	473	2.084	985.730	
KONINKLIJKE DSM NV	67	144.750	9,698.250	
COMMERZBANK AG	534	4.404	2,351.730	
EIFFAGE	26	77.140	2,005.640	
FRESENIUS SE & CO KGAA	185	35.660	6,597.100	
UNITED INTERNET	60	32.790	1,967.400	
FUCHS PETROLUB SE PREF	21	45.540	956.340	
PUBLICIS GROUPE	98	31.400	3,077.200	
IBERDROLA SA	2,430	10.945	26,596.350	
ENI SPA	1,005	6.586	6,618.930	
JERONIMO MARTINS	148	14.525	2,149.700	
KBC GROUPE	100	44.410	4,441.000	
HANNOVER RUECK SE	29	129.400	3,752.600	
WARTSILA OYJ	111	7.248	804.520	
L'OREAL	106	288.500	30,581.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	115	432.300	49,714.500	
GEA GROUP AG	83	30.360	2,519.880	
BOLLORE	503	3.290	1,654.870	
MEDIOBANCA SPA	225	6.582	1,480.950	
MICHELIN(CGDE) -B	67	93.200	6,244.400	
CONTINENTAL AG	53	102.500	5,432.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	386	41.340	15,957.240	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	129	25.900	3,341.100	
OMV AG	59	23.020	1,358.180	
PERNOD-RICARD	87	142.550	12,401.850	
PEUGEOT SA	264	16.070	4,242.480	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	69	50.480	3,483.120	
RENAULT SA	94	23.805	2,237.670	
REPSOL SA	549	5.926	3,253.370	
REMY COINTREAU	12	157.300	1,887.600	
MERCK KGAA	56	124.300	6,960.800	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	209	33.800	7,064.200	
RWE AG	268	33.810	9,061.080	
SEB SA	14	151.300	2,118.200	
SOCIETE GENERALE-A	342	12.294	4,204.540	
VINCI S.A.	221	73.620	16,270.020	
SODEXO	22	61.820	1,360.040	
SOFINA	8	234.000	1,872.000	
SOLVAY SA	32	77.580	2,482.560	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	227	107.800	24,470.600	

VIVENDI SA	370	24.970	9,238.900	
SAP SE	426	131.000	55,806.000	
TELEFONICA S.A	1,932	3.007	5,809.520	
TOTAL SE	1,014	28.210	28,604.940	
VALEO	108	27.850	3,007.800	
E.ON SE	931	9.664	8,997.180	
VOEST-ALPINE AG	26	24.250	630.500	
HENKEL AG & CO KGAA	26	81.400	2,116.400	
SIEMENS AG-REG	315	110.460	34,794.900	
UPM-KYMMENE OYJ	225	26.550	5,973.750	
ING GROEP NV-CVA	1,673	6.380	10,673.740	
PUMA AG	42	81.600	3,427.200	
BAYER AG	394	44.330	17,466.020	
STORA ENSO OYJ-R SHS	281	14.220	3,995.820	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	78	90.460	7,055.880	
DAIMLER AG	365	48.810	17,815.650	
BASF SE	385	53.210	20,485.850	
BEIERSDORF AG	34	99.980	3,399.320	
HOCHTIEF AG	11	68.150	749.650	
HEIDELBERGCEMENT AG	59	54.960	3,242.640	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	96	70.980	6,814.080	
ORANGE	888	9.436	8,379.160	
SAMPO OYJ-A SHS	187	35.830	6,700.210	
RANDSTAD NV	22	46.500	1,023.000	
ALLIANZ SE	168	164.480	27,632.640	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	967	4.496	4,347.630	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	431	25.110	10,822.410	
HERMES INTL	13	798.200	10,376.600	
ENDESA S.A.	143	23.970	3,427.710	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	94	7.990	751.060	
ERSTE GROUP BANK AG	128	17.860	2,286.080	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	55	212.200	11,671.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	263	12.330	3,242.790	
DASSAULT SYSTEMES SA	54	159.900	8,634.600	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	141	23.190	3,269.790	
HEINEKEN NV	111	78.840	8,751.240	
AKZO NOBEL	87	89.880	7,819.560	
ASML HOLDING NV	175	329.600	57,680.000	
AEGON NV	863	2.447	2,111.760	
BANKINTER S.A.	407	3.510	1,428.570	
VOLKSWAGEN AG	19	147.400	2,800.600	
VOLKSWAGEN AG PFD	71	139.280	9,888.880	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,837	2.356	6,683.970	

KERING	31	586.000	18,166.000	
CNP ASSURANCES	121	10.730	1,298.330	
FORTUM OYJ	149	18.090	2,695.410	
AGEAS	36	36.000	1,296.000	
UCB SA	48	92.440	4,437.120	
NEMETSCHEK SE	31	63.300	1,962.300	
THYSSENKRUPP AG	236	4.505	1,063.180	
CARREFOUR SA	232	14.015	3,251.480	
NATURGY ENERGY GROUP SA	107	17.570	1,879.990	
ATOS SE	48	69.360	3,329.280	
NOKIA OYJ	2,286	3.544	8,101.580	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	368	39.900	14,683.200	
WOLTERS KLUWER-CVA	104	72.640	7,554.560	
SANOFI	470	85.440	40,156.800	
STMICROELECTRONICS NV	278	29.430	8,181.540	
ELISA OYJ	49	46.720	2,289.280	
BANCO SANTANDER SA	6,520	1.653	10,777.560	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	206	16.095	3,315.570	
QIAGEN N.V.	105	45.090	4,734.450	
DEUTSCHE BANK AG-REG	815	8.000	6,520.000	
BMW VORZUG	19	48.460	920.740	
ENEL SPA	3,353	7.469	25,043.550	
VOPAK (KON.)	38	47.690	1,812.220	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,331	13.950	18,567.450	
SARTORIUS AG	15	373.400	5,601.000	
LEONARDO SPA	270	4.763	1,286.010	
UBISOFT ENTERTAINMENT	23	81.840	1,882.320	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	505	27.630	13,953.150	
CARL ZEISS MEDITEC AG	9	123.000	1,107.000	
KONINKLIJKE KPN NV	1,753	2.417	4,237.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	6	703.000	4,218.000	
TELEPERFORMANCE	22	274.200	6,032.400	
DEUTSCHE BOERSE AG	80	146.650	11,732.000	
EURAZEO	23	43.720	1,005.560	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	60	77.140	4,628.400	
HEINEKEN HOLDING NV-A	60	69.800	4,188.000	
INDITEX	447	23.880	10,674.360	
JC DECAUX SA	24	13.800	331.200	
ANDRITZ AG	7	29.240	204.680	
MAPFRE SA	646	1.322	854.010	
ESSILORLUXOTTICA	116	115.700	13,421.200	
SNAM SPA	926	4.350	4,028.100	
CREDIT AGRICOLE SA	428	7.388	3,162.060	
ORPEA	19	94.440	1,794.360	
ENAGAS	61	19.405	1,183.700	
WENDEL	13	81.600	1,060.800	
TENARIS SA	163	4.375	713.120	

TELECOM ITALIA-RNC	3,436	0.357	1,226.650	
ATLANTIA SPA	206	15.285	3,148.710	
PROXIMUS	94	16.315	1,533.610	
SES FDR	252	6.650	1,675.800	
TERNA SPA	664	6.002	3,985.320	
BIOMERIEUX	17	125.100	2,126.700	
GRIFOLS SA	143	26.710	3,819.530	
FERROVIAL SA	196	20.680	4,053.280	
LANXESS AG	48	49.750	2,388.000	
NESTE OYJ	186	48.490	9,019.140	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	91	13.160	1,197.560	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	9,000	0.000	0.000	
RECORDATI SPA	33	46.610	1,538.130	
GALAPAGOS NV	22	111.700	2,457.400	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	290	9.352	2,712.080	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	18	154.850	2,787.300	
KONE OYJ	143	74.660	10,676.380	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	11	305.000	3,355.000	
ENGIE	725	11.680	8,468.000	
ALSTOM	72	40.810	2,938.320	
TELENET GROUP HOLDING NV	12	33.600	403.200	
ELECTRICITE DE FRANCE	195	10.355	2,019.220	
IPSEN SA	21	77.500	1,627.500	
DEUTSCHE WOHNEN	115	44.840	5,156.600	
ARKEMA SA	28	85.000	2,380.000	
LEGRAND SA	101	69.300	6,999.300	
UNILEVER NV	596	52.160	31,087.360	
ADP	10	83.900	839.000	
ORION OYJ	46	38.130	1,753.980	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	236	8.182	1,930.950	
SYMRISE AG	57	116.400	6,634.800	
SCOR SE	71	24.220	1,719.620	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	109	35.140	3,830.260	
PRYSMIAN SPA	121	25.660	3,104.860	
DIASORIN SPA	11	193.600	2,129.600	
CAIXABANK	1,237	1.710	2,115.270	
BUREAU VERITAS SA	95	19.480	1,850.600	
GETLINK	218	12.330	2,687.940	
SUEZ SA	164	15.720	2,578.080	
AMADEUS IT GROUP SA	191	47.350	9,043.850	
BRENTAG AG	76	55.220	4,196.720	
EVONIK INDUSTRIES AG	105	22.700	2,383.500	
EDENRED	109	41.370	4,509.330	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	686	2.215	1,519.490	

LEG IMMOBILIEN AG	33	122.700	4,049.100	
KION GROUP AG	28	77.900	2,181.200	
VONOVIA SE	203	58.400	11,855.200	
KNORR-BREMSE AG	22	104.260	2,293.720	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44	38.355	1,687.620	
FERRARI NV	56	162.850	9,119.600	
METRO AG	96	8.480	814.080	
CNH INDUSTRIAL NV	524	7.286	3,817.860	
AROUNDTOWN SA	443	4.473	1,981.530	
MONCLER SPA	88	36.740	3,233.120	
NEXI SPA	160	15.200	2,432.000	
TEAMVIEWER AG	62	46.090	2,857.580	
PROSUS NV	192	85.000	16,320.000	
SIEMENS ENERGY AG	157	21.270	3,339.390	
WORLDLINE SA	51	71.380	3,640.380	
NN GROUP NV	142	32.600	4,629.200	
FINECOBANK SPA	300	12.185	3,655.500	
ARGENX SE	15	226.200	3,393.000	
ZALANDO SE	52	85.000	4,420.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	485	10.746	5,211.810	
AENA SME SA	33	120.600	3,979.800	
CELLNEX TELECOM SAU	117	51.900	6,072.300	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	54	108.900	5,880.600	
ABN AMRO BANK NV	203	7.450	1,512.350	
EXOR NV	22	47.550	1,046.100	
SCOUT24 AG	50	76.650	3,832.500	
COVESTRO AG	83	44.080	3,658.640	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	343	47.640	16,340.520	
POSTE ITALIANE SPA	238	7.728	1,839.260	
AMUNDI SA	30	61.600	1,848.000	
ADYEN NV	7	1,629.500	11,406.500	
UNIPER SE	61	27.140	1,655.540	
DELIVERY HERO SE	59	100.400	5,923.600	
ユーロ 小計	92,360		1,562,305.800 (194,241,480)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	100	87.050	8,705.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	864	19.960	17,245.440	
BANK OF EAST ASIA	267	14.260	3,807.420	
CLP HOLDINGS LTD	735	73.200	53,802.000	
PCCW LTD	884	4.930	4,358.120	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	500	36.700	18,350.000	
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	566	367.200	207,835.200	
MTR CORP	903	39.000	35,217.000	
HANG SENG BANK LTD	300	114.000	34,200.000	

HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,086	28.800	31,276.800	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	567	41.150	23,332.050	
HONG KONG & CHINA GAS	4,348	11.280	49,045.440	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	537	51.650	27,736.050	
KERRY PROPERTIES LTD	452	19.740	8,922.480	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,684	21.400	36,037.600	
NEW WORLD DEVELOPMENT	890	38.250	34,042.500	
SINO LAND CO	576	9.850	5,673.600	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	500	98.900	49,450.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	773	105.000	81,165.000	
SJM HOLDINGS LTD	1,000	8.240	8,240.000	
WYNN MACAU LTD	699	11.300	7,898.700	
AIA GROUP LTD	5,151	77.600	399,717.600	
HKT TRUST / HKT LTD	2,080	10.360	21,548.800	
SANDS CHINA LTD	974	27.650	26,931.100	
SWIRE PROPERTIES LTD	32	20.900	668.800	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,000	31.500	31,500.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	500	24.000	12,000.000	
WH GROUP LTD	3,000	6.180	18,540.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,034	46.350	47,925.900	
CK ASSET HOLDINGS LTD	534	37.450	19,998.300	
香港・ドル 小計	32,536		1,325,170.900 (18,048,828)	
合計	455,463		1,803,957,997 (1,803,957,997)	

## (2) 株式以外の有価証券

令和2年10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	583.000	5,264.490	
		GOODMAN GROUP	703.000	13,279.670	
		GPT GROUP	956.000	3,833.560	
		MIRVAC GROUP	827.000	1,844.210	
		SCENTRE GROUP	1,418.000	3,204.680	
		STOCKLAND	1,002.000	4,118.220	
		VICINITY CENTRES	1,672.000	2,257.200	
	オーストラリア・ドル 小計		7,161.000	33,802.030 (2,517,913)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,100.000	3,542.000	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	869.000	1,433.850	

		CAPITALAND MALL TRUST	1,500.000	2,895.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	500.000	725.000	
	シンガポール・ドル	小計	3,969.000	8,595.850 (668,843)	
投資信託受益証券 合計			11,130	3,186,756 (3,186,756)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	286.000	4,012.580	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	54.000	8,561.160	
		AMERICAN TOWER CORP	181.000	43,367.600	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	549.000	3,897.900	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	60.000	8,724.600	
		BOSTON PROPERTIES INC	66.000	5,016.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	33.000	3,002.670	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	169.000	27,770.080	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	115.000	17,845.700	
		DUKE REALTY TRUST	174.000	6,681.600	
		EQUINIX INC	37.000	29,970.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	85.000	5,355.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	162.000	8,215.020	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	23.000	4,578.380	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	58.000	6,596.340	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	34.000	2,495.940	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	189.000	5,016.060	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	326.000	3,478.420	
		INVITATION HOMES INC	246.000	6,806.820	
		IRON MOUNTAIN INC	70.000	1,913.100	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	198.000	3,500.640	
		MID AMERICA	54.000	6,354.720	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	88.000	2,959.440	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	113.000	3,323.330	
		PROLOGIS INC	296.000	30,493.920	
		PUBLIC STORAGE	62.000	14,333.780	
		REALTY INCOME CORP	127.000	7,461.250	
REGENCY CENTERS CORP	86.000	3,182.000			
SBA COMMUNICATIONS CORP	48.000	14,773.440			
SIMON PROPERTY GROUP INC	117.000	7,477.470			
SUN COMMUNITIES INC	41.000	5,932.700			
UDR INC	131.000	4,210.340			
VENTAS INC	142.000	5,860.340			

	VEREIT INC	549.000	3,595.950	
	VICI PROPERTIES INC	207.000	4,792.050	
	VORNADO REALTY TRUST	57.000	1,857.630	
	WELLTOWER INC	178.000	9,359.240	
	WEYERHAEUSER CO	284.000	8,321.200	
	WP CAREY INC	73.000	4,782.960	
アメリカ・ドル	小計	5,768.000	345,877.370 (36,521,192)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	255.000	929.470	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	322.000	1,712.710	
	SEGRO PLC	481.000	4,397.300	
イギリス・ポンド	小計	1,058.000	7,039.480 (962,930)	
カナダ・ドル	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	93.000	1,347.570	
カナダ・ドル	小計	93.000	1,347.570 (107,913)	
ユーロ	COVIVIO	21.000	1,189.650	
	GECINA SA	34.000	3,682.200	
	ICADE	19.000	873.240	
	KLEPIERRE	82.000	1,031.560	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	61.000	2,587.620	
ユーロ	小計	217.000	9,364.270 (1,164,260)	
香港・ドル	LINK REIT	807.000	49,509.450	
香港・ドル	小計	807.000	49,509.450 (674,319)	
投資証券	合計	7,943	39,430,614 (39,430,614)	
合計			42,617,370 (42,617,370)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 588銘柄	66.67	-	-	72.52
	投資証券 39銘柄	-	-	1.87	
イギリス・ポンド	株式 82銘柄	4.01	-	-	4.29
	投資証券 3銘柄	-	-	0.05	
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 52銘柄	1.97	-	-	2.22

	投資信託受益証券	7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式	78銘柄	3.14	-	-	3.33
	投資証券	1銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.28	-	-	0.34
	投資信託受益証券	4銘柄	-	0.03	-	
スイス・フラン	株式	36銘柄	3.19	-	-	3.37
スウェーデン・クローナ	株式	35銘柄	1.05	-	-	1.11
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.80	-	-	0.85
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.10	-	-	0.10
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.17	-	-	0.18
ユーロ	株式	230銘柄	9.94	-	-	10.58
	投資証券	5銘柄	-	-	0.06	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.92	-	-	1.01
	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

海外国債マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和2年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	33,066,922
コール・ローン	154,568,401
国債証券	16,940,600,056
未収利息	121,529,534
前払費用	7,370,340
流動資産合計	17,257,135,253
資産合計	17,257,135,253
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	6,839,282,823
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,417,852,430
元本等合計	17,257,135,253
純資産合計	17,257,135,253
負債純資産合計	17,257,135,253

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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	令和2年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,182,998,461円
同期中追加設定元本額	54,554,873円
同期中一部解約元本額	398,270,511円
元本の内訳	
ファンド名	
海外国債ファンド	5,059,918,217円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	846,545,579円
新光7資産バランスファンド	244,933,996円
海外国債ファンド（1年決算型）	21,926,544円
海外国債ファンド（変額年金）	653,995,861円
グローバル・ナビ	11,962,626円
計	6,839,282,823円
2. 受益権の総数	6,839,282,823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 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	令和2年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年10月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	500,034,489
合計	500,034,489

(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(令和1年11月5日から令和2年10月20日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和2年10月20日現在
1口当たり純資産額	2.5232円
(1万口当たり純資産額)	(25,232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

令和2年10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.625 05/15/30	5,000,000.000	4,948,437.500	
		US T N/B 1.125 08/15/40	6,400,000.000	6,191,000.000	

	US T N/B 1.5 02/15/30	4,000,000.000	4,285,625.000	
	US T N/B 1.625 08/15/29	5,000,000.000	5,405,859.350	
	US T N/B 1.75 11/15/29	5,000,000.000	5,466,015.600	
	US T N/B 2.25 11/15/27	3,000,000.000	3,356,015.610	
	US T N/B 2.375 05/15/29	5,000,000.000	5,714,062.500	
	US T N/B 2.625 02/15/29	5,000,000.000	5,802,343.740	
	US T N/B 2.75 02/15/28	5,000,000.000	5,784,765.600	
	US T N/B 2.875 05/15/28	5,000,000.000	5,847,265.600	
	US T N/B 2.875 08/15/28	5,000,000.000	5,866,406.250	
	US T N/B 3.125 11/15/28	5,000,000.000	5,983,984.350	
アメリカ・ドル	小計	58,400,000.000 (6,166,456,000)	64,651,781.100 (6,826,581,566)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,300,000.000	1,387,365.200	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	800,000.000	867,952.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,000,000.000	1,126,588.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	700,000.000	912,520.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,200,000.000	1,775,340.000	
イギリス・ポンド	小計	5,000,000.000 (683,950,000)	6,069,765.200 (830,283,182)	
カナダ・ドル	CANADA 1.25 06/01/30	1,500,000.000	1,598,265.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,500,000.000	1,674,540.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	2,000,000.000	2,294,300.000	
カナダ・ドル	小計	5,000,000.000 (400,400,000)	5,567,105.000 (445,813,768)	
ユーロ	DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,000,000.000	2,122,280.000	
	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,700,000.000	1,841,484.710	
	DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,000,000.000	2,156,640.000	
	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,500,000.000	1,640,565.000	
	DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,500,000.000	2,725,147.500	
	DEUTSCHLAND 08/15/29	2,500,000.000	2,657,034.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	900,000.000	1,293,399.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,000,000.000	1,474,420.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,900,000.000	3,155,330.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,000,000.000	1,503,000.000	
	FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,300,000.000	3,425,779.500	
	FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,000,000.000	3,251,663.100	
	FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,000,000.000	3,296,286.000	
	FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,500,000.000	3,859,555.000	
	FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,000,000.000	3,851,024.400	
	FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,954,624.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	4,564,635.000		

	ITALY BTPS 1.35 04/01/30	2,000,000.000	2,131,090.000	
	ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,000,000.000	2,223,122.000	
	ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,000,000.000	2,224,208.000	
	ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,000,000.000	1,120,900.000	
	ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,000,000.000	2,363,400.000	
	ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,000,000.000	2,415,450.000	
	ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,000,000.000	2,521,579.400	
	ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.000	2,655,168.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,000,000.000	2,819,200.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,000,000.000	2,837,400.000	
	ユーロ 小計	58,800,000.000 (7,310,604,000)	71,084,384.610 (8,837,921,540)	
国債証券 合計		14,561,410,000 (14,561,410,000)	16,940,600,056 (16,940,600,056)	
合計			16,940,600,056 (16,940,600,056)	

(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 12銘柄	39.56	40.30
イギリス・ポンド	国債証券 5銘柄	4.81	4.90
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	2.58	2.63
ユーロ	国債証券 27銘柄	51.21	52.17

(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)

令和2年10月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,374,297
コール・ローン	1,245,704
投資証券	602,349,976
未収配当金	509,219
流動資産合計	608,479,196
資産合計	608,479,196
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	368,112,178
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	240,367,018
元本等合計	608,479,196
純資産合計	608,479,196
負債純資産合計	608,479,196

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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	令和2年10月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	433,900,439円
同期中追加設定元本額	1,255,673円
同期中一部解約元本額	67,043,934円
元本の内訳	
ファンド名	
新光7資産バランスファンド	362,317,942円
グローバル・ナビ	5,794,236円
計	368,112,178円
2. 受益権の総数	368,112,178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 令和2年4月21日 至 令和2年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	令和2年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年10月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	64,562,208
合計	64,562,208

(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(令和1年10月22日から令和2年10月20日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和2年10月20日現在
1口当たり純資産額	1.6530円
(1万口当たり純資産額)	(16,530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

令和2年10月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	451.000	4,365.680	
		AGREE REALTY CORP	283.000	18,392.170	

ALEXANDER & BALDWIN INC	380.000	4,544.800	
ALEXANDER'S INC.	11.000	2,653.200	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	669.000	106,063.260	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	267.000	6,301.200	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	731.000	26,169.800	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	591.000	3,504.630	
AMERICAN HOMES 4 RENT	1,387.000	39,973.340	
AMERICAN TOWER CORP	2,362.000	565,935.200	
AMERICOLD REALTY TRUST	1,088.000	39,527.040	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	791.000	26,142.550	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,120.000	11,121.600	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	309.000	2,672.850	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	752.000	109,348.320	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	144.000	1,188.000	
BOSTON PROPERTIES INC	831.000	63,156.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	900.000	8,973.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,582.000	17,686.760	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	245.000	3,329.550	
BRT APARTMENTS CORP	60.000	720.600	
CAMDEN PROPERTY TRUST	504.000	45,858.960	
CARETRUST REIT INC	507.000	8,859.820	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	271.000	2,235.750	
CHATHAM LODGING TRUST	246.000	1,800.720	
CITY OFFICE REIT INC	227.000	1,564.030	
CLIPPER REALTY INC	88.000	531.520	
COLONY CAPITAL INC	2,578.000	7,888.680	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	608.000	6,511.680	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	1,026.000	10,311.300	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	112.000	5,312.160	
CORECIVIC INC	659.000	5,034.760	
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	79.000	411.590	
COREPOINT LODGING INC	245.000	1,296.050	
CORESITE REALTY CORP	215.000	26,885.750	

CORPORATE OFFICE PROPERTIES	600.000	14,166.000	
COUSINS PROPERTIES INC	791.000	21,451.920	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2,224.000	365,447.680	
CUBESMART	1,032.000	34,633.920	
CYRUSONE INC	623.000	48,083.140	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,061.000	5,060.970	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,429.000	221,752.220	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	1,259.000	4,053.980	
DOUGLAS EMMETT INC	889.000	21,531.580	
DUKE REALTY TRUST	1,968.000	75,571.200	
EAST GROUP	205.000	28,048.100	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	425.000	9,235.250	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	781.000	4,951.540	
EPR PROPERTIES	395.000	8,642.600	
EQUINIX INC	471.000	381,510.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	929.000	58,527.000	
EQUITY RESIDENTIAL	1,964.000	99,594.440	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	485.000	8,962.800	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	349.000	69,471.940	
EXTRA SPACE STORAGE INC	674.000	76,654.020	
FARMLAND PARTNERS INC	139.000	925.740	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	402.000	29,510.820	
FIRST INDUSTRIAL RT	674.000	27,741.840	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	374.000	9,974.580	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	574.000	2,244.340	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	274.000	3,682.560	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,114.000	41,318.260	
GEO GROUP INC	626.000	6,441.540	
GETTY REALTY CORP	185.000	4,630.550	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	179.000	3,043.000	
GLADSTONE LAND CORP	113.000	1,611.380	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	236.000	3,169.480	
GLOBAL NET LEASE INC	479.000	7,319.120	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	718.000	21,224.080	

HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,161.000	29,141.100	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,881.000	76,461.740	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	210.000	1,045.800	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	549.000	17,782.110	
HOST HOTELS & RESORTS INC	3,735.000	39,852.450	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	802.000	16,296.640	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	504.000	5,796.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	345.000	7,362.300	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	68.000	4,688.600	
INVITATION HOMES INC	3,000.000	83,010.000	
IRON MOUNTAIN INC	1,528.000	41,760.240	
JBG SMITH PROPERTIES	651.000	16,470.300	
JERNIGAN CAPITAL INC	119.000	2,046.800	
KILROY REALTY CORP	614.000	30,411.420	
KIMCO REALTY	2,206.000	24,111.580	
KITE REALTY GROUP TRUST	458.000	5,060.900	
LAMAR ADVERTISING CO	459.000	29,991.060	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,453.000	15,024.020	
LIFE STORAGE INC	249.000	28,371.060	
LTC PROPERTIES INC	206.000	7,014.300	
MACK CALI	461.000	5,366.040	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,778.000	49,115.040	
MID AMERICA	609.000	71,667.120	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	504.000	7,141.680	
NATIONAL HEALTH INVS INC	229.000	12,975.140	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	915.000	30,771.450	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	329.000	10,722.110	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	435.000	1,744.350	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	115.000	4,964.550	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	254.000	5,120.640	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	1,202.000	35,350.820	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	95.000	1,524.750	
OUTFRONT MEDIA INC	768.000	10,490.880	
PARAMOUNT GROUP INC	1,011.000	6,611.940	

PARK HOTELS & RESORTS INC	1,256.000	12,095.280	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	691.000	8,340.370	
PHYSICIANS REALTY TRUST	1,109.000	19,407.500	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	670.000	8,616.200	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	80.000	1,000.800	
POTLATCH CORP	348.000	15,851.400	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	280.000	1,484.000	
PROLOGIS INC	3,941.000	406,001.820	
PS BUSINESS PARKS	107.000	12,321.050	
PUBLIC STORAGE	806.000	186,339.140	
QTS REALTY TRUST INC	325.000	21,323.250	
RAYONIER INC	705.000	19,458.000	
REALTY INCOME CORP	1,838.000	107,982.500	
REGENCY CENTERS CORP	900.000	33,300.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	606.000	6,217.560	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,139.000	6,218.940	
RETAIL VALUE INC	91.000	1,161.160	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	660.000	32,043.000	
RLJ LODGING TRUST	872.000	7,255.040	
RPT REALTY	432.000	2,168.640	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	268.000	10,776.280	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,091.000	14,946.700	
SAFEHOLD INC	92.000	6,013.120	
SAUL CENTERS INC	63.000	1,616.580	
SBA COMMUNICATIONS CORP	591.000	181,897.980	
SERVICE PROPERTIES TRUST	871.000	6,785.090	
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,626.000	103,917.660	
SITE CENTERS CORP	834.000	5,996.460	
SL GREEN	390.000	17,787.900	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	549.000	17,705.250	
STAG INDUSTRIAL INC	796.000	25,328.720	
STORE CAPITAL CORP	1,245.000	33,303.750	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	573.000	2,956.680	
SUN COMMUNITIES INC	516.000	74,665.200	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,142.000	8,622.100	
TANGER FACTORY OUTLET	499.000	3,063.860	
TAUBMAN CENTERS INC	320.000	10,844.800	

	TERRENO REALTY CORP	354.000	21,091.320	
	THE MACERICH COMPANY	785.000	5,699.100	
	UDR INC	1,565.000	50,299.100	
	UMH PROPERTIES INC	195.000	2,679.300	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	71.000	3,808.440	
	URBAN EDGE PROPERTIES	617.000	6,071.280	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	158.000	1,505.740	
	VENTAS INC	1,995.000	82,333.650	
	VEREIT INC	5,768.000	37,780.400	
	VICI PROPERTIES INC	2,858.000	66,162.700	
	VORNADO REALTY TRUST	937.000	30,536.830	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,143.000	697.230	
	WASHINGTON REIT	438.000	8,282.580	
	WEINGARTEN REALTY INVST	648.000	10,225.440	
	WELLTOWER INC	2,235.000	117,516.300	
	WEYERHAEUSER CO	3,992.000	116,965.600	
	WHITESTONE REIT	234.000	1,404.000	
	WP CAREY INC	914.000	59,885.280	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	602.000	5,129.040	
	アメリカ・ドル 小計	131,694.000	5,704,611.950 (602,349,976)	
投資証券 合計		131,694	602,349,976 (602,349,976)	
合計			602,349,976 (602,349,976)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資証券 159銘柄	98.99	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。

(参考)

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

「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、ケイマン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの2020年5月31日現在の財務書類は、国際財務報告基準に従い作成されており、独立監査人の監査を受けております。

同ファンドの「財政状態計算書」及び「投資ポートフォリオ」は、2020年5月31日現在の財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋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

2020年5月31日現在

	2020年 (日本円)	2019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	23,312,508,302	28,798,229,550
ブローカーに対する債権	302,000,000	-
現金および現金同等物	631,504,565	1,612,634,555
その他の債権	79,302	585,504
資産合計	<u>24,246,092,169</u>	<u>30,411,449,609</u>
負債		
流動負債		
未払解約金	303,520,000	-
ブローカーに対する債務	341,308,763	320,660,640
未払費用	27,096,268	37,865,210
負債合計	<u>671,925,031</u>	<u>358,525,850</u>
受益証券保有者に帰属する純資産	<u>23,574,167,138</u>	<u>30,052,923,759</u>

## 投資ポートフォリオ(無監査)

2020年5月31日終了会計年度

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
<b>債券</b>		
<b>アンゴラ</b>		
Angolan Government International Bond 8.00% due 26/11/2029 REGS	485,754,341	-
Angolan Government International Bond 9.50% due 26/11/2029 REGS	-	1,065,202,163
<b>アンゴラ合計</b>	<b>485,754,341</b>	<b>1,065,202,163</b>
<b>アルゼンチン</b>		
Argentina Treasury Bill 0% due 28/06/2019 TBLM	-	307,882,633
Argentina Treasury Bill 0% due 30/04/2020	-	32,785,893
Bonos De La Nacion Argentina En Moneda Dua 4.50% due 13/02/2020	-	264,109,932
Provincia Del Chubut Argentina 7.75% due 26/07/2026 REGS	69,966,794	548,624,657
Provincia De Tierra Del Fuego Argentina 8.95% due 17/04/2027 REGS	259,937,602	487,837,514
Republic of Argentina 5.875% due 11/01/2028	-	287,071,653
<b>アルゼンチン合計</b>	<b>329,904,396</b>	<b>1,928,312,282</b>
<b>アルメニア</b>		
Republic of Armenia International Bond 7.15% due 26/03/2025 REGS	622,962,259	827,802,600
<b>アルメニア合計</b>	<b>622,962,259</b>	<b>827,802,600</b>
<b>アゼルバイジャン</b>		
International Bank of Azerbaijan Ojsc 5.625% due 11/06/2019 REGS	542,151,550	519,343,303
Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026 REGS	402,534,028	400,528,873
<b>アゼルバイジャン合計</b>	<b>944,685,578</b>	<b>919,872,176</b>
<b>ベラルーシ</b>		
Development Bank of the Republic of Belarus JSC 12.00% due 15/05/2022 REGS	288,837,645	322,243,961
Republic of Belarus International Bond 6.20% due 28/02/2030 REGS	325,231,856	331,102,508
<b>ベラルーシ合計</b>	<b>614,069,501</b>	<b>653,346,469</b>
<b>ボスニア・ヘルツェゴビナ</b>		
Bosnia and Herzegovina due 20/12/2021 REGS	242,154,573	350,021,453
<b>ボスニア・ヘルツェゴビナ合計</b>	<b>242,154,573</b>	<b>350,021,453</b>
<b>ブラジル</b>		
Brazil Republic of 2.625% due 05/01/2023	-	149,837,903
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 8.20% due 06/04/2028 REGS	374,919,491	409,907,720
<b>ブラジル合計</b>	<b>374,919,491</b>	<b>559,745,623</b>
<b>カメルーン</b>		
Republic of Cameroon International Bond 9.50% due 19/11/2025 REGS	494,795,841	541,505,227
<b>カメルーン合計</b>	<b>494,795,841</b>	<b>541,505,227</b>

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
<b>債券（続き）</b>		
<b>中国</b>		
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.875% due 14/03/2025 REGS	632,529,013	613,168,580
中国合計	632,529,013	613,168,580
<b>コロンビア</b>		
Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS	446,615,163	494,730,326
Ecopetrol SA 4.125% due 16/01/2025	317,674,883	315,553,418
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	361,617,331	368,005,979
Republic of Colombia 4.375% due 12/07/2021	284,013,947	294,754,675
コロンビア合計	1,409,921,324	1,473,044,398
<b>ドミニカ共和国</b>		
Dominican Republic 8.90% due 15/02/2023 REGS	249,397,178	318,587,731
Dominican Republic International Bond 9.75% due 05/06/2026 REGS	295,130,796	302,750,138
Mestenio Ltd 8.50% due 02/01/2020 REGS	-	35,695,093
ドミニカ共和国合計	544,527,974	657,032,962
<b>エジプト</b>		
Egypt Government Bond 16.40% due 05/09/2020	64,671,809	60,063,858
Egypt Government Bond 18.15% due 13/06/2020	196,721,094	188,383,591
Egypt Government International Bond 7.625% due 29/05/2032 REGS	185,510,495	-
Egypt Treasury Bills 0% due 15/09/2020 TBLM	478,981,784	392,493,699
エジプト合計	925,885,182	640,941,148
<b>エルサルバドル</b>		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035 REGS	436,469,319	255,474,237
エルサルバドル合計	436,469,319	255,474,237
<b>エチオピア</b>		
Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	580,035,583	627,971,988
エチオピア合計	580,035,583	627,971,988
<b>ガボン</b>		
Republic of Gabon 6.95% due 16/06/2025 REGS	-	92,049,636
ガボン合計	-	92,049,636
<b>ジョージア</b>		
Georgian Oil & Gas Corp 6.75% due 26/04/2021 REGS	290,167,017	306,311,752
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022 REGS	134,925,770	144,339,258
ジョージア合計	425,092,787	450,651,010
<b>ガーナ</b>		
Ghana Government International Bond 8.125% due 18/01/2026 REGS	216,847,700	229,924,005
Ghana Govt 18.25% due 25/07/2022	500,039,599	527,088,575
Ghana Govt 24.75% due 19/07/2021	69,122,267	76,690,000
Saderea DAC 12.50% due 30/11/2026 REGS	81,567,131	89,813,011
ガーナ合計	867,576,697	923,515,591

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
<b>債券(続き)</b>		
<b>インドネシア</b>		
Government of Indonesia 3.375% due 15/04/2023 REGS	448,853,600	437,259,848
インドネシア合計	448,853,600	437,259,848
<b>イラク</b>		
Oilflow SPV 1 DAC (Krg) 12.00% due 13/01/2022 REGS	-	197,444,218
Republic of Iraq 5.80% due 15/01/2028 REGS	-	245,435,984
イラク合計	-	442,880,202
<b>ジャマイカ</b>		
Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045	258,602,840	253,645,523
ジャマイカ合計	258,602,840	253,645,523
<b>ヨルダン</b>		
Jordan Kingdom 6.125% due 29/01/2026 REGS	441,160,766	445,982,637
ヨルダン合計	441,160,766	445,982,637
<b>カザフスタン</b>		
Astana Finance JSC 0% due 22/12/2024 REGS	3,265,620	3,281,544
Development Bank of Kazakhstan JSC 9.50% due 14/12/2020 REGS	138,100,748	156,682,645
Kazakhstan Government International Bond 4.875% due 14/10/2044 REGS	571,183,053	492,598,640
Kazakhstan Temir Zholy Finance Bv 6.95% due 10/07/2042 REGS	254,054,643	239,464,727
Kazakhstan Temir Zholy National Co JSC 4.85% due 17/11/2027 REGS	-	237,796,807
カザフスタン合計	966,604,064	1,129,824,363
<b>ケニア</b>		
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	321,307,925	340,917,904
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 12/05/2025	274,710,911	305,284,470
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 10/01/2033	81,006,407	89,591,450
ケニア合計	677,025,243	735,793,824
<b>メキシコ</b>		
Mexican Bonos 8.50% due 31/05/2029	993,848,490	-
Mexico City Airport Trust 4.25% due 31/10/2026 REGS	98,909,026	107,140,416
Mexico City Airport Trust 5.50% due 31/07/2047 REGS	175,559,483	199,025,486
Mexican Fixed Rate Bonds 5.00% due 11/12/2019	-	1,002,636,308
Mexican Udibonos 4.50% due 04/12/2025 Index Linked To Mxudi	90,420,623	93,667,646
メキシコ合計	1,358,737,622	1,402,469,856

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
<b>債券（続き）</b>		
<b>モザンビーク</b>		
Mozambique International Bond 10.50% due 18/01/2023 REGS	-	377,219,062
モザンビーク合計	-	377,219,062
<b>パラグアイ</b>		
Rutas 2 and 7 Finance Ltd 0% due 30/09/2036 REGS	280,891,783	-
パラグアイ合計	280,891,783	-
<b>ペルー</b>		
Iirsa Norte Finance Ltd 8.75% due 30/05/2024 REGS	207,322,503	271,275,755
Lima Metro Line 2 Finance Ltd 5.875% due 05/07/2034 REGS	336,902,878	584,018,145
Peruvian Government International Bond 6.35% due 12/08/2028 REGS	441,325,969	416,522,832
ペルー合計	985,551,350	1,271,816,732
<b>ロシア</b>		
Rzd Capital PLC (Russian Railways) 5.70% due 05/04/2022 REGS	428,466,890	423,782,582
ロシア合計	428,466,890	423,782,582
<b>南アフリカ</b>		
Government of South Africa 4.30% due 12/10/2028	567,209,588	596,453,306
Government of South Africa 7.00% due 28/02/2031	1,135,602,453	1,263,677,457
南アフリカ合計	1,702,812,041	1,860,130,763
<b>国際機関</b>		
Banque Ouest Africaine De Development 5.00% due 27/07/2027 REGS	330,709,228	336,141,815
European Bank for Reconstruction & Development 6.85% due 21/06/2021	318,256,025	328,527,087
European Bank for Reconstruction & Development 8.30% due 02/10/2020	166,323,419	171,977,887
European Bank for Reconstruction & Development 27.50% due 11/09/2020	569,640,669	-
European Bank for Reconstruction & Development 28.50% due 10/07/2019	-	722,317,180
International Bank for Reconstruction and Development 9.00% due 26/02/2021 REGS	288,045,406	315,227,056
Inter-American Development Bank 8.01% due 11/12/2021 REGS	127,398,191	-
国際機関合計	1,800,372,938	1,874,191,025
<b>スリナム</b>		
Government of Suriname 9.25% due 26/10/2026 REGS	105,724,168	287,684,786
Suriname Government International Bond 9.875% due 30/12/2023 REGS	82,887,763	-
スリナム合計	188,611,931	287,684,786

	公正価値 2020年 (日本円)	公正価値 2019年 (日本円)
債券(続き)		
トリニダード・トバゴ		
Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 REGS	-	757,689,459
Trinidad Petroleum Holdings Ltd 9.75% due 15/06/2026 REGS	615,733,670	-
トリニダード・トバゴ合計	615,733,670	757,689,459
チュニジア		
Banque Cent de Tunisie International Bond 5.75% due 30/01/2025 REGS	689,988,228	699,545,726
チュニジア合計	689,988,228	699,545,726
トルコ		
Government of Turkey 4.875% due 16/04/2043	558,493,072	562,335,419
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS 6.125% due 03/05/2024 REGS	325,402,681	303,554,731
トルコ合計	883,895,753	865,890,150
ウガンダ		
Republic of Uganda Government Bonds 13.75% due 13/06/2019	-	215,169,308
ウガンダ合計	-	215,169,308
ウクライナ		
KYIV Finance PLC (CITY OF KIEV) 7.50% due 15/12/2022 REGS	539,609,503	606,868,138
Ukraine Government 7.375% due 25/09/2032 REGS	-	514,370,192
ウクライナ合計	539,609,503	1,121,238,330
ウルグアイ		
Uruguay Republic of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked	901,681,330	899,655,404
ウルグアイ合計	901,681,330	899,655,404
債券合計	23,099,883,411	28,081,527,123
原油ワラント		
ナイジェリア		
Nigeria Central Bank of WRD Exp 15/11/2020 REGS	165,561,307	600,373,862
ナイジェリア合計	165,561,307	600,373,862
ベネズエラ		
Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020	47,063,584	116,328,565
ベネズエラ合計	47,063,584	116,328,565
原油ワラント合計	212,624,891	716,702,427
投資ポートフォリオ	23,312,508,302	28,798,229,550

(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】

令和2年10月30日現在

資産総額	4,232,435,053円
負債総額	19,116,013円
純資産総額（ - ）	4,213,319,040円
発行済数量	4,830,768,599口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8722円

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

令和2年10月30日現在

資産総額	2,386,030,690円
負債総額	3,477,154円
純資産総額（ - ）	2,382,553,536円
発行済数量	1,093,959,319口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1779円

新光日本債券インデックスマザーファンド

令和2年10月30日現在

資産総額	8,799,297,850円
負債総額	10,391,900円
純資産総額（ - ）	8,788,905,950円
発行済数量	6,845,240,491口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2839円

新光J - R E I Tマザーファンド

令和2年10月30日現在

資産総額	1,458,975,447円
負債総額	3,014,713円
純資産総額（ - ）	1,455,960,734円
発行済数量	834,074,861口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7456円

新光外国株式インデックスマザーファンド

令和2年10月30日現在

資産総額	1,857,000,534円
負債総額	4,446,220円
純資産総額（ - ）	1,852,554,314円
発行済数量	727,252,128口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5473円

海外国債マザーファンド

令和2年10月30日現在

資産総額	16,944,014,919円
負債総額	5,400,000円
純資産総額（ - ）	16,938,614,919円
発行済数量	6,821,152,033口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4832円

## 新光米国REITマザーファンド

令和2年10月30日現在

資産総額	583,904,168円
負債総額	78円
純資産総額( - )	583,904,090円
発行済数量	368,112,178口
1口当たり純資産額( / )	1.5862円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

### (7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額(2020年10月30日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構(2020年10月30日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年10月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,349,996,407,143
追加型株式投資信託	852	13,896,345,858,304
単位型公社債投資信託	35	77,756,605,656
単位型株式投資信託	193	1,262,956,120,495
合計	1,106	16,587,054,991,598

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千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35期事業年度(自2019年4月1日至2020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36期中間会計期間(自2020年4月1日至2020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：千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
1 建物	1,096,916	1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
1,522,040	221,784	
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
4,499,196	5,299,196	
長期差入保証金	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1,749		4,440
受取配当金		73,517		11,185
時効成立分配金・償還金		8,582		49,164
投資信託償還益		-		5,528
受取負担金		177,066		297,886
雑収入		24,919		7,394
時効後支払損引当金戻入額		19,797		3,473
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損		17,542		19,750
投資信託償還損		-		1
金銭の信託運用損		175,164		169,505
システム解約料		-		31,680
雑損失		5,659		104
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益		353,644		1,169,758
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1	19,121	1	16,085
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

## (3)【株主資本等変動計算書】

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	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	研究開発 積立金	運用責任 準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			-	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	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		別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	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	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

## 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 時価のあるもの：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） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、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。</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. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

**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

(千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

## (損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

## (株主資本等変動計算書関係)

## 第34期(自2018年4月1日至2019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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種 類株式					

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21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  
2020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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

第34期(2019年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

第35期(2020年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

## 負債

## (1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 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34期(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

第35期(2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

## 2. その他有価証券

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

(注)非上場株式(貸借対照表計上額276,764千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

(注) 投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、償還によるものであります。

(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

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

(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

(千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳  
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

## (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	76,224,837千円
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	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(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	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

## (2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64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	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,241,252千円	5,149,555千円

(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。

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
子 会 社	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	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
								子会社株式 の取得	10,294,840	未払 手数料	1,231,431
子 会 社	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

## 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) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

(注3) 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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,281,363
金銭の信託		25,870,423
有価証券		996
未収委託者報酬		13,747,204
未収運用受託報酬		3,023,356
未収投資助言報酬		304,673
未収収益		24,940
前払費用		757,672
その他		2,912,168
	流動資産計	73,922,799
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	961,771
器具備品	1	237,569
無形固定資産		
ソフトウェア		3,099,921
ソフトウェア仮勘定		556,224
電話加入権		3,931
投資その他の資産		
投資有価証券		261,361
関係会社株式		5,299,196
長期差入保証金		1,295,930
繰延税金資産		2,294,343
その他		793,037
	固定資産計	14,803,286
	資産合計	88,726,085

(単位:千円)

	第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,297,202
未払金	5,820,782
未払収益分配金	899
未払償還金	19,850
未払手数料	5,549,722
その他未払金	250,310
未払費用	7,902,650
未払法人税等	2,901,506
未払消費税等	824,900
前受収益	20,779
賞与引当金	1,126,713
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	19,928,648
固定負債	
退職給付引当金	2,207,043
時効後支払損引当金	156,886
固定負債計	2,363,929
負債合計	22,292,578
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	44,880,558
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	44,757,265
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	13,077,265
株主資本計	66,433,515
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	8
評価・換算差額等計	8
純資産合計	66,433,506
負債・純資産合計	88,726,085

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	40,520,928	
運用受託報酬	6,813,891	
投資助言報酬	548,146	
その他営業収益	773,786	
	営業収益計	48,656,752
営業費用		
支払手数料	16,685,574	
広告宣伝費	116,359	
調査費	12,452,140	
調査費	4,305,114	
委託調査費	8,147,025	
委託計算費	269,176	
営業雑経費	450,999	
通信費	24,247	
印刷費	314,201	
協会費	20,394	
諸会費	32,852	
支払販売手数料	59,302	
	営業費用計	29,974,250
一般管理費		
給料	4,693,004	
役員報酬	75,939	
給料・手当	4,496,351	
賞与	120,714	
交際費	5,108	
寄付金	6,331	
旅費交通費	20,383	
租税公課	277,754	
不動産賃借料	734,008	
退職給付費用	267,068	
固定資産減価償却費	1 534,020	
福利厚生費	17,379	
修繕費	511	
賞与引当金繰入額	1,126,713	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	139	
事務委託費	1,899,643	
事務用消耗品費	35,787	
器具備品費	265	
諸経費	66,792	
	一般管理費計	9,719,026
営業利益		8,963,474

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	17,653	
受取配当金	2,356	
時効成立分配金・償還金	176	
時効後支払損引当金戻入額	16,343	
為替差益	8,484	
金銭の信託運用損益	1,367,091	
雑収入	1,361	
営業外収益計		1,413,467
経常利益		10,376,942
特別損失		
固定資産除却損	0	
特別損失計		0
税引前中間純利益		10,376,942
法人税、住民税及び事業税		2,957,106
法人税等調整額		213,661
法人税等合計		3,170,767
中間純利益		7,206,174

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

	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	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,000,000
中間純利益							7,206,174
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,793,825
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	13,077,265

	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	49,674,383	71,227,341	7	7	71,227,333
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,000,000	12,000,000			12,000,000
中間純利益	7,206,174	7,206,174			7,206,174
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	4,793,825	4,793,825	0	0	4,793,826
当中間期末残高	44,800,558	66,433,515	8	8	66,433,506

## 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 時価のあるもの：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） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 …… 6～18年 器具備品 …… 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</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。 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。 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. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

項目	第36期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	365,042千円
	器具備品	980,577千円

## （中間損益計算書関係）

項目	第36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1. 減価償却実施額	有形固定資産	79,115千円
	無形固定資産	454,905千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## （1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当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36期中間会計期間末(2020年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

2020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。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	27,281,363	27,281,363	-
(2) 金銭の信託	25,870,423	25,870,423	-
(3) 未収委託者報酬	13,747,204	13,747,204	-
(4) 未収運用受託報酬	3,023,356	3,023,356	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,987	2,987	-
資産計	69,925,335	69,925,335	-
(1) 未払手数料	5,549,722	5,549,722	-
負債計	5,549,722	5,549,722	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

**負債**

(1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	259,369
関係会社株式	5,299,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(有価証券関係)

第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)			
1. 子会社株式			
関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
2. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
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	2,987	3,000	12
小計	2,987	3,000	12
合計	2,987	3,000	12
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

## （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

2020年4月1日から2020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 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (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 76,224,837千円

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 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(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 53,030,000千円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

## 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	- 千円
固定資産	90,405,440千円
資産合計	90,405,440千円
流動負債	- 千円
固定負債	7,722,834千円
負債合計	7,722,834千円
純資産	82,682,605千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額60,979,870千円及び顧客関連資産の金額32,301,694千円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,411,813千円
経常利益	4,411,813千円
税引前中間純利益	4,411,813千円
中間純利益	3,644,417千円
1株当たり中間純利益	91,110円42銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,508,336千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。

(セグメント情報等)

第36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,660,837円67銭
1株当たり中間純利益金額	180,154円36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いません。

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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益金額	7,206,174千円
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	7,206,174千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
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) 三井住友信託銀行株式会社(「受託者」)

## a. 資本金の額

2020年3月末日現在、342,037百万円

## b. 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) 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(「投資顧問会社」)

## a. 資本金の額

2020年3月末日現在、300万ポンド

## b. 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。

## (3) 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( )	14,577	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
永和証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡安証券株式会社	650	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
あかつき証券株式会社	3,067	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
大山日ノ丸証券株式会社	215	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
西村証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
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2020年3月末日現在

( ) 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【関係業務の概要】

「受託者」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

「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

「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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2020年5月8日	臨時報告書
2020年7月20日	有価証券報告書
2020年7月20日	有価証券届出書
2020年8月5日	臨時報告書

## 独立監査人の監査報告書

2020年5月27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 山野 浩 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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2020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。

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 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) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

令和2年11月27日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印  
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令和2年4月21日から令和2年10月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの令和2年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2020年11月26日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	丘本 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬 印

#### 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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間(2020年4月1日から2020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2020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(2020年4月1日から2020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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 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) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。