

新光7資産 バランスファンド

愛称：七重奏

追加型投信／内外／資産複合

- この目論見書により行う「新光7資産バランスファンド」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2024年1月19日に関東財務局長に提出しており、2024年1月20日にその効力が生じております。
- 「新光7資産バランスファンド」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

アセットマネジメントOne株式会社

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
ファンドは、課税上「株式投資信託」として取り扱われます。

■委託会社への照会先

【コールセンター】 **0120-104-694** (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

【ホームページアドレス】 <https://www.am-one.co.jp/>

| | |
|---------------------|-------------------|
| 発行者名 | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 代表者の役職氏名 | 取締役社長 杉原 規之 |
| 本店の所在の場所 | 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号 |
| 有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 | 該当事項はありません。 |

目 次

| | |
|---------------------|-----|
| 第一部【証券情報】 | 1 |
| 第二部【ファンド情報】 | 4 |
| 第1【ファンドの状況】 | 4 |
| 第2【管理及び運営】 | 71 |
| 第3【ファンドの経理状況】 | 78 |
| 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】 | 191 |
| 第三部【委託会社等の情報】 | 193 |
| 第1【委託会社等の概況】 | 193 |
| 約款 | 239 |

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

新光7資産バランスファンド

愛称として「七重奏」という名称を用いることがあります。

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

(イ) 追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

(ロ) 当初元本は1口当たり1円です。

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

(イ) 発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。)

インターネットホームページ

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

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

(5) 【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

(6) 【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

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

(7) 【申込期間】

2024年1月20日から2024年7月22日までです。

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

(8) 【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所（販売会社）については、下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。)

インターネットホームページ

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

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

■商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

■商品分類の定義

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

■属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

■属性区分の定義

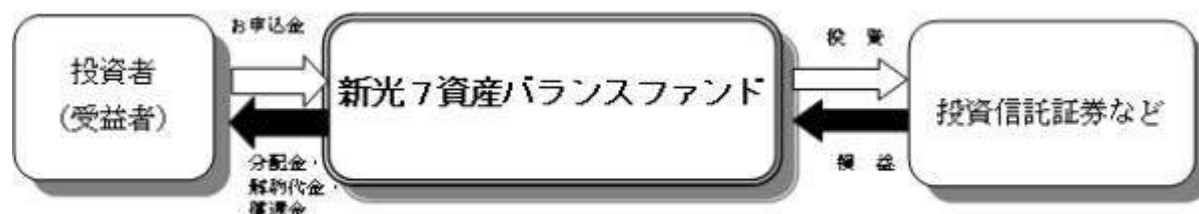
| | |
|---|--|
| <p>その他資産 （投資信託証券（資産複 合（株式 一般、債券 一般、不動産投信）） （資産配分固定型））</p> | <p>投資信託証券への投資を通じて、実質的に株式 一般、債券 一 般、不動産投信の複数の資産に投資を行います。 資産配分固定型とは、目論見書または投資信託約款において、複数 資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載が あるものをいう。</p> |
| <p>年12回（毎月）</p> | <p>目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨 の記載があるものをいう。</p> |
| <p>グローバル（含む日本） エマージング</p> | <p>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。</p> |
| <p>ファンド・オブ・ファンズ</p> | <p>「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。</p> |
| <p>為替ヘッジなし（注）</p> | <p>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。</p> |

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

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

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

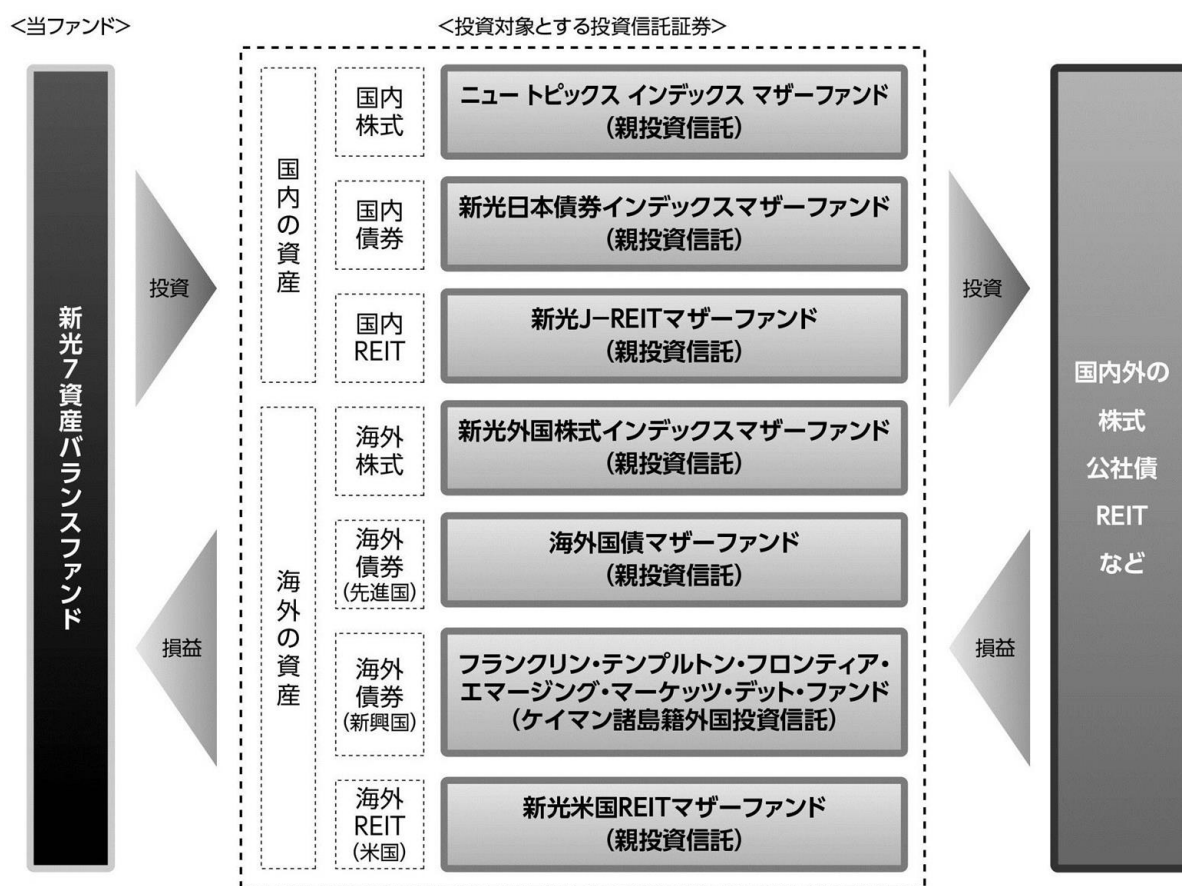
当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



b. ファンドの特色

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

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

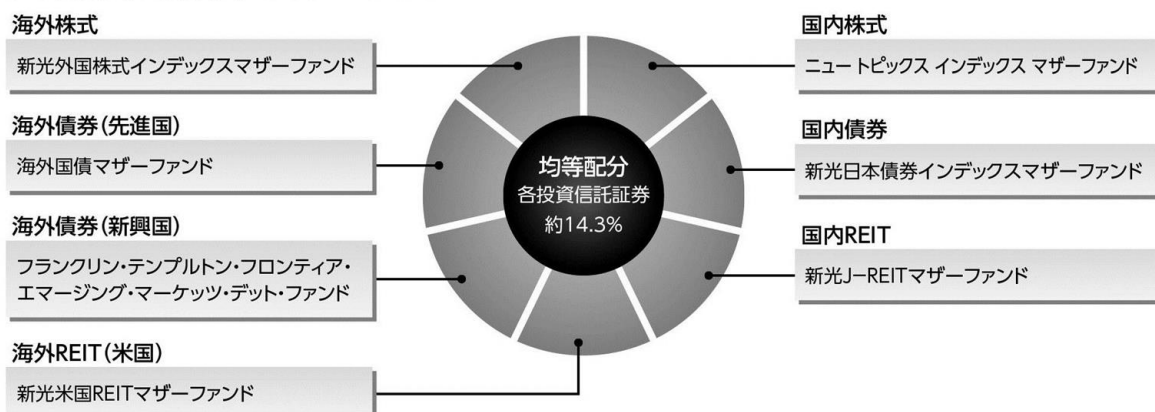


2 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は均等とします。

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

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



■ 分配方針

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



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

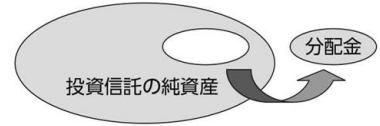
※運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



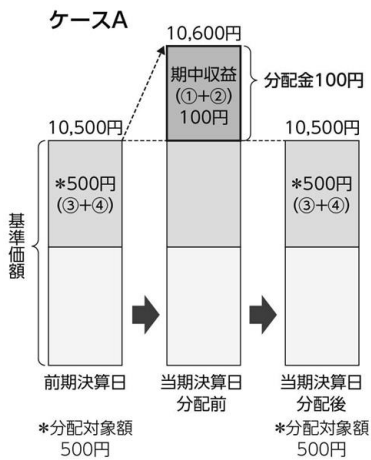
◆分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係(イメージ)

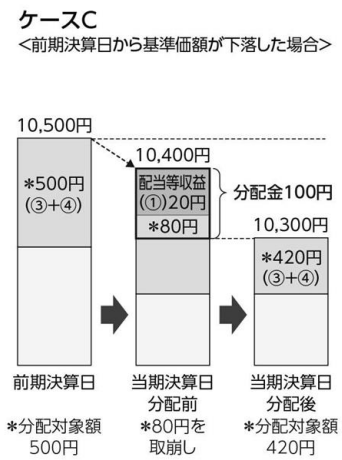
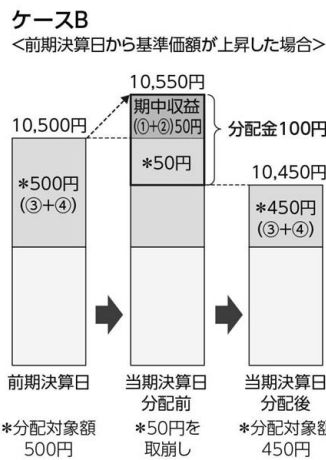
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



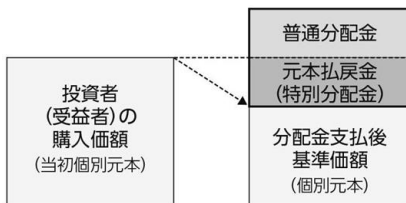
上記のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

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

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

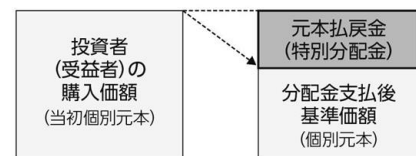
◆投資者(受益者)のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

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。

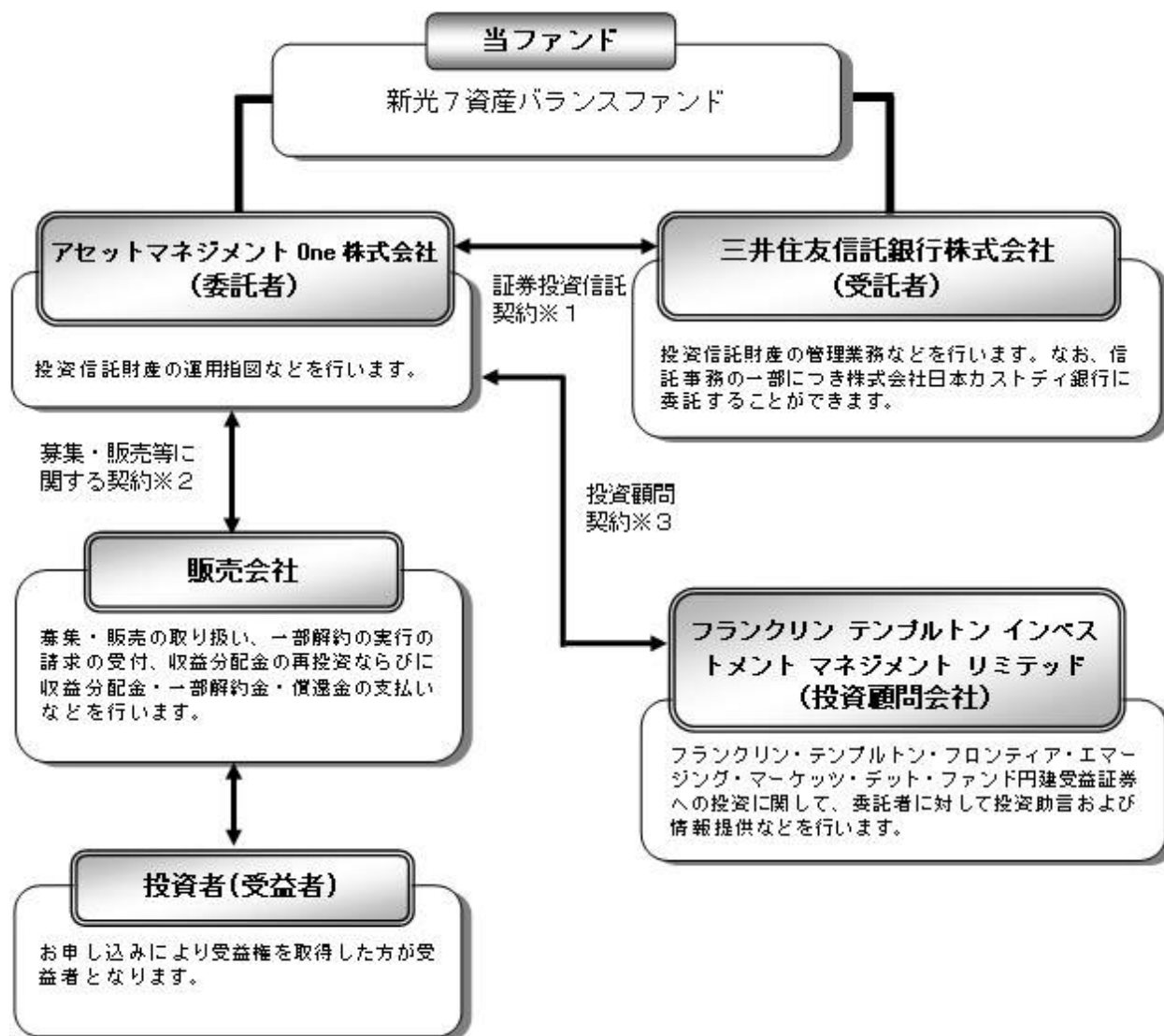
元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(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（2023年10月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2023年10月31日現在)

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

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

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

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

| | |
|-----------------|------------------------------|
| 内国証券投資信託（親投資信託） | ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券 |
|-----------------|------------------------------|

| | |
|-----------------|-------------------------|
| 内国証券投資信託（親投資信託） | 新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券 |
|-----------------|-------------------------|

| | |
|-----------------|--------------------------|
| 内国証券投資信託（親投資信託） | 新光 J-R E I T マザーファンド受益証券 |
|-----------------|--------------------------|

| | |
|-----------------|-------------------------|
| 内国証券投資信託（親投資信託） | 新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券 |
|-----------------|-------------------------|

| | |
|-----------------|-----------------|
| 内国証券投資信託（親投資信託） | 海外国債マザーファンド受益証券 |
|-----------------|-----------------|

| | |
|---------------|--|
| ケイマン諸島籍外国投資信託 | フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド円建受益証券 |
|---------------|--|

| | |
|-----------------|--------------------------|
| 内国証券投資信託（親投資信託） | 新光米国 R E I T マザーファンド受益証券 |
|-----------------|--------------------------|

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

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

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

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

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

(2) 【投資対象】

a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

b. 運用の指図範囲

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

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

東証株価指数について

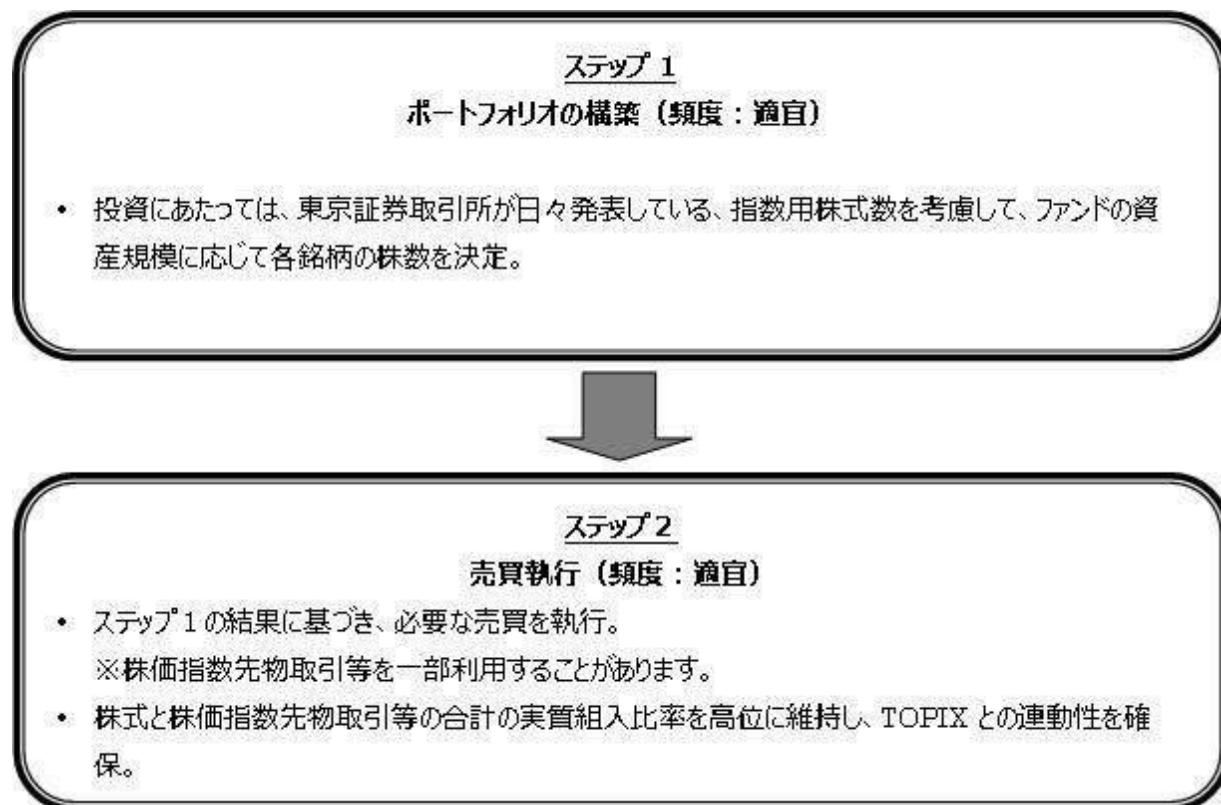
東証株価指数（TOPIX）とは、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。

- ① 東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有しています。
- ② J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（TOPIX）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 本件商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ J P X は、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ J P X は、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 以上の項目に限らず、J P X は本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

運用プロセス

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



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

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

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

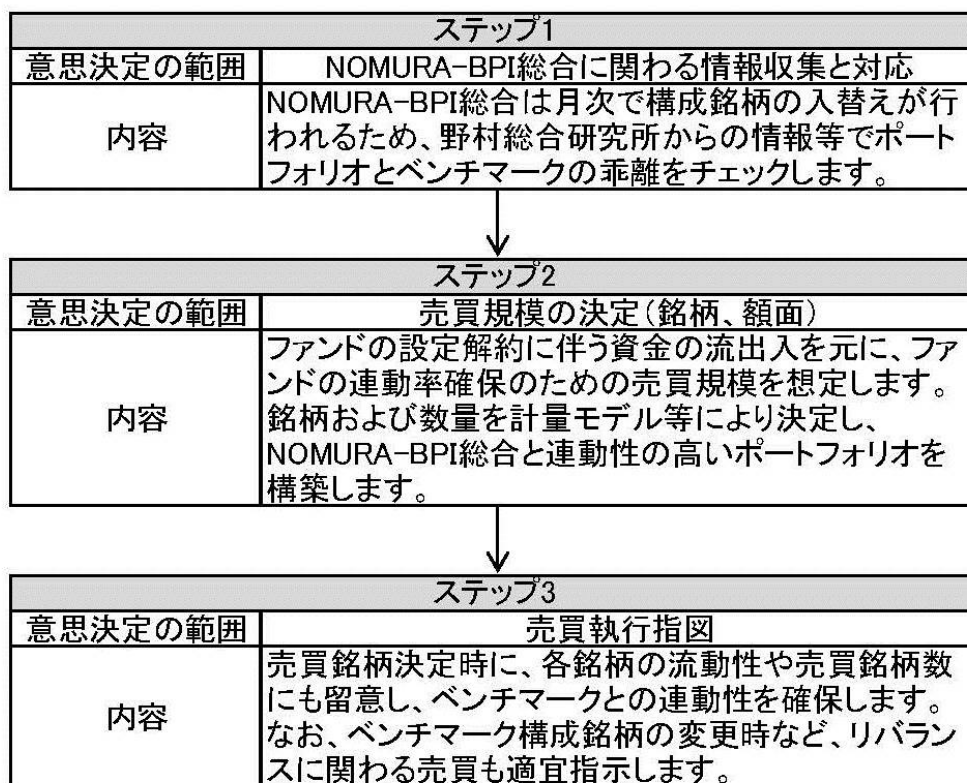
NOMURA-BPI総合について

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

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

運用プロセス

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



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

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

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

東証REIT指数（配当込み）について

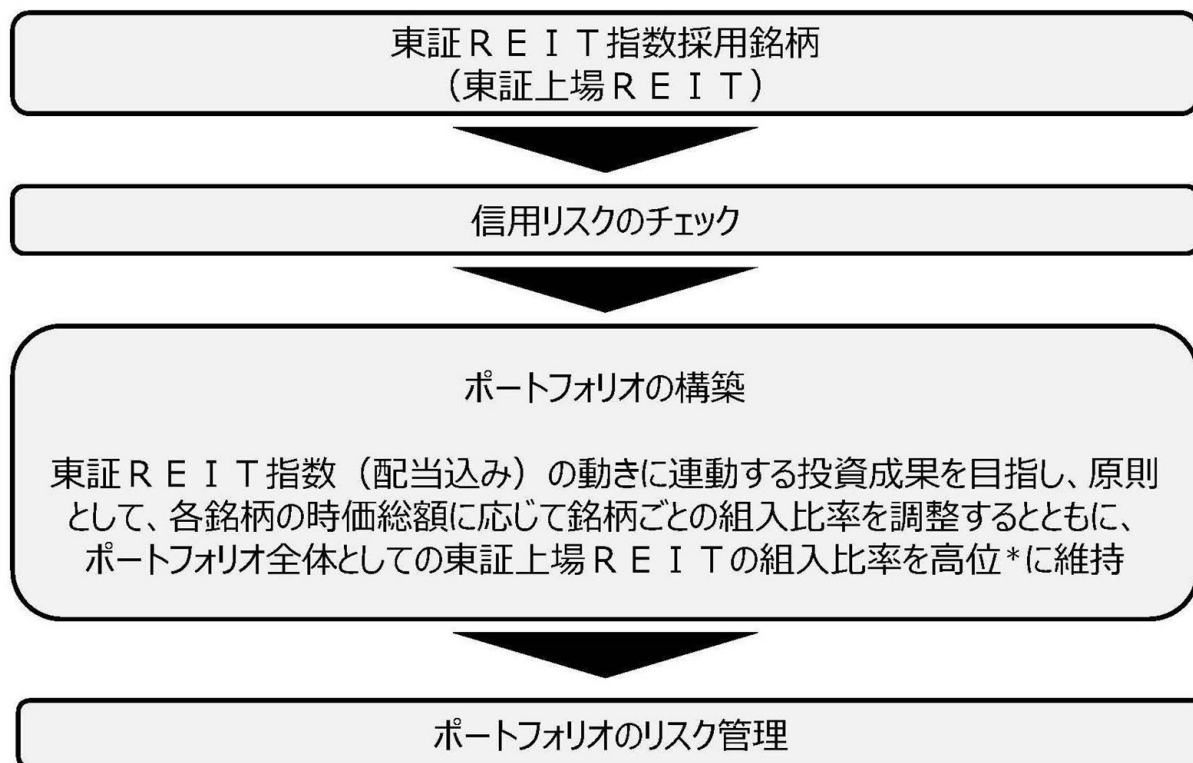
東証REIT指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均の指数で、東京証券取引所上場のREIT全体の値動きを、配当金を反映させたうえで表す指数です。なお、2017年1月31日より、浮動株比率が考慮された指数となっています。

- ① 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有しています。
- ② J P X は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ J P X は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ J P X は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 本件商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ J P X は、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ J P X は、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 以上の項目に限らず、J P X は本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

運用プロセス

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



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

*不動産投信指数先物取引を一部利用することがあります。

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

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

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

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

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

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

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

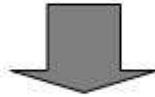
運用プロセス

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

ステップ 1

リスクモニタリング

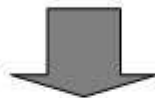
- 計量モデル等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析を実施し、リバランスの必要性を判断。



ステップ 2

ポートフォリオの構築

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



ステップ 3

売買執行

- ステップ 2 で選択された銘柄について売買を執行。
- 加えて、株価指数先物取引等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2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）について

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

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

運用プロセス

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



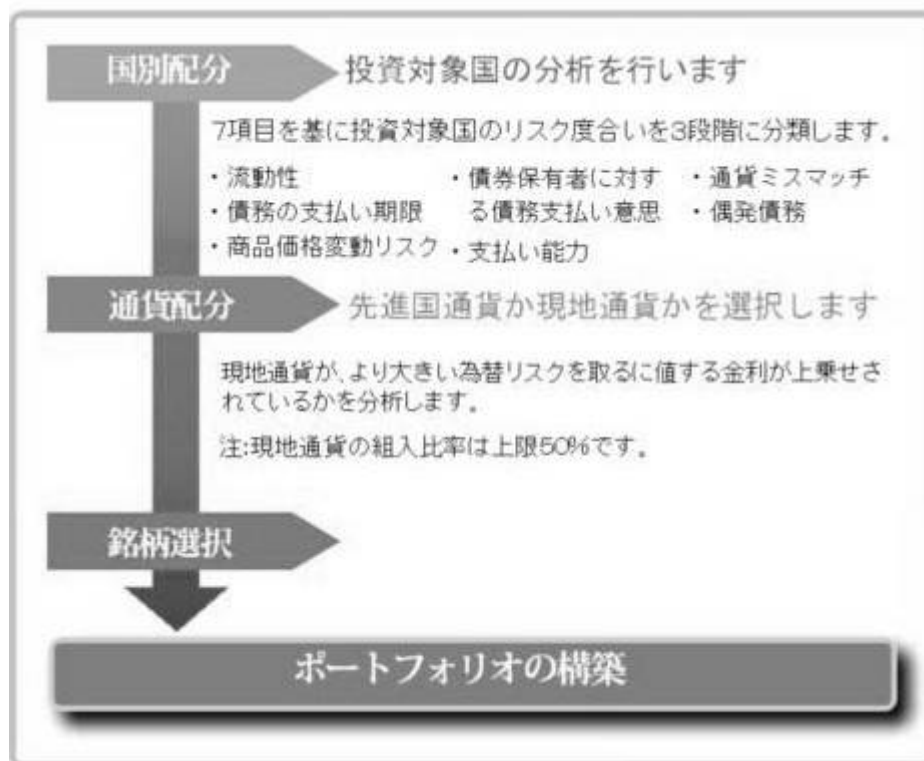
※運用プロセスは2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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

フランクリン テンプレートン インベストメント マネジメント リミテッド について
 フランクリン テンプレートン 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・テンプレートン (設立：1947年、運用総資産：約205.6兆円※) の
 一員です。F T I M L 社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多
 様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

※2023年9月末現在、1米ドル=149.58円で換算

運用プロセス



出所：F T I M L 社資料を基にアセットマネジメントOne作成

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

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

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

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

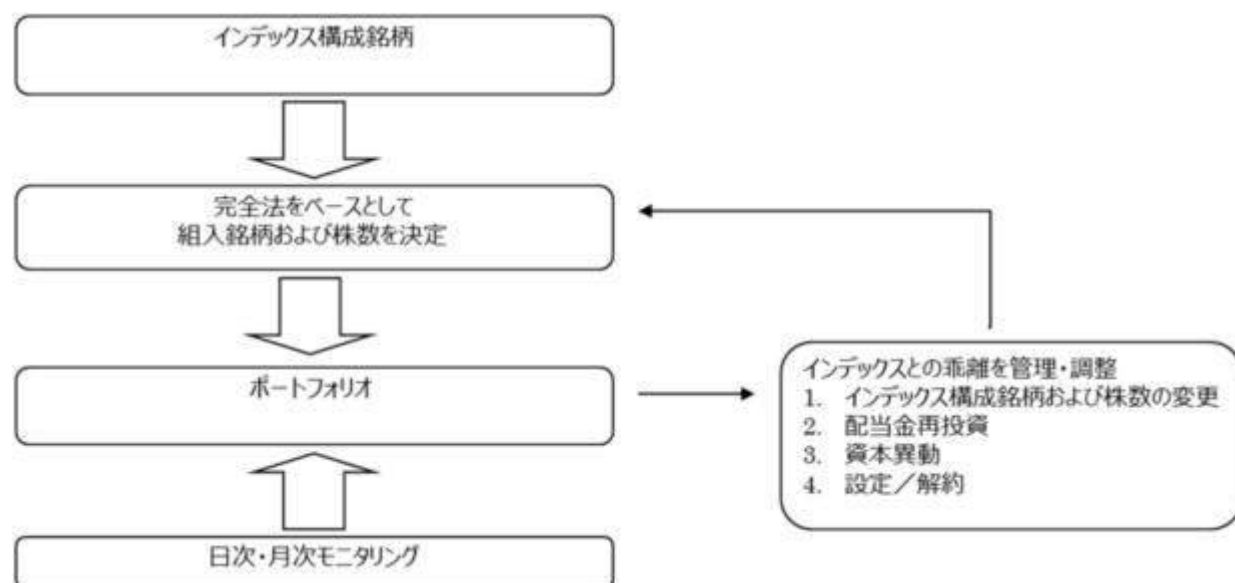
新光米国REITマザーファンド（以下「当マザーファンド」といことがあります。）は、アセットマネジメントOne株式会社によって単独で開発されたものです。当マザーファンドは、いかなる方法においても、FTSE、London Stock Exchange Group plcおよび、そのグループ企業（以下、総称して「LSE Group」といいます。）またはNareitによって出資、保証、販売または販売促進されることはありません。

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

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

運用プロセス

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



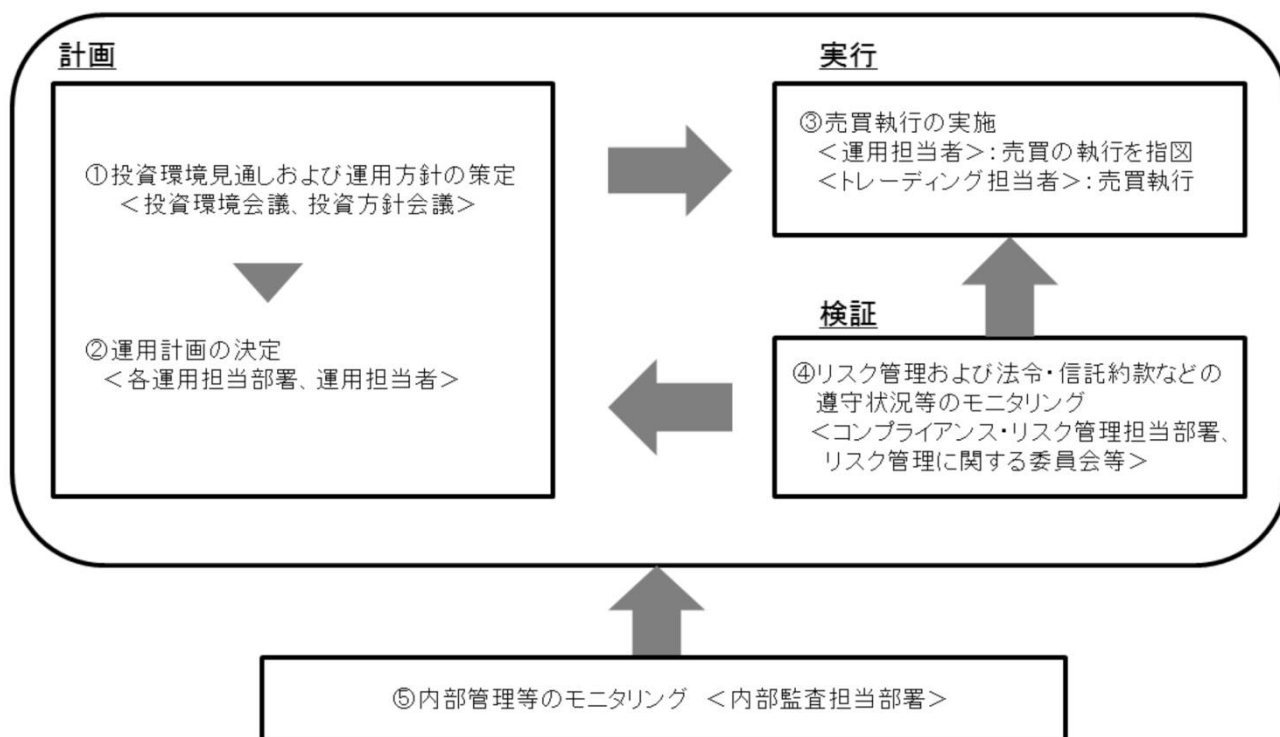
※運用プロセスは2023年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

※前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

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

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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

③ 売買執行の実施

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

④ モニタリング

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

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

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

(4) 【分配方針】

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

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

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

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

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

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

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

(5) 【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c. 公社債の借り入れ

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

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

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

(ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d. 同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

e. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

f. 外国為替予約の指図

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

g. 資金の借り入れ

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

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

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

(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があり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。これらの影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

h. 流動性リスク

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

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

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

i. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

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

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

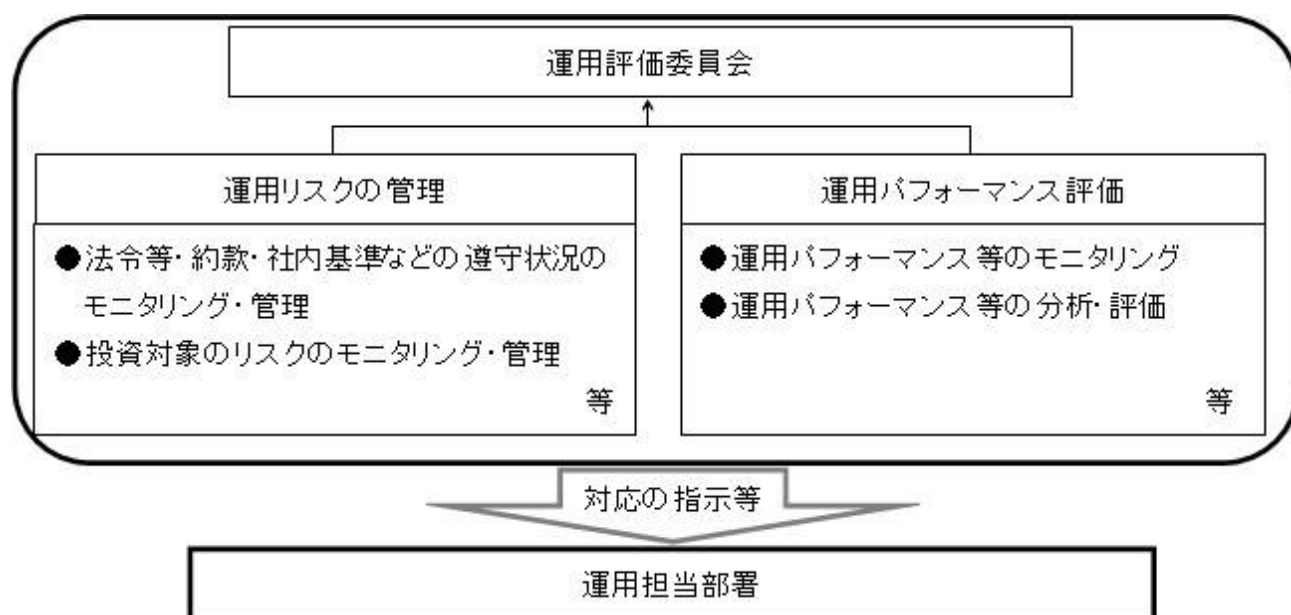
- (ニ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ホ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ヘ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ト) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変ま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

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

(2) リスク管理体制

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

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



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

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

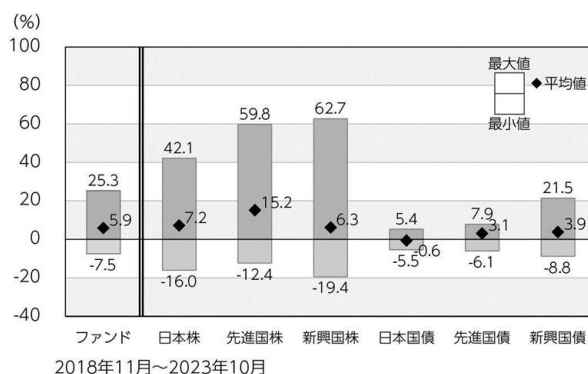
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。)

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

(2) 【換金（解約）手数料】

a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

b. 信託財産留保額

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

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

(3) 【信託報酬等】

| <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="448 528 1407 1211"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用 (信託報酬) の配分 (税抜)</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円未満の部分</td> <td>年率0.42%</td> <td>年率0.45%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>300億円以上 500億円未満の部分</td> <td>年率0.37%</td> <td>年率0.50%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>500億円以上の部分</td> <td>年率0.32%</td> <td>年率0.55%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table> <p>※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社 (フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド) に対する投資顧問報酬 (投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうちファンドにおける保有分に対し年率0.05%) が含まれます。</p> | 運用管理費用 (信託報酬) の配分 (税抜) | | | | 各販売会社の取扱純資産額 | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 | 300億円未満の部分 | 年率0.42% | 年率0.45% | 年率0.08% | 300億円以上 500億円未満の部分 | 年率0.37% | 年率0.50% | 年率0.08% | 500億円以上の部分 | 年率0.32% | 年率0.55% | 年率0.08% | 主な役務 | 信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価 | 運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
|---------------------------|---|--|-------------------------------|--|--|--------------|------|------|------|------------|---------|---------|---------|-----------------------|---------|---------|---------|------------|---------|---------|---------|------|----------------------------------|--|-------------------------------|
| 運用管理費用 (信託報酬) の配分 (税抜) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 各販売会社の取扱純資産額 | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 300億円未満の部分 | 年率0.42% | 年率0.45% | 年率0.08% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 300億円以上 500億円未満の部分 | 年率0.37% | 年率0.50% | 年率0.08% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 500億円以上の部分 | 年率0.32% | 年率0.55% | 年率0.08% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 主な役務 | 信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理等の対価 | 運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <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・マーケット・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。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定

口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

○法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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

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

◇個別元本方式について

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

<個別元本について>

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

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

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

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

<収益分配金の課税について>

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

収益分配の際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

--- (参考情報) ファンドの総経費率 ---

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

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年4月21日~2023年10月20日

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

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2023年10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|------------------------|---------------|----------|
| 投資信託受益証券 | 641,563,600 | 14.57 |
| 内 ケイマン諸島 | 641,563,600 | 14.57 |
| 親投資信託受益証券 | 3,636,741,352 | 82.61 |
| 内 日本 | 3,636,741,352 | 82.61 |
| コール・ローン、その他の資産 (負債控除後) | 123,763,082 | 2.81 |
| 純資産総額 | 4,402,068,034 | 100.00 |

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

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

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2023年10月31日現在

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

その他資産の投資状況

2023年10月31日現在

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

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

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

(注3) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

新光日本債券インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|------------------------|----------------|----------|
| 国債証券 | 8,748,959,400 | 83.66 |
| 内 日本 | 8,748,959,400 | 83.66 |
| 地方債証券 | 660,233,300 | 6.31 |
| 内 日本 | 660,233,300 | 6.31 |
| 特殊債券 | 602,212,000 | 5.76 |
| 内 日本 | 602,212,000 | 5.76 |
| 社債券 | 293,591,000 | 2.81 |
| 内 日本 | 293,591,000 | 2.81 |
| コール・ローン、その他の資産 (負債控除後) | 152,334,371 | 1.46 |
| 純資産総額 | 10,457,330,071 | 100.00 |

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

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

新光J-REITマザーファンド

2023年10月31日現在

| | | |
|--|--|--|
| | | |
|--|--|--|

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

その他資産の投資状況

2023年10月31日現在

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

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

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

(注3) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

新光外国株式インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

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

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

その他資産の投資状況

2023年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

海外国債マザーファンド

2023年10月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------------|
| 国債証券 | 13,183,686,646 | 98.27 |
| | 内 アメリカ | 5,486,675,158 |
| | 内 フランス | 2,874,058,922 |
| | 内 イタリア | 1,924,830,560 |
| | 内 ドイツ | 1,383,289,298 |
| | 内 イギリス | 963,889,111 |
| | 内 カナダ | 550,943,597 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 231,722,193 | 1.73 |
| 純資産総額 | 13,415,408,839 | 100.00 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

新光米国REITマザーファンド

2023年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

2023年10月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率 (%) 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|--|-----------|-------------|---------------------------|---------------------------|------------------|-----------------|
| 1 | フランクリン・テンプレートン・フロンティア・エマージェンシ・マーケット・デット・ファンド ケイマン諸島 | 投資信託受益証券 | 333,800 | 1,909.0000 637,224,200 | 1,922.0000 641,563,600 | — — | 14.57 |
| 2 | 海外国債マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 235,052,061 | 2.6742 628,599,726 | 2.7001 634,664,069 | — — | 14.42 |
| 3 | ニュー トピックス インデックス マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 184,139,379 | 3.3453 616,019,878 | 3.3430 615,577,943 | — — | 13.98 |
| 4 | 新光外国株式インデックスマザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 133,658,339 | 4.6573 622,500,348 | 4.5298 605,445,544 | — — | 13.75 |
| 5 | 新光J-REITマザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 277,479,957 | 2.1746 603,435,662 | 2.1724 602,797,458 | — — | 13.69 |
| 6 | 新光日本債券インデックスマザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 504,434,964 | 1.2026 606,683,931 | 1.1937 602,144,016 | — — | 13.68 |
| 7 | 新光米国REITマザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 244,032,668 | 2.4043 586,752,146 | 2.3608 576,112,322 | — — | 13.09 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2023年10月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 業種 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率 (%) 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|-----------------|----------|--------|---------------------|---------------------|------------------|-----------------|
| 1 | トヨタ自動車 | 株式 | 25,600 | 1,815.38 | 2,590.00 | — | 4.14 |

| | | | | | | | | |
|----|-------------------|----|--------------|---------|-------------------------|-------------------------|--------|------|
| | | 日本 | 輸送用機器 | | 46,473,932 | 66,304,000 | — | |
| 2 | ソニーグループ | 日本 | 株式 電気機器 | 3,300 | 11,000.29 36,300,960 | 12,425.00 41,002,500 | — — | 2.56 |
| 3 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本 | 株式 銀行業 | 28,800 | 976.02 28,109,410 | 1,257.00 36,201,600 | — — | 2.26 |
| 4 | キーエンス | 日本 | 株式 電気機器 | 500 | 55,080.00 27,540,000 | 58,150.00 29,075,000 | — — | 1.82 |
| 5 | 日本電信電話 | 日本 | 株式 情報・通信業 | 138,700 | 149.60 20,749,520 | 176.80 24,522,160 | — — | 1.53 |
| 6 | 三井住友フィナンシャルグループ | 日本 | 株式 銀行業 | 3,300 | 5,720.00 18,876,000 | 7,220.00 23,826,000 | — — | 1.49 |
| 7 | 三菱商事 | 日本 | 株式 卸売業 | 3,300 | 4,419.27 14,583,593 | 6,955.00 22,951,500 | — — | 1.43 |
| 8 | 日立製作所 | 日本 | 株式 電気機器 | 2,300 | 6,480.00 14,904,000 | 9,477.00 21,797,100 | — — | 1.36 |
| 9 | 三井物産 | 日本 | 株式 卸売業 | 3,700 | 3,856.18 14,267,895 | 5,417.00 20,042,900 | — — | 1.25 |
| 10 | 東京エレクトロン | 日本 | 株式 電気機器 | 1,000 | 15,030.00 15,030,000 | 19,755.00 19,755,000 | — — | 1.23 |
| 11 | 信越化学工業 | 日本 | 株式 化学 | 4,200 | 3,369.26 14,150,926 | 4,468.00 18,765,600 | — — | 1.17 |
| 12 | 任天堂 | 日本 | 株式 その他製品 | 3,000 | 5,397.00 16,191,000 | 6,221.00 18,663,000 | — — | 1.17 |
| 13 | 伊藤忠商事 | 日本 | 株式 卸売業 | 3,300 | 4,089.78 13,496,295 | 5,373.00 17,730,900 | — — | 1.11 |
| 14 | 本田技研工業 | 日本 | 株式 輸送用機器 | 11,400 | 1,022.33 11,654,602 | 1,506.50 17,174,100 | — — | 1.07 |
| 15 | 武田薬品工業 | 日本 | 株式 医薬品 | 4,100 | 4,095.00 16,789,500 | 4,063.00 16,658,300 | — — | 1.04 |
| 16 | KDDI | 日本 | 株式 情報・通信業 | 3,600 | 3,885.00 13,986,000 | 4,487.00 16,153,200 | — — | 1.01 |
| 17 | 第一三共 | 日本 | 株式 医薬品 | 4,100 | 4,148.10 17,007,240 | 3,858.00 15,817,800 | — — | 0.99 |
| 18 | みずほフィナンシャルグループ | 日本 | 株式 銀行業 | 6,200 | 2,042.56 12,663,916 | 2,545.50 15,782,100 | — — | 0.99 |
| 19 | リクルートホールディングス | 日本 | 株式 サービス業 | 3,600 | 4,079.31 14,685,545 | 4,333.00 15,598,800 | — — | 0.97 |
| 20 | 東京海上ホールディングス | 日本 | 株式 保険業 | 4,500 | 2,751.00 12,379,500 | 3,343.00 15,043,500 | — — | 0.94 |
| 21 | ソフトバンクグループ | 日本 | 株式 情報・通 | 2,300 | 5,924.00 13,625,200 | 6,124.00 14,085,200 | — — | 0.88 |

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|----|----------|
| 株式 | 90.83 |
| 合計 | 90.83 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年10月31日現在

| 業種 | 国内／外国 | 投資比率 (%) |
|--------|-------|----------|
| 電気機器 | 国内 | 15.17 |
| 輸送用機器 | | 7.96 |
| 情報・通信業 | | 7.17 |
| 銀行業 | | 7.10 |
| 卸売業 | | 6.40 |
| 化学 | | 5.27 |
| 医薬品 | | 4.43 |
| 機械 | | 4.32 |
| サービス業 | | 4.16 |
| 小売業 | | 3.92 |
| 食料品 | | 3.21 |
| 陸運業 | | 2.63 |
| 保険業 | | 2.32 |
| その他製品 | | 2.09 |
| 精密機器 | | 1.96 |
| 建設業 | | 1.93 |
| 不動産業 | | 1.87 |

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

新光日本債券インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率 (%) 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|---------------------------------|-------|-------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|-----------------|
| 1 | 339回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 120,000,000 | 101.13 121,367,400 | 100.54 120,655,200 | 0.4 2025/6/20 | 1.15 |
| 2 | 146回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証券 | 120,000,000 | 100.48 120,576,000 | 99.92 119,910,000 | 0.1 2025/12/20 | 1.15 |
| 3 | 147回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証券 | 120,000,000 | 100.15 120,188,400 | 99.63 119,558,400 | 0.005 2026/3/20 | 1.14 |
| 4 | 350回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 120,000,000 | 100.07 120,094,800 | 98.75 118,500,000 | 0.1 2028/3/20 | 1.13 |
| 5 | 351回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 120,000,000 | 100.02 120,032,400 | 98.52 118,227,600 | 0.1 2028/6/20 | 1.13 |
| 6 | 97回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本 | 特殊債券 | 100,000,000 | 112.91 112,915,000 | 108.50 108,509,000 | 2.1 2029/12/28 | 1.04 |
| 7 | 18回 東京都公募公債 20年 日本 | 地方債証券 | 100,000,000 | 112.28 112,282,000 | 108.37 108,372,000 | 2.22 2029/3/19 | 1.04 |
| 8 | 353回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証券 | 110,000,000 | 99.87 109,865,800 | 98.12 107,932,000 | 0.1 2028/12/20 | 1.03 |
| 9 | 36回 東日本旅客鉄道社 債 日本 | 社債券 | 100,000,000 | 103.94 103,945,000 | 102.11 102,110,000 | 2.11 2024/12/20 | 0.98 |

| | | | | | | | |
|----|----------------------------------|-----------|-------------|-----------------------|-----------------------|---------------------|------|
| 10 | 249回政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本 | 特殊債 券 | 100,000,000 | 101.19 101,195,000 | 100.53 100,536,000 | 0.484 2025/6/30 | 0.96 |
| 11 | 144回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証 券 | 100,000,000 | 100.38 100,388,000 | 100.05 100,057,000 | 0.1 2025/6/20 | 0.96 |
| 12 | 218回 神奈川県公募公 債 日本 | 地方債 証券 | 100,000,000 | 100.38 100,387,000 | 99.87 99,872,000 | 0.195 2025/12/19 | 0.96 |
| 13 | 12回 兵庫県公募公債 15年 日本 | 地方債 証券 | 100,000,000 | 103.26 103,260,000 | 99.64 99,642,000 | 0.781 2030/12/6 | 0.95 |
| 14 | 148回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証 券 | 100,000,000 | 100.09 100,099,600 | 99.52 99,528,000 | 0.005 2026/6/20 | 0.95 |
| 15 | 169回 共同発行市場公 募地方債 日本 | 地方債 証券 | 100,000,000 | 100.22 100,229,000 | 99.32 99,329,000 | 0.205 2027/4/23 | 0.95 |
| 16 | 87回 中日本高速道路債 券 日本 | 特殊債 券 | 100,000,000 | 99.59 99,597,000 | 99.30 99,303,000 | 0.06 2026/3/18 | 0.95 |
| 17 | 349回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証 券 | 100,000,000 | 100.12 100,127,000 | 98.96 98,961,000 | 0.1 2027/12/20 | 0.95 |
| 18 | 327回 政保日本高速道 路保有・債務返済機構 日本 | 特殊債 券 | 100,000,000 | 100.12 100,123,000 | 98.96 98,961,000 | 0.17 2027/10/29 | 0.95 |
| 19 | 11回 プリヂストーン社債 日本 | 社債券 | 100,000,000 | 99.93 99,932,000 | 98.91 98,916,000 | 0.295 2027/4/21 | 0.95 |
| 20 | 190回 大阪府公募公債 5年 日本 | 地方債 証券 | 100,000,000 | 99.43 99,430,000 | 98.84 98,848,000 | 0.001 2026/12/25 | 0.95 |
| 21 | 250回 住宅金融支援機 構 日本 | 特殊債 券 | 100,000,000 | 99.81 99,813,000 | 98.22 98,223,000 | 0.289 2028/11/20 | 0.94 |
| 22 | 147回 高速道路機構債 券 日本 | 特殊債 券 | 100,000,000 | 102.62 102,620,000 | 96.68 96,680,000 | 0.955 2034/12/20 | 0.92 |
| 23 | 令和3年度11回 愛知県 公募公債 日本 | 地方債 証券 | 100,000,000 | 97.92 97,924,000 | 94.01 94,014,000 | 0.145 2031/10/29 | 0.90 |
| 24 | 494回 九州電力社債 日本 | 社債券 | 100,000,000 | 95.44 95,447,000 | 92.56 92,565,000 | 0.31 2031/5/23 | 0.89 |
| 25 | 145回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証 券 | 90,000,000 | 100.41 90,372,200 | 99.99 89,991,000 | 0.1 2025/9/20 | 0.86 |
| 26 | 149回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証 券 | 90,000,000 | 100.06 90,057,000 | 99.41 89,470,800 | 0.005 2026/9/20 | 0.86 |
| 27 | 150回 利付国庫債券 (5年) 日本 | 国債証 券 | 90,000,000 | 99.97 89,974,800 | 99.28 89,355,600 | 0.005 2026/12/20 | 0.85 |

| | | | | | | | |
|----|----------------------------|----------|------------|----------------------|---------------------|-------------------|------|
| 28 | 348回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証 券 | 90,000,000 | 100.05 90,048,300 | 99.13 89,222,400 | 0.1 2027/9/20 | 0.85 |
| 29 | 359回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証 券 | 90,000,000 | 98.81 88,931,700 | 96.62 86,962,500 | 0.1 2030/6/20 | 0.83 |
| 30 | 361回 利付国庫債券 (10年) 日本 | 国債証 券 | 90,000,000 | 98.90 89,014,700 | 95.92 86,330,700 | 0.1 2030/12/20 | 0.83 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

2023年10月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率 (%) 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|-----------------------------|----------|--------|-----------------------------|-----------------------------|------------------|-----------------|
| 1 | 日本ビルファンド投資法人 日本 | 投資証 券 | 8,573 | 587,012.96 5,032,462,153 | 607,000.00 5,203,811,000 | — — | 6.65 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本 | 投資証 券 | 7,549 | 563,995.14 4,257,599,328 | 561,000.00 4,234,989,000 | — — | 5.41 |
| 3 | 野村不動産マスターファン ド投資法人 日本 | 投資証 券 | 23,766 | 167,897.28 3,990,246,760 | 166,900.00 3,966,545,400 | — — | 5.07 |
| 4 | 日本プロロジスリート投資 法人 日本 | 投資証 券 | 12,803 | 272,396.08 3,487,487,106 | 268,800.00 3,441,446,400 | — — | 4.40 |
| 5 | 日本都市ファンド投資法人 日本 | 投資証 券 | 35,227 | 99,297.67 3,497,959,349 | 97,500.00 3,434,632,500 | — — | 4.39 |
| 6 | GLP投資法人 日本 | 投資証 券 | 24,825 | 132,002.07 3,276,951,480 | 135,500.00 3,363,787,500 | — — | 4.30 |
| 7 | ケネディクス・オフィス投 資法人 日本 | 投資証 券 | 21,149 | 164,608.27 3,481,300,357 | 157,600.00 3,333,082,400 | — — | 4.26 |
| 8 | 大和ハウスリート投資法人 日本 | 投資証 券 | 11,078 | 265,602.71 2,942,346,923 | 267,600.00 2,964,472,800 | — — | 3.79 |
| 9 | オリックス不動産投資法人 日本 | 投資証 券 | 14,643 | 178,494.64 2,613,697,080 | 173,800.00 2,544,953,400 | — — | 3.25 |

| | | | | | | | |
|----|---------------------------|------|--------|-----------------------------|-----------------------------|--------|------|
| 10 | ユナイテッド・アーバン投資法人 日本 | 投資証券 | 16,440 | 150,799.97 2,479,151,566 | 152,400.00 2,505,456,000 | — — | 3.20 |
| 11 | アドバンス・レジデンス投資法人 日本 | 投資証券 | 7,211 | 330,997.03 2,386,819,604 | 328,500.00 2,368,813,500 | — — | 3.03 |
| 12 | インヴィンシブル投資法人 日本 | 投資証券 | 35,583 | 57,400.72 2,042,489,981 | 58,100.00 2,067,372,300 | — — | 2.64 |
| 13 | 日本プライムリアルティ投資法人 日本 | 投資証券 | 5,026 | 354,496.76 1,781,700,716 | 354,000.00 1,779,204,000 | — — | 2.27 |
| 14 | 積水ハウス・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 22,084 | 80,999.00 1,788,782,130 | 79,600.00 1,757,886,400 | — — | 2.25 |
| 15 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 24,602 | 69,298.85 1,704,890,340 | 68,700.00 1,690,157,400 | — — | 2.16 |
| 16 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本 | 投資証券 | 3,856 | 409,497.32 1,579,021,672 | 408,500.00 1,575,176,000 | — — | 2.01 |
| 17 | 日本アコモデーションファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 2,538 | 610,995.17 1,550,705,758 | 609,000.00 1,545,642,000 | — — | 1.97 |
| 18 | 産業ファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 11,213 | 136,698.61 1,532,801,557 | 135,700.00 1,521,604,100 | — — | 1.94 |
| 19 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本 | 投資証券 | 3,057 | 467,489.60 1,429,115,724 | 456,500.00 1,395,520,500 | — — | 1.78 |
| 20 | ラサールロジポート投資法人 日本 | 投資証券 | 9,394 | 147,900.27 1,389,375,190 | 148,200.00 1,392,190,800 | — — | 1.78 |
| 21 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 4,708 | 285,792.47 1,345,510,976 | 279,900.00 1,317,769,200 | — — | 1.68 |
| 22 | イオンリート投資法人 日本 | 投資証券 | 9,015 | 145,299.04 1,309,870,897 | 144,000.00 1,298,160,000 | — — | 1.66 |
| 23 | フロンティア不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 2,727 | 444,503.60 1,212,161,320 | 452,500.00 1,233,967,500 | — — | 1.58 |
| 24 | 森ヒルズリート投資法人 日本 | 投資証券 | 8,642 | 139,900.78 1,209,022,597 | 141,500.00 1,222,843,000 | — — | 1.56 |
| 25 | 大和証券リビング投資法人 日本 | 投資証券 | 10,823 | 109,702.72 1,187,312,593 | 111,800.00 1,210,011,400 | — — | 1.55 |
| 26 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本 | 投資証券 | 3,614 | 306,007.00 1,105,909,311 | 321,000.00 1,160,094,000 | — — | 1.48 |
| 27 | ヒューリックリート投資法人 日本 | 投資証券 | 6,876 | 154,698.14 1,063,704,414 | 154,200.00 1,060,279,200 | — — | 1.35 |
| 28 | 森トラストリート投資法人 日本 | 投資証券 | 14,166 | 72,600.91 1,028,464,620 | 73,700.00 1,044,034,200 | — — | 1.33 |

| | | | | | | | |
|----|-------------------------|----------|-------|---------------------------|-----------------------------|--------|------|
| 29 | 大和証券オフィス投資法人 日本 | 投資証 券 | 1,522 | 652,004.51 992,350,869 | 661,000.00 1,006,042,000 | — — | 1.28 |
| 30 | 三菱地所物流リート投資法 人 日本 | 投資証 券 | 2,538 | 378,999.94 961,901,848 | 380,500.00 965,709,000 | — — | 1.23 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 投資証券 | 97.01 |
| 合計 | 97.01 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 業種 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率 (%) 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|----------------------------|--|-------|-------------------------|-------------------------|------------------|-----------------|
| 1 | APPLE INC アメリカ | 株式 コン ピュー タ・周辺 機器 | 3,053 | 20,164.41 61,561,955 | 25,460.05 77,729,556 | — — | 4.73 |
| 2 | MICROSOFT CORP アメリカ | 株式 ソフト ウェア | 1,371 | 33,607.22 46,075,511 | 50,431.21 69,141,200 | — — | 4.21 |
| 3 | AMAZON.COM INC アメリカ | 株式 大規模小 売り | 1,791 | 12,914.01 23,129,002 | 19,841.47 35,536,076 | — — | 2.16 |
| 4 | NVIDIA CORP アメリカ | 株式 半導体・ 半導体製 造装置 | 479 | 20,797.24 9,961,881 | 61,539.81 29,477,569 | — — | 1.80 |
| 5 | ALPHABET INC-CL A アメリカ | 株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス | 1,152 | 13,072.44 15,059,453 | 18,608.01 21,436,432 | — — | 1.31 |
| 6 | META PLATFORMS INC アメリカ | 株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス | 429 | 15,170.77 6,508,264 | 45,250.69 19,412,548 | — — | 1.18 |
| 7 | ALPHABET INC-CL C | 株式 | 1,025 | 13,067.17 | 18,800.88 | — | 1.17 |

| | | | | | | | |
|----|-------------------------------------|-------------------------------|-----|-------------------------|--------------------------|--------|------|
| | アメリカ | インタラクティブ・メディアおよびサービス | | 13,393,853 | 19,270,904 | — | |
| 8 | TESLA INC アメリカ | 株式 自動車 | 552 | 26,773.00 14,778,697 | 29,507.29 16,288,026 | — — | 0.99 |
| 9 | UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ | 株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス | 181 | 80,834.07 14,630,967 | 79,238.80 14,342,223 | — — | 0.87 |
| 10 | ELI LILLY & CO アメリカ | 株式 医薬品 | 156 | 54,312.49 8,472,749 | 84,579.30 13,194,371 | — — | 0.80 |
| 11 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ | 株式 金融サービス | 252 | 43,156.05 10,875,327 | 50,446.16 12,712,434 | — — | 0.77 |
| 12 | EXXON MOBIL CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・消耗燃料 | 785 | 16,281.63 12,781,086 | 15,830.11 12,426,643 | — — | 0.76 |
| 13 | JPMORGAN CHASE & CO アメリカ | 株式 銀行 | 567 | 19,397.42 10,998,341 | 20,545.66 11,649,391 | — — | 0.71 |
| 14 | VISA INC アメリカ | 株式 金融サービス | 314 | 28,994.47 9,104,264 | 34,847.78 10,942,206 | — — | 0.67 |
| 15 | JOHNSON & JOHNSON アメリカ | 株式 医薬品 | 467 | 25,594.65 11,952,702 | 21,982.45 10,265,806 | — — | 0.63 |
| 16 | PROCTER & GAMBLE CO アメリカ | 株式 家庭用品 | 458 | 20,405.12 9,345,547 | 22,315.86 10,220,665 | — — | 0.62 |
| 17 | BROADCOM INC アメリカ | 株式 半導体・半導体製造装置 | 80 | 70,382.91 5,630,633 | 125,775.28 10,062,023 | — — | 0.61 |
| 18 | MASTERCARD INC アメリカ | 株式 金融サービス | 164 | 47,191.33 7,739,379 | 55,680.51 9,131,604 | — — | 0.56 |
| 19 | NOVO NORDISK A/S-B デンマーク | 株式 医薬品 | 631 | 9,022.74 5,693,351 | 14,407.90 9,091,386 | — — | 0.55 |
| 20 | NESTLE SA-REGISTERED スイス | 株式 食品 | 521 | 18,088.82 9,424,276 | 16,195.72 8,437,974 | — — | 0.51 |
| 21 | HOME DEPOT INC アメリカ | 株式 専門小売り | 195 | 42,871.98 8,360,038 | 42,084.07 8,206,394 | — — | 0.50 |
| 22 | CHEVRON CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・消耗 | 353 | 26,602.31 9,390,616 | 21,841.91 7,710,196 | — — | 0.47 |

| | | 燃料 | | | | | |
|----|-------------------------------|---------------------------|-----|------------------------|------------------------|--------|------|
| 23 | MERCK & CO. INC. アメリカ | 株式 医薬品 | 492 | 15,188.71 7,472,850 | 15,351.68 7,553,029 | — — | 0.46 |
| 24 | ABBVIE INC アメリカ | 株式 バイオテ クノロ ジー | 342 | 22,069.89 7,547,904 | 21,213.97 7,255,179 | — — | 0.44 |
| 25 | COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ | 株式 生活必需 品流通・ 小売り | 86 | 73,348.77 6,307,995 | 82,960.10 7,134,569 | — — | 0.43 |
| 26 | WALMART INC アメリカ | 株式 生活必需 品流通・ 小売り | 288 | 20,852.15 6,005,421 | 24,373.11 7,019,458 | — — | 0.43 |
| 27 | ADOBE INC アメリカ | 株式 ソフト ウェア | 88 | 44,684.04 3,932,196 | 78,782.79 6,932,886 | — — | 0.42 |
| 28 | ASML HOLDING NV オランダ | 株式 半導体・ 半導体製 造装置 | 78 | 78,679.48 6,137,000 | 87,580.30 6,831,264 | — — | 0.42 |
| 29 | COCA-COLA CO/THE アメリカ | 株式 飲料 | 796 | 8,786.70 6,994,215 | 8,394.98 6,682,409 | — — | 0.41 |
| 30 | PEPSICO INC アメリカ | 株式 飲料 | 266 | 26,695.00 7,100,872 | 24,262.48 6,453,820 | — — | 0.39 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年10月31日現在

| 業種 | 国内／外国 | 投資比率 (%) |
|----------------------|-------|----------|
| ソフトウェア | 外国 | 7.57 |
| 半導体・半導体製造装置 | | 5.13 |
| コンピュータ・周辺機器 | | 4.95 |
| 医薬品 | | 4.66 |
| 銀行 | | 4.57 |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 4.47 |
| インタラクティブ・メディアおよびサービス | | 3.77 |
| 保険 | | 2.87 |
| 金融サービス | | 2.69 |
| 資本市場 | | 2.66 |

| | |
|-------------------------|------|
| 大規模小売り | 2.53 |
| ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス | 2.03 |
| ヘルスケア機器・用品 | 1.88 |
| ホテル・レストラン・レジャー | 1.80 |
| バイオテクノロジー | 1.69 |
| 化学 | 1.69 |
| 機械 | 1.58 |
| 生活必需品流通・小売り | 1.56 |
| 自動車 | 1.53 |
| 航空宇宙・防衛 | 1.53 |
| 電力 | 1.50 |
| 飲料 | 1.48 |
| 専門小売り | 1.37 |
| 金属・鉱業 | 1.37 |
| 食品 | 1.32 |
| 情報技術サービス | 1.14 |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | 1.07 |
| 家庭用品 | 1.01 |
| ライフサイエンス・ツール／サービス | 0.95 |
| 陸上運輸 | 0.91 |
| 娯楽 | 0.88 |
| 専門サービス | 0.88 |
| 各種電気通信サービス | 0.88 |
| コングロマリット | 0.79 |
| 電気設備 | 0.73 |
| 総合公益事業 | 0.69 |
| 通信機器 | 0.62 |
| メディア | 0.61 |
| パーソナルケア用品 | 0.55 |
| タバコ | 0.53 |
| 商業サービス・用品 | 0.51 |
| 建設関連製品 | 0.50 |
| 航空貨物・物流サービス | 0.43 |
| 電子装置・機器・部品 | 0.43 |
| 商社・流通業 | 0.38 |
| 不動産管理・開発 | 0.30 |
| 消費者金融 | 0.29 |
| エネルギー設備・サービス | 0.28 |
| 建設・土木 | 0.28 |
| 家庭用耐久財 | 0.26 |
| 建設資材 | 0.25 |
| 無線通信サービス | 0.21 |
| 容器・包装 | 0.20 |
| 自動車用部品 | 0.15 |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.10 |
| 運送インフラ | 0.10 |
| ガス | 0.09 |
| 紙製品・林産品 | 0.09 |
| 水道 | 0.08 |
| 販売 | 0.08 |

| | | |
|--------------|--|-------|
| 海上運輸 | | 0.06 |
| ヘルスケア・テクノロジー | | 0.05 |
| 旅客航空輸送 | | 0.04 |
| 各種消費者サービス | | 0.02 |
| レジャー用品 | | 0.01 |
| 合計 | | 85.65 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

海外国債マザーファンド

2023年10月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率 (%) 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|-----------------------------------|----------|---------------|------------------------|----------------------|--------------------|-----------------|
| 1 | US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ | 国債証 券 | 1,106,374,000 | 92.25 1,020,728,924 | 86.01 951,654,509 | 2.875 2032/5/15 | 7.09 |
| 2 | US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ | 国債証 券 | 1,091,423,000 | 82.58 901,303,219 | 79.79 870,921,446 | 1.625 2031/5/15 | 6.49 |
| 3 | FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス | 国債証 券 | 866,283,600 | 99.31 860,311,447 | 96.38 834,929,953 | 2.5 2030/5/25 | 6.22 |
| 4 | ITALY BTPS 4.4 05/01/33 イタリア | 国債証 券 | 825,032,000 | 101.97 841,311,309 | 98.41 811,996,494 | 4.4 2033/5/1 | 6.05 |
| 5 | US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ | 国債証 券 | 852,207,000 | 96.87 825,569,686 | 89.74 764,855,782 | 3.5 2033/2/15 | 5.70 |
| 6 | US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ | 国債証 券 | 956,864,000 | 82.75 791,833,665 | 79.66 762,239,354 | 1.875 2032/2/15 | 5.68 |
| 7 | FRANCE OAT 0.0 11/25/31 フランス | 国債証 券 | 809,166,000 | 79.17 640,636,380 | 77.26 625,177,834 | — 2031/11/25 | 4.66 |
| 8 | FRANCE OAT 2.0 11/25/32 フランス | 国債証 券 | 634,640,000 | 91.28 579,360,476 | 89.68 569,147,690 | 2 2032/11/25 | 4.24 |
| 9 | US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ | 国債証 券 | 678,775,400 | 79.07 536,710,118 | 75.69 513,774,641 | 0.625 2030/8/15 | 3.83 |
| 10 | ITALY BTPS 0.95 06/01/32 イタリア | 国債証 券 | 637,813,200 | 76.16 485,780,904 | 75.02 478,551,243 | 0.95 2032/6/1 | 3.57 |
| 11 | US T N/B 5.0 08/31/25 アメリカ | 国債証 券 | 478,432,000 | 99.82 477,591,006 | 99.82 477,591,006 | 5 2025/8/31 | 3.56 |
| 12 | US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ | 国債証 券 | 517,304,600 | 94.69 489,849,190 | 88.64 458,582,446 | 3.375 2033/5/15 | 3.42 |
| 13 | US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ | 国債証 券 | 493,383,000 | 81.86 403,898,125 | 76.76 378,738,906 | 1.25 2031/8/15 | 2.82 |
| 14 | UK TREASURY 3.75 01/29/38 イギリス | 国債証 券 | 403,462,800 | 90.06 363,370,701 | 88.42 356,766,015 | 3.75 2038/1/29 | 2.66 |
| 15 | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 ドイツ | 国債証 券 | 396,650,000 | 80.93 321,023,917 | 80.01 317,375,531 | — 2032/2/15 | 2.37 |
| 16 | DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 ドイツ | 国債証 券 | 325,253,000 | 101.19 329,140,566 | 96.05 312,431,526 | 2.3 2033/2/15 | 2.33 |
| 17 | UK TREASURY 3.25 01/31/33 イギリス | 国債証 券 | 345,306,000 | 93.21 321,862,630 | 90.16 311,345,154 | 3.25 2033/1/31 | 2.32 |
| 18 | US T N/B 4.375 08/31/28 アメリカ | 国債証 券 | 313,971,000 | 98.79 310,181,271 | 98.19 308,317,068 | 4.375 2028/8/31 | 2.30 |
| 19 | ITALY BTPS 3.5 03/01/30 イタリア | 国債証 券 | 317,320,000 | 97.45 309,252,139 | 96.21 305,293,572 | 3.5 2030/3/1 | 2.28 |

| | | | | | | | |
|----|----------------------------------|----------|-------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|------|
| 20 | FRANCE OAT 1.75 06/25/39 フランス | 国債証 券 | 380,784,000 | 81.88 311,824,017 | 76.97 293,106,944 | 1.75 2039/6/25 | 2.18 |
| 21 | FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス | 国債証 券 | 317,320,000 | 88.28 280,135,807 | 86.99 276,065,861 | 0.5 2029/5/25 | 2.06 |
| 22 | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 ドイツ | 国債証 券 | 310,973,600 | 81.91 254,745,701 | 81.26 252,718,915 | — 2031/8/15 | 1.88 |
| 23 | DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 ドイツ | 国債証 券 | 301,454,000 | 84.58 254,990,894 | 83.66 252,214,503 | — 2030/8/15 | 1.88 |
| 24 | DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 ドイツ | 国債証 券 | 301,454,000 | 82.96 250,096,709 | 82.45 248,548,823 | — 2031/2/15 | 1.85 |
| 25 | ITALY BTPT 0.95 08/01/30 イタリア | 国債証 券 | 285,588,000 | 79.58 227,299,489 | 80.61 230,241,045 | 0.95 2030/8/1 | 1.72 |
| 26 | FRANCE OAT 3.0 05/25/33 フランス | 国債証 券 | 174,526,000 | 99.98 174,494,585 | 96.91 169,142,396 | 3 2033/5/25 | 1.26 |
| 27 | CANADA 2.5 12/01/32 カナダ | 国債証 券 | 172,864,000 | 94.36 163,128,299 | 88.22 152,504,623 | 2.5 2032/12/1 | 1.14 |
| 28 | CANADA 5.75 06/01/33 カナダ | 国債証 券 | 133,969,600 | 116.46 156,026,700 | 113.34 151,853,482 | 5.75 2033/6/1 | 1.13 |
| 29 | CANADA 1.5 06/01/31 カナダ | 国債証 券 | 151,256,000 | 88.12 133,298,887 | 83.33 126,051,216 | 1.5 2031/6/1 | 0.94 |
| 30 | UK TREASURY 1.0 01/31/32 イギリス | 国債証 券 | 163,566,000 | 81.09 132,647,119 | 76.13 124,530,974 | 1 2032/1/31 | 0.93 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 98.27 |
| 合計 | 98.27 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

2023年10月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率 (%) 償還日 | 投資 比率 (%) |
|----|-----------------------------|----------|-------|--------------------------|--------------------------|------------------|-----------------|
| 1 | PROLOGIS INC アメリカ | 投資証 券 | 3,225 | 15,336.73 49,460,972 | 14,783.54 47,676,944 | — — | 8.28 |
| 2 | AMERICAN TOWER CORP アメリカ | 投資証 券 | 1,712 | 23,836.37 40,807,881 | 25,811.40 44,189,127 | — — | 7.67 |
| 3 | EQUINIX INC アメリカ | 投資証 券 | 343 | 105,226.63 36,092,735 | 106,948.98 36,683,502 | — — | 6.37 |
| 4 | WELLTOWER INC アメリカ | 投資証 券 | 1,826 | 12,546.87 22,910,601 | 12,240.38 22,350,940 | — — | 3.88 |
| 5 | CROWN CASTLE INC アメリカ | 投資証 券 | 1,590 | 12,841.41 20,417,848 | 13,482.81 21,437,670 | — — | 3.72 |
| 6 | PUBLIC STORAGE アメリカ | 投資証 券 | 576 | 38,648.33 22,261,440 | 35,705.97 20,566,643 | — — | 3.57 |

| | | | | | | | |
|----|--|----------|-------|-------------------------|-------------------------|--------|------|
| 7 | DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ | 投資証 券 | 1,097 | 17,289.33 18,966,402 | 18,252.18 20,022,642 | — — | 3.48 |
| 8 | SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ | 投資証 券 | 1,193 | 15,922.81 18,995,918 | 15,747.88 18,787,230 | — — | 3.26 |
| 9 | REALTY INCOME CORP アメリカ | 投資証 券 | 2,476 | 7,388.78 18,294,629 | 6,910.35 17,110,032 | — — | 2.97 |
| 10 | VICI PROPERTIES INC アメリカ | 投資証 券 | 3,689 | 4,198.24 15,487,310 | 4,063.68 14,990,922 | — — | 2.60 |
| 11 | AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ | 投資証 券 | 521 | 25,872.70 13,479,679 | 24,317.80 12,669,574 | — — | 2.20 |
| 12 | SBA COMMUNICATIONS CORP アメリカ | 投資証 券 | 395 | 28,323.17 11,187,653 | 30,636.09 12,101,257 | — — | 2.10 |
| 13 | EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ | 投資証 券 | 769 | 16,819.87 12,934,483 | 15,538.57 11,949,163 | — — | 2.07 |
| 14 | WEYERHAEUSER CO アメリカ | 投資証 券 | 2,691 | 4,385.12 11,800,380 | 4,268.51 11,486,561 | — — | 1.99 |
| 15 | EQUITY RESIDENTIAL アメリカ | 投資証 券 | 1,371 | 8,744.83 11,989,175 | 8,142.31 11,163,113 | — — | 1.94 |
| 16 | INVITATION HOMES INC アメリカ | 投資証 券 | 2,246 | 4,718.53 10,597,830 | 4,376.15 9,828,850 | — — | 1.71 |
| 17 | IRON MOUNTAIN INC アメリカ | 投資証 券 | 1,064 | 8,933.22 9,504,948 | 8,714.93 9,272,693 | — — | 1.61 |
| 18 | VENTAS INC アメリカ | 投資証 券 | 1,468 | 6,254.00 9,180,876 | 6,212.14 9,119,422 | — — | 1.58 |
| 19 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ | 投資証 券 | 625 | 14,161.58 8,850,992 | 13,908.91 8,693,072 | — — | 1.51 |
| 20 | MID AMERICA アメリカ | 投資証 券 | 427 | 19,570.85 8,356,756 | 17,568.91 7,501,928 | — — | 1.30 |
| 21 | SUN COMMUNITIES INC アメリカ | 投資証 券 | 452 | 15,795.73 7,139,670 | 16,404.23 7,414,715 | — — | 1.29 |
| 22 | ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ | 投資証 券 | 235 | 32,039.99 7,529,398 | 31,403.07 7,379,723 | — — | 1.28 |
| 23 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ | 投資証 券 | 651 | 9,807.85 6,384,914 | 9,824.30 6,395,620 | — — | 1.11 |
| 24 | WP CAREY INC アメリカ | 投資証 券 | 776 | 8,001.77 6,209,377 | 7,886.65 6,120,042 | — — | 1.06 |
| 25 | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ | 投資証 券 | 924 | 6,825.13 6,306,421 | 6,603.85 6,101,963 | — — | 1.06 |
| 26 | HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ | 投資証 券 | 2,589 | 2,354.78 6,096,531 | 2,299.46 5,953,311 | — — | 1.03 |
| 27 | AMERICAN HOMES 4 RENT アメリカ | 投資証 券 | 1,223 | 5,078.85 6,211,439 | 4,814.22 5,887,793 | — — | 1.02 |
| 28 | REGENCY CENTERS CORP アメリカ | 投資証 券 | 664 | 8,849.49 5,876,065 | 8,702.97 5,778,776 | — — | 1.00 |
| 29 | KIMCO REALTY アメリカ | 投資証 券 | 2,212 | 2,523.72 5,582,488 | 2,583.53 5,714,774 | — — | 0.99 |
| 30 | UDR INC アメリカ | 投資証 券 | 1,205 | 5,261.25 6,339,814 | 4,727.50 5,696,644 | — — | 0.99 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年10月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 投資証券 | 98.96 |
| 合計 | 98.96 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2023年10月31日現在

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

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

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

新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

2023年10月31日現在

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

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

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

新光外国株式インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

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

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

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

海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

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

| | 純資産総額 (分配落) (百万円) | 純資産総額 (分配付) (百万円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落) (円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付) (円) |
|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 第15特定期間末 (2014年 4月21日) | 8,104 | 8,125 | 0.7970 | 0.7990 |
| 第16特定期間末 (2014年10月20日) | 7,644 | 7,663 | 0.8254 | 0.8274 |
| 第17特定期間末 (2015年 4月20日) | 7,692 | 7,709 | 0.9283 | 0.9303 |
| 第18特定期間末 (2015年10月20日) | 6,937 | 6,952 | 0.8993 | 0.9013 |
| 第19特定期間末 (2016年 4月20日) | 6,329 | 6,344 | 0.8666 | 0.8686 |
| 第20特定期間末 (2016年10月20日) | 5,699 | 5,713 | 0.8330 | 0.8350 |
| 第21特定期間末 (2017年 4月20日) | 5,622 | 5,635 | 0.8684 | 0.8704 |

| | | | | |
|---------------------------|-------|-------|--------|--------|
| 第22特定期間末 (2017年10月20日) | 5,597 | 5,609 | 0.9138 | 0.9158 |
| 第23特定期間末 (2018年 4月20日) | 5,336 | 5,348 | 0.8885 | 0.8905 |
| 第24特定期間末 (2018年10月22日) | 5,115 | 5,126 | 0.8935 | 0.8955 |
| 第25特定期間末 (2019年 4月22日) | 5,013 | 5,024 | 0.9197 | 0.9217 |
| 第26特定期間末 (2019年10月21日) | 4,980 | 4,991 | 0.9464 | 0.9484 |
| 第27特定期間末 (2020年4月20日) | 4,234 | 4,244 | 0.8402 | 0.8422 |
| 第28特定期間末 (2020年10月20日) | 4,344 | 4,353 | 0.8946 | 0.8966 |
| 第29特定期間末 (2021年4月20日) | 4,642 | 4,651 | 1.0067 | 1.0087 |
| 第30特定期間末 (2021年10月20日) | 4,749 | 4,758 | 1.0661 | 1.0681 |
| 第31特定期間末 (2022年4月20日) | 4,727 | 4,736 | 1.0747 | 1.0767 |
| 第32特定期間末 (2022年10月20日) | 4,398 | 4,407 | 1.0262 | 1.0282 |
| 第33特定期間末 (2023年4月20日) | 4,351 | 4,359 | 1.0280 | 1.0300 |
| 第34特定期間末 (2023年10月20日) | 4,428 | 4,436 | 1.0617 | 1.0637 |
| 2022年10月末日 | 4,515 | — | 1.0535 | — |
| 11月末日 | 4,440 | — | 1.0406 | — |
| 12月末日 | 4,240 | — | 0.9943 | — |
| 2023年1月末日 | 4,290 | — | 1.0081 | — |
| 2月末日 | 4,343 | — | 1.0225 | — |
| 3月末日 | 4,285 | — | 1.0115 | — |
| 4月末日 | 4,367 | — | 1.0293 | — |
| 5月末日 | 4,443 | — | 1.0493 | — |
| 6月末日 | 4,629 | — | 1.0971 | — |
| 7月末日 | 4,595 | — | 1.0933 | — |
| 8月末日 | 4,632 | — | 1.1043 | — |
| 9月末日 | 4,518 | — | 1.0810 | — |
| 10月末日 | 4,402 | — | 1.0558 | — |

②【分配の推移】

| | 1口当たりの分配金 (円) |
|---------|---------------|
| 第15特定期間 | 0.0120 |
| 第16特定期間 | 0.0120 |
| 第17特定期間 | 0.0120 |
| 第18特定期間 | 0.0120 |
| 第19特定期間 | 0.0120 |
| 第20特定期間 | 0.0120 |
| 第21特定期間 | 0.0120 |

| | |
|---------|--------|
| 第22特定期間 | 0.0120 |
| 第23特定期間 | 0.0120 |
| 第24特定期間 | 0.0120 |
| 第25特定期間 | 0.0120 |
| 第26特定期間 | 0.0120 |
| 第27特定期間 | 0.0120 |
| 第28特定期間 | 0.0120 |
| 第29特定期間 | 0.0120 |
| 第30特定期間 | 0.0120 |
| 第31特定期間 | 0.0120 |
| 第32特定期間 | 0.0120 |
| 第33特定期間 | 0.0120 |
| 第34特定期間 | 0.0120 |

③【収益率の推移】

| | 収益率 (%) |
|---------|---------|
| 第15特定期間 | 4.7 |
| 第16特定期間 | 5.1 |
| 第17特定期間 | 13.9 |
| 第18特定期間 | △1.8 |
| 第19特定期間 | △2.3 |
| 第20特定期間 | △2.5 |
| 第21特定期間 | 5.7 |
| 第22特定期間 | 6.6 |
| 第23特定期間 | △1.5 |
| 第24特定期間 | 1.9 |
| 第25特定期間 | 4.3 |
| 第26特定期間 | 4.2 |
| 第27特定期間 | △10.0 |
| 第28特定期間 | 7.9 |
| 第29特定期間 | 13.9 |
| 第30特定期間 | 7.1 |
| 第31特定期間 | 1.9 |
| 第32特定期間 | △3.4 |
| 第33特定期間 | 1.3 |
| 第34特定期間 | 4.4 |

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

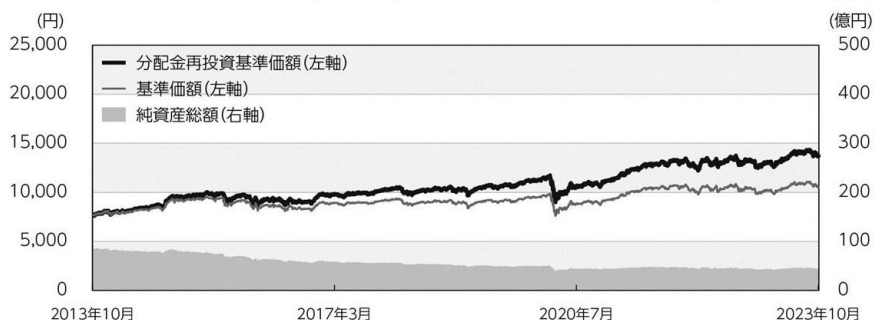
| | 設定口数 | 解約口数 |
|---------|------------|-------------|
| 第15特定期間 | 25,208,228 | 996,341,985 |
| 第16特定期間 | 8,899,172 | 916,673,106 |
| 第17特定期間 | 13,815,643 | 989,033,927 |
| 第18特定期間 | 10,689,548 | 583,223,930 |
| 第19特定期間 | 7,316,627 | 417,039,060 |
| 第20特定期間 | 6,935,970 | 468,057,013 |
| 第21特定期間 | 5,348,676 | 374,412,075 |
| 第22特定期間 | 9,877,379 | 358,418,763 |

| | | |
|---------|------------|-------------|
| 第23特定期間 | 45,095,213 | 164,575,560 |
| 第24特定期間 | 4,817,074 | 285,434,876 |
| 第25特定期間 | 13,966,043 | 287,993,351 |
| 第26特定期間 | 34,127,005 | 222,623,381 |
| 第27特定期間 | 9,232,953 | 232,290,245 |
| 第28特定期間 | 14,557,001 | 198,285,857 |
| 第29特定期間 | 8,969,863 | 253,533,579 |
| 第30特定期間 | 20,473,306 | 177,049,394 |
| 第31特定期間 | 59,835,363 | 115,612,488 |
| 第32特定期間 | 60,021,152 | 172,680,942 |
| 第33特定期間 | 7,853,916 | 61,140,924 |
| 第34特定期間 | 17,589,380 | 79,729,532 |

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

データの基準日:2023年10月31日

基準価額・純資産の推移 《2013年10月31日～2023年10月31日》



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

分配の推移 (税引前)

| | |
|----------|--------|
| 2023年 6月 | 20円 |
| 2023年 7月 | 20円 |
| 2023年 8月 | 20円 |
| 2023年 9月 | 20円 |
| 2023年10月 | 20円 |
| 直近1年間累計 | 240円 |
| 設定来累計 | 5,120円 |

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名 | 比率(%) |
|----|--|-------|
| 1 | フランクリン・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 | 14.57 |
| 2 | 海外国債マザーファンド | 14.42 |
| 3 | ニュー トピックス インデックス マザーファンド | 13.98 |
| 4 | 新光外国株式インデックスマザーファンド | 13.75 |
| 5 | 新光J-REITマザーファンド | 13.69 |
| 6 | 新光日本債券インデックスマザーファンド | 13.68 |
| 7 | 新光米国REITマザーファンド | 13.09 |

■ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

■新光日本債券インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

■新光J-REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

○掲載データ等は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。

■新光外国株式インデックスマザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 業種 | 比率(%) |
|----|-------------------|----|------|----------------------|-------|
| 1 | APPLE INC | 株式 | アメリカ | コンピュータ・周辺機器 | 4.73 |
| 2 | MICROSOFT CORP | 株式 | アメリカ | ソフトウェア | 4.21 |
| 3 | AMAZON.COM INC | 株式 | アメリカ | 大規模小売り | 2.16 |
| 4 | NVIDIA CORP | 株式 | アメリカ | 半導体・半導体製造装置 | 1.80 |
| 5 | ALPHABET INC-CL A | 株式 | アメリカ | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 1.31 |

■海外国債マザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 利率(%) | 償還日 | 比率(%) |
|----|-------------------------|------|------|-------|-----------|-------|
| 1 | US T N/B 2.875 05/15/32 | 国債証券 | アメリカ | 2.875 | 2032/5/15 | 7.09 |
| 2 | US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | アメリカ | 1.625 | 2031/5/15 | 6.49 |
| 3 | FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 国債証券 | フランス | 2.5 | 2030/5/25 | 6.22 |
| 4 | ITALY BTPS 4.4 05/01/33 | 国債証券 | イタリア | 4.4 | 2033/5/1 | 6.05 |
| 5 | US T N/B 3.5 02/15/33 | 国債証券 | アメリカ | 3.5 | 2033/2/15 | 5.70 |

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

①組入公社債の上位5通貨

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

②組入公社債の上位5カ国

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

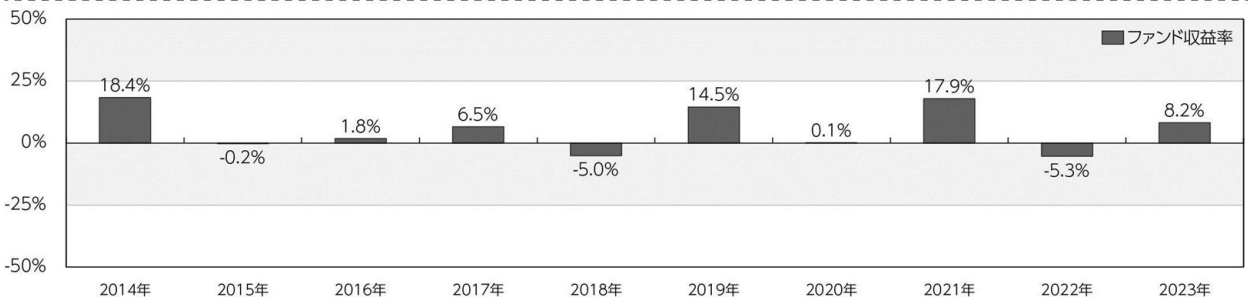
■新光米国REITマザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2023年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

2【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

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

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

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

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

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。)

インターネットホームページ

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

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

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

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

b. 投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d. 運用報告書

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

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

e. 公告

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

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

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

f. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g. 信託事務処理の再信託

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

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

h. 信託業務の委託等

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

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- (ロ) 受託者は、上記(イ)に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が上記(イ)各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- (ハ) 上記(イ)および(ロ)にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務(裁量性のないものに限ります。)を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みません。)に委託することができるものとします。
1. 投資信託財産の保存にかかる業務
 2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

i. 関係法人との契約の更改

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

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

4 【受益者の権利等】

a. 収益分配金請求権

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

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

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

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

b. 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c. 一部解約請求権

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

d. 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

独立監査人の監査報告書

2023年12月15日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

1【財務諸表】

【新光7資産バランスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 前期 | | 当期 | |
|---|----|-----------------------------|----|-----------------------------|
| | 自 | 2022年10月21日 至 2023年4月20日 | 自 | 2023年4月21日 至 2023年10月20日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 33,033,600 | | 32,539,200 |
| 有価証券売買等損益 | | 47,912,089 | | 185,561,146 |
| 営業収益合計 | | 80,945,689 | | 218,100,346 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 16,286 | | 26,935 |
| 受託者報酬 | | 1,900,405 | | 1,990,195 |
| 委託者報酬 | | 20,667,355 | | 21,643,812 |
| その他費用 | | 84,472 | | 88,469 |
| 営業費用合計 | | 22,668,518 | | 23,749,411 |
| 営業利益又は営業損失(△) | | 58,277,171 | | 194,350,935 |
| 経常利益又は経常損失(△) | | 58,277,171 | | 194,350,935 |
| 当期純利益又は当期純損失(△) | | 58,277,171 | | 194,350,935 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△) | | 380,665 | | 36,783 |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△) | | 112,127,986 | | 118,321,993 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 152,631 | | 756,486 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | — | | — |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 152,631 | | 756,486 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 814,436 | | 5,789,638 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 814,436 | | 5,789,638 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | — | | — |
| 分配金 | | 51,040,694 | | 50,441,521 |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | | 118,321,993 | | 257,161,472 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 前期 | 当期 |
|-------------|---|---|
| | 自 2022年10月21日 至 2023年4月20日 | 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日 |
| 1. 分配金の計算過程 | <p>(自2022年10月21日 至2022年11月21日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,398,074円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(27,555,036円)及び分配準備積立金(535,151,430円)より分配対象収益は572,104,540円(1万口当たり1,339.04円)であり、うち8,544,956円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2022年11月22日 至2022年12月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,369,105円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(27,920,209円)及び分配準備積立金(534,713,114円)</p> | <p>(自2023年4月21日 至2023年5月22日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,499,684円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(29,597,448円)及び分配準備積立金(542,313,681円)より分配対象収益は582,410,813円(1万口当たり1,374.13円)であり、うち8,476,743円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自2023年5月23日 至2023年6月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,126,722円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(29,620,889円)及び分配準備積立金</p> |

| | |
|---|--|
| <p>円)より分配対象収益は570,002,428円(1万口当たり1,336.33円)であり、うち8,530,857円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> | <p>(542,081,774円)より分配対象収益は583,829,385円(1万口当たり1,382.86円)であり、うち8,443,776円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> |
| <p>(自2022年12月21日 至2023年1月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,496,699円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(28,052,268円)及び分配準備積立金(532,737,157円)より分配対象収益は569,286,124円(1万口当たり1,336.27円)であり、うち8,520,475円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> | <p>(自2023年6月21日 至2023年7月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,055,043円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(29,646,961円)及び分配準備積立金(543,364,935円)より分配対象収益は584,066,939円(1万口当たり1,389.15円)であり、うち8,408,927円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> |
| <p>(自2023年1月21日 至2023年2月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,335,130円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(28,083,221円)及び分配準備積立金(531,230,017円)より分配対象収益は569,648,368円(1万口当たり1,340.60円)であり、うち8,498,403円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> | <p>(自2023年7月21日 至2023年8月21日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,099,050円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(30,024,808円)及び分配準備積立金(545,379,786円)より分配対象収益は582,503,644円(1万口当たり1,386.05円)であり、うち8,405,205円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> |
| <p>(自2023年2月21日 至2023年3月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,277,553円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(28,104,208円)及び分配準備積立金(531,816,533円)より分配対象収益は571,198,294円(1万口当たり1,347.20円)であり、うち8,479,783円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> | <p>(自2023年8月22日 至2023年9月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,016,777円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(12,498,921円)、信託約款に規定される収益調整金(29,959,061円)及び分配準備積立金(541,388,726円)より分配対象収益は597,863,485円(1万口当たり1,429.45円)であり、うち8,364,930円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> |
| <p>(自2023年3月21日 至2023年4月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,841,652円)、費用控</p> | <p>(自2023年9月21日 至2023年10月20日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,296,388円)、費用控</p> |

| | | |
|--|---|---|
| | <p>除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（28,147,866円）及び分配準備積立金（533,672,098円）より分配対象収益は579,661,616円（1万口当たり1,369.35円）であり、うち8,466,220円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p> | <p>除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（29,980,820円）及び分配準備積立金（557,898,847円）より分配対象収益は601,176,055円（1万口当たり1,441.33円）であり、うち8,341,940円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p> |
|--|---|---|

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 前期 | 当期 |
|--------------------------|---|-------------------------------|
| | 自 2022年10月21日 至 2023年4月20日 | 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 前期 | 当期 |
|----------------------|--|---------------|
| | 2023年4月20日現在 | 2023年10月20日現在 |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 | 同左 |

| | | |
|----------------------------|--|----|
| | 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （2）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 前期 2023年4月20日現在 | 当期 2023年10月20日現在 |
|-----------|-------------------------------|-------------------------------|
| | 最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円） | 最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 投資信託受益証券 | 22,710,600 | △16,022,400 |
| 親投資信託受益証券 | 152,260,477 | △133,438,079 |
| 合計 | 174,971,077 | △149,460,479 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2023年10月20日現在

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 （円） | 評価額 （円） | 備考 |
|----|----|-------------|------------|----|
| | | | | |

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年10月20日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 2023年10月20日現在 |
|---------------------------------------|---------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 540,012,065円 |
| 同期中追加設定元本額 | 21,044,349円 |
| 同期中一部解約元本額 | 79,672,001円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| 新光7資産バランスファンド | 184,139,379円 |
| ニュー トピックス インデックス (変額年金) | 44,538,564円 |
| 世界バランスファンド35VA (適格機関投資家私募) | 215,472,536円 |
| 新光ワールドバランスファンドVA (適格機関投資家私募) | 4,985,801円 |
| ワールドバランスファンド30VA (適格機関投資家私募) | 13,477,262円 |
| ワールドバランスファンド30VA2 (適格機関投資家私募) | 6,125,772円 |
| 太陽財形株投 太陽一般財形 30 | 3,553,237円 |
| 太陽財形株投 太陽一般財形 50 | 8,585,124円 |
| 太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30 | 506,738円 |
| 計 | 481,384,413円 |
| 2. 受益権の総数 | 481,384,413口 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 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 |

| | |
|--------------------------|--|
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <p>スク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p> <p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> |
|--------------------------|--|

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年1月15日から2023年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

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

| | | | | |
|----|------------|---|------------|----------|
| 合計 | 45,280,000 | — | 45,020,000 | △260,000 |
|----|------------|---|------------|----------|

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 2023年10月20日現在 |
|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 3,3454円 |
| (1万口当たり純資産額) | (33,454円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年10月20日現在

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|----------------|-------|----------|-----------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| ニッセイ | 700 | 693.00 | 485,100 | |
| マルハニチロ | 100 | 2,454.50 | 245,450 | |
| 雪国まいたけ | 100 | 884.00 | 88,400 | |
| サカタのタネ | 100 | 4,095.00 | 409,500 | |
| ホクト | 100 | 1,789.00 | 178,900 | |
| ショーボンドホールディングス | 100 | 5,683.00 | 568,300 | |
| ミライト・ワン | 200 | 1,937.00 | 387,400 | |
| I N P E X | 2,500 | 2,230.00 | 5,575,000 | |
| 石油資源開発 | 100 | 5,360.00 | 536,000 | |
| 安藤・間 | 400 | 1,137.00 | 454,800 | |
| 東急建設 | 200 | 736.00 | 147,200 | |
| コムシスホールディングス | 200 | 3,033.00 | 606,600 | |
| ビーアールホールディングス | 200 | 364.00 | 72,800 | |
| ヤマウラ | 100 | 1,212.00 | 121,200 | |
| オリエンタル白石 | 300 | 326.00 | 97,800 | |
| 大成建設 | 400 | 4,920.00 | 1,968,000 | |
| 大林組 | 1,700 | 1,253.50 | 2,130,950 | |
| 清水建設 | 1,300 | 1,032.50 | 1,342,250 | |
| 飛島建設 | 100 | 1,261.00 | 126,100 | |
| 長谷工コーポレーション | 500 | 1,849.00 | 924,500 | |
| 松井建設 | 100 | 758.00 | 75,800 | |
| 鹿島建設 | 1,100 | 2,370.00 | 2,607,000 | |
| 不動テトラ | 100 | 2,010.00 | 201,000 | |
| 西松建設 | 100 | 3,516.00 | 351,600 | |
| 三井住友建設 | 400 | 387.00 | 154,800 | |
| 奥村組 | 100 | 4,400.00 | 440,000 | |
| 東鉄工業 | 100 | 2,893.00 | 289,300 | |

| | | | |
|-------------------|-------|-----------|-----------|
| 戸田建設 | 600 | 799.40 | 479,640 |
| 熊谷組 | 100 | 3,625.00 | 362,500 |
| 矢作建設工業 | 100 | 1,253.00 | 125,300 |
| ピーエス三菱 | 100 | 800.00 | 80,000 |
| 日本ハウスホールディングス | 200 | 367.00 | 73,400 |
| 大東建託 | 200 | 15,465.00 | 3,093,000 |
| 新日本建設 | 100 | 1,194.00 | 119,400 |
| 日本国土開発 | 200 | 590.00 | 118,000 |
| 東洋建設 | 200 | 1,227.00 | 245,400 |
| 五洋建設 | 700 | 841.90 | 589,330 |
| 世紀東急工業 | 100 | 1,573.00 | 157,300 |
| 住友林業 | 400 | 3,492.00 | 1,396,800 |
| 大和ハウス工業 | 1,300 | 3,982.00 | 5,176,600 |
| ライト工業 | 100 | 1,923.00 | 192,300 |
| 積水ハウス | 1,500 | 2,866.00 | 4,299,000 |
| 日特建設 | 100 | 1,044.00 | 104,400 |
| 北陸電気工事 | 100 | 979.00 | 97,900 |
| ユアテック | 100 | 940.00 | 94,000 |
| 中電工 | 100 | 2,372.00 | 237,200 |
| 関電工 | 200 | 1,320.00 | 264,000 |
| きんでん | 300 | 2,101.00 | 630,300 |
| 東京エネシス | 100 | 963.00 | 96,300 |
| 日本電設工業 | 100 | 2,025.00 | 202,500 |
| エクシオグループ | 200 | 2,995.00 | 599,000 |
| 九電工 | 100 | 4,439.00 | 443,900 |
| 三機工業 | 100 | 1,650.00 | 165,000 |
| 日揮ホールディングス | 500 | 1,835.00 | 917,500 |
| 高砂熱学工業 | 100 | 2,802.00 | 280,200 |
| NEC ネットズエスアイ | 200 | 1,977.00 | 395,400 |
| 明星工業 | 100 | 1,009.00 | 100,900 |
| 大気社 | 100 | 4,445.00 | 444,500 |
| ニッポン | 100 | 2,145.00 | 214,500 |
| 日清製粉グループ本社 | 400 | 1,810.50 | 724,200 |
| 中部飼料 | 100 | 1,074.00 | 107,400 |
| フィード・ワン | 100 | 755.00 | 75,500 |
| L I F U L L | 200 | 226.00 | 45,200 |
| M I X I | 100 | 2,289.00 | 228,900 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 100 | 2,338.00 | 233,800 |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 900 | 665.30 | 598,770 |
| UTグループ | 100 | 1,932.00 | 193,200 |
| E・Jホールディングス | 100 | 1,491.00 | 149,100 |
| オープンアップグループ | 200 | 1,869.00 | 373,800 |
| コシダカホールディングス | 200 | 1,009.00 | 201,800 |
| パソナグループ | 100 | 1,362.00 | 136,200 |
| リンクアンドモチベーション | 200 | 376.00 | 75,200 |
| エス・エム・エス | 200 | 2,275.00 | 455,000 |
| パーソルホールディングス | 6,000 | 216.40 | 1,298,400 |
| 森永製菓 | 100 | 5,172.00 | 517,200 |
| 江崎グリコ | 100 | 4,168.00 | 416,800 |
| 山崎製パン | 300 | 2,690.00 | 807,000 |

| | | | |
|------------------------------|-------|----------|-----------|
| 寿スピリッツ | 500 | 2,053.00 | 1,026,500 |
| カルビー | 200 | 2,696.00 | 539,200 |
| 森永乳業 | 100 | 5,460.00 | 546,000 |
| 六甲バター | 100 | 1,360.00 | 136,000 |
| ヤクルト本社 | 600 | 3,540.00 | 2,124,000 |
| 明治ホールディングス | 600 | 3,688.00 | 2,212,800 |
| 雪印メグミルク | 100 | 2,259.00 | 225,900 |
| プリマハム | 100 | 2,267.00 | 226,700 |
| 日本ハム | 200 | 4,273.00 | 854,600 |
| 丸大食品 | 100 | 1,617.00 | 161,700 |
| S Foods | 100 | 3,115.00 | 311,500 |
| システナ | 900 | 253.00 | 227,700 |
| 日鉄ソリューションズ | 100 | 4,090.00 | 409,000 |
| 総合警備保障 | 900 | 850.60 | 765,540 |
| キューブシステム | 100 | 1,067.00 | 106,700 |
| いちご | 600 | 328.00 | 196,800 |
| 日本駐車場開発 | 500 | 207.00 | 103,500 |
| コア | 100 | 1,665.00 | 166,500 |
| カカクコム | 400 | 1,414.00 | 565,600 |
| ルネサンス | 100 | 855.00 | 85,500 |
| ディップ | 100 | 2,935.00 | 293,500 |
| 新日本科学 | 100 | 1,682.00 | 168,200 |
| ベネフィット・ワン | 200 | 970.90 | 194,180 |
| エムスリー | 1,000 | 2,399.50 | 2,399,500 |
| アウトソーシング | 300 | 1,095.00 | 328,500 |
| ディー・エヌ・エー | 200 | 1,435.00 | 287,000 |
| 博報堂DYホールディングス | 600 | 1,213.00 | 727,800 |
| エスプール | 200 | 325.00 | 65,000 |
| アドウェイズ | 100 | 535.00 | 53,500 |
| バリューコマース | 100 | 1,225.00 | 122,500 |
| インフォマート | 500 | 369.00 | 184,500 |
| サッポロホールディングス | 200 | 5,057.00 | 1,011,400 |
| アサヒグループホールディングス | 1,100 | 5,281.00 | 5,809,100 |
| キリンホールディングス | 2,000 | 2,071.50 | 4,143,000 |
| 宝ホールディングス | 300 | 1,216.50 | 364,950 |
| オエノンホールディングス | 200 | 382.00 | 76,400 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス | 400 | 1,887.00 | 754,800 |
| サントリー食品インターナショナル | 300 | 4,378.00 | 1,313,400 |
| 伊藤園 | 200 | 4,839.00 | 967,800 |
| キーコーヒー | 100 | 2,014.00 | 201,400 |
| 日清オイリオグループ | 100 | 4,000.00 | 400,000 |
| 不二製油グループ本社 | 100 | 2,233.00 | 223,300 |
| J-オイルミルズ | 100 | 1,706.00 | 170,600 |
| ローソン | 100 | 6,935.00 | 693,500 |
| エービーシー・マート | 200 | 2,332.00 | 466,400 |
| アスクル | 100 | 2,014.00 | 201,400 |
| ゲオホールディングス | 100 | 2,115.00 | 211,500 |
| アダストリア | 100 | 3,050.00 | 305,000 |
| くら寿司 | 100 | 3,255.00 | 325,500 |

| | | | |
|------------------|-------|-----------|-----------|
| エレマテック | 100 | 1,755.00 | 175,500 |
| パルグループホールディングス | 100 | 1,709.00 | 170,900 |
| エディオン | 200 | 1,474.00 | 294,800 |
| サーラコーポレーション | 100 | 721.00 | 72,100 |
| J Pホールディングス | 200 | 334.00 | 66,800 |
| ひらまつ | 200 | 243.00 | 48,600 |
| 円谷フィールドホールディングス | 100 | 1,558.00 | 155,800 |
| 双日 | 500 | 3,109.00 | 1,554,500 |
| アルフレッサ ホールディングス | 500 | 2,381.50 | 1,190,750 |
| キッコーマン | 300 | 8,228.00 | 2,468,400 |
| 味の素 | 1,200 | 5,565.00 | 6,678,000 |
| キューピー | 300 | 2,556.00 | 766,800 |
| ハウス食品グループ本社 | 100 | 3,120.00 | 312,000 |
| カゴメ | 200 | 3,077.00 | 615,400 |
| ニチレイ | 200 | 3,214.00 | 642,800 |
| 横浜冷凍 | 200 | 1,154.00 | 230,800 |
| 東洋水産 | 200 | 5,980.00 | 1,196,000 |
| 日清食品ホールディングス | 200 | 12,240.00 | 2,448,000 |
| フジッコ | 100 | 1,893.00 | 189,300 |
| ロック・フィールド | 100 | 1,522.00 | 152,200 |
| 日本たばこ産業 | 2,900 | 3,423.00 | 9,926,700 |
| ファーマフーズ | 100 | 1,400.00 | 140,000 |
| 北の達人コーポレーション | 200 | 197.00 | 39,400 |
| ユーグレナ | 300 | 729.00 | 218,700 |
| 紀文食品 | 100 | 1,111.00 | 111,100 |
| 片倉工業 | 100 | 1,747.00 | 174,700 |
| ヒューリック | 1,100 | 1,345.50 | 1,480,050 |
| アルペン | 100 | 1,923.00 | 192,300 |
| クオールホールディングス | 100 | 1,685.00 | 168,500 |
| アルコニックス | 100 | 1,340.00 | 134,000 |
| 神戸物産 | 400 | 3,768.00 | 1,507,200 |
| ビックカメラ | 300 | 1,084.00 | 325,200 |
| DCMホールディングス | 300 | 1,199.00 | 359,700 |
| ペッパーフードサービス | 100 | 113.00 | 11,300 |
| MonotaRO | 700 | 1,215.50 | 850,850 |
| あい ホールディングス | 100 | 2,323.00 | 232,300 |
| J. フロント リテイリング | 700 | 1,385.00 | 969,500 |
| ドトール・日レスホールディングス | 100 | 2,114.00 | 211,400 |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 900 | 2,560.00 | 2,304,000 |
| ZOZO | 300 | 2,792.00 | 837,600 |
| 物語コーポレーション | 100 | 3,605.00 | 360,500 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 900 | 1,632.00 | 1,468,800 |
| 東洋紡 | 200 | 1,011.50 | 202,300 |
| 日清紡ホールディングス | 400 | 1,089.00 | 435,600 |
| ダイワボウホールディングス | 200 | 2,790.00 | 558,000 |
| 日東紡績 | 100 | 3,550.00 | 355,000 |
| トヨタ紡織 | 200 | 2,549.00 | 509,800 |
| マクニカホールディングス | 100 | 7,190.00 | 719,000 |
| ウエルシアホールディングス | 300 | 2,373.50 | 712,050 |
| クリエイトSDホールディングス | 100 | 3,230.00 | 323,000 |

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------|-----------|
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 100 | 987.00 | 98,700 |
| 八洲電機 | 100 | 1,252.00 | 125,200 |
| レスターホールディングス | 100 | 2,480.00 | 248,000 |
| TOKAIホールディングス | 200 | 941.00 | 188,200 |
| 三洋貿易 | 100 | 1,295.00 | 129,500 |
| オイシックス・ラ・大地 | 100 | 1,143.00 | 114,300 |
| ネクステージ | 100 | 2,110.00 | 211,000 |
| ジョイフル本田 | 200 | 1,754.00 | 350,800 |
| すかいらくホールディングス | 700 | 2,095.00 | 1,466,500 |
| 綿半ホールディングス | 100 | 1,299.00 | 129,900 |
| 日本毛織 | 100 | 1,388.00 | 138,800 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 200 | 1,043.00 | 208,600 |
| 野村不動産ホールディングス | 300 | 3,687.00 | 1,106,100 |
| サムティ | 100 | 2,436.00 | 243,600 |
| ディア・ライフ | 100 | 757.00 | 75,700 |
| 地主 | 100 | 1,944.00 | 194,400 |
| プレサンスコーポレーション | 100 | 1,670.00 | 167,000 |
| JPMC | 100 | 1,127.00 | 112,700 |
| フージャースホールディングス | 100 | 1,051.00 | 105,100 |
| オープンハウスグループ | 200 | 4,754.00 | 950,800 |
| 東急不動産ホールディングス | 1,500 | 884.50 | 1,326,750 |
| 飯田グループホールディングス | 400 | 2,312.00 | 924,800 |
| 帝国繊維 | 100 | 1,834.00 | 183,400 |
| あさひ | 100 | 1,252.00 | 125,200 |
| コスモス薬品 | 100 | 14,265.00 | 1,426,500 |
| シップヘルスケアホールディングス | 200 | 2,150.00 | 430,000 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 1,800 | 5,227.00 | 9,408,600 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 400 | 984.00 | 393,600 |
| ツルハホールディングス | 100 | 10,530.00 | 1,053,000 |
| サンマルクホールディングス | 100 | 1,859.00 | 185,900 |
| トリドールホールディングス | 100 | 3,450.00 | 345,000 |
| 帝人 | 500 | 1,372.00 | 686,000 |
| 東レ | 3,300 | 726.30 | 2,396,790 |
| クラレ | 700 | 1,701.50 | 1,191,050 |
| 旭化成 | 3,100 | 924.70 | 2,866,570 |
| トーカロ | 200 | 1,370.00 | 274,000 |
| SUMCO | 900 | 1,953.50 | 1,758,150 |
| グッドコムアセット | 100 | 994.00 | 99,400 |
| JMホールディングス | 100 | 1,934.00 | 193,400 |
| コメダホールディングス | 100 | 2,667.00 | 266,700 |
| アレンザホールディングス | 100 | 991.00 | 99,100 |
| FOOD & LIFE COMPANIES | 300 | 2,486.50 | 745,950 |
| セーレン | 100 | 2,140.00 | 214,000 |
| 小松マテーレ | 100 | 720.00 | 72,000 |
| ワコールホールディングス | 100 | 3,442.00 | 344,200 |
| ホギメディカル | 100 | 3,230.00 | 323,000 |

| | | | |
|----------------------|-------|----------|------------|
| T S Iホールディングス | 200 | 767.00 | 153,400 |
| ワールド | 100 | 1,532.00 | 153,200 |
| T I S | 500 | 3,142.00 | 1,571,000 |
| グリー | 200 | 561.00 | 112,200 |
| コーエーテクモホールディングス | 300 | 2,026.50 | 607,950 |
| ネクソン | 1,100 | 2,500.00 | 2,750,000 |
| アイスタイル | 200 | 433.00 | 86,600 |
| エムアップホールディングス | 100 | 1,147.00 | 114,700 |
| コロプラ | 200 | 581.00 | 116,200 |
| オルトプラス | 100 | 187.00 | 18,700 |
| ブロードリーフ | 300 | 518.00 | 155,400 |
| じげん | 200 | 506.00 | 101,200 |
| フィックスターズ | 100 | 1,000.00 | 100,000 |
| オブティム | 100 | 806.00 | 80,600 |
| テクマトリックス | 100 | 1,487.00 | 148,700 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 100 | 2,303.50 | 230,350 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 100 | 6,281.00 | 628,100 |
| インターネットイニシアティブ | 300 | 2,452.00 | 735,600 |
| さくらインターネット | 100 | 1,119.00 | 111,900 |
| 朝日ネット | 100 | 603.00 | 60,300 |
| e B A S E | 100 | 652.00 | 65,200 |
| アバントグループ | 100 | 1,208.00 | 120,800 |
| コムチュア | 100 | 2,128.00 | 212,800 |
| 王子ホールディングス | 2,000 | 618.20 | 1,236,400 |
| 日本製紙 | 300 | 1,288.00 | 386,400 |
| 北越コーポレーション | 300 | 1,037.00 | 311,100 |
| 大王製紙 | 200 | 1,197.00 | 239,400 |
| メディカル・データ・ビジョン | 100 | 687.00 | 68,700 |
| ラクス | 200 | 1,800.50 | 360,100 |
| レンゴー | 400 | 992.70 | 397,080 |
| チェンジホールディングス | 100 | 1,507.00 | 150,700 |
| マクロミル | 100 | 667.00 | 66,700 |
| マネーフォワード | 100 | 3,772.00 | 377,200 |
| レゾナック・ホールディングス | 500 | 2,457.50 | 1,228,750 |
| 住友化学 | 3,600 | 402.20 | 1,447,920 |
| 日産化学 | 200 | 6,359.00 | 1,271,800 |
| 石原産業 | 100 | 1,435.00 | 143,500 |
| 日本曹達 | 100 | 5,420.00 | 542,000 |
| 東ソー | 600 | 1,788.50 | 1,073,100 |
| トクヤマ | 200 | 2,251.50 | 450,300 |
| セントラル硝子 | 100 | 2,918.00 | 291,800 |
| 東亜合成 | 300 | 1,338.50 | 401,550 |
| 関東電化工業 | 100 | 810.00 | 81,000 |
| デンカ | 200 | 2,716.00 | 543,200 |
| イビデン | 300 | 7,414.00 | 2,224,200 |
| 信越化学工業 | 4,100 | 4,297.00 | 17,617,700 |
| 第一稀元素化学工業 | 100 | 937.00 | 93,700 |
| エア・ウォーター | 500 | 1,845.50 | 922,750 |
| 日本酸素ホールディングス | 500 | 3,697.00 | 1,848,500 |

| | | | |
|------------------|-------|----------|------------|
| 日本パーカラライジング | 200 | 1,094.00 | 218,800 |
| 高圧ガス工業 | 100 | 768.00 | 76,800 |
| 四国化成ホールディングス | 100 | 1,703.00 | 170,300 |
| 日本触媒 | 100 | 5,445.00 | 544,500 |
| カネカ | 100 | 3,740.00 | 374,000 |
| 協和キリン | 600 | 2,374.00 | 1,424,400 |
| APPIER GROUP | 200 | 1,375.00 | 275,000 |
| 三菱瓦斯化学 | 400 | 2,019.50 | 807,800 |
| 三井化学 | 400 | 3,656.00 | 1,462,400 |
| J S R | 500 | 4,010.00 | 2,005,000 |
| 東京応化工業 | 100 | 8,603.00 | 860,300 |
| 三菱ケミカルグループ | 3,300 | 855.20 | 2,822,160 |
| KHネオケム | 100 | 2,226.00 | 222,600 |
| ダイセル | 700 | 1,226.50 | 858,550 |
| 住友ベークライト | 100 | 6,659.00 | 665,900 |
| 積水化学工業 | 1,000 | 2,019.50 | 2,019,500 |
| 日本ゼオン | 300 | 1,507.00 | 452,100 |
| アイカ工業 | 100 | 3,276.00 | 327,600 |
| UBE | 200 | 2,287.50 | 457,500 |
| 積水樹脂 | 100 | 2,423.00 | 242,300 |
| タキロンシーアイ | 100 | 564.00 | 56,400 |
| リケンテクノス | 100 | 719.00 | 71,900 |
| 積水化成成品工業 | 100 | 439.00 | 43,900 |
| ダイキョーニシカワ | 100 | 762.00 | 76,200 |
| 日本化薬 | 400 | 1,263.50 | 505,400 |
| プレステージ・インターナショナル | 200 | 599.00 | 119,800 |
| プロトコーポレーション | 100 | 1,111.00 | 111,100 |
| 野村総合研究所 | 1,000 | 3,739.00 | 3,739,000 |
| 電通グループ | 500 | 4,416.00 | 2,208,000 |
| インテージホールディングス | 100 | 1,767.00 | 176,700 |
| ソースネクスト | 300 | 175.00 | 52,500 |
| シーティーエス | 100 | 676.00 | 67,600 |
| インフォコム | 100 | 2,607.00 | 260,700 |
| トリケミカル研究所 | 100 | 3,325.00 | 332,500 |
| シンプレクス・ホールディングス | 100 | 2,646.00 | 264,600 |
| ラクスル | 100 | 1,138.00 | 113,800 |
| メルカリ | 300 | 3,054.00 | 916,200 |
| ADEKA | 200 | 2,652.00 | 530,400 |
| 日油 | 200 | 6,006.00 | 1,201,200 |
| ウイングアーク1st | 100 | 2,746.00 | 274,600 |
| Sansan | 200 | 1,102.00 | 220,400 |
| 花王 | 1,100 | 5,444.00 | 5,988,400 |
| メドレー | 100 | 4,230.00 | 423,000 |
| JMDC | 100 | 4,870.00 | 487,000 |
| 武田薬品工業 | 4,300 | 4,352.00 | 18,713,600 |
| アステラス製薬 | 4,600 | 1,882.00 | 8,657,200 |
| 住友ファーマ | 400 | 480.00 | 192,000 |
| 塩野義製薬 | 600 | 6,993.00 | 4,195,800 |
| 日本新薬 | 100 | 5,510.00 | 551,000 |
| 中外製薬 | 1,500 | 4,548.00 | 6,822,000 |

| | | | |
|--------------------|-------|-----------|------------|
| 科研製薬 | 100 | 3,344.00 | 334,400 |
| エーザイ | 600 | 8,085.00 | 4,851,000 |
| ロート製薬 | 500 | 3,395.00 | 1,697,500 |
| 小野薬品工業 | 900 | 2,631.50 | 2,368,350 |
| 久光製薬 | 100 | 4,806.00 | 480,600 |
| 持田製薬 | 100 | 3,310.00 | 331,000 |
| 参天製薬 | 900 | 1,294.50 | 1,165,050 |
| ツムラ | 200 | 2,621.00 | 524,200 |
| テルモ | 1,500 | 3,869.00 | 5,803,500 |
| H. U. グループホールディングス | 200 | 2,444.50 | 488,900 |
| キッセイ薬品工業 | 100 | 3,210.00 | 321,000 |
| 生化学工業 | 100 | 769.00 | 76,900 |
| 栄研化学 | 100 | 1,463.00 | 146,300 |
| JCRファーマ | 200 | 1,115.50 | 223,100 |
| 東和薬品 | 100 | 2,681.00 | 268,100 |
| ゼリア新薬工業 | 100 | 2,008.00 | 200,800 |
| そーせいグループ | 200 | 1,344.00 | 268,800 |
| 第一三共 | 4,300 | 4,095.00 | 17,608,500 |
| 杏林製薬 | 100 | 1,785.00 | 178,500 |
| 大幸薬品 | 100 | 328.00 | 32,800 |
| 大塚ホールディングス | 1,000 | 4,980.00 | 4,980,000 |
| 大正製薬ホールディングス | 100 | 5,926.00 | 592,600 |
| ペプチドリーム | 200 | 1,256.00 | 251,200 |
| 大日本塗料 | 100 | 939.00 | 93,900 |
| 日本ペイントホールディングス | 2,600 | 965.50 | 2,510,300 |
| 関西ペイント | 400 | 2,177.50 | 871,000 |
| 中国塗料 | 100 | 1,317.00 | 131,700 |
| 太陽ホールディングス | 100 | 2,460.00 | 246,000 |
| D I C | 200 | 2,385.50 | 477,100 |
| サカタインクス | 100 | 1,222.00 | 122,200 |
| 東洋インキS Cホールディングス | 100 | 2,464.00 | 246,400 |
| アルプス技研 | 100 | 2,527.00 | 252,700 |
| サニックス | 100 | 310.00 | 31,000 |
| 日本空調サービス | 100 | 762.00 | 76,200 |
| オリエンタルランド | 2,700 | 4,578.00 | 12,360,600 |
| フォーカスシステムズ | 100 | 967.00 | 96,700 |
| ダスキン | 100 | 3,250.00 | 325,000 |
| パーク24 | 300 | 1,659.00 | 497,700 |
| 明光ネットワークジャパン | 100 | 695.00 | 69,500 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 500 | 1,510.00 | 755,000 |
| ラウンドワン | 400 | 534.00 | 213,600 |
| リゾートトラスト | 200 | 2,097.00 | 419,400 |
| オービック | 200 | 22,290.00 | 4,458,000 |
| ジャストシステム | 100 | 2,728.50 | 272,850 |
| L I N Eヤフー | 7,000 | 382.30 | 2,676,100 |
| ビー・エム・エル | 100 | 2,749.00 | 274,900 |
| トレンドマイクロ | 200 | 5,597.00 | 1,119,400 |
| リソー教育 | 300 | 257.00 | 77,100 |
| 日本オラクル | 100 | 10,575.00 | 1,057,500 |
| フューチャー | 100 | 1,446.00 | 144,600 |

| | | | |
|--------------------|-------|-----------|-----------|
| ユー・エス・エス | 500 | 2,586.50 | 1,293,250 |
| オービックビジネスコンサルタント | 100 | 6,060.00 | 606,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 100 | 4,321.00 | 432,100 |
| アイティフォー | 100 | 1,067.00 | 106,700 |
| サイバーエージェント | 1,100 | 777.90 | 855,690 |
| 楽天グループ | 4,300 | 575.00 | 2,472,500 |
| テー・オー・ダブリュー | 300 | 309.00 | 92,700 |
| 大塚商会 | 200 | 5,952.00 | 1,190,400 |
| サイボウズ | 100 | 1,701.00 | 170,100 |
| セントラルスポーツ | 100 | 2,369.00 | 236,900 |
| 電通国際情報サービス | 100 | 5,210.00 | 521,000 |
| デジタルガレージ | 100 | 2,809.00 | 280,900 |
| C I J | 100 | 534.00 | 53,400 |
| WOWOW | 100 | 1,090.00 | 109,000 |
| スカラ | 100 | 753.00 | 75,300 |
| フルキャストホールディングス | 100 | 1,699.00 | 169,900 |
| エン・ジャパン | 100 | 2,125.00 | 212,500 |
| あすか製薬ホールディングス | 100 | 1,717.00 | 171,700 |
| サワイグループホールディングス | 100 | 4,575.00 | 457,500 |
| 富士フイルムホールディングス | 900 | 8,470.00 | 7,623,000 |
| コニカミノルタ | 1,100 | 450.20 | 495,220 |
| 資生堂 | 1,000 | 4,711.00 | 4,711,000 |
| ライオン | 600 | 1,418.00 | 850,800 |
| マンダム | 100 | 1,350.00 | 135,000 |
| ミルボン | 100 | 4,001.00 | 400,100 |
| ファンケル | 200 | 2,224.00 | 444,800 |
| コーセー | 100 | 10,015.00 | 1,001,500 |
| コタ | 100 | 1,625.00 | 162,500 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 300 | 1,664.50 | 499,350 |
| エステー | 100 | 1,497.00 | 149,700 |
| コニシ | 100 | 2,179.00 | 217,900 |
| 長谷川香料 | 100 | 3,070.00 | 307,000 |
| 小林製薬 | 100 | 6,165.00 | 616,500 |
| 荒川化学工業 | 100 | 1,010.00 | 101,000 |
| タカラバイオ | 100 | 1,287.00 | 128,700 |
| J C U | 100 | 3,165.00 | 316,500 |
| デクセリアルズ | 100 | 3,740.00 | 374,000 |
| 北興化学工業 | 100 | 913.00 | 91,300 |
| クミアイ化学工業 | 200 | 1,149.00 | 229,800 |
| 日本農薬 | 100 | 650.00 | 65,000 |
| ニチレキ | 100 | 2,038.00 | 203,800 |
| 富士石油 | 100 | 326.00 | 32,600 |
| 出光興産 | 500 | 3,332.00 | 1,666,000 |
| E N E O S ホールディングス | 8,400 | 565.00 | 4,746,000 |
| コスモエネルギーホールディングス | 200 | 5,324.00 | 1,064,800 |
| テスホールディングス | 100 | 478.00 | 47,800 |
| インフロニア・ホールディングス | 500 | 1,541.50 | 770,750 |
| 横浜ゴム | 300 | 2,849.50 | 854,850 |
| TOYO TIRE | 300 | 2,225.00 | 667,500 |
| ブリヂストン | 1,400 | 5,808.00 | 8,131,200 |

| | | | |
|------------------|-------|----------|-----------|
| 住友ゴム工業 | 500 | 1,490.00 | 745,000 |
| アキレス | 100 | 1,503.00 | 150,300 |
| ニッタ | 100 | 3,390.00 | 339,000 |
| 住友理工 | 100 | 1,017.00 | 101,700 |
| 三ツ星ベルト | 100 | 4,450.00 | 445,000 |
| バンドー化学 | 100 | 1,514.00 | 151,400 |
| A G C | 500 | 5,169.00 | 2,584,500 |
| 日本板硝子 | 300 | 685.00 | 205,500 |
| 日本電気硝子 | 200 | 2,770.00 | 554,000 |
| 住友大阪セメント | 100 | 3,501.00 | 350,100 |
| 太平洋セメント | 300 | 2,514.50 | 754,350 |
| 日本コンクリート工業 | 200 | 300.00 | 60,000 |
| アジアパイルホールディングス | 100 | 679.00 | 67,900 |
| 東海カーボン | 500 | 1,134.00 | 567,000 |
| T O T O | 300 | 3,674.00 | 1,102,200 |
| 日本碍子 | 600 | 1,774.00 | 1,064,400 |
| 日本特殊陶業 | 400 | 3,184.00 | 1,273,600 |
| フジミインコーポレーテッド | 100 | 2,920.00 | 292,000 |
| ニチアス | 100 | 3,020.00 | 302,000 |
| 日本製鉄 | 2,300 | 3,219.00 | 7,403,700 |
| 神戸製鋼所 | 1,000 | 1,788.00 | 1,788,000 |
| 中山製鋼所 | 100 | 848.00 | 84,800 |
| J F Eホールディングス | 1,400 | 2,069.50 | 2,897,300 |
| 東京製鉄 | 100 | 1,637.00 | 163,700 |
| 共英製鋼 | 100 | 1,854.00 | 185,400 |
| 大和工業 | 100 | 6,969.00 | 696,900 |
| 淀川製鋼所 | 100 | 3,525.00 | 352,500 |
| 丸一鋼管 | 200 | 3,649.00 | 729,800 |
| 大同特殊鋼 | 100 | 5,895.00 | 589,500 |
| 山陽特殊製鋼 | 100 | 2,646.00 | 264,600 |
| 新日本電工 | 300 | 288.00 | 86,400 |
| 日本製鋼所 | 100 | 2,539.50 | 253,950 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 100 | 1,214.00 | 121,400 |
| 日本軽金属ホールディングス | 100 | 1,583.00 | 158,300 |
| 三井金属鉱業 | 100 | 3,762.00 | 376,200 |
| 三菱マテリアル | 300 | 2,325.00 | 697,500 |
| 住友金属鉱山 | 600 | 4,138.00 | 2,482,800 |
| D O W Aホールディングス | 100 | 4,500.00 | 450,000 |
| 古河機械金属 | 100 | 1,907.00 | 190,700 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 100 | 3,120.00 | 312,000 |
| 東邦チタニウム | 100 | 1,818.00 | 181,800 |
| U A C J | 100 | 3,000.00 | 300,000 |
| 古河電気工業 | 200 | 2,245.50 | 449,100 |
| 住友電気工業 | 1,700 | 1,606.00 | 2,730,200 |
| フジクラ | 500 | 1,135.50 | 567,750 |
| S W C C | 100 | 1,998.00 | 199,800 |
| タツタ電線 | 100 | 694.00 | 69,400 |
| いよぎんホールディングス | 600 | 1,066.50 | 639,900 |
| しずおかフィナンシャルグループ | 1,100 | 1,236.00 | 1,359,600 |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 400 | 1,155.00 | 462,000 |

| | | | |
|------------------|-------|-----------|------------|
| 楽天銀行 | 200 | 2,390.00 | 478,000 |
| 京都フィナンシャルグループ | 200 | 8,461.00 | 1,692,200 |
| リョービ | 100 | 2,682.00 | 268,200 |
| AREホールディングス | 200 | 1,880.00 | 376,000 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 300 | 2,460.50 | 738,150 |
| 横河ブリッジホールディングス | 100 | 2,657.00 | 265,700 |
| 三和ホールディングス | 500 | 2,028.00 | 1,014,000 |
| 文化シャッター | 200 | 1,130.00 | 226,000 |
| 三協立山 | 100 | 775.00 | 77,500 |
| LIXIL | 700 | 1,616.50 | 1,131,550 |
| ノーリツ | 100 | 1,565.00 | 156,500 |
| 長府製作所 | 100 | 2,105.00 | 210,500 |
| リンナイ | 300 | 2,688.00 | 806,400 |
| ユニプレス | 100 | 1,048.00 | 104,800 |
| 日東精工 | 100 | 573.00 | 57,300 |
| 岡部 | 100 | 718.00 | 71,800 |
| ジーテクト | 100 | 1,738.00 | 173,800 |
| 東プレ | 100 | 1,603.00 | 160,300 |
| 高周波熱錬 | 100 | 1,012.00 | 101,200 |
| パイオラックス | 100 | 2,147.00 | 214,700 |
| エイチワン | 100 | 789.00 | 78,900 |
| 日本発条 | 500 | 1,049.50 | 524,750 |
| 三浦工業 | 200 | 2,953.00 | 590,600 |
| タクマ | 100 | 1,467.00 | 146,700 |
| テクノプロ・ホールディングス | 300 | 2,953.00 | 885,900 |
| ジャパンマテリアル | 200 | 2,364.00 | 472,800 |
| ベクトル | 100 | 1,128.00 | 112,800 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 100 | 1,089.00 | 108,900 |
| バリューHR | 100 | 1,212.00 | 121,200 |
| シグマクシス・ホールディングス | 100 | 1,455.00 | 145,500 |
| ウィルグループ | 100 | 1,095.00 | 109,500 |
| メドピア | 100 | 955.00 | 95,500 |
| リクルートホールディングス | 3,700 | 4,498.00 | 16,642,600 |
| エラン | 100 | 749.00 | 74,900 |
| ツガミ | 100 | 1,115.00 | 111,500 |
| オークマ | 100 | 6,502.00 | 650,200 |
| アマダ | 800 | 1,470.50 | 1,176,400 |
| アイダエンジニアリング | 100 | 925.00 | 92,500 |
| FUJI | 200 | 2,355.50 | 471,100 |
| 牧野フライス製作所 | 100 | 6,200.00 | 620,000 |
| オーエスジー | 200 | 1,716.00 | 343,200 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 100 | 813.00 | 81,300 |
| DMG森精機 | 300 | 2,467.50 | 740,250 |
| ソディック | 100 | 764.00 | 76,400 |
| ディスコ | 200 | 28,000.00 | 5,600,000 |
| 日進工具 | 100 | 1,078.00 | 107,800 |
| 日本郵政 | 6,100 | 1,278.50 | 7,798,850 |
| ベルシステム24ホールディングス | 100 | 1,476.00 | 147,600 |
| 鎌倉新書 | 100 | 590.00 | 59,000 |
| ソラスト | 200 | 561.00 | 112,200 |

| | | | |
|-------------|-------|-----------|------------|
| インソース | 100 | 852.00 | 85,200 |
| 豊田自動織機 | 400 | 11,140.00 | 4,456,000 |
| 島精機製作所 | 100 | 1,623.00 | 162,300 |
| オプトラン | 100 | 1,829.00 | 182,900 |
| フリー | 100 | 1,427.00 | 142,700 |
| ヤマシンフィルタ | 100 | 304.00 | 30,400 |
| 日阪製作所 | 100 | 956.00 | 95,600 |
| やまびこ | 100 | 1,387.00 | 138,700 |
| ナブテスコ | 300 | 2,692.00 | 807,600 |
| 三井海洋開発 | 100 | 1,689.00 | 168,900 |
| レオン自動機 | 100 | 1,320.00 | 132,000 |
| SMC | 200 | 70,110.00 | 14,022,000 |
| オイレス工業 | 100 | 1,927.00 | 192,700 |
| サトーホールディングス | 100 | 2,044.00 | 204,400 |
| 日精樹脂工業 | 100 | 1,029.00 | 102,900 |
| 小松製作所 | 2,300 | 3,810.00 | 8,763,000 |
| 住友重機械工業 | 300 | 3,533.00 | 1,059,900 |
| 日立建機 | 200 | 4,089.00 | 817,800 |
| 日工 | 100 | 659.00 | 65,900 |
| 井関農機 | 100 | 1,098.00 | 109,800 |
| TOWA | 100 | 5,370.00 | 537,000 |
| クボタ | 2,600 | 2,018.00 | 5,246,800 |
| 東洋エンジニアリング | 100 | 585.00 | 58,500 |
| 月島ホールディングス | 100 | 1,253.00 | 125,300 |
| 新東工業 | 100 | 1,041.00 | 104,100 |
| 澁谷工業 | 100 | 2,450.00 | 245,000 |
| 小森コーポレーション | 100 | 1,039.00 | 103,900 |
| 荏原製作所 | 200 | 6,556.00 | 1,311,200 |
| 北越工業 | 100 | 1,876.00 | 187,600 |
| ダイキン工業 | 600 | 22,015.00 | 13,209,000 |
| オルガノ | 100 | 3,935.00 | 393,500 |
| 栗田工業 | 300 | 4,332.00 | 1,299,600 |
| 椿本チエイン | 100 | 3,840.00 | 384,000 |
| 日機装 | 100 | 927.00 | 92,700 |
| レイズネクスト | 100 | 1,450.00 | 145,000 |
| アネスト岩田 | 100 | 1,114.00 | 111,400 |
| ダイフク | 800 | 2,573.00 | 2,058,400 |
| タダノ | 300 | 1,156.00 | 346,800 |
| フジテック | 200 | 3,235.00 | 647,000 |
| CKD | 100 | 2,038.00 | 203,800 |
| 平和 | 200 | 2,115.00 | 423,000 |
| SANKYO | 100 | 6,260.00 | 626,000 |
| 日本金銭機械 | 100 | 965.00 | 96,500 |
| 竹内製作所 | 100 | 4,580.00 | 458,000 |
| アマノ | 100 | 3,156.00 | 315,600 |
| JUKI | 100 | 594.00 | 59,400 |
| サンデン | 100 | 186.00 | 18,600 |
| ジャノメ | 100 | 690.00 | 69,000 |
| ブラザー工業 | 700 | 2,365.00 | 1,655,500 |
| マックス | 100 | 2,534.00 | 253,400 |

| | | | |
|------------------------|-------|-----------|------------|
| モリタホールディングス | 100 | 1,554.00 | 155,400 |
| グローリー | 100 | 2,780.00 | 278,000 |
| 新晃工業 | 100 | 2,153.00 | 215,300 |
| 大和冷機工業 | 100 | 1,322.00 | 132,200 |
| セガサミーホールディングス | 400 | 2,405.00 | 962,000 |
| T P R | 100 | 1,738.00 | 173,800 |
| ホシザキ | 300 | 4,825.00 | 1,447,500 |
| 大豊工業 | 100 | 802.00 | 80,200 |
| 日本精工 | 800 | 821.20 | 656,960 |
| NTN | 1,000 | 270.30 | 270,300 |
| ジェイテクト | 400 | 1,259.50 | 503,800 |
| ミネベアミツミ | 900 | 2,352.00 | 2,116,800 |
| 日本トムソン | 200 | 549.00 | 109,800 |
| THK | 300 | 2,730.50 | 819,150 |
| 前澤給装工業 | 100 | 1,266.00 | 126,600 |
| イーグル工業 | 100 | 1,648.00 | 164,800 |
| キット | 200 | 1,015.00 | 203,000 |
| 日立製作所 | 2,400 | 8,750.00 | 21,000,000 |
| 東芝 | 1,000 | 4,601.00 | 4,601,000 |
| 三菱電機 | 5,100 | 1,765.00 | 9,001,500 |
| 富士電機 | 300 | 6,237.00 | 1,871,100 |
| 安川電機 | 600 | 5,155.00 | 3,093,000 |
| シンフォニア テクノロジー | 100 | 1,540.00 | 154,000 |
| 明電舎 | 100 | 2,052.00 | 205,200 |
| PHCホールディングス | 100 | 1,443.00 | 144,300 |
| ソシオネクスト | 100 | 14,830.00 | 1,483,000 |
| バイカレント・コンサルティング | 400 | 3,969.00 | 1,587,600 |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 200 | 1,915.00 | 383,000 |
| 三櫻工業 | 100 | 878.00 | 87,800 |
| マキタ | 600 | 3,616.00 | 2,169,600 |
| 東芝テック | 100 | 3,165.00 | 316,500 |
| マブチモーター | 100 | 4,355.00 | 435,500 |
| ニデック | 1,200 | 6,699.00 | 8,038,800 |
| ダブル・スコープ | 100 | 986.00 | 98,600 |
| ヤーマン | 100 | 1,018.00 | 101,800 |
| J V Cケンウッド | 500 | 626.00 | 313,000 |
| ミマキエンジニアリング | 100 | 748.00 | 74,800 |
| 大崎電気工業 | 100 | 635.00 | 63,500 |
| オムロン | 500 | 6,210.00 | 3,105,000 |
| 日東工業 | 100 | 3,455.00 | 345,500 |
| I D E C | 100 | 2,792.00 | 279,200 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 200 | 2,440.00 | 488,000 |
| 日本電気 | 700 | 7,636.00 | 5,345,200 |
| 富士通 | 500 | 17,020.00 | 8,510,000 |
| 沖電気工業 | 200 | 945.00 | 189,000 |
| ルネサスエレクトロニクス | 3,200 | 2,249.00 | 7,196,800 |
| セイコーエプソン | 600 | 2,309.00 | 1,385,400 |
| ワコム | 400 | 559.00 | 223,600 |
| アルバック | 100 | 5,483.00 | 548,300 |

| | | | |
|-----------------|-------|-----------|------------|
| ジャパンディスプレイ | 2,200 | 38.00 | 83,600 |
| 日本信号 | 100 | 914.00 | 91,400 |
| 京三製作所 | 100 | 484.00 | 48,400 |
| 能美防災 | 100 | 1,772.00 | 177,200 |
| エレコム | 100 | 1,735.00 | 173,500 |
| パナソニック ホールディングス | 5,800 | 1,487.50 | 8,627,500 |
| シャープ | 600 | 934.40 | 560,640 |
| アンリツ | 400 | 997.10 | 398,840 |
| 富士通ゼネラル | 100 | 2,655.50 | 265,550 |
| ソニーグループ | 3,500 | 12,555.00 | 43,942,500 |
| TDK | 800 | 5,606.00 | 4,484,800 |
| タムラ製作所 | 200 | 500.00 | 100,000 |
| アルプスアルパイン | 400 | 1,236.50 | 494,600 |
| 日本電波工業 | 100 | 1,216.00 | 121,600 |
| メイコー | 100 | 3,225.00 | 322,500 |
| フォスター電機 | 100 | 948.00 | 94,800 |
| ホシデン | 100 | 1,750.00 | 175,000 |
| ヒロセ電機 | 100 | 17,820.00 | 1,782,000 |
| 日本航空電子工業 | 100 | 2,876.00 | 287,600 |
| TOA | 100 | 1,057.00 | 105,700 |
| マクセル | 100 | 1,605.00 | 160,500 |
| 古野電気 | 100 | 1,585.00 | 158,500 |
| スミダコーポレーション | 100 | 1,321.00 | 132,100 |
| 横河電機 | 500 | 2,711.50 | 1,355,750 |
| アズビル | 300 | 4,492.00 | 1,347,600 |
| 日本光電工業 | 200 | 3,571.00 | 714,200 |
| 堀場製作所 | 100 | 7,790.00 | 779,000 |
| アドバンテスト | 1,600 | 4,259.00 | 6,814,400 |
| キーエンス | 500 | 54,630.00 | 27,315,000 |
| シスメックス | 400 | 7,056.00 | 2,822,400 |
| 日本マイクロニクス | 100 | 2,349.00 | 234,900 |
| デンソー | 4,000 | 2,312.50 | 9,250,000 |
| コーセル | 100 | 1,155.00 | 115,500 |
| オプテックスグループ | 100 | 1,669.00 | 166,900 |
| レーザーテック | 200 | 26,500.00 | 5,300,000 |
| スタンレー電気 | 300 | 2,388.00 | 716,400 |
| ウシオ電機 | 300 | 1,935.50 | 580,650 |
| 古河電池 | 100 | 923.00 | 92,300 |
| 日本電子 | 100 | 4,841.00 | 484,100 |
| カシオ計算機 | 400 | 1,184.50 | 473,800 |
| ファナック | 2,400 | 3,823.00 | 9,175,200 |
| 日本シイエムケイ | 100 | 668.00 | 66,800 |
| 大真空 | 100 | 738.00 | 73,800 |
| ローム | 800 | 2,724.50 | 2,179,600 |
| 浜松ホトニクス | 400 | 5,921.00 | 2,368,400 |
| 三井ハイテック | 100 | 6,730.00 | 673,000 |
| 新光電気工業 | 200 | 5,476.00 | 1,095,200 |
| 京セラ | 800 | 7,324.00 | 5,859,200 |
| 太陽誘電 | 200 | 3,472.00 | 694,400 |
| 村田製作所 | 4,500 | 2,632.00 | 11,844,000 |

| | | | |
|---------------------|--------|----------|------------|
| 双葉電子工業 | 100 | 507.00 | 50,700 |
| 日東電工 | 400 | 9,414.00 | 3,765,600 |
| 東海理化電機製作所 | 100 | 2,204.00 | 220,400 |
| ニチコン | 100 | 1,274.00 | 127,400 |
| 日本ケミコン | 100 | 1,295.00 | 129,500 |
| K O A | 100 | 1,661.00 | 166,100 |
| 三井E & S | 300 | 432.00 | 129,600 |
| 日立造船 | 400 | 793.00 | 317,200 |
| 三菱重工業 | 900 | 7,914.00 | 7,122,600 |
| 川崎重工業 | 400 | 3,433.00 | 1,373,200 |
| I H I | 300 | 2,821.00 | 846,300 |
| 名村造船所 | 100 | 816.00 | 81,600 |
| アンビスホールディングス | 100 | 2,312.00 | 231,200 |
| カーブスホールディングス | 200 | 653.00 | 130,600 |
| 三菱ロジスネクスト | 100 | 1,214.00 | 121,400 |
| F P G | 200 | 1,273.00 | 254,600 |
| 全国保証 | 100 | 4,888.00 | 488,800 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 2,400 | 425.90 | 1,022,160 |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 100 | 4,435.00 | 443,500 |
| 九州フィナンシャルグループ | 900 | 886.00 | 797,400 |
| かんぽ生命保険 | 600 | 2,717.00 | 1,630,200 |
| ゆうちょ銀行 | 1,300 | 1,334.00 | 1,734,200 |
| 富山第一銀行 | 200 | 934.00 | 186,800 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 2,600 | 689.00 | 1,791,400 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 300 | 1,728.00 | 518,400 |
| アルヒ | 100 | 823.00 | 82,300 |
| プレミアグループ | 100 | 1,398.00 | 139,800 |
| 日産自動車 | 7,000 | 600.90 | 4,206,300 |
| いすゞ自動車 | 1,400 | 1,771.00 | 2,479,400 |
| トヨタ自動車 | 26,900 | 2,617.00 | 70,397,300 |
| 日野自動車 | 600 | 531.40 | 318,840 |
| 三菱自動車工業 | 1,900 | 524.40 | 996,360 |
| 武蔵精密工業 | 100 | 1,462.00 | 146,200 |
| 日産車体 | 100 | 808.00 | 80,800 |
| 新明和工業 | 200 | 1,211.00 | 242,200 |
| 極東開発工業 | 100 | 1,767.00 | 176,700 |
| 曙ブレーキ工業 | 400 | 126.00 | 50,400 |
| タチエス | 100 | 1,609.00 | 160,900 |
| N O K | 200 | 1,887.00 | 377,400 |
| フタバ産業 | 200 | 696.00 | 139,200 |
| カヤバ | 100 | 4,375.00 | 437,500 |
| 市光工業 | 100 | 529.00 | 52,900 |
| 大同メタル工業 | 100 | 513.00 | 51,300 |
| プレス工業 | 300 | 642.00 | 192,600 |
| 太平洋工業 | 100 | 1,353.00 | 135,300 |
| アイシン | 400 | 5,386.00 | 2,154,400 |
| マツダ | 1,600 | 1,513.50 | 2,421,600 |
| 本田技研工業 | 12,000 | 1,632.00 | 19,584,000 |

| | | | |
|-----------------------------|-------|-----------|-----------|
| スズキ | 900 | 5,788.00 | 5,209,200 |
| SUBARU | 1,600 | 2,683.50 | 4,293,600 |
| ヤマハ発動機 | 700 | 3,778.00 | 2,644,600 |
| 小糸製作所 | 600 | 2,219.50 | 1,331,700 |
| エクセディ | 100 | 2,486.00 | 248,600 |
| ミツバ | 100 | 682.00 | 68,200 |
| 豊田合成 | 100 | 2,953.00 | 295,300 |
| 愛三工業 | 100 | 1,160.00 | 116,000 |
| ヨロズ | 100 | 890.00 | 89,000 |
| エフ・シー・シー | 100 | 1,768.00 | 176,800 |
| シマノ | 200 | 20,570.00 | 4,114,000 |
| テイ・エス テック | 200 | 1,663.50 | 332,700 |
| 三十三フィナンシャルグループ | 100 | 1,853.00 | 185,300 |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 100 | 3,790.00 | 379,000 |
| ひろぎんホールディングス | 600 | 942.70 | 565,620 |
| 十六フィナンシャルグループ | 100 | 3,805.00 | 380,500 |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 100 | 5,150.00 | 515,000 |
| ネットプロテクションズホールディングス | 200 | 275.00 | 55,000 |
| プロクレアホールディングス | 100 | 1,884.00 | 188,400 |
| あいちフィナンシャルグループ | 100 | 2,367.00 | 236,700 |
| 小野建 | 100 | 1,662.00 | 166,200 |
| ノジマ | 200 | 1,306.00 | 261,200 |
| カップ・クリエイト | 100 | 1,543.00 | 154,300 |
| コンドーテック | 100 | 1,113.00 | 111,300 |
| ナガイレーベン | 100 | 2,061.00 | 206,100 |
| 良品計画 | 600 | 2,001.00 | 1,200,600 |
| 第一興商 | 200 | 2,252.00 | 450,400 |
| メディパルホールディングス | 500 | 2,485.00 | 1,242,500 |
| アドヴァングループ | 100 | 1,014.00 | 101,400 |
| アズワン | 100 | 4,694.00 | 469,400 |
| ドウシシャ | 100 | 2,170.00 | 217,000 |
| G-7ホールディングス | 100 | 1,181.00 | 118,100 |
| イオン北海道 | 100 | 865.00 | 86,500 |
| コジマ | 100 | 633.00 | 63,300 |
| コーナン商事 | 100 | 3,935.00 | 393,500 |
| ネットワンシステムズ | 200 | 2,663.50 | 532,700 |
| ワタミ | 100 | 1,116.00 | 111,600 |
| パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | 1,000 | 2,825.50 | 2,825,500 |
| 丸文 | 100 | 1,138.00 | 113,800 |
| 西松屋チェーン | 100 | 1,863.00 | 186,300 |
| ゼンショーホールディングス | 300 | 7,032.00 | 2,109,600 |
| 幸楽苑ホールディングス | 100 | 1,091.00 | 109,100 |
| 日本ライフライン | 200 | 1,110.00 | 222,000 |
| サイゼリヤ | 100 | 5,690.00 | 569,000 |
| VTホールディングス | 200 | 503.00 | 100,600 |
| アルゴグラフィックス | 100 | 3,135.00 | 313,500 |
| IDOM | 200 | 857.00 | 171,400 |
| ユナイテッドアローズ | 100 | 1,879.00 | 187,900 |

| | | | |
|-------------------|-------|-----------|------------|
| ハイデイ日高 | 100 | 2,577.00 | 257,700 |
| シークス | 100 | 1,445.00 | 144,500 |
| コロワイド | 200 | 2,255.50 | 451,100 |
| スギホールディングス | 100 | 5,667.00 | 566,700 |
| 島津製作所 | 600 | 3,701.00 | 2,220,600 |
| スター精密 | 100 | 1,843.00 | 184,300 |
| 東京計器 | 100 | 1,474.00 | 147,400 |
| 東京精密 | 100 | 7,080.00 | 708,000 |
| マニー | 200 | 2,058.00 | 411,600 |
| ニコン | 700 | 1,490.00 | 1,043,000 |
| トプコン | 300 | 1,705.00 | 511,500 |
| オリンパス | 3,000 | 1,965.50 | 5,896,500 |
| SCREENホールディングス | 200 | 7,243.00 | 1,448,600 |
| HOYA | 1,000 | 14,615.00 | 14,615,000 |
| A&Dホロンホールディングス | 100 | 1,555.00 | 155,500 |
| 朝日インテック | 500 | 2,550.00 | 1,275,000 |
| キヤノン | 2,400 | 3,695.00 | 8,868,000 |
| リコー | 1,200 | 1,226.50 | 1,471,800 |
| シチズン時計 | 500 | 881.00 | 440,500 |
| メニコン | 200 | 1,710.00 | 342,000 |
| スノーピーク | 100 | 1,021.00 | 102,100 |
| パラマウントベッドホールディングス | 100 | 2,369.00 | 236,900 |
| ニホンフラッシュ | 100 | 862.00 | 86,200 |
| アートネイチャー | 100 | 814.00 | 81,400 |
| バンダイナムコホールディングス | 1,300 | 3,107.00 | 4,039,100 |
| SHOEI | 100 | 2,089.00 | 208,900 |
| フランスベッドホールディングス | 100 | 1,184.00 | 118,400 |
| マーベラス | 100 | 685.00 | 68,500 |
| パイロットコーポレーション | 100 | 5,164.00 | 516,400 |
| エイベックス | 100 | 1,328.00 | 132,800 |
| フジシールインターナショナル | 100 | 1,678.00 | 167,800 |
| タカラトミー | 200 | 2,015.00 | 403,000 |
| レック | 100 | 990.00 | 99,000 |
| 三光合成 | 100 | 540.00 | 54,000 |
| TOPPANホールディングス | 600 | 3,302.00 | 1,981,200 |
| 大日本印刷 | 500 | 3,870.00 | 1,935,000 |
| NISSHA | 100 | 1,593.00 | 159,300 |
| 前澤化成工業 | 100 | 1,493.00 | 149,300 |
| アシックス | 400 | 4,646.00 | 1,858,400 |
| ニチハ | 100 | 2,940.00 | 294,000 |
| エフピコ | 100 | 2,577.50 | 257,750 |
| ヤマハ | 300 | 3,945.00 | 1,183,500 |
| クリナップ | 100 | 688.00 | 68,800 |
| ピジョン | 300 | 1,607.00 | 482,100 |
| 象印マホービン | 100 | 1,516.00 | 151,600 |
| リンテック | 100 | 2,525.00 | 252,500 |
| 信越ポリマー | 100 | 1,317.00 | 131,700 |
| イトーキ | 100 | 1,414.00 | 141,400 |
| 任天堂 | 3,100 | 6,101.00 | 18,913,100 |
| 三菱鉛筆 | 100 | 1,853.00 | 185,300 |

| | | | |
|-------------------|-------|-----------|------------|
| タカラスタンダード | 100 | 1,800.00 | 180,000 |
| コクヨ | 200 | 2,346.00 | 469,200 |
| ニフコ | 200 | 3,729.00 | 745,800 |
| オカムラ | 100 | 2,134.00 | 213,400 |
| 伊藤忠商事 | 3,200 | 5,312.00 | 16,998,400 |
| 丸紅 | 4,000 | 2,215.50 | 8,862,000 |
| スクロール | 100 | 1,062.00 | 106,200 |
| ヨンドシーホールディングス | 100 | 1,893.00 | 189,300 |
| 長瀬産業 | 200 | 2,305.00 | 461,000 |
| 豊田通商 | 500 | 8,061.00 | 4,030,500 |
| オンワードホールディングス | 300 | 472.00 | 141,600 |
| 三共生興 | 100 | 810.00 | 81,000 |
| 兼松 | 200 | 1,940.00 | 388,000 |
| 美津濃 | 100 | 4,425.00 | 442,500 |
| 三井物産 | 3,600 | 5,518.00 | 19,864,800 |
| 東京エレクトロン | 1,000 | 20,085.00 | 20,085,000 |
| カメイ | 100 | 1,420.00 | 142,000 |
| セイコーグループ | 100 | 2,351.00 | 235,100 |
| 山善 | 100 | 1,193.00 | 119,300 |
| 住友商事 | 3,100 | 2,951.00 | 9,148,100 |
| B I P R O G Y | 200 | 3,669.00 | 733,800 |
| 三菱商事 | 3,200 | 6,947.00 | 22,230,400 |
| キャノンマーケティングジャパン | 100 | 3,863.00 | 386,300 |
| 佐藤商事 | 100 | 1,455.00 | 145,500 |
| 東京産業 | 100 | 819.00 | 81,900 |
| 阪和興業 | 100 | 4,410.00 | 441,000 |
| RYODEN | 100 | 2,336.00 | 233,600 |
| ニプロ | 400 | 1,085.00 | 434,000 |
| 岩谷産業 | 100 | 7,216.00 | 721,600 |
| アステナホールディングス | 200 | 528.00 | 105,600 |
| 三愛オプリー | 100 | 1,604.00 | 160,400 |
| 稲畑産業 | 100 | 3,070.00 | 307,000 |
| 明和産業 | 100 | 641.00 | 64,100 |
| ゴールドウイン | 100 | 9,851.00 | 985,100 |
| ユニ・チャーム | 1,000 | 5,053.00 | 5,053,000 |
| デサント | 100 | 4,305.00 | 430,500 |
| ワキタ | 100 | 1,518.00 | 151,800 |
| 東邦ホールディングス | 100 | 3,253.00 | 325,300 |
| サンゲツ | 100 | 2,860.00 | 286,000 |
| ミツウロコグループホールディングス | 100 | 1,287.00 | 128,700 |
| 伊藤忠エネクス | 100 | 1,510.00 | 151,000 |
| サンリオ | 100 | 6,431.00 | 643,100 |
| リョーサン | 100 | 4,620.00 | 462,000 |
| 新光商事 | 100 | 1,160.00 | 116,000 |
| 東陽テクニカ | 100 | 1,277.00 | 127,700 |
| モスフードサービス | 100 | 3,225.00 | 322,500 |
| 木曾路 | 100 | 2,520.00 | 252,000 |
| S R S ホールディングス | 100 | 1,023.00 | 102,300 |
| 千趣会 | 100 | 400.00 | 40,000 |
| リテールパートナーズ | 100 | 1,705.00 | 170,500 |

| | | | |
|-------------------|--------|-----------|------------|
| ケーヨー | 100 | 1,297.00 | 129,700 |
| 上新電機 | 100 | 2,327.00 | 232,700 |
| 日本瓦斯 | 300 | 2,201.50 | 660,450 |
| ロイヤルホールディングス | 100 | 2,434.00 | 243,400 |
| いなげや | 100 | 1,591.00 | 159,100 |
| リンガーハット | 100 | 2,281.00 | 228,100 |
| MrMaxHD | 100 | 610.00 | 61,000 |
| テナアライド | 100 | 293.00 | 29,300 |
| AOKIホールディングス | 100 | 969.00 | 96,900 |
| オークワ | 100 | 825.00 | 82,500 |
| コメリ | 100 | 3,090.00 | 309,000 |
| 青山商事 | 100 | 1,417.00 | 141,700 |
| しまむら | 100 | 14,675.00 | 1,467,500 |
| 高島屋 | 400 | 1,972.50 | 789,000 |
| 松屋 | 100 | 906.00 | 90,600 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 300 | 1,591.00 | 477,300 |
| 丸井グループ | 400 | 2,352.00 | 940,800 |
| クレディセゾン | 300 | 2,253.50 | 676,050 |
| イオン | 1,800 | 3,059.00 | 5,506,200 |
| イズミ | 100 | 3,803.00 | 380,300 |
| 平和堂 | 100 | 2,411.00 | 241,100 |
| フジ | 100 | 1,823.00 | 182,300 |
| ヤオコー | 100 | 7,489.00 | 748,900 |
| ゼビオホールディングス | 100 | 952.00 | 95,200 |
| ケーズホールディングス | 400 | 1,383.00 | 553,200 |
| PALTAC | 100 | 4,522.00 | 452,200 |
| 三谷産業 | 200 | 319.00 | 63,800 |
| あおぞら銀行 | 300 | 2,858.50 | 857,550 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 30,200 | 1,235.00 | 37,297,000 |
| りそなホールディングス | 6,100 | 807.40 | 4,925,140 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 900 | 5,603.00 | 5,042,700 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 3,400 | 7,190.00 | 24,446,000 |
| 千葉銀行 | 1,300 | 1,103.00 | 1,433,900 |
| 群馬銀行 | 1,000 | 693.90 | 693,900 |
| 武蔵野銀行 | 100 | 2,726.00 | 272,600 |
| 筑波銀行 | 300 | 281.00 | 84,300 |
| 七十七銀行 | 200 | 3,220.00 | 644,000 |
| 山形銀行 | 100 | 1,132.00 | 113,200 |
| 東邦銀行 | 400 | 277.00 | 110,800 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 400 | 3,742.00 | 1,496,800 |
| スルガ銀行 | 400 | 628.00 | 251,200 |
| 八十二銀行 | 1,100 | 821.00 | 903,100 |
| 山梨中央銀行 | 100 | 1,765.00 | 176,500 |
| 大垣共立銀行 | 100 | 1,979.00 | 197,900 |
| 福井銀行 | 100 | 1,548.00 | 154,800 |
| 滋賀銀行 | 100 | 3,730.00 | 373,000 |
| 南都銀行 | 100 | 2,616.00 | 261,600 |
| 百五銀行 | 500 | 536.00 | 268,000 |
| 紀陽銀行 | 200 | 1,485.00 | 297,000 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 300 | 1,652.00 | 495,600 |

| | | | |
|---------------------------|-------|----------|------------|
| 山陰合同銀行 | 300 | 992.00 | 297,600 |
| 四国銀行 | 100 | 1,029.00 | 102,900 |
| 阿波銀行 | 100 | 2,357.00 | 235,700 |
| 琉球銀行 | 100 | 1,183.00 | 118,300 |
| セブン銀行 | 1,700 | 293.80 | 499,460 |
| みずほフィナンシャルグループ | 7,000 | 2,546.00 | 17,822,000 |
| 山口フィナンシャルグループ | 500 | 1,292.50 | 646,250 |
| みずほリース | 100 | 4,715.00 | 471,500 |
| 東京センチュリー | 100 | 5,831.00 | 583,100 |
| SBIホールディングス | 700 | 3,121.00 | 2,184,700 |
| 日本証券金融 | 200 | 1,481.00 | 296,200 |
| アイフル | 800 | 386.00 | 308,800 |
| 北洋銀行 | 700 | 361.00 | 252,700 |
| 愛媛銀行 | 100 | 1,058.00 | 105,800 |
| 京葉銀行 | 200 | 661.00 | 132,200 |
| 栃木銀行 | 200 | 325.00 | 65,000 |
| 東和銀行 | 100 | 659.00 | 65,900 |
| イオンフィナンシャルサービス | 300 | 1,226.00 | 367,800 |
| アコム | 900 | 353.90 | 318,510 |
| ジャックス | 100 | 5,140.00 | 514,000 |
| オリエントコーポレーション | 100 | 1,112.00 | 111,200 |
| オリックス | 3,200 | 2,699.50 | 8,638,400 |
| 三菱HCキャピタル | 1,900 | 959.60 | 1,823,240 |
| ジャフコグループ | 200 | 1,547.00 | 309,400 |
| トモニホールディングス | 400 | 474.00 | 189,600 |
| 大和証券グループ本社 | 3,400 | 851.30 | 2,894,420 |
| 野村ホールディングス | 8,700 | 581.50 | 5,059,050 |
| 岡三証券グループ | 400 | 705.00 | 282,000 |
| 丸三証券 | 200 | 803.00 | 160,600 |
| 東洋証券 | 200 | 324.00 | 64,800 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 500 | 497.00 | 248,500 |
| 水戸証券 | 100 | 452.00 | 45,200 |
| いちよし証券 | 100 | 718.00 | 71,800 |
| 松井証券 | 200 | 754.00 | 150,800 |
| SOMPOホールディングス | 800 | 6,370.00 | 5,096,000 |
| 日本取引所グループ | 1,400 | 2,954.00 | 4,135,600 |
| マネックスグループ | 500 | 638.00 | 319,000 |
| 極東証券 | 100 | 1,000.00 | 100,000 |
| 岩井コスモホールディングス | 100 | 1,733.00 | 173,300 |
| アイザワ証券グループ | 100 | 1,140.00 | 114,000 |
| フィデアホールディングス | 100 | 1,584.00 | 158,400 |
| 池田泉州ホールディングス | 600 | 329.00 | 197,400 |
| アニコムホールディングス | 200 | 556.00 | 111,200 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 1,000 | 5,427.00 | 5,427,000 |
| スパークス・グループ | 100 | 1,428.00 | 142,800 |
| 第一生命ホールディングス | 2,400 | 3,089.00 | 7,413,600 |
| 東京海上ホールディングス | 4,800 | 3,353.00 | 16,094,400 |
| イー・ギャランティ | 100 | 1,753.00 | 175,300 |

| | | | |
|------------------|-------|----------|-----------|
| T&Dホールディングス | 1,300 | 2,543.50 | 3,306,550 |
| 三井不動産 | 2,100 | 3,290.00 | 6,909,000 |
| 三菱地所 | 2,900 | 1,954.50 | 5,668,050 |
| 平和不動産 | 100 | 3,980.00 | 398,000 |
| 東京建物 | 400 | 2,031.50 | 812,600 |
| 京阪神ビルディング | 100 | 1,365.00 | 136,500 |
| 住友不動産 | 900 | 3,726.00 | 3,353,400 |
| テーオーシー | 100 | 644.00 | 64,400 |
| レオパレス21 | 600 | 332.00 | 199,200 |
| スターツコーポレーション | 100 | 2,808.00 | 280,800 |
| フジ住宅 | 100 | 720.00 | 72,000 |
| ゴールドクレスト | 100 | 2,386.00 | 238,600 |
| リログループ | 300 | 1,459.50 | 437,850 |
| 日神グループホールディングス | 100 | 526.00 | 52,600 |
| 日本エスコン | 100 | 893.00 | 89,300 |
| MIRARTHホールディングス | 300 | 469.00 | 140,700 |
| イオンモール | 200 | 1,736.50 | 347,300 |
| カチタス | 100 | 2,057.00 | 205,700 |
| トーセイ | 100 | 1,768.00 | 176,800 |
| サンフロンティア不動産 | 100 | 1,457.00 | 145,700 |
| FJネクストホールディングス | 100 | 1,041.00 | 104,100 |
| 東武鉄道 | 500 | 3,520.00 | 1,760,000 |
| 相鉄ホールディングス | 200 | 2,680.00 | 536,000 |
| 東急 | 1,400 | 1,645.00 | 2,303,000 |
| 京浜急行電鉄 | 600 | 1,243.50 | 746,100 |
| 小田急電鉄 | 700 | 2,066.00 | 1,446,200 |
| 京王電鉄 | 300 | 4,374.00 | 1,312,200 |
| 京成電鉄 | 300 | 5,541.00 | 1,662,300 |
| 富士急行 | 100 | 4,065.00 | 406,500 |
| 東日本旅客鉄道 | 800 | 7,739.00 | 6,191,200 |
| 西日本旅客鉄道 | 600 | 5,635.00 | 3,381,000 |
| 東海旅客鉄道 | 2,000 | 3,335.00 | 6,670,000 |
| 西武ホールディングス | 600 | 1,427.00 | 856,200 |
| 鴻池運輸 | 100 | 1,904.00 | 190,400 |
| 西日本鉄道 | 100 | 2,391.50 | 239,150 |
| 近鉄グループホールディングス | 500 | 4,144.00 | 2,072,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 600 | 4,637.00 | 2,782,200 |
| 南海電気鉄道 | 200 | 2,810.50 | 562,100 |
| 京阪ホールディングス | 300 | 3,572.00 | 1,071,600 |
| 名古屋鉄道 | 500 | 2,077.00 | 1,038,500 |
| ヤマトホールディングス | 600 | 2,381.00 | 1,428,600 |
| 山九 | 100 | 5,090.00 | 509,000 |
| センコーグループホールディングス | 200 | 1,028.00 | 205,600 |
| ニッコンホールディングス | 200 | 3,239.00 | 647,800 |
| セイノーホールディングス | 300 | 2,129.50 | 638,850 |
| AZ-COM丸和ホールディングス | 100 | 2,034.00 | 203,400 |
| C&Fロジホールディングス | 100 | 1,372.00 | 137,200 |
| 日本郵船 | 1,300 | 3,863.00 | 5,021,900 |
| 商船三井 | 900 | 4,088.00 | 3,679,200 |
| 川崎汽船 | 400 | 5,225.00 | 2,090,000 |

| | | | |
|------------------------|---------|-----------|------------|
| 飯野海運 | 200 | 1,035.00 | 207,000 |
| 九州旅客鉄道 | 300 | 3,021.00 | 906,300 |
| SGホールディングス | 900 | 1,905.00 | 1,714,500 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 200 | 7,580.00 | 1,516,000 |
| 日本航空 | 1,200 | 2,657.00 | 3,188,400 |
| ANAホールディングス | 1,300 | 2,871.50 | 3,732,950 |
| TREホールディングス | 100 | 1,128.00 | 112,800 |
| KPPグループホールディングス | 100 | 623.00 | 62,300 |
| 三菱倉庫 | 100 | 3,879.00 | 387,900 |
| 住友倉庫 | 100 | 2,385.00 | 238,500 |
| 乾汽船 | 100 | 1,221.00 | 122,100 |
| 日本トランスシティ | 100 | 651.00 | 65,100 |
| 安田倉庫 | 100 | 1,082.00 | 108,200 |
| 大栄環境 | 100 | 2,064.00 | 206,400 |
| 日本管財ホールディングス | 100 | 2,451.00 | 245,100 |
| 上組 | 200 | 3,054.00 | 610,800 |
| TBSホールディングス | 300 | 2,400.00 | 720,000 |
| 日本テレビホールディングス | 400 | 1,471.50 | 588,600 |
| 朝日放送グループホールディングス | 100 | 664.00 | 66,400 |
| テレビ朝日ホールディングス | 100 | 1,621.00 | 162,100 |
| スカパーJSATホールディングス | 400 | 704.00 | 281,600 |
| ビジョン | 100 | 1,280.00 | 128,000 |
| USEN-NEXT HOLDINGS | 100 | 3,450.00 | 345,000 |
| 日本通信 | 500 | 204.00 | 102,000 |
| 日本電信電話 | 157,300 | 173.60 | 27,307,280 |
| KDDI | 3,800 | 4,452.00 | 16,917,600 |
| ソフトバンク | 7,900 | 1,673.50 | 13,220,650 |
| 光通信 | 100 | 21,335.00 | 2,133,500 |
| GMOインターネットグループ | 200 | 2,182.50 | 436,500 |
| KADOKAWA | 300 | 2,995.50 | 898,650 |
| 学研ホールディングス | 100 | 825.00 | 82,500 |
| ゼンリン | 100 | 927.00 | 92,700 |
| 東京電力ホールディングス | 4,400 | 636.20 | 2,799,280 |
| 中部電力 | 1,800 | 1,795.00 | 3,231,000 |
| 関西電力 | 1,900 | 1,943.00 | 3,691,700 |
| 中国電力 | 800 | 921.30 | 737,040 |
| 北陸電力 | 500 | 761.90 | 380,950 |
| 東北電力 | 1,200 | 940.70 | 1,128,840 |
| 四国電力 | 400 | 1,020.00 | 408,000 |
| 九州電力 | 1,100 | 953.30 | 1,048,630 |
| 北海道電力 | 500 | 633.90 | 316,950 |
| 沖縄電力 | 100 | 1,066.00 | 106,600 |
| 電源開発 | 400 | 2,319.50 | 927,800 |
| イーレックス | 100 | 722.00 | 72,200 |
| レノバ | 100 | 1,082.00 | 108,200 |
| 東京瓦斯 | 1,000 | 3,402.00 | 3,402,000 |
| 大阪瓦斯 | 1,000 | 2,466.00 | 2,466,000 |
| 東邦瓦斯 | 200 | 2,590.00 | 518,000 |

| | | | |
|----------------------|-------|-----------|-----------|
| 広島ガス | 200 | 389.00 | 77,800 |
| 西部ガスホールディングス | 100 | 1,950.00 | 195,000 |
| 静岡ガス | 100 | 1,009.00 | 100,900 |
| メタウォーター | 100 | 1,836.00 | 183,600 |
| 東宝 | 300 | 4,866.00 | 1,459,800 |
| エイチ・アイ・エス | 200 | 1,630.00 | 326,000 |
| NTTデータグループ | 1,500 | 1,768.00 | 2,652,000 |
| 共立メンテナンス | 100 | 5,577.00 | 557,700 |
| イチネンホールディングス | 100 | 1,367.00 | 136,700 |
| アインホールディングス | 100 | 4,072.00 | 407,200 |
| カナモト | 100 | 2,444.00 | 244,400 |
| D T S | 100 | 3,235.00 | 323,500 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 200 | 5,048.00 | 1,009,600 |
| シーイーシー | 100 | 1,530.00 | 153,000 |
| カプコン | 500 | 5,288.00 | 2,644,000 |
| ニシオホールディングス | 100 | 3,260.00 | 326,000 |
| 日本空港ビルデング | 200 | 6,407.00 | 1,281,400 |
| トランス・コスモス | 100 | 3,105.00 | 310,500 |
| 乃村工藝社 | 200 | 872.00 | 174,400 |
| ジャステック | 100 | 1,502.00 | 150,200 |
| S C S K | 400 | 2,466.00 | 986,400 |
| セコム | 500 | 10,090.00 | 5,045,000 |
| アイネス | 100 | 1,588.00 | 158,800 |
| 丹青社 | 100 | 836.00 | 83,600 |
| メイテックグループホールディングス | 200 | 2,586.50 | 517,300 |
| T K C | 100 | 3,500.00 | 350,000 |
| 富士ソフト | 100 | 5,410.00 | 541,000 |
| 船井総研ホールディングス | 100 | 2,504.00 | 250,400 |
| N S D | 200 | 2,772.00 | 554,400 |
| コナミグループ | 200 | 8,116.00 | 1,623,200 |
| ベネッセホールディングス | 200 | 1,778.00 | 355,600 |
| イオンディライト | 100 | 3,260.00 | 326,000 |
| ダイセキ | 100 | 4,060.00 | 406,000 |
| トラスコ中山 | 100 | 2,315.00 | 231,500 |
| ヤマダホールディングス | 2,100 | 461.40 | 968,940 |
| オートバックスセブン | 200 | 1,508.50 | 301,700 |
| アーケランズ | 200 | 1,527.00 | 305,400 |
| ニトリホールディングス | 200 | 15,615.00 | 3,123,000 |
| グルメ杵屋 | 100 | 1,055.00 | 105,500 |
| 吉野家ホールディングス | 200 | 3,160.00 | 632,000 |
| 加藤産業 | 100 | 3,990.00 | 399,000 |
| イエローハット | 100 | 1,795.00 | 179,500 |
| J Kホールディングス | 100 | 939.00 | 93,900 |
| サガミホールディングス | 100 | 1,306.00 | 130,600 |
| ミロク情報サービス | 100 | 1,560.00 | 156,000 |
| 因幡電機産業 | 100 | 3,175.00 | 317,500 |
| アークス | 100 | 2,772.00 | 277,200 |
| バローホールディングス | 100 | 2,193.00 | 219,300 |
| ミスミグループ本社 | 800 | 2,333.00 | 1,866,400 |

| | | | | |
|-----------------|---------|-----------|---------------|--|
| ファーストリテイリング | 200 | 33,840.00 | 6,768,000 | |
| ソフトバンクグループ | 2,400 | 6,255.00 | 15,012,000 | |
| スズケン | 200 | 4,580.00 | 916,000 | |
| サンドラッグ | 200 | 3,955.00 | 791,000 | |
| サックスパー ホールディングス | 100 | 838.00 | 83,800 | |
| ベルーナ | 100 | 630.00 | 63,000 | |
| 合計 | 743,300 | | 1,557,335,340 | |

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

新光日本債券インデックスマザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年10月20日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 2023年10月20日現在 |
|---------------------------------------|----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 8,366,977,587円 |
| 同期中追加設定元本額 | 956,609,520円 |
| 同期中一部解約元本額 | 566,997,442円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| One DC 国内債券インデックスファンド | 4,192,576,141円 |
| 新光7資産バランスファンド | 504,434,964円 |
| 日本債券ファンド | 3,495,065,347円 |
| 世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募） | 470,503,187円 |
| 新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募） | 14,269,919円 |
| ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募） | 51,144,972円 |
| ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募） | 28,595,135円 |
| 計 | 8,756,589,665円 |
| 2. 受益権の総数 | 8,756,589,665口 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 2023年10月20日現在 |
|--------------------|-----------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその | 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 |

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | | 2023年10月20日現在 |
|--------------|--|---------------|
| 1口当たり純資産額 | | 1,2027円 |
| (1万口当たり純資産額) | | (12,027円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年10月20日現在

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|------|-----------------|------------|------------|----|
| 国債証券 | 442回 利付国庫債券(2年) | 60,000,000 | 60,036,600 | |
| | 444回 利付国庫債券(2年) | 30,000,000 | 30,014,100 | |

| | | | |
|--------------------|-------------|-------------|--|
| 4 4 5回 利付国庫債券 (2年) | 20,000,000 | 20,007,600 | |
| 4 4 6回 利付国庫債券 (2年) | 30,000,000 | 30,008,100 | |
| 4 4 7回 利付国庫債券 (2年) | 40,000,000 | 40,005,600 | |
| 4 4 8回 利付国庫債券 (2年) | 40,000,000 | 39,996,800 | |
| 4 4 9回 利付国庫債券 (2年) | 20,000,000 | 19,995,000 | |
| 4 5 2回 利付国庫債券 (2年) | 30,000,000 | 29,972,100 | |
| 1 4 2回 利付国庫債券 (5年) | 60,000,000 | 60,097,200 | |
| 1 4 3回 利付国庫債券 (5年) | 50,000,000 | 50,080,500 | |
| 1 4 4回 利付国庫債券 (5年) | 100,000,000 | 100,149,000 | |
| 1 4 5回 利付国庫債券 (5年) | 90,000,000 | 90,111,600 | |
| 1 4 6回 利付国庫債券 (5年) | 120,000,000 | 120,116,400 | |
| 1 4 7回 利付国庫債券 (5年) | 120,000,000 | 119,782,800 | |
| 1 4 8回 利付国庫債券 (5年) | 100,000,000 | 99,748,000 | |
| 1 4 9回 利付国庫債券 (5年) | 90,000,000 | 89,686,800 | |
| 1 5 0回 利付国庫債券 (5年) | 90,000,000 | 89,589,600 | |
| 1 5 1回 利付国庫債券 (5年) | 30,000,000 | 29,827,200 | |
| 1 5 2回 利付国庫債券 (5年) | 50,000,000 | 49,873,000 | |
| 1 5 3回 利付国庫債券 (5年) | 70,000,000 | 69,503,700 | |
| 1 5 4回 利付国庫債券 (5年) | 80,000,000 | 79,596,800 | |
| 1 5 5回 利付国庫債券 (5年) | 20,000,000 | 20,028,600 | |
| 1 5 6回 利付国庫債券 (5年) | 50,000,000 | 49,866,000 | |
| 1 5 7回 利付国庫債券 (5年) | 30,000,000 | 29,875,800 | |
| 1 5 8回 利付国庫債券 (5年) | 50,000,000 | 49,575,500 | |
| 1 5 9回 利付国庫債券 (5年) | 20,000,000 | 19,793,400 | |
| 1 6 0回 利付国庫債券 (5年) | 50,000,000 | 49,713,000 | |
| 1 6 1回 利付国庫債券 (5年) | 40,000,000 | 39,944,800 | |

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

| | | | |
|--------------------|-------------|-------------|--|
| 3 4 5回 利付国庫債券（10年） | 60,000,000 | 59,905,200 | |
| 3 4 6回 利付国庫債券（10年） | 70,000,000 | 69,822,200 | |
| 3 4 7回 利付国庫債券（10年） | 70,000,000 | 69,745,200 | |
| 3 4 8回 利付国庫債券（10年） | 90,000,000 | 89,546,400 | |
| 3 4 9回 利付国庫債券（10年） | 100,000,000 | 99,321,000 | |
| 3 5 0回 利付国庫債券（10年） | 120,000,000 | 118,981,200 | |
| 3 5 1回 利付国庫債券（10年） | 120,000,000 | 118,760,400 | |
| 3 5 2回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 79,015,200 | |
| 3 5 3回 利付国庫債券（10年） | 110,000,000 | 108,523,800 | |
| 3 5 4回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 78,792,000 | |
| 3 5 5回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 78,650,400 | |
| 3 5 6回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 78,478,400 | |
| 3 5 7回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 78,274,400 | |
| 3 5 8回 利付国庫債券（10年） | 70,000,000 | 68,282,900 | |
| 3 5 9回 利付国庫債券（10年） | 90,000,000 | 87,539,400 | |
| 3 6 0回 利付国庫債券（10年） | 90,000,000 | 87,245,100 | |
| 3 6 1回 利付国庫債券（10年） | 90,000,000 | 86,910,300 | |
| 3 6 2回 利付国庫債券（10年） | 90,000,000 | 86,594,400 | |
| 3 6 3回 利付国庫債券（10年） | 90,000,000 | 86,294,700 | |
| 3 6 4回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 76,431,200 | |
| 3 6 5回 利付国庫債券（10年） | 70,000,000 | 66,655,400 | |
| 3 6 6回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 76,611,200 | |
| 3 6 7回 利付国庫債券（10年） | 70,000,000 | 66,815,700 | |
| 3 6 8回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 76,134,400 | |
| 3 6 9回 利付国庫債券（10年） | 60,000,000 | 58,513,800 | |
| 3 7 0回 利付国庫債券（10年） | 80,000,000 | 77,866,400 | |

| | | | |
|-------------------|------------|------------|--|
| 0年) | | | |
| 371回 利付国庫債券 (10年) | 70,000,000 | 67,338,600 | |
| 10回 利付国庫債券 (30年) | 20,000,000 | 20,551,800 | |
| 11回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 10,826,200 | |
| 12回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,203,900 | |
| 15回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,629,400 | |
| 17回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,544,400 | |
| 19回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,446,800 | |
| 20回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,670,800 | |
| 21回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,452,700 | |
| 22回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,687,700 | |
| 23回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,691,800 | |
| 26回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,559,200 | |
| 27回 利付国庫債券 (30年) | 10,000,000 | 11,681,800 | |
| 28回 利付国庫債券 (30年) | 20,000,000 | 23,351,000 | |
| 29回 利付国庫債券 (30年) | 20,000,000 | 23,049,800 | |
| 30回 利付国庫債券 (30年) | 20,000,000 | 22,727,400 | |
| 31回 利付国庫債券 (30年) | 20,000,000 | 22,402,400 | |
| 32回 利付国庫債券 (30年) | 30,000,000 | 33,964,500 | |
| 33回 利付国庫債券 (30年) | 30,000,000 | 32,550,000 | |
| 34回 利付国庫債券 (30年) | 30,000,000 | 33,358,800 | |
| 35回 利付国庫債券 (30年) | 30,000,000 | 32,368,800 | |
| 36回 利付国庫債券 (30年) | 30,000,000 | 32,279,700 | |
| 37回 利付国庫債券 (30年) | 60,000,000 | 63,394,800 | |
| 38回 利付国庫債券 (30年) | 20,000,000 | 20,730,400 | |
| 39回 利付国庫債券 (30年) | 30,000,000 | 31,558,200 | |

| | | | |
|----------------------|------------|------------|--|
| 4 0 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 20,650,600 | |
| 4 1 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 20,289,200 | |
| 4 2 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 20,260,800 | |
| 4 3 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 20,231,800 | |
| 4 4 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 30,303,600 | |
| 4 5 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 29,202,600 | |
| 4 6 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 29,149,800 | |
| 4 7 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 29,642,400 | |
| 4 8 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 40,000,000 | 38,023,600 | |
| 4 9 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 28,459,500 | |
| 5 0 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 25,069,800 | |
| 5 1 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 22,186,200 | |
| 5 2 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 40,000,000 | 30,962,400 | |
| 5 3 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 23,708,700 | |
| 5 4 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 24,774,000 | |
| 5 5 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 25,000,000 | 20,578,750 | |
| 5 6 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 24,614,700 | |
| 5 7 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 24,535,500 | |
| 5 8 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 24,456,600 | |
| 5 9 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 15,850,200 | |
| 6 0 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 16,590,400 | |
| 6 1 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 15,740,400 | |
| 6 2 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 14,883,400 | |
| 6 3 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 14,403,000 | |
| 6 4 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 30,000,000 | 21,514,500 | |
| 6 5 回 利付国庫債券 (3 0 年) | 20,000,000 | 14,295,600 | |

| | | | |
|------------------|------------|------------|--|
| 年) | | | |
| 66回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 21,336,900 | |
| 67回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 22,501,500 | |
| 68回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 22,416,900 | |
| 69回 利付国庫債券(30年) | 40,000,000 | 30,659,200 | |
| 70回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 22,933,500 | |
| 71回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 22,871,700 | |
| 72回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 22,810,200 | |
| 73回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 22,769,400 | |
| 74回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 24,677,400 | |
| 75回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 26,610,600 | |
| 76回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 27,251,700 | |
| 77回 利付国庫債券(30年) | 30,000,000 | 28,579,200 | |
| 78回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 18,147,600 | |
| 79回 利付国庫債券(30年) | 20,000,000 | 17,229,800 | |
| 81回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,374,900 | |
| 84回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,419,400 | |
| 88回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,583,100 | |
| 90回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,603,000 | |
| 92回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 21,229,400 | |
| 95回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 21,528,800 | |
| 99回 利付国庫債券(20年) | 30,000,000 | 32,277,600 | |
| 105回 利付国庫債券(20年) | 20,000,000 | 21,699,800 | |
| 108回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,785,400 | |
| 110回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 10,916,800 | |
| 111回 利付国庫債券(20年) | 10,000,000 | 11,004,900 | |

| | | | |
|---------------------|------------|------------|--|
| 1 1 2回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,899,000 | |
| 1 1 3回 利付国庫債券 (20年) | 30,000,000 | 32,925,000 | |
| 1 1 4回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,998,700 | |
| 1 1 6回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 11,075,700 | |
| 1 1 7回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 22,027,000 | |
| 1 1 8回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,939,800 | |
| 1 2 0回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,417,400 | |
| 1 2 1回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,826,200 | |
| 1 2 2回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,846,500 | |
| 1 2 3回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 22,119,800 | |
| 1 2 4回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,991,100 | |
| 1 2 5回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 11,138,400 | |
| 1 2 6回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,992,600 | |
| 1 2 7回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,921,700 | |
| 1 2 8回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,871,400 | |
| 1 2 9回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,862,600 | |
| 1 3 0回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,730,200 | |
| 1 3 1回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,789,800 | |
| 1 3 2回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,788,400 | |
| 1 3 3回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,739,800 | |
| 1 3 4回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,755,000 | |
| 1 3 5回 利付国庫債券 (20年) | 10,000,000 | 10,798,100 | |
| 1 3 6回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,428,800 | |
| 1 3 7回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,606,000 | |
| 1 3 8回 利付国庫債券 (20年) | 30,000,000 | 31,906,800 | |
| 1 3 9回 利付国庫債券 (20年) | 40,000,000 | 42,886,000 | |

| | | | |
|-------------------|------------|------------|--|
| 0年) | | | |
| 140回 利付国庫債券 (20年) | 60,000,000 | 64,841,400 | |
| 141回 利付国庫債券 (20年) | 40,000,000 | 43,256,400 | |
| 142回 利付国庫債券 (20年) | 40,000,000 | 43,599,200 | |
| 143回 利付国庫債券 (20年) | 30,000,000 | 32,183,700 | |
| 144回 利付国庫債券 (20年) | 20,000,000 | 21,271,000 | |
| 145回 利付国庫債券 (20年) | 70,000,000 | 75,783,400 | |
| 146回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 54,106,500 | |
| 147回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 53,632,000 | |
| 148回 利付国庫債券 (20年) | 40,000,000 | 42,485,200 | |
| 149回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 53,072,000 | |
| 150回 利付国庫債券 (20年) | 60,000,000 | 63,011,400 | |
| 151回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 51,390,500 | |
| 152回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 51,286,000 | |
| 153回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 51,755,000 | |
| 154回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 51,091,000 | |
| 155回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 49,864,500 | |
| 156回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 46,255,000 | |
| 157回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 44,875,500 | |
| 158回 利付国庫債券 (20年) | 60,000,000 | 55,741,200 | |
| 159回 利付国庫債券 (20年) | 60,000,000 | 56,227,800 | |
| 160回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 47,276,500 | |
| 161回 利付国庫債券 (20年) | 40,000,000 | 37,161,600 | |
| 162回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 46,258,500 | |
| 163回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 46,062,500 | |
| 164回 利付国庫債券 (20年) | 50,000,000 | 45,201,500 | |

| | | | | |
|---------|-------------------------|---------------|---------------|--|
| | 1 6 5回 利付国庫債券 (2 0年) | 50,000,000 | 44,992,000 | |
| | 1 6 6回 利付国庫債券 (2 0年) | 50,000,000 | 46,109,000 | |
| | 1 6 7回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 35,631,600 | |
| | 1 6 8回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 34,886,800 | |
| | 1 6 9回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 34,151,600 | |
| | 1 7 0回 利付国庫債券 (2 0年) | 30,000,000 | 25,473,900 | |
| | 1 7 1回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 33,778,800 | |
| | 1 7 2回 利付国庫債券 (2 0年) | 50,000,000 | 42,730,500 | |
| | 1 7 3回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 33,999,600 | |
| | 1 7 4回 利付国庫債券 (2 0年) | 50,000,000 | 42,267,500 | |
| | 1 7 5回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 34,237,600 | |
| | 1 7 6回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 34,079,200 | |
| | 1 7 7回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 33,299,600 | |
| | 1 7 8回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 33,757,200 | |
| | 1 7 9回 利付国庫債券 (2 0年) | 50,000,000 | 42,024,500 | |
| | 1 8 0回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 35,374,400 | |
| | 1 8 1回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 35,873,600 | |
| | 1 8 2回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 37,042,400 | |
| | 1 8 3回 利付国庫債券 (2 0年) | 30,000,000 | 29,184,300 | |
| | 1 8 4回 利付国庫債券 (2 0年) | 30,000,000 | 27,615,000 | |
| | 1 8 5回 利付国庫債券 (2 0年) | 40,000,000 | 36,680,000 | |
| 国債証券 合計 | | 9,225,000,000 | 8,919,954,350 | |
| 地方債証券 | 1 8回 東京都公募公債 2 0年 | 100,000,000 | 109,061,000 | |
| | 2 1 8回 神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 100,021,000 | |
| | 4 1 2回 大阪府公募公債 1 0年 | 50,000,000 | 49,708,000 | |
| | 1 9 0回 大阪府公募公債 5年 | 100,000,000 | 99,104,000 | |
| | 1 2回 兵庫県公募公債 1 | 100,000,000 | 100,311,000 | |

| | | | | |
|----------|------------------------|-------------|----------------|--|
| | 5年 | | | |
| | 令和3年度11回 愛知県公募公債 | 100,000,000 | 94,739,000 | |
| | 24年度1回 福岡県公募公債 30年 | 10,000,000 | 10,709,900 | |
| | 169回 共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 99,635,000 | |
| 地方債証券 合計 | | 660,000,000 | 663,288,900 | |
| 特殊債券 | 147回 高速道路機構債 | 100,000,000 | 97,976,000 | |
| | 97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 109,211,000 | |
| | 249回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 100,632,000 | |
| | 327回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 99,305,000 | |
| | 250回 住宅金融支援機構 | 100,000,000 | 98,758,000 | |
| | 87回 中日本高速道路債券 | 100,000,000 | 99,473,000 | |
| 特殊債券 合計 | | 600,000,000 | 605,355,000 | |
| 社債券 | 11回 プリヂストン社債 | 100,000,000 | 99,186,000 | |
| | 36回 東日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 102,223,000 | |
| | 494回 九州電力社債 | 100,000,000 | 93,451,000 | |
| 社債券 合計 | | 300,000,000 | 294,860,000 | |
| 合計 | | | 10,483,458,250 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光 J-REIT マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年10月20日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 2023年10月20日現在 |
|---------------------------------------|-----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 39,020,847,590円 |
| 同期中追加設定元本額 | 417,166,351円 |
| 同期中一部解約元本額 | 3,350,694,315円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| J-REITパッケージ | 1,925,871,959円 |
| 新光J-REITオープン | 31,646,671,380円 |
| One DC 国内リートインデックスファンド | 1,476,828,680円 |
| 新光7資産バランスファンド | 277,479,957円 |
| 新光J-REITオープン（年2回決算型） | 760,467,650円 |
| 計 | 36,087,319,626円 |
| 2. 受益権の総数 | 36,087,319,626口 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に |

| | |
|-------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。</p> <p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> |
|-------------------|--|

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年10月21日から2023年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

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

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

(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)

| | 2023年10月20日現在 |
|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 2,1747円 |
| (1万口当たり純資産額) | (21,747円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年10月20日現在

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|---------------------|------------------------|---------------|---------------|----|
| 投資証券 | CREロジスティクスファン ド投資法人 | 3,163 | 508,294,100 | |
| | GLP投資法人 | 24,818 | 3,275,976,000 | |
| | NTT都市開発リート投資法 人 | 7,063 | 950,679,800 | |
| | Oneリート投資法人 | 1,282 | 325,115,200 | |
| | SOSILA物流リート投資法 法人 | 3,666 | 443,586,000 | |
| | いちごオフィスリート投資法 人 | 6,020 | 524,944,000 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 1,217 | 128,880,300 | |
| | アクティビア・プロパティ ーズ投資法人 | 3,855 | 1,578,622,500 | |
| | アドバンス・レジデンス投資 法人 | 7,209 | 2,386,179,000 | |
| | アドバンス・ロジスティクス 投資法人 | 3,219 | 403,984,500 | |
| | イオンリート投資法人 | 9,013 | 1,309,588,900 | |
| | インヴィンシブル投資法人 | 35,574 | 2,041,947,600 | |
| | エスコンジャパンリート投資 法人 | 1,494 | 174,349,800 | |
| | オリックス不動産投資法人 | 14,639 | 2,613,061,500 | |
| | グローバル・ワン不動産投資 法人 | 5,425 | 616,822,500 | |
| ケネディクス・オフィス投資 法人 | 4,275 | 1,427,850,000 | | |

| | | | |
|-------------------------|--------|---------------|--|
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 5,394 | 1,185,601,200 | |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 3,194 | 898,791,600 | |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 3,613 | 1,105,578,000 | |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 2,002 | 226,025,800 | |
| サンケイリアルエステート投資法人 | 2,354 | 216,803,400 | |
| ザイマックス・リート投資法人 | 1,192 | 137,437,600 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 24,595 | 1,704,433,500 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 6,385 | 842,820,000 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 7,547 | 4,256,508,000 | |
| スターアジア不動産投資法人 | 11,323 | 668,057,000 | |
| スターツプロシード投資法人 | 1,274 | 269,578,400 | |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 3,484 | 340,735,200 | |
| トーセイ・リート投資法人 | 1,547 | 218,281,700 | |
| ヒューリックリート投資法人 | 6,874 | 1,063,407,800 | |
| フロンティア不動産投資法人 | 2,726 | 1,211,707,000 | |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 1,811 | 254,264,400 | |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 1,132 | 143,764,000 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 16,435 | 2,478,398,000 | |
| ラサールロジポート投資法人 | 9,392 | 1,389,076,800 | |
| 阪急阪神リート投資法人 | 3,503 | 491,120,600 | |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 3,056 | 1,428,680,000 | |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 2,537 | 961,523,000 | |
| 産業ファンド投資法人 | 11,210 | 1,532,407,000 | |
| 森トラストリート投資法人 | 14,162 | 1,028,161,200 | |
| 森ヒルズリート投資法人 | 8,640 | 1,208,736,000 | |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 1,356 | 824,448,000 | |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 22,078 | 1,788,318,000 | |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 1,123 | 72,545,800 | |
| 大和ハウスリート投資法人 | 11,075 | 2,941,520,000 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 1,522 | 992,344,000 | |
| 大和証券リビング投資法人 | 10,820 | 1,186,954,000 | |
| 投資法人みらい | 9,396 | 444,430,800 | |
| 東海道リート投資法人 | 1,093 | 137,718,000 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 4,926 | 876,828,000 | |
| | | | |

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

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

新光外国株式インデックスマザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年10月20日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

| | |
|-------------------------------|--------------|
| 世界バランスファンド35VA (適格機関投資家私募) | 61,707,018円 |
| 新光ワールドバランスファンドVA (適格機関投資家私募) | 1,226,042円 |
| ワールドバランスファンド30VA (適格機関投資家私募) | 6,608,143円 |
| ワールドバランスファンド30VA2 (適格機関投資家私募) | 4,472,189円 |
| 計 | 362,540,197円 |
| 2. 受益権の総数 | 362,540,197口 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

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

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年10月20日現在

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

| | | | |
|---------------------------------------|-------|-----------|-------------|
| ADOBE INC | 92 | 555.740 | 51,128.080 |
| CHUBB LTD | 83 | 210.550 | 17,475.650 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 45 | 280.610 | 12,627.450 |
| ALLSTATE CORP | 51 | 124.740 | 6,361.740 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 136 | 182.270 | 24,788.720 |
| AMGEN INC | 107 | 280.600 | 30,024.200 |
| HESS CORP | 55 | 166.080 | 9,134.400 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 127 | 149.620 | 19,001.740 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 100 | 74.420 | 7,442.000 |
| AFLAC INC | 113 | 79.550 | 8,989.150 |
| AMERICAN INTL GROUP | 151 | 61.170 | 9,236.670 |
| ANALOG DEVICES | 100 | 168.720 | 16,872.000 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 143 | 49.200 | 7,035.600 |
| VALERO ENERGY CORP | 75 | 132.420 | 9,931.500 |
| ANSYS INC | 17 | 285.920 | 4,860.640 |
| APPLE INC | 3,178 | 175.460 | 557,611.880 |
| APPLIED MATERIALS INC | 171 | 134.430 | 22,987.530 |
| ALBEMARLE CORP | 24 | 144.560 | 3,469.440 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 108 | 73.840 | 7,974.720 |
| AMEREN CORP | 48 | 77.650 | 3,727.200 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 10 | 112.640 | 1,126.400 |
| AUTODESK INC | 44 | 206.070 | 9,067.080 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 85 | 246.080 | 20,916.800 |
| AUTOZONE INC | 4 | 2,494.660 | 9,978.640 |
| AVERY DENNISON CORP | 17 | 176.930 | 3,007.810 |
| BALL CORP | 57 | 45.160 | 2,574.120 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B | 262 | 338.660 | 88,728.920 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 150 | 42.190 | 6,328.500 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 100 | 32.610 | 3,261.000 |
| BECTON DICKINSON & CO | 57 | 257.480 | 14,676.360 |
| AMETEK INC | 45 | 143.650 | 6,464.250 |
| VERIZON COMM INC | 842 | 31.580 | 26,590.360 |
| WR BERKLEY CORP | 45 | 64.240 | 2,890.800 |
| BEST BUY CO INC | 36 | 69.500 | 2,502.000 |
| BIO-RAD LABORATORIES-CL A | 4 | 315.990 | 1,263.960 |
| YUM! BRANDS INC | 57 | 120.560 | 6,871.920 |
| FIRSTENERGY CORP | 109 | 35.660 | 3,886.940 |
| BOEING CO | 114 | 182.790 | 20,838.060 |
| ROBERT HALF INC | 25 | 74.470 | 1,861.750 |
| BORGWARNER INC | 49 | 38.110 | 1,867.390 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 294 | 50.550 | 14,861.700 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE | 19 | 83.310 | 1,582.890 |

| | | | | |
|--------------------------------------|-----|-----------|------------|--|
| INC | | | | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 36 | 140.280 | 5,050.080 | |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC | 4 | 1,014.120 | 4,056.480 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 433 | 56.480 | 24,455.840 | |
| ONEOK INC | 111 | 69.210 | 7,682.310 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 17 | 109.100 | 1,854.700 | |
| UNITED RENTALS INC | 13 | 411.190 | 5,345.470 | |
| SEMPRA | 128 | 69.550 | 8,902.400 | |
| FEDEX CORP | 50 | 243.290 | 12,164.500 | |
| VERISIGN INC | 20 | 211.660 | 4,233.200 | |
| AMPHENOL CORP | 119 | 80.890 | 9,625.910 | |
| BROWN-FORMAN CORP | 63 | 55.750 | 3,512.250 | |
| QUANTA SERVICES INC | 28 | 168.740 | 4,724.720 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 218 | 4.560 | 994.080 | |
| CSX CORP | 422 | 30.540 | 12,887.880 | |
| COTERRA ENERGY INC | 164 | 29.600 | 4,854.400 | |
| CAMPBELL SOUP CO | 34 | 39.780 | 1,352.520 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 33 | 233.200 | 7,695.600 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 51 | 92.790 | 4,732.290 | |
| CARLISLE COS INC | 11 | 246.620 | 2,712.820 | |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED | 204 | 11.390 | 2,323.560 | |
| CATERPILLAR INC | 106 | 252.890 | 26,806.340 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 20 | 135.500 | 2,710.000 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 589 | 145.290 | 85,575.810 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 50 | 89.600 | 4,480.000 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 32 | 100.920 | 3,229.440 | |
| CINTAS CORP | 19 | 502.820 | 9,553.580 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 819 | 53.320 | 43,669.080 | |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | 128 | 14.540 | 1,861.120 | |
| CLOROX COMPANY | 28 | 123.990 | 3,471.720 | |
| COCA-COLA CO/THE | 831 | 54.350 | 45,164.850 | |
| COPART INC | 172 | 44.330 | 7,624.760 | |
| COGNEX CORP | 29 | 36.790 | 1,066.910 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 164 | 73.190 | 12,003.160 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A | 52 | 192.310 | 10,000.120 | |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 11 | 349.620 | 3,845.820 | |
| NRG ENERGY, INC. | 42 | 40.760 | 1,711.920 | |
| COMCAST CORP-CL A | 838 | 43.070 | 36,092.660 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 103 | 27.150 | 2,796.450 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 72 | 87.670 | 6,312.240 | |
| CMS ENERGY CORP | 63 | 53.510 | 3,371.130 | |
| COOPER COS INC | 10 | 323.800 | 3,238.000 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO | 39 | 58.340 | 2,275.260 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|-------|---------|------------|--|
| CORNING INC | 158 | 27.430 | 4,333.940 | |
| WOLFSPEED INC | 27 | 34.000 | 918.000 | |
| SEALED AIR CORP | 32 | 29.030 | 928.960 | |
| HEICO CORP-CL A | 14 | 127.500 | 1,785.000 | |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC | 13 | 196.260 | 2,551.380 | |
| CUMMINS INC | 30 | 221.700 | 6,651.000 | |
| DARLING INTERNATIONAL INC | 36 | 43.210 | 1,555.560 | |
| DR HORTON INC | 63 | 101.240 | 6,378.120 | |
| DANAHER CORP | 141 | 207.300 | 29,229.300 | |
| MOODY'S CORP | 34 | 311.580 | 10,593.720 | |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 101 | 65.440 | 6,609.440 | |
| TARGET CORP | 92 | 108.360 | 9,969.120 | |
| DEERE & CO | 57 | 381.370 | 21,738.090 | |
| MORGAN STANLEY | 257 | 72.920 | 18,740.440 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 43 | 145.790 | 6,268.970 | |
| COSTAR GROUP INC | 82 | 73.940 | 6,063.080 | |
| DECKERS OUTDOOR CORP | 5 | 508.880 | 2,544.400 | |
| THE WALT DISNEY CO | 375 | 83.250 | 31,218.750 | |
| DOLLAR TREE INC | 45 | 113.110 | 5,089.950 | |
| DOVER CORP | 28 | 134.430 | 3,764.040 | |
| OMNICOM GROUP | 38 | 74.220 | 2,820.360 | |
| DTE ENERGY CO | 38 | 96.740 | 3,676.120 | |
| DUKE ENERGY CORP | 155 | 87.780 | 13,605.900 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 25 | 142.260 | 3,556.500 | |
| EBAY INC | 110 | 41.140 | 4,525.400 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 1,439 | 26.960 | 38,795.440 | |
| CITIGROUP INC | 399 | 40.060 | 15,983.940 | |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 25 | 71.530 | 1,788.250 | |
| EATON CORP PLC | 81 | 199.910 | 16,192.710 | |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 55 | 245.060 | 13,478.300 | |
| ECOLAB INC | 53 | 160.340 | 8,498.020 | |
| REVVITY INC | 25 | 101.430 | 2,535.750 | |
| ELECTRONIC ARTS INC | 51 | 128.230 | 6,539.730 | |
| SALESFORCE INC | 196 | 208.320 | 40,830.720 | |
| ERIE INDEMNITY CO | 6 | 304.070 | 1,824.420 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 113 | 93.140 | 10,524.820 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 31 | 110.100 | 3,413.100 | |
| ENTERGY CORP | 38 | 93.370 | 3,548.060 | |
| EOG RESOURCES INC | 120 | 136.230 | 16,347.600 | |
| EQUIFAX INC | 25 | 178.980 | 4,474.500 | |
| EQT CORP | 86 | 43.090 | 3,705.740 | |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE | 46 | 138.810 | 6,385.260 | |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL | 31 | 114.780 | 3,558.180 | |
| EXXON MOBIL CORP | 815 | 113.020 | 92,111.300 | |
| FMC CORP | 28 | 66.590 | 1,864.520 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 413 | 52.390 | 21,637.070 | |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 8 | 436.870 | 3,494.960 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|-----|-----------|-------------|--|
| FAIR ISAAC CORP | 5 | 919.260 | 4,596.300 | |
| ASSURANT INC | 9 | 149.070 | 1,341.630 | |
| FASTENAL CO | 120 | 58.530 | 7,023.600 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 125 | 24.920 | 3,115.000 | |
| M&T BANK CORP | 34 | 119.610 | 4,066.740 | |
| FIRST HORIZON CORP | 128 | 11.190 | 1,432.320 | |
| FISERV INC | 128 | 111.970 | 14,332.160 | |
| FORD MOTOR CO | 785 | 11.530 | 9,051.050 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 72 | 22.630 | 1,629.360 | |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 287 | 35.230 | 10,111.010 | |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 2 | 1,355.770 | 2,711.540 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 44 | 231.030 | 10,165.320 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 34 | 31.500 | 1,071.000 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 47 | 237.950 | 11,183.650 | |
| GENERAL MILLS INC | 120 | 62.860 | 7,543.200 | |
| GENUINE PARTS CO | 30 | 130.120 | 3,903.600 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 250 | 78.440 | 19,610.000 | |
| GARTNER INC | 16 | 353.030 | 5,648.480 | |
| MCKESSON CORP | 28 | 453.270 | 12,691.560 | |
| NVIDIA CORP | 499 | 421.010 | 210,083.990 | |
| GRACO INC | 36 | 70.740 | 2,546.640 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 218 | 106.950 | 23,315.100 | |
| WW GRAINGER INC | 9 | 702.830 | 6,325.470 | |
| HALLIBURTON CO | 178 | 43.260 | 7,700.280 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 157 | 50.400 | 7,912.800 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 68 | 299.190 | 20,344.920 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 39 | 177.900 | 6,938.100 | |
| HASBRO INC | 25 | 56.620 | 1,415.500 | |
| HENRY SCHEIN INC | 24 | 68.750 | 1,650.000 | |
| HEICO CORP | 11 | 160.840 | 1,769.240 | |
| HERSHEY FOODS CORP | 30 | 191.580 | 5,747.400 | |
| HP INC | 186 | 26.450 | 4,919.700 | |
| F5 INC | 14 | 148.510 | 2,079.140 | |
| CROWN HOLDINGS INC NPR | 22 | 79.890 | 1,757.580 | |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 10 | 225.820 | 2,258.200 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 73 | 25.070 | 1,830.110 | |
| HOLOGIC INC | 54 | 67.820 | 3,662.280 | |
| HOME DEPOT INC | 203 | 286.770 | 58,214.310 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 41 | 82.590 | 3,386.190 | |
| HORMEL FOODS CORP | 67 | 31.820 | 2,131.940 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 118 | 27.470 | 3,241.460 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 6 | 357.340 | 2,144.040 | |
| HUBBELL INC | 12 | 285.000 | 3,420.000 | |
| HUMANA INC | 25 | 522.720 | 13,068.000 | |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 15 | 178.810 | 2,682.150 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES | 316 | 10.030 | 3,169.480 | |

| | | | | |
|---------------------------------|-----|---------|------------|--|
| INC | | | | |
| BIOGEN INC | 28 | 257.300 | 7,204.400 | |
| IDEX CORP | 14 | 195.600 | 2,738.400 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 60 | 224.900 | 13,494.000 | |
| INTUIT INC | 57 | 521.520 | 29,726.640 | |
| IDEXX LABORATORIES INC | 16 | 425.680 | 6,810.880 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 45 | 191.320 | 8,609.400 | |
| INTEL CORP | 839 | 35.670 | 29,927.130 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 56 | 66.400 | 3,718.400 | |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 56 | 34.260 | 1,918.560 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 72 | 28.540 | 2,054.880 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 16 | 145.610 | 2,329.760 | |
| JABIL CIRCUIT INC | 24 | 130.340 | 3,128.160 | |
| INCYTE CORP | 42 | 55.640 | 2,336.880 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 486 | 152.320 | 74,027.520 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 59 | 71.990 | 4,247.410 | |
| KLA CORPORATION | 27 | 465.050 | 12,556.350 | |
| DEVON ENERGY CORP | 125 | 49.250 | 6,156.250 | |
| KELLANOVA | 56 | 49.890 | 2,793.840 | |
| KEYCORP | 195 | 10.560 | 2,059.200 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 69 | 122.860 | 8,477.340 | |
| BLACKROCK INC/NEW YORK | 30 | 622.510 | 18,675.300 | |
| KROGER CO | 134 | 44.500 | 5,963.000 | |
| LAM RESEARCH CORP | 27 | 601.950 | 16,252.650 | |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 9 | 393.610 | 3,542.490 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 17 | 149.550 | 2,542.350 | |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | 27 | 73.980 | 1,997.460 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 29 | 106.990 | 3,102.710 | |
| LENNAR CORP | 51 | 104.610 | 5,335.110 | |
| ELI LILLY & CO | 163 | 590.800 | 96,300.400 | |
| BATH & BODY WORKS INC | 45 | 30.710 | 1,381.950 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 145 | 152.060 | 22,048.700 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 61 | 109.510 | 6,680.110 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 45 | 449.180 | 20,213.100 | |
| LOEWS CORP | 35 | 64.080 | 2,242.800 | |
| LOWE'S COS INC | 117 | 190.460 | 22,283.820 | |
| DOMINION ENERGY INC | 162 | 40.640 | 6,583.680 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 54 | 35.990 | 1,943.460 | |
| MCCORMICK & CO INC | 50 | 60.040 | 3,002.000 | |
| MCDONALD'S CORPORATION | 148 | 258.380 | 38,240.240 | |
| S&P GLOBAL INC | 67 | 357.560 | 23,956.520 | |

| | | | |
|-----------------------------------|-------|-----------|-------------|
| EVEREST GROUP LTD | 9 | 401.850 | 3,616.650 |
| MARKEL GROUP INC | 2 | 1,479.330 | 2,958.660 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 123 | 69.080 | 8,496.840 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 99 | 191.000 | 18,909.000 |
| MASCO CORP | 39 | 50.120 | 1,954.680 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 13 | 410.720 | 5,339.360 |
| METLIFE INC | 132 | 61.920 | 8,173.440 |
| MEDTRONIC PLC | 267 | 72.350 | 19,317.450 |
| CVS HEALTH CORP | 257 | 70.610 | 18,146.770 |
| MERCK & CO. INC. | 512 | 100.430 | 51,420.160 |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 86 | 87.010 | 7,482.860 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 19 | 199.430 | 3,789.170 |
| MICROSOFT CORP | 1,427 | 331.320 | 472,793.640 |
| MICRON TECH INC | 225 | 67.530 | 15,194.250 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 116 | 76.790 | 8,907.640 |
| 3M CO | 116 | 87.060 | 10,098.960 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 6 | 79.130 | 474.780 |
| ENTEGRIS INC | 27 | 91.870 | 2,480.490 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES INT | 12 | 187.400 | 2,248.800 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 35 | 281.940 | 9,867.900 |
| ILLUMINA INC | 33 | 119.980 | 3,959.340 |
| XCEL ENERGY INC | 105 | 59.050 | 6,200.250 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 19 | 111.130 | 2,111.470 |
| NETAPP INC | 48 | 75.040 | 3,601.920 |
| NEWMONT CORP | 152 | 39.450 | 5,996.400 |
| NVR INC | 1 | 5,563.550 | 5,563.550 |
| NIKE INC-CL B | 247 | 103.050 | 25,453.350 |
| NORDSON CORP | 10 | 216.170 | 2,161.700 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 44 | 200.090 | 8,803.960 |
| EVERSOURCE ENERGY | 74 | 53.900 | 3,988.600 |
| NISOURCE INC | 72 | 25.630 | 1,845.360 |
| NORTHERN TRUST CORP | 37 | 65.500 | 2,423.500 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 28 | 489.940 | 13,718.320 |
| WELLS FARGO & CO | 737 | 41.180 | 30,349.660 |
| NUCOR CORP | 49 | 143.750 | 7,043.750 |
| CHENIERE ENERGY INC | 48 | 175.540 | 8,425.920 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 80 | 92.700 | 7,416.000 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 136 | 66.460 | 9,038.560 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 20 | 396.450 | 7,929.000 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 12 | 898.390 | 10,780.680 |
| ORACLE CORP | 328 | 108.340 | 35,535.520 |

| | | | | |
|---------------------------------|-------|---------|------------|--|
| PACCAR INC | 110 | 82.550 | 9,080.500 | |
| PTC INC | 22 | 141.320 | 3,109.040 | |
| EXELON CORP | 196 | 39.770 | 7,794.920 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 27 | 374.980 | 10,124.460 | |
| PAYCHEX INC | 67 | 118.190 | 7,918.730 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 16 | 270.290 | 4,324.640 | |
| PPL CORPORATION | 136 | 23.820 | 3,239.520 | |
| PEPSICO INC | 278 | 160.560 | 44,635.680 | |
| PENTAIR PLC | 28 | 63.040 | 1,765.120 | |
| PFIZER INC | 1,137 | 31.190 | 35,463.030 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 61 | 33.040 | 2,015.440 | |
| CONOCOPHILLIPS | 244 | 126.380 | 30,836.720 | |
| PG&E CORP | 389 | 16.000 | 6,224.000 | |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 48 | 255.330 | 12,255.840 | |
| ALTRIA GROUP INC | 361 | 42.610 | 15,382.210 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 78 | 115.660 | 9,021.480 | |
| BROWN & BROWN INC | 49 | 68.270 | 3,345.230 | |
| GARMIN LTD | 29 | 104.330 | 3,025.570 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 45 | 124.340 | 5,595.300 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 89 | 565.630 | 50,341.070 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 45 | 97.370 | 4,381.650 | |
| QUEST DIAGNOSTICS | 22 | 122.830 | 2,702.260 | |
| PROCTER & GAMBLE CO | 477 | 148.250 | 70,715.250 | |
| PROGRESSIVE CORP | 120 | 157.800 | 18,936.000 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 105 | 59.830 | 6,282.150 | |
| PULTE GROUP INC | 47 | 70.130 | 3,296.110 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 53 | 112.410 | 5,957.730 | |
| QUALCOMM INC | 229 | 111.280 | 25,483.120 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 38 | 96.850 | 3,680.300 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 37 | 64.450 | 2,384.650 | |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO | 12 | 250.300 | 3,003.600 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 22 | 808.640 | 17,790.080 | |
| REPLIGEN CORP | 11 | 146.280 | 1,609.080 | |
| RESMED INC | 32 | 142.290 | 4,553.280 | |
| US BANCORP | 303 | 32.750 | 9,923.250 | |
| SEAGEN INC | 28 | 214.970 | 6,019.160 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 72 | 83.780 | 6,032.160 | |
| ROSS STORES INC | 67 | 116.260 | 7,789.420 | |
| ROLLINS INC | 46 | 32.920 | 1,514.320 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 22 | 487.530 | 10,725.660 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 22 | 271.520 | 5,973.440 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 42 | 82.080 | 3,447.360 | |
| RPM INTERNATIONAL INC | 29 | 94.410 | 2,737.890 | |

| | | | | |
|--|-------|-----------|------------|--|
| ACCENTURE PLC-CL A | 127 | 302.940 | 38,473.380 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 274 | 64.210 | 17,593.540 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 21 | 207.360 | 4,354.560 | |
| AXON ENTERPRISE INC | 15 | 212.310 | 3,184.650 | |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC | 48 | 163.940 | 7,869.120 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 119 | 51.420 | 6,118.980 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 7 | 2,785.200 | 19,496.400 | |
| SCHLUMBERGER LTD | 284 | 59.970 | 17,031.480 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 300 | 51.900 | 15,570.000 | |
| POOL CORP | 7 | 325.200 | 2,276.400 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 41 | 104.810 | 4,297.210 | |
| BUNGE LTD | 34 | 103.650 | 3,524.100 | |
| SEI INVESTMENTS CO | 22 | 55.580 | 1,222.760 | |
| ELEVANCE HEALTH INC | 49 | 463.280 | 22,700.720 | |
| CENCORA INC | 36 | 189.890 | 6,836.040 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 44 | 69.510 | 3,058.440 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 50 | 238.890 | 11,944.500 | |
| CENTENE CORP | 109 | 71.940 | 7,841.460 | |
| SMITH (A. O.) CORP | 26 | 67.010 | 1,742.260 | |
| SNAP-ON INC | 12 | 252.710 | 3,032.520 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 73 | 93.290 | 6,810.170 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 83 | 64.000 | 5,312.000 | |
| SOUTHERN CO | 220 | 66.440 | 14,616.800 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 270 | 28.060 | 7,576.200 | |
| SOUTHWEST AIRLINES | 29 | 24.370 | 706.730 | |
| AT&T INC | 1,437 | 15.260 | 21,928.620 | |
| CHEVRON CORP | 366 | 169.100 | 61,890.600 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 29 | 78.860 | 2,286.940 | |
| STATE STREET CORP | 64 | 66.360 | 4,247.040 | |
| STARBUCKS CORP | 230 | 94.420 | 21,716.600 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 30 | 99.200 | 2,976.000 | |
| STRYKER CORP | 68 | 268.420 | 18,252.560 | |
| NETFLIX INC | 90 | 401.770 | 36,159.300 | |
| GEN DIGITAL INC | 130 | 17.390 | 2,260.700 | |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 30 | 45.880 | 1,376.400 | |
| SYNOPSIS INC | 30 | 482.370 | 14,471.100 | |
| SYSCO CORP | 109 | 65.660 | 7,156.940 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 70 | 273.450 | 19,141.500 | |
| TELEFLEX INC | 8 | 186.020 | 1,488.160 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 278 | 8.160 | 2,268.480 | |
| TERADYNE INC | 34 | 92.740 | 3,153.160 | |

| | | | | |
|-------------------------------|-----|---------|------------|--|
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 182 | 150.940 | 27,471.080 | |
| TEXTRON INC | 41 | 77.340 | 3,170.940 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 78 | 469.670 | 36,634.260 | |
| GLOBE LIFE INC | 21 | 113.590 | 2,385.390 | |
| TORO CO | 22 | 83.620 | 1,839.640 | |
| DAVITA INC | 16 | 81.620 | 1,305.920 | |
| TRACTOR SUPPLY CO | 24 | 202.140 | 4,851.360 | |
| BIO-TECHNE CORP | 27 | 63.500 | 1,714.500 | |
| TRIMBLE INC | 44 | 49.530 | 2,179.320 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 8 | 377.000 | 3,016.000 | |
| TYSON FOODS INC | 60 | 46.590 | 2,795.400 | |
| MARATHON OIL CORP | 142 | 29.190 | 4,144.980 | |
| UNION PACIFIC CORP | 122 | 210.330 | 25,660.260 | |
| RTX CORP | 299 | 73.890 | 22,093.110 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 188 | 531.630 | 99,946.440 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 11 | 127.660 | 1,404.260 | |
| VF CORP | 73 | 18.560 | 1,354.880 | |
| PARAMOUNT GLOBAL | 70 | 11.780 | 824.600 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 52 | 364.800 | 18,969.600 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 26 | 202.690 | 5,269.940 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 137 | 20.960 | 2,871.520 | |
| WALMART INC | 299 | 160.770 | 48,070.230 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 84 | 157.070 | 13,193.880 | |
| WATERS CORP | 11 | 252.330 | 2,775.630 | |
| WATSCO INC | 6 | 353.970 | 2,123.820 | |
| WEBSTER FINANCIAL CORP | 36 | 40.130 | 1,444.680 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 16 | 369.330 | 5,909.280 | |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 22 | 113.820 | 2,504.040 | |
| VAIL RESORTS INC | 8 | 215.520 | 1,724.160 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 62 | 43.060 | 2,669.720 | |
| WABTEC CORP | 33 | 100.080 | 3,302.640 | |
| WHIRLPOOL CORP | 14 | 129.150 | 1,808.100 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 32 | 93.580 | 2,994.560 | |
| WYNN RESORTS LTD | 23 | 88.220 | 2,029.060 | |
| NASDAQ INC | 67 | 51.290 | 3,436.430 | |
| CME GROUP INC | 72 | 214.120 | 15,416.640 | |
| WILLIAMS COS INC | 251 | 35.570 | 8,928.070 | |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 13 | 108.810 | 1,414.530 | |
| LKQ CORP | 50 | 48.810 | 2,440.500 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 56 | 49.450 | 2,769.200 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 67 | 82.450 | 5,524.150 | |
| CARMAX INC | 38 | 63.420 | 2,409.960 | |
| TJX COMPANIES INC | 238 | 89.830 | 21,379.540 | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP | 11 | 205.990 | 2,265.890 | |

| | | | |
|--------------------------------|-----|-----------|------------|
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 343 | 3.420 | 1,173.060 |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 100 | 40.900 | 4,090.000 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 26 | 160.500 | 4,173.000 |
| CBRE GROUP INC | 70 | 68.320 | 4,782.400 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 156 | 16.480 | 2,570.880 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 7 | 344.310 | 2,410.170 |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 9 | 433.750 | 3,903.750 |
| WESTLAKE CORP | 4 | 117.990 | 471.960 |
| T-MOBILE US INC | 107 | 137.840 | 14,748.880 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 74 | 45.880 | 3,395.120 |
| MOSAIC CO/THE | 57 | 36.440 | 2,077.080 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 9 | 234.830 | 2,113.470 |
| CELANESE CORP | 21 | 116.650 | 2,449.650 |
| DEXCOM INC | 77 | 86.040 | 6,625.080 |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 23 | 111.390 | 2,561.970 |
| EXPEDIA GROUP INC | 33 | 95.660 | 3,156.780 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 44 | 85.680 | 3,769.920 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 22 | 316.590 | 6,964.980 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 34 | 17.870 | 607.580 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 113 | 109.570 | 12,381.410 |
| LIVE NATION | 32 | 80.500 | 2,576.000 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 6 | 1,847.630 | 11,085.780 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 11 | 830.620 | 9,136.820 |
| MASTERCARD INC | 171 | 387.870 | 66,325.770 |
| OWENS CORNING | 19 | 122.830 | 2,333.770 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 23 | 93.410 | 2,148.430 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 33 | 58.110 | 1,917.630 |
| FIRST SOLAR INC | 22 | 151.970 | 3,343.340 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 23 | 175.900 | 4,045.700 |
| SUPER MICRO COMPUTER INC | 10 | 265.050 | 2,650.500 |
| AECOM TECHNOLOGY CORP | 27 | 78.110 | 2,108.970 |
| DELTA AIR LINES INC | 27 | 32.710 | 883.170 |
| INSULET CORP | 15 | 145.240 | 2,178.600 |
| DISCOVER FINANCIAL | 50 | 84.590 | 4,229.500 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 67 | 119.350 | 7,996.450 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 24 | 396.190 | 9,508.560 |
| VMWARE INC | 51 | 150.310 | 7,665.810 |
| MERCADOLIBRE INC | 9 | 1,179.960 | 10,619.640 |
| ULTA BEAUTY INC | 10 | 372.860 | 3,728.600 |
| INVESCO LTD | 75 | 12.800 | 960.000 |
| MSCI INC | 16 | 497.270 | 7,956.320 |

| | | | | |
|-----------------------------------|-----|---------|-------------|--|
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 319 | 90.730 | 28,942.870 | |
| VISA INC | 327 | 233.810 | 76,455.870 | |
| KEURIG DR PEPPER INC | 195 | 28.450 | 5,547.750 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 40 | 117.020 | 4,680.800 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 86 | 152.840 | 13,144.240 | |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC | 23 | 57.600 | 1,324.800 | |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE | 411 | 17.010 | 6,991.110 | |
| XYLEM INC | 50 | 92.160 | 4,608.000 | |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | 49 | 92.750 | 4,544.750 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 8 | 221.330 | 1,770.640 | |
| SPLUNK INC | 31 | 147.900 | 4,584.900 | |
| EPAM SYSTEMS INC | 13 | 230.730 | 2,999.490 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 41 | 244.050 | 10,006.050 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 30 | 234.450 | 7,033.500 | |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 16 | 132.030 | 2,112.480 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 13 | 241.970 | 3,145.610 | |
| NXP SEMICONDUCTOR NV | 55 | 187.930 | 10,336.150 | |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP | 28 | 123.310 | 3,452.680 | |
| TARGA RESOURCES CORP | 45 | 87.710 | 3,946.950 | |
| LEAR CORP | 13 | 130.370 | 1,694.810 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 23 | 162.730 | 3,742.790 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 40 | 50.780 | 2,031.200 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 47 | 115.510 | 5,428.970 | |
| FORTINET INC | 132 | 57.770 | 7,625.640 | |
| HYATT HOTELS CORP | 8 | 103.880 | 831.040 | |
| TESLA INC | 576 | 220.110 | 126,783.360 | |
| GENERAC HOLDINGS INC | 15 | 93.960 | 1,409.400 | |
| ENPHASE ENERGY INC | 31 | 115.900 | 3,592.900 | |
| GENERAL MOTORS CO | 280 | 29.330 | 8,212.400 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 39 | 24.620 | 960.180 | |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 15 | 225.880 | 3,388.200 | |
| APTIV PLC | 60 | 90.250 | 5,415.000 | |
| PHILLIPS 66 | 95 | 115.190 | 10,943.050 | |
| META PLATFORMS INC | 447 | 312.810 | 139,826.070 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 37 | 186.750 | 6,909.750 | |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 36 | 168.920 | 6,081.120 | |
| SERVICENOW INC | 41 | 559.980 | 22,959.180 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 61 | 253.130 | 15,440.930 | |
| WORKDAY INC | 43 | 213.260 | 9,170.180 | |
| ABBVIE INC | 356 | 145.520 | 51,805.120 | |

| | | | |
|-------------------------------------|-----|---------|------------|
| ZOETIS INC | 93 | 168.040 | 15,627.720 |
| NEWS CORP/NEW-CL A | 90 | 21.620 | 1,945.800 |
| CDW CORP | 26 | 202.850 | 5,274.100 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 90 | 43.710 | 3,933.900 |
| TWILIO INC | 30 | 55.410 | 1,662.300 |
| SNAP INC | 190 | 9.650 | 1,833.500 |
| TRADE DESK INC A | 89 | 75.870 | 6,752.430 |
| OKTA INC | 35 | 85.460 | 2,991.100 |
| BAKER HUGHES CO | 219 | 35.580 | 7,792.020 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 35 | 87.490 | 3,062.150 |
| BROADCOM INC | 83 | 867.830 | 72,029.890 |
| ARES MANAGEMENT CORP | 35 | 105.130 | 3,679.550 |
| MONGODB INC | 14 | 358.000 | 5,012.000 |
| BURLINGTON STORES INC | 14 | 120.620 | 1,688.680 |
| VEEVA SYSTEMS INC | 30 | 202.170 | 6,065.100 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | 31 | 35.750 | 1,108.250 |
| EVERGY INC | 37 | 48.520 | 1,795.240 |
| ALLEGION PLC | 20 | 98.560 | 1,971.200 |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 30 | 71.300 | 2,139.000 |
| STERIS PLC | 19 | 216.900 | 4,121.100 |
| DOCUSIGN INC | 51 | 41.140 | 2,098.140 |
| WIX.COM LTD | 14 | 84.080 | 1,177.120 |
| DROPBOX INC | 57 | 27.320 | 1,557.240 |
| KKR & CO INC | 125 | 55.610 | 6,951.250 |
| FUTU HOLDINGS LTD ADR | 16 | 58.430 | 934.880 |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC | 51 | 62.360 | 3,180.360 |
| MODERNA INC | 64 | 82.370 | 5,271.680 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 52 | 150.310 | 7,816.120 |
| ARAMARK | 53 | 26.420 | 1,400.260 |
| CIGNA GROUP | 59 | 310.170 | 18,300.030 |
| DELL TECHNOLOGIES INC | 58 | 67.030 | 3,887.740 |
| DOW INC | 137 | 49.450 | 6,774.650 |
| OVINTIV INC | 50 | 50.870 | 2,543.500 |
| AMCOR PLC | 318 | 8.620 | 2,741.160 |
| PINTEREST INC | 117 | 26.550 | 3,106.350 |
| FOX CORP-A | 71 | 30.850 | 2,190.350 |
| FOX CORP-B | 24 | 28.510 | 684.240 |
| CLARIVATE ANALYTICS PLC | 105 | 6.720 | 705.600 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC | 47 | 184.520 | 8,672.440 |
| CHEWY INC | 26 | 16.860 | 438.360 |
| AVANTOR INC | 134 | 20.830 | 2,791.220 |
| DYNATRACE INC | 55 | 47.600 | 2,618.000 |
| CLOUDFLARE INC | 51 | 62.790 | 3,202.290 |
| TRADEWEB MARKETS INC | 24 | 82.470 | 1,979.280 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 177 | 49.000 | 8,673.000 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 81 | 78.170 | 6,331.770 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 376 | 42.720 | 16,062.720 |

| | | | |
|---------------------------------|-----|-----------|------------|
| CORTEVA INC | 134 | 50.960 | 6,828.640 |
| MATCH GROUP INC | 66 | 36.200 | 2,389.200 |
| FERGUSON PLC | 40 | 155.290 | 6,211.600 |
| BILL HOLDINGS INC | 19 | 102.500 | 1,947.500 |
| BLACKSTONE INC | 146 | 94.220 | 13,756.120 |
| PAYLOCITY HOLDING CORP | 9 | 196.050 | 1,764.450 |
| CARLYLE GROUP INC | 43 | 27.540 | 1,184.220 |
| DATADOG INC | 49 | 87.750 | 4,299.750 |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC | 32 | 66.870 | 2,139.840 |
| INGERSOLL RAND INC | 79 | 61.220 | 4,836.380 |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC | 86 | 65.450 | 5,628.700 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 9 | 265.500 | 2,389.500 |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC | 116 | 17.160 | 1,990.560 |
| DRAFTKINGS INC | 95 | 27.720 | 2,633.400 |
| UNITY SOFTWARE INC | 51 | 27.490 | 1,401.990 |
| AON PLC | 42 | 319.080 | 13,401.360 |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 467 | 10.390 | 4,852.130 |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP | 1 | 1,965.020 | 1,965.020 |
| BENTLEY SYSTEMS INC | 36 | 51.360 | 1,848.960 |
| COINBASE GLOBAL INC | 30 | 73.100 | 2,193.000 |
| UIPATH INC | 70 | 16.040 | 1,122.800 |
| AIRBNB INC | 83 | 119.970 | 9,957.510 |
| CONSTELLATION ENERGY CORP | 67 | 114.290 | 7,657.430 |
| MONDAY.COM LTD | 3 | 138.880 | 416.640 |
| ROYALTY PHARMA PLC | 75 | 28.110 | 2,108.250 |
| ROBLOX CORP | 91 | 31.670 | 2,881.970 |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC | 69 | 17.000 | 1,173.000 |
| VIATRIS INC | 263 | 9.310 | 2,448.530 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 48 | 41.910 | 2,011.680 |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP | 22 | 88.770 | 1,952.940 |
| HF SINCLAIR CORP | 37 | 56.690 | 2,097.530 |
| SNOWFLAKE INC | 52 | 153.430 | 7,978.360 |
| DOORDASH INC | 48 | 73.370 | 3,521.760 |
| ARISTA NETWORKS INC | 52 | 191.480 | 9,956.960 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 81 | 83.380 | 6,753.780 |
| GLOBAL-E ONLINE LTD | 18 | 35.340 | 636.120 |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC | 385 | 17.060 | 6,568.100 |
| FNF GROUP | 57 | 38.410 | 2,189.370 |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 25 | 132.820 | 3,320.500 |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 169 | 50.690 | 8,566.610 |
| APA CORP | 57 | 43.300 | 2,468.100 |
| CONFLUENT INC | 33 | 29.820 | 984.060 |

| | | | |
|--|-------|---------|-------------|
| LINDE PLC | 98 | 370.140 | 36,273.720 |
| ROBINHOOD MARKETS INC | 115 | 8.970 | 1,031.550 |
| LUCID GROUP INC | 213 | 4.340 | 924.420 |
| U-HAUL HOLDING CO | 18 | 50.190 | 903.420 |
| ASPEN TECHNOLOGY INC | 6 | 189.600 | 1,137.600 |
| TOAST INC | 48 | 17.810 | 854.880 |
| GRAB HOLDINGS LTD | 357 | 3.300 | 1,178.100 |
| CATALENT INC | 39 | 43.140 | 1,682.460 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 104 | 28.760 | 2,991.040 |
| VERALTO CORP | 48 | 70.290 | 3,373.920 |
| LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM | 36 | 25.230 | 908.280 |
| LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE | 39 | 68.400 | 2,667.600 |
| KENVUE INC | 328 | 19.840 | 6,507.520 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | 111 | 24.880 | 2,761.680 |
| CYBERARK SOFTWARE LTD | 8 | 168.040 | 1,344.320 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 36 | 123.990 | 4,463.640 |
| HUBSPOT INC | 9 | 444.830 | 4,003.470 |
| QORVO INC | 17 | 90.980 | 1,546.660 |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I | 20 | 91.100 | 1,822.000 |
| SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC | 13 | 113.980 | 1,481.740 |
| GODADDY INC | 29 | 75.470 | 2,188.630 |
| ETSY INC | 26 | 65.420 | 1,700.920 |
| TRANSUNION | 39 | 66.350 | 2,587.650 |
| ALBERTSONS COS INC | 55 | 22.340 | 1,228.700 |
| BLOCK INC | 106 | 44.170 | 4,682.020 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 93 | 73.980 | 6,880.140 |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | 41 | 57.830 | 2,371.030 |
| WESTROCK CO | 54 | 35.340 | 1,908.360 |
| KRAFT HEINZ CO | 178 | 31.450 | 5,598.100 |
| FORTIVE CORP | 72 | 71.100 | 5,119.200 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 51 | 136.030 | 6,937.530 |
| ALPHABET INC-CL A | 1,200 | 137.750 | 165,300.000 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | 251 | 16.300 | 4,091.300 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 212 | 54.810 | 11,619.720 |
| SEA LTD ADR | 78 | 45.090 | 3,517.020 |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 60 | 27.640 | 1,658.400 |
| ZILLOW GROUP INC-C | 29 | 39.390 | 1,142.310 |
| ALPHABET INC-CL C | 1,068 | 138.980 | 148,430.640 |
| ZSCALER INC | 16 | 169.070 | 2,705.120 |
| ATLASSIAN CORP PLC | 33 | 192.400 | 6,349.200 |
| ROKU INC | 20 | 62.480 | 1,249.600 |
| CHARTER COMMUNICATIONS | 19 | 435.870 | 8,281.530 |

| | | | | | |
|----------|------------------------------|--------|--------|----------------------------------|--|
| | INC | | | | |
| | VISTRA CORP | 67 | 32.110 | 2,151.370 | |
| アメリカ・ドル | 小計 | 69,355 | | 7,486,545.370 (1,122,682,344) | |
| イギリス・ポンド | ANTOFAGASTA PLC | 69 | 13.470 | 929.430 | |
| | ASHTREAD GROUP | 88 | 47.770 | 4,203.760 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 53 | 25.140 | 1,332.420 | |
| | BARCLAYS PLC | 3,262 | 1.478 | 4,821.230 | |
| | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 208 | 3.925 | 816.400 | |
| | BT GROUP PLC | 1,139 | 1.160 | 1,321.240 | |
| | BUNZL PLC | 65 | 28.900 | 1,878.500 | |
| | CRH PLC | 149 | 45.680 | 6,806.320 | |
| | AVIVA PLC | 521 | 4.049 | 2,109.520 | |
| | CRODA INTERNATIONAL | 30 | 41.350 | 1,240.500 | |
| | DIAGEO PLC | 451 | 31.140 | 14,044.140 | |
| | SCHRODERS PLC | 229 | 3.743 | 857.140 | |
| | DCC PLC | 22 | 45.270 | 995.940 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 732 | 9.718 | 7,113.570 | |
| | KINGFISHER PLC | 413 | 2.029 | 837.970 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 633 | 10.405 | 6,586.360 | |
| | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 442 | 24.880 | 10,996.960 | |
| | HALMA PLC | 74 | 18.605 | 1,376.770 | |
| | NEXT PLC | 27 | 69.640 | 1,880.280 | |
| | IMPERIAL BRANDS PLC | 188 | 17.205 | 3,234.540 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 52 | 14.920 | 775.840 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 245 | 21.560 | 5,282.200 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 346 | 20.460 | 7,079.160 | |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 3,978 | 6.412 | 25,506.930 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 1,098 | 2.118 | 2,325.560 | |
| | CENTRICA PLC | 1,265 | 1.571 | 1,987.310 | |
| | UNILEVER PLC | 508 | 39.885 | 20,261.580 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 165 | 10.160 | 1,676.400 | |
| | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 76 | 19.410 | 1,475.160 | |
| | PEARSON PLC | 156 | 9.080 | 1,416.480 | |
| | PERSIMMON PLC | 64 | 9.800 | 627.200 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 589 | 8.596 | 5,063.040 | |
| | RIO TINTO PLC | 226 | 50.520 | 11,417.520 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 4,486 | 0.766 | 3,436.270 | |
| | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 149 | 59.420 | 8,853.580 | |
| | RELX PLC | 389 | 28.800 | 11,203.200 | |
| | RENTOKIL INITIAL PLC | 537 | 4.839 | 2,598.540 | |
| | ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC | 1,645 | 2.056 | 3,382.120 | |
| | NATWEST GROUP PLC | 1,183 | 2.224 | 2,630.990 | |
| | ST JAMES' S PLACE PLC | 100 | 6.354 | 635.400 | |

| | | | | |
|------------------------------|-----------------|---------|-----------------------------|-----------|
| SSE PLC | 234 | 15.870 | 3,713.580 | |
| BP PLC | 3,461 | 5.529 | 19,135.860 | |
| SAGE GROUP PLC(THE) | 196 | 9.878 | 1,936.080 | |
| SMITHS GROUP PLC | 80 | 15.420 | 1,233.600 | |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 14 | 83.840 | 1,173.760 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 516 | 7.356 | 3,795.690 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 12,592 | 0.418 | 5,263.450 | |
| TAYLOR WIMPLEY PLC | 400 | 1.049 | 419.600 | |
| TESCO PLC | 1,495 | 2.739 | 4,094.800 | |
| 3I GROUP PLC | 191 | 20.310 | 3,879.210 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 195 | 9.208 | 1,795.560 | |
| GSK PLC | 821 | 14.512 | 11,914.350 | |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 86 | 82.260 | 7,074.360 | |
| WPP PLC | 202 | 7.012 | 1,416.420 | |
| ASTRAZENECA PLC | 312 | 104.880 | 32,722.560 | |
| WHITBREAD PLC | 39 | 33.410 | 1,302.990 | |
| INTERTEK GROUP PLC | 29 | 40.720 | 1,180.880 | |
| BURBERRY GROUP PLC | 83 | 17.220 | 1,429.260 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 29 | 61.540 | 1,784.660 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 302 | 2.553 | 771.000 | |
| ADMIRAL GROUP PLC | 59 | 24.890 | 1,468.510 | |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 12 | 39.800 | 477.600 | |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 43 | 19.920 | 856.560 | |
| ABRDN PLC | 388 | 1.535 | 595.580 | |
| EXPERIAN PLC | 184 | 26.380 | 4,853.920 | |
| MONDI PLC | 125 | 12.520 | 1,565.000 | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 117 | 6.922 | 809.870 | |
| OCADO GROUP PLC | 126 | 5.022 | 632.770 | |
| INFORMA PLC | 294 | 7.016 | 2,062.700 | |
| GLENCORE PLC | 2,111 | 4.501 | 9,501.610 | |
| ENTAIN PLC | 153 | 9.422 | 1,441.560 | |
| COCA-COLA HBC AG | 32 | 21.370 | 683.840 | |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 130 | 4.551 | 591.630 | |
| M&G PLC | 366 | 1.984 | 726.140 | |
| ENDEAVOUR MINING PLC | 18 | 16.860 | 303.480 | |
| WISE PLC | 103 | 6.924 | 713.170 | |
| JD SPORTS FASHION PLC | 595 | 1.300 | 773.500 | |
| HALEON PLC | 1,081 | 3.346 | 3,617.020 | |
| SHELL PLC | 1,345 | 27.580 | 37,095.100 | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 134 | 6.114 | 819.270 | |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 296 | 4.607 | 1,363.670 | |
| イギリス・ポンド 小計 | 55,041 | | 368,007.640 (66,918,509) | |
| イスラエル・ シュケル | BANK HAPOLIM BM | 318 | 28.950 | 9,206.100 |

| | | | | | |
|-----------------------------|--------------------------------|--------|-----------|---------------------------|--|
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL BM | 266 | 26.000 | 6,916.000 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 5 | 777.000 | 3,885.000 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK LTD | 247 | 17.360 | 4,287.920 | |
| | ICL GROUP LTD | 193 | 20.720 | 3,998.960 | |
| | NICE LTD | 12 | 644.000 | 7,728.000 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 17 | 121.000 | 2,057.000 | |
| | AZRIELI GROUP | 17 | 175.000 | 2,975.000 | |
| イスラエル・シュケル 小計 | | 1,075 | | 41,053.980 (1,521,941) | |
| オーストラリア・ドル | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 30 | 50.490 | 1,514.700 | |
| | WESTPAC BANKING CORPORATION | 703 | 21.150 | 14,868.450 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 349 | 21.870 | 7,632.630 | |
| | TELSTRA GROUP LTD | 956 | 3.870 | 3,699.720 | |
| | ASX LTD | 48 | 55.370 | 2,657.760 | |
| | BHP GROUP LTD | 1,035 | 45.230 | 46,813.050 | |
| | AMPOL LTD | 49 | 32.170 | 1,576.330 | |
| | COMPUTERSHARE LT | 107 | 26.030 | 2,785.210 | |
| | CSL LIMITED | 97 | 235.870 | 22,879.390 | |
| | REA GROUP LTD | 6 | 156.860 | 941.160 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 640 | 12.050 | 7,712.000 | |
| | COCHLEAR LTD | 14 | 250.610 | 3,508.540 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 315 | 9.220 | 2,904.300 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 337 | 99.780 | 33,625.860 | |
| | RIO TINTO LIMITED | 80 | 115.470 | 9,237.600 | |
| | APA GROUP | 248 | 8.000 | 1,984.000 | |
| | ARISTOCRAT LEISU | 110 | 38.740 | 4,261.400 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 522 | 5.790 | 3,022.380 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 76 | 40.000 | 3,040.000 | |
| | IGO LTD | 118 | 11.400 | 1,345.200 | |
| | ORICA LTD | 100 | 15.200 | 1,520.000 | |
| | LEND LEASE CORP LTD | 207 | 6.580 | 1,362.060 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 51 | 17.750 | 905.250 | |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 71 | 164.100 | 11,651.100 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 237 | 13.970 | 3,310.890 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 625 | 29.120 | 18,200.000 | |
| | NEWCREST MINING LTD | 195 | 25.140 | 4,902.300 | |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 136 | 4.740 | 644.640 | | |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 288 | 15.860 | 4,567.680 | | |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 244 | 11.980 | 2,923.120 | | |
| REECE LTD | 30 | 17.800 | 534.000 | | |
| SANTOS LTD | 623 | 7.850 | 4,890.550 | | |

| | | | | | |
|--------|---|--------|---------|-----------------------------|--|
| | SONIC HEALTHCARE | 85 | 29.620 | 2,517.700 | |
| | WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD | 40 | 34.480 | 1,379.200 | |
| | WESFARMERS LTD | 224 | 51.700 | 11,580.800 | |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 392 | 36.560 | 14,331.520 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 233 | 36.790 | 8,572.070 | |
| | SEEK LTD | 81 | 22.440 | 1,817.640 | |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 45 | 61.040 | 2,746.800 | |
| | BRAMBLES LTD | 288 | 14.270 | 4,109.760 | |
| | PILBARA MINERALS LTD | 512 | 3.860 | 1,976.320 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 267 | 3.500 | 934.500 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 186 | 11.870 | 2,207.820 | |
| | XERO LTD | 27 | 111.080 | 2,999.160 | |
| | IDP EDUCATION LTD | 49 | 21.790 | 1,067.710 | |
| | LOTTERY CORP LTD | 433 | 4.420 | 1,913.860 | |
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA | 402 | 5.170 | 2,078.340 | |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 597 | 25.630 | 15,301.110 | |
| | MEDIBANK PVT LTD | 498 | 3.570 | 1,777.860 | |
| | SOUTH32 LTD(AUD) | 1,072 | 3.390 | 3,634.080 | |
| | COLES GROUP LTD | 269 | 15.160 | 4,078.040 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 39 | 61.630 | 2,403.570 | |
| | オーストラリア・ドル 小計 | 14,386 | | 318,849.130 (30,204,578) | |
| カナダ・ドル | AGNICO EAGLE MINES LTD | 103 | 68.070 | 7,011.210 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 342 | 22.740 | 7,777.080 | |
| | BANK OF MONTREAL | 142 | 108.440 | 15,398.480 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 232 | 58.230 | 13,509.360 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 72 | 88.550 | 6,375.600 | |
| | BCE INC | 8 | 51.510 | 412.080 | |
| | BROOKFIELD CORP | 286 | 42.800 | 12,240.800 | |
| | SAPUTO INC | 46 | 27.130 | 1,247.980 | |
| | ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO | 122 | 7.070 | 862.540 | |
| | DESCARTES SYSTEMS GRP (THE) | 17 | 100.710 | 1,712.070 | |
| | CGI INC | 46 | 135.170 | 6,217.820 | |
| | CCL INDUSTRIES INC | 36 | 55.450 | 1,996.200 | |
| | CAE INC | 67 | 29.340 | 1,965.780 | |
| | CAMECO CORP | 90 | 52.610 | 4,734.900 | |
| | ROGERS COMM-CL B | 73 | 52.010 | 3,796.730 | |
| | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 188 | 50.320 | 9,460.160 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 217 | 91.150 | 19,779.550 | |
| | CANADIAN TIRE CORP-CL A | 11 | 139.060 | 1,529.660 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD | 43 | 29.140 | 1,253.020 | |
| | CANADIAN NATL RAILWAY CO | 114 | 144.120 | 16,429.680 | |

| | | | |
|----------------------------------|-----|-----------|------------|
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 31 | 39.870 | 1,235.970 |
| OPEN TEXT CORP | 50 | 45.860 | 2,293.000 |
| EMPIRE CO LTD | 12 | 37.250 | 447.000 |
| KINROSS GOLD CORP | 311 | 7.360 | 2,288.960 |
| RB GLOBAL INC | 33 | 87.700 | 2,894.100 |
| FORTIS INC | 102 | 53.970 | 5,504.940 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 116 | 30.990 | 3,594.840 |
| TELUS CORP | 88 | 22.450 | 1,975.600 |
| GREAT WEST LIFECO INC | 70 | 38.640 | 2,704.800 |
| IMPERIAL OIL LTD | 39 | 83.580 | 3,259.620 |
| ENBRIDGE INC | 431 | 44.020 | 18,972.620 |
| IGM FINANCIAL INC | 35 | 32.210 | 1,127.350 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 354 | 24.430 | 8,648.220 |
| LOBLAW CO LTD | 33 | 111.870 | 3,691.710 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 154 | 73.800 | 11,365.200 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 55 | 69.230 | 3,807.650 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 118 | 64.120 | 7,566.160 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 4 | 1,108.900 | 4,435.600 |
| METRO INC | 39 | 70.210 | 2,738.190 |
| EMERA INC | 58 | 45.530 | 2,640.740 |
| ONEX CORP | 13 | 76.600 | 995.800 |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 73 | 20.890 | 1,524.970 |
| POWER CORP OF CANADA | 133 | 34.010 | 4,523.330 |
| QUEBECOR INC-B | 38 | 28.350 | 1,077.300 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 282 | 113.030 | 31,874.460 |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD | 190 | 97.780 | 18,578.200 |
| STANTEC INC | 18 | 84.770 | 1,525.860 |
| SUNCOR ENERGY INC | 278 | 47.290 | 13,146.620 |
| LUNDIN MINING CORP | 208 | 8.960 | 1,863.680 |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 84 | 54.780 | 4,601.520 |
| THOMSON REUTERS CORP | 36 | 168.010 | 6,048.360 |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 19 | 106.400 | 2,021.600 |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$ | 364 | 79.920 | 29,090.880 |
| TC ENERGY CORP | 194 | 47.350 | 9,185.900 |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 10 | 93.330 | 933.300 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 16 | 146.010 | 2,336.160 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 38 | 198.440 | 7,540.720 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 92 | 58.950 | 5,423.400 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 4 | 2,857.610 | 11,430.440 |
| FRANCO-NEVADA CORP NPR | 42 | 189.350 | 7,952.700 |
| TOURMALINE OIL CORP | 60 | 73.280 | 4,396.800 |
| KEYERA CORP | 42 | 32.970 | 1,384.740 |

| | | | | | |
|-----------|-------------------------------------|--------|---------|-----------------------------|--|
| | PARKLAND CORP | 41 | 41.360 | 1,695.760 | |
| | ALTAGAS LTD | 79 | 26.100 | 2,061.900 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 110 | 42.220 | 4,644.200 | |
| | DOLLARAMA INC | 54 | 94.020 | 5,077.080 | |
| | CENOVUS ENERGY INC W/I | 297 | 29.030 | 8,621.910 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 94 | 22.580 | 2,122.520 | |
| | NORTHLAND POWER INC | 57 | 20.320 | 1,158.240 | |
| | ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | 70 | 18.860 | 1,320.200 | |
| | TMX GROUP LTD | 40 | 29.530 | 1,181.200 | |
| | BRP INC | 7 | 97.310 | 681.170 | |
| | IVANHOE MINES LTD | 91 | 10.880 | 990.080 | |
| | NUTRIEN LTD | 96 | 83.480 | 8,014.080 | |
| | TFI INTERNATIONAL INC | 19 | 160.690 | 3,053.110 | |
| | WSP GLOBAL INC | 26 | 186.290 | 4,843.540 | |
| | IA FINANCIAL CORP INC | 17 | 81.850 | 1,391.450 | |
| | GFL ENVIRONMENTAL INC | 49 | 41.230 | 2,020.270 | |
| | NUVEI CORP | 14 | 21.260 | 297.640 | |
| | BROOKFIELD RENEWABLE CORP | 18 | 31.450 | 566.100 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD | 80 | 42.160 | 3,372.800 | |
| | AIR CANADA | 21 | 17.080 | 358.680 | |
| | RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 61 | 90.490 | 5,519.890 | |
| | SHOPIFY INC | 240 | 71.100 | 17,064.000 | |
| | FIRSTSERVICE CORP | 9 | 192.150 | 1,729.350 | |
| | HYDRO ONE LTD | 74 | 34.890 | 2,581.860 | |
| | カナダ・ドル 小計 | 8,286 | | 472,726.740 (51,645,396) | |
| シンガポール・ドル | SINGAPORE TECH ENG | 300 | 3.790 | 1,137.000 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES | 100 | 4.560 | 456.000 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 400 | 33.170 | 13,268.000 | |
| | SEATRIUM LTD | 5,725 | 0.117 | 669.820 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 200 | 9.650 | 1,930.000 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 800 | 0.830 | 664.000 | |
| | KEPPEL CORP LTD | 300 | 6.250 | 1,875.000 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 700 | 12.830 | 8,981.000 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 1,400 | 2.360 | 3,304.000 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 400 | 6.050 | 2,420.000 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 300 | 27.880 | 8,364.000 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 100 | 6.220 | 622.000 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 300 | 3.510 | 1,053.000 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE | 600 | 3.020 | 1,812.000 | |
| | シンガポール・ドル 小計 | 11,625 | | 46,555.820 (5,082,499) | |

| | | | | | |
|-----------------|----------------------------------|---------|------------|-----------------------------|--|
| スイス・フラン | LOGITECH INTL-REG | 39 | 63.020 | 2,457.780 | |
| | NESTLE SA-REGISTERED | 541 | 98.750 | 53,423.750 | |
| | CIE FINANC RICHEMONT | 107 | 106.050 | 11,347.350 | |
| | ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN | 141 | 238.450 | 33,621.450 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 8 | 184.100 | 1,472.800 | |
| | SIKA INHABER | 31 | 218.200 | 6,764.200 | |
| | SGS SA-REG | 27 | 76.120 | 2,055.240 | |
| | NOVARTIS AG-REG SHS | 414 | 84.750 | 35,086.500 | |
| | BALOISE HOLDING AG -R | 8 | 129.100 | 1,032.800 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG | 1 | 1,361.000 | 1,361.000 | |
| | CLARIANT AG-REG | 69 | 12.360 | 852.840 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 6 | 539.400 | 3,236.400 | |
| | ABB LTD | 327 | 30.260 | 9,895.020 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 44 | 34.360 | 1,511.840 | |
| | GEBERIT AG | 7 | 427.700 | 2,993.900 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 16 | 342.000 | 5,472.000 | |
| | GIVAUDAN-REG | 2 | 2,897.000 | 5,794.000 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 30 | 425.700 | 12,771.000 | |
| | ROCHE HOLDING AG-BEARER | 7 | 252.600 | 1,768.200 | |
| | HOLCIM LTD | 106 | 56.480 | 5,986.880 | |
| | TEMENOS GROUP | 7 | 62.640 | 438.480 | |
| | BACHEM HOLDING AG | 5 | 65.800 | 329.000 | |
| | SONOVA HOLDING AG | 10 | 213.700 | 2,137.000 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG | 11 | 251.700 | 2,768.700 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG | 23 | 113.500 | 2,610.500 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 6 | 229.600 | 1,377.600 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 10 | 43.450 | 434.500 | |
| | HELVETIA HOLDING AG | 9 | 120.000 | 1,080.000 | |
| | SCHINDLER NAMEN | 6 | 178.600 | 1,071.600 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 6 | 574.000 | 3,444.000 | |
| | BANQUE CANTONALE VAUD | 8 | 99.250 | 794.000 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING | 2 | 604.000 | 1,208.000 | |
| | SWISS PRIME SITE AG | 12 | 82.350 | 988.200 | |
| | DUFREY GROUP | 9 | 31.400 | 282.600 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 5 | 976.600 | 4,883.000 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 42 | 55.320 | 2,323.440 | |
| | SWISS RE LTD | 63 | 98.380 | 6,197.940 | |
| | BKW AG | 7 | 153.100 | 1,071.700 | |
| SIG GROUP AG | 50 | 19.490 | 974.500 | | |
| ALCON INC | 103 | 65.300 | 6,725.900 | | |
| SANDOZ GROUP AG | 85 | 27.770 | 2,360.450 | | |
| UBS GROUP AG | 659 | 21.710 | 14,306.890 | | |
| VAT GROUP AG | 5 | 325.800 | 1,629.000 | | |
| スイス・フラン | 小計 | 3,074 | | 258,341.950 (43,401,448) | |
| スウェーデン・ | ATLAS COPCO AB-A SHS | 558 | 142.800 | 79,682.400 | |

クローナ

| | | | | |
|---------------------------------|----------------|-----------|-------------------------------|------------|
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 288 | 125.650 | 36,187.200 | |
| ERICSSON LM-B SHS | 561 | 49.510 | 27,775.110 | |
| GETINGE AB-B SHS | 49 | 190.700 | 9,344.300 | |
| LUNDBERGS B | 9 | 449.900 | 4,049.100 | |
| SKF AB-B SHS | 67 | 173.100 | 11,597.700 | |
| SANDVIK AB | 223 | 189.950 | 42,358.850 | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 321 | 134.450 | 43,158.450 | |
| SKANSKA AB-B SHS | 48 | 168.150 | 8,071.200 | |
| SWEDBANK AB | 157 | 206.700 | 32,451.900 | |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | 143 | 153.700 | 21,979.100 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 265 | 100.550 | 26,645.750 | |
| VOLVO AB-A SHS | 47 | 225.600 | 10,603.200 | |
| VOLVO AB-B SHS | 307 | 222.850 | 68,414.950 | |
| HOLMEN AB-B SHS | 28 | 415.400 | 11,631.200 | |
| TELE2 AB-B SHS | 145 | 85.100 | 12,339.500 | |
| INDUSTRIVARDEN A | 19 | 285.600 | 5,426.400 | |
| INDUSTRIVARDEN C | 40 | 284.600 | 11,384.000 | |
| SAAB AB-B | 13 | 563.600 | 7,326.800 | |
| SECURITAS AB-B SHS | 101 | 92.280 | 9,320.280 | |
| INVESTOR AB-B SHS | 335 | 210.000 | 70,350.000 | |
| HENNES&MAURITZ AB-B SHS | 125 | 152.920 | 19,115.000 | |
| ASSA ABLOY AB-B | 221 | 234.600 | 51,846.600 | |
| TELIA CO AB | 640 | 25.370 | 16,236.800 | |
| BOLIDEN AB | 46 | 289.850 | 13,333.100 | |
| ALFA LAVAL AB | 48 | 360.700 | 17,313.600 | |
| FASTIGHETS AB BALDER | 144 | 44.720 | 6,439.680 | |
| INDUTRADE AB | 76 | 190.000 | 14,440.000 | |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 25 | 79.140 | 1,978.500 | |
| NIBE INDUSTRIER AB | 342 | 65.280 | 22,325.760 | |
| SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 41 | 208.800 | 8,560.800 | |
| HEXAGON AB-B SHS | 385 | 95.760 | 36,867.600 | |
| SAGAX AB | 60 | 189.700 | 11,382.000 | |
| EPIROC AB-A | 126 | 203.600 | 25,653.600 | |
| EPIROC AB-B | 56 | 171.900 | 9,626.400 | |
| ESSITY AB-B | 122 | 244.100 | 29,780.200 | |
| EQT AB | 78 | 207.000 | 16,146.000 | |
| VOLVO CAR AB | 144 | 45.430 | 6,541.920 | |
| BEIJER REF AB | 40 | 101.500 | 4,060.000 | |
| LIFCO AB | 43 | 177.650 | 7,638.950 | |
| EVOLUTION AB | 41 | 1,046.200 | 42,894.200 | |
| NORDEA BANK ABP | 704 | 120.760 | 85,015.040 | |
| INVESTMENT AB LATOUR | 23 | 187.100 | 4,303.300 | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | 7,254 | | 1,001,596.440 (13,691,823) | |
| デンマーク・ク | CARLSBERG AS-B | 20 | 877.400 | 17,548.000 |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|---------|-----------------------------|-------------|--|
| ローネ | A P MOLLER A/S | 1 | 11,570.000 | 11,570.000 | |
| | AP MOLLER MAERSK A | 1 | 11,460.000 | 11,460.000 | |
| | DANSKE BANK A/S | 135 | 164.600 | 22,221.000 | |
| | GENMAB A/S | 13 | 1,986.000 | 25,818.000 | |
| | NOVOZYMES-B SHS | 48 | 284.300 | 13,646.400 | |
| | ROCKWOOL AS | 2 | 1,518.500 | 3,037.000 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 658 | 684.200 | 450,203.600 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 208 | 141.360 | 29,402.880 | |
| | COLOPLAST-B | 23 | 708.000 | 16,284.000 | |
| | DSV A/S | 39 | 1,130.500 | 44,089.500 | |
| | DEMANT A/S | 9 | 266.100 | 2,394.900 | |
| | TRYG A/S | 84 | 137.650 | 11,562.600 | |
| | PANDORA A/S | 21 | 814.600 | 17,106.600 | |
| | CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 27 | 430.500 | 11,623.500 | |
| ORSTED A/S | 34 | 325.000 | 11,050.000 | | |
| デンマーク・クローネ 小計 | 1,323 | | 699,017.980 (14,847,142) | | |
| ニュージーランド・ドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 345 | 7.810 | 2,694.450 | |
| | EBOS GROUP LTD | 18 | 34.290 | 617.220 | |
| | FISHER & PAYKEL | 148 | 21.150 | 3,130.200 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 235 | 4.980 | 1,170.300 | |
| | MIGHTY RIVER POWER LTD | 87 | 6.045 | 525.910 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 226 | 5.080 | 1,148.080 | |
| ニュージーランド・ドル 小計 | 1,059 | | 9,286.160 (812,168) | | |
| ノルウェー・クローネ | MOWI ASA | 113 | 182.150 | 20,582.950 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 235 | 59.320 | 13,940.200 | |
| | TELENOR ASA | 162 | 115.400 | 18,694.800 | |
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 26 | 477.000 | 12,402.000 | |
| | ORKLA ASA | 135 | 80.680 | 10,891.800 | |
| | EQUINOR ASA | 195 | 377.800 | 73,671.000 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 33 | 386.000 | 12,738.000 | |
| | AKER BP ASA | 61 | 317.800 | 19,385.800 | |
| | SALMAR ASA | 11 | 529.400 | 5,823.400 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 24 | 158.100 | 3,794.400 | |
| | ADEVINTA ASA | 72 | 104.000 | 7,488.000 | |
| DNB BANK ASA | 170 | 207.600 | 35,292.000 | | |
| ノルウェー・クローネ 小計 | 1,237 | | 234,704.350 (3,194,326) | | |
| ユーロ | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 35 | 146.000 | 5,110.000 | |
| | KERRY GROUP PLC-A | 33 | 72.500 | 2,392.500 | |
| | KINGSPAN GROUP PLC | 30 | 64.160 | 1,924.800 | |
| | UMICORE | 47 | 24.040 | 1,129.880 | |
| | AIR LIQUIDE | 103 | 157.040 | 16,175.120 | |

| | | | | |
|--|-------|---------|------------|--|
| AIRBUS SE | 117 | 123.900 | 14,496.300 | |
| AXA SA | 376 | 27.875 | 10,481.000 | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 150 | 25.720 | 3,858.000 | |
| ADIDAS AG | 35 | 174.320 | 6,101.200 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 198 | 18.580 | 3,678.840 | |
| DASSAULT AVIATION SA | 4 | 183.500 | 734.000 | |
| DANONE | 137 | 54.080 | 7,408.960 | |
| SAFRAN SA | 70 | 148.460 | 10,392.200 | |
| INTESA SANPAOLO | 3,038 | 2.375 | 7,215.250 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 64 | 95.310 | 6,099.840 | |
| ACCOR SA | 28 | 30.200 | 845.600 | |
| BOUYGUES | 48 | 31.470 | 1,510.560 | |
| BNP PARIBAS | 214 | 56.710 | 12,135.940 | |
| THALES SA | 21 | 138.300 | 2,904.300 | |
| CAPGEMINI SA | 32 | 164.400 | 5,260.800 | |
| UNICREDIT SPA | 365 | 22.505 | 8,214.320 | |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV | 17 | 86.800 | 1,475.600 | |
| D' IETEREN TRDG | 6 | 148.000 | 888.000 | |
| COMMERZBANK AG | 231 | 10.255 | 2,368.900 | |
| EIFFAGE | 18 | 85.420 | 1,537.560 | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 76 | 24.900 | 1,892.400 | |
| PUBLICIS GROUPE | 51 | 74.500 | 3,799.500 | |
| IBERDROLA SA | 1,327 | 10.410 | 13,814.070 | |
| ENI SPA | 494 | 15.452 | 7,633.280 | |
| JERONIMO MARTINS | 51 | 20.600 | 1,050.600 | |
| KESKO OYJ-B | 72 | 15.325 | 1,103.400 | |
| KBC GROUPE | 54 | 53.860 | 2,908.440 | |
| HANNOVER RUECK SE | 14 | 210.800 | 2,951.200 | |
| WARTSILA OYJ | 111 | 9.870 | 1,095.570 | |
| L' OREAL | 48 | 386.200 | 18,537.600 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 55 | 670.600 | 36,883.000 | |
| GEA GROUP AG | 28 | 32.940 | 922.320 | |
| BOLLORE | 224 | 5.055 | 1,132.320 | |
| MEDIOBANCA SPA | 115 | 11.230 | 1,291.450 | |
| MICHELIN (CGDE)-B | 141 | 28.450 | 4,011.450 | |
| CONTINENTAL AG | 25 | 60.980 | 1,524.500 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 200 | 37.845 | 7,569.000 | |
| OMV AG | 35 | 42.940 | 1,502.900 | |
| VERBUND AG | 13 | 82.350 | 1,070.550 | |
| PERNOD-RICARD | 42 | 166.150 | 6,978.300 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD | 27 | 45.810 | 1,236.870 | |
| RENAULT SA | 42 | 33.425 | 1,403.850 | |
| REPSOL SA | 233 | 14.990 | 3,492.670 | |
| REMY COINTREAU | 3 | 119.200 | 357.600 | |
| MERCK KGAA | 27 | 150.050 | 4,051.350 | |
| COMPAGNIE DE SAINT- | 99 | 50.240 | 4,973.760 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|-------|-----------|------------|--|
| GOBAIN | | | | |
| RWE AG | 123 | 34.240 | 4.211.520 | |
| SEB SA | 9 | 88.450 | 796.050 | |
| SOCIETE GENERALE-A | 141 | 21.395 | 3.016.690 | |
| VINCI S. A. | 109 | 100.600 | 10.965.400 | |
| SODEXO | 15 | 98.300 | 1.474.500 | |
| SOFINA | 3 | 180.900 | 542.700 | |
| SOLVAY SA | 18 | 98.680 | 1.776.240 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 108 | 145.740 | 15.739.920 | |
| VIVENDI SE | 106 | 8.256 | 875.130 | |
| SAP SE | 209 | 127.280 | 26.601.520 | |
| TELEFONICA S. A | 1.040 | 3.802 | 3.954.080 | |
| TOTALENERGIES SE | 448 | 63.330 | 28.371.840 | |
| VALEO | 32 | 12.590 | 402.880 | |
| E.ON SE | 441 | 10.910 | 4.811.310 | |
| VOEST-ALPINE AG | 26 | 23.940 | 622.440 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 16 | 58.920 | 942.720 | |
| SIEMENS AG-REG | 155 | 129.860 | 20.128.300 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 107 | 31.640 | 3.385.480 | |
| ING GROEP NV-CVA | 722 | 12.376 | 8.935.470 | |
| PUMA AG | 14 | 50.560 | 707.840 | |
| BAYER AG | 203 | 42.145 | 8.555.430 | |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 97 | 11.355 | 1.101.430 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 40 | 67.120 | 2.684.800 | |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 162 | 63.450 | 10.278.900 | |
| BASF SE | 186 | 41.430 | 7.705.980 | |
| BEIERSDORF AG | 20 | 121.050 | 2.421.000 | |
| HEIDELBERG MATERIALS AG | 26 | 70.840 | 1.841.840 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 38 | 33.150 | 1.259.700 | |
| ASM INTERNATIONAL NV | 10 | 370.050 | 3.700.500 | |
| ORANGE | 417 | 10.906 | 4.547.800 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 92 | 37.600 | 3.459.200 | |
| RANDSTAD NV | 20 | 48.460 | 969.200 | |
| ALLIANZ SE | 79 | 221.250 | 17.478.750 | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 651 | 3.755 | 2.444.500 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 211 | 27.515 | 5.805.660 | |
| HERMES INTL | 6 | 1.680.000 | 10.080.000 | |
| ENDESA S. A. | 49 | 19.030 | 932.470 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 81 | 6.808 | 551.440 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 69 | 32.500 | 2.242.500 | |
| MUENCHENER RUECKVER AG- REG | 28 | 377.700 | 10.575.600 | |
| ARCELOR MITTAL (NL) | 120 | 21.365 | 2.563.800 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 140 | 34.845 | 4.878.300 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 42 | 32.510 | 1.365.420 | |
| RHEINMETALL STAMM | 8 | 258.300 | 2.066.400 | |

| | | | |
|---------------------------------|-------|---------|------------|
| HEINEKEN NV | 57 | 83.480 | 4,758.360 |
| AKZO NOBEL | 41 | 64.060 | 2,626.460 |
| ASML HOLDING NV | 81 | 562.500 | 45,562.500 |
| AEGON LTD | 404 | 4.583 | 1,851.530 |
| VOLKSWAGEN AG | 5 | 118.100 | 590.500 |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 45 | 105.300 | 4,738.500 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 1,217 | 7.624 | 9,278.400 |
| KERING | 14 | 410.650 | 5,749.100 |
| ACCIONA S. A. | 4 | 119.250 | 477.000 |
| FORTUM OYJ | 90 | 11.010 | 990.900 |
| AGEAS | 25 | 38.960 | 974.000 |
| UCB SA | 23 | 72.460 | 1,666.580 |
| NEMETSCHEK SE | 12 | 64.080 | 768.960 |
| CARREFOUR SA | 136 | 15.820 | 2,151.520 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 15 | 26.360 | 395.400 |
| NOKIA OYJ | 1,012 | 3.050 | 3,086.600 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 189 | 17.474 | 3,302.580 |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 53 | 121.400 | 6,434.200 |
| SANOFI | 228 | 98.810 | 22,528.680 |
| STMICROELECTRONICS NV | 149 | 38.935 | 5,801.310 |
| ELISA OYJ | 33 | 41.720 | 1,376.760 |
| BANCO SANTANDER SA | 3,320 | 3.508 | 11,646.560 |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 72 | 15.075 | 1,085.400 |
| QIAGEN N. V. | 53 | 35.460 | 1,879.380 |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 374 | 9.749 | 3,646.120 |
| BMW VORZUG | 8 | 88.100 | 704.800 |
| ENEL SPA | 1,606 | 5.682 | 9,125.290 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 646 | 20.350 | 13,146.100 |
| SARTORIUS AG | 5 | 257.500 | 1,287.500 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 256 | 30.065 | 7,696.640 |
| RATIONAL AG | 1 | 577.500 | 577.500 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG | 12 | 78.040 | 936.480 |
| BECHTLE AG | 21 | 41.620 | 874.020 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 551 | 3.139 | 1,729.580 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 25 | 47.480 | 1,187.000 |
| TELEPERFORMANCE | 14 | 118.850 | 1,663.900 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 40 | 157.650 | 6,306.000 |
| EURAZEO | 11 | 52.800 | 580.800 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 15 | 70.200 | 1,053.000 |
| HEINEKEN HOLDING NV-A | 24 | 70.350 | 1,688.400 |
| INDITEX | 225 | 33.960 | 7,641.000 |
| ESSILORLUXOTTICA | 58 | 162.140 | 9,404.120 |
| SNAM SPA | 307 | 4.425 | 1,358.470 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 218 | 11.378 | 2,480.400 |
| ENAGAS | 51 | 15.980 | 814.980 |
| WENDEL | 6 | 75.200 | 451.200 |
| TENARIS SA | 87 | 15.625 | 1,359.370 |

| | | | |
|--------------------------------------|-------|---------|-----------|
| TELECOM ITALIA SPA | 1,698 | 0.267 | 453.360 |
| TERNA SPA | 287 | 7.240 | 2,077.880 |
| BIOMERIEUX | 11 | 85.900 | 944.900 |
| GRIFOLS SA | 92 | 10.715 | 985.780 |
| NESTE OYJ | 79 | 29.970 | 2,367.630 |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP | 9,000 | 0.000 | 0.000 |
| RECORDATI SPA | 19 | 44.620 | 847.780 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 89 | 10.935 | 973.210 |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG | 11 | 167.050 | 1,837.550 |
| KONE OYJ | 74 | 39.050 | 2,889.700 |
| ELIA GROUP | 4 | 91.600 | 366.400 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 5 | 195.000 | 975.000 |
| ENGIE | 367 | 14.874 | 5,458.750 |
| ALSTOM | 49 | 12.455 | 610.290 |
| IPSEN SA | 5 | 115.400 | 577.000 |
| ARKEMA SA | 14 | 85.480 | 1,196.720 |
| LEGRAND SA | 53 | 83.120 | 4,405.360 |
| AMPLIFON SPA | 27 | 27.080 | 731.160 |
| ADP | 10 | 103.000 | 1,030.000 |
| ORION OYJ | 14 | 36.670 | 513.380 |
| METSO CORPORATION | 125 | 9.114 | 1,139.250 |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 92 | 14.670 | 1,349.640 |
| SYMRISE AG | 30 | 91.400 | 2,742.000 |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 60 | 30.690 | 1,841.400 |
| PRYSMIAN SPA | 62 | 35.110 | 2,176.820 |
| DIASORIN ITALIA SPA | 3 | 82.220 | 246.660 |
| CAIXABANK | 931 | 3.854 | 3,588.070 |
| BUREAU VERITAS SA | 49 | 23.280 | 1,140.720 |
| GETLINK | 48 | 14.675 | 704.400 |
| EDP RENOVAVEIS SA | 78 | 14.310 | 1,116.180 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 86 | 54.740 | 4,707.640 |
| BRENTAG SE | 30 | 67.960 | 2,038.800 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 15 | 16.570 | 248.550 |
| EDENRED | 51 | 52.560 | 2,680.560 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 239 | 1.679 | 401.280 |
| TALANX AG | 13 | 59.350 | 771.550 |
| LEG IMMOBILIEN SE | 19 | 55.760 | 1,059.440 |
| VONOVIA SE | 159 | 20.510 | 3,261.090 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 237 | 9.326 | 2,210.260 |
| KNORR-BREMSE AG | 12 | 54.820 | 657.840 |
| OCI NV | 29 | 24.680 | 715.720 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 65 | 46.030 | 2,991.950 |
| FERRARI NV | 25 | 285.100 | 7,127.500 |
| ASR NEDERLAND NV | 28 | 35.740 | 1,000.720 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 183 | 10.885 | 1,991.950 |

| | | | | | |
|-------|---|--------|---------|------------------------------|--|
| | AIB GROUP PLC | 250 | 4.300 | 1,075.000 | |
| | LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 25 | 29.040 | 726.000 | |
| | MONCLER SPA | 43 | 53.120 | 2,284.160 | |
| | NEXI SPA | 160 | 6.460 | 1,033.600 | |
| | PROSUS NV | 305 | 26.450 | 8,067.250 | |
| | DR ING HC F PORSCHE AG | 22 | 91.300 | 2,008.600 | |
| | JDE PEET'S BV | 9 | 25.540 | 229.860 | |
| | EXOR NV | 21 | 84.420 | 1,772.820 | |
| | SIEMENS ENERGY AG | 114 | 11.245 | 1,281.930 | |
| | EURONEXT NV | 16 | 66.950 | 1,071.200 | |
| | IMCD NV | 12 | 111.450 | 1,337.400 | |
| | WORLDLINE SA | 47 | 24.080 | 1,131.760 | |
| | NN GROUP NV | 39 | 30.620 | 1,194.180 | |
| | FINECOBANK SPA | 147 | 10.990 | 1,615.530 | |
| | ARGENX SE | 12 | 450.800 | 5,409.600 | |
| | UNIVERSAL MUSIC GROUP BV | 169 | 24.650 | 4,165.850 | |
| | DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 96 | 30.360 | 2,914.560 | |
| | CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA | 20 | 25.660 | 513.200 | |
| | DSM-FIRMENICH AG | 35 | 77.070 | 2,697.450 | |
| | ZALANDO SE | 43 | 22.120 | 951.160 | |
| | STELLANTIS NV | 437 | 18.086 | 7,903.580 | |
| | FERROVIAL SE | 111 | 28.390 | 3,151.290 | |
| | AENA SME SA | 17 | 139.950 | 2,379.150 | |
| | CELLNEX TELECOM SAU | 108 | 27.550 | 2,975.400 | |
| | ABN AMRO BANK NV | 70 | 13.045 | 913.150 | |
| | SCOUT24 SE | 20 | 59.940 | 1,198.800 | |
| | COVESTRO AG | 43 | 47.620 | 2,047.660 | |
| | HELLOFRESH SE | 26 | 24.410 | 634.660 | |
| | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 178 | 50.550 | 8,997.900 | |
| | POSTE ITALIANE SPA | 150 | 9.522 | 1,428.300 | |
| | AMUNDI SA | 10 | 50.850 | 508.500 | |
| | INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA | 59 | 10.355 | 610.940 | |
| | ADYEN NV | 4 | 699.300 | 2,797.200 | |
| | DELIVERY HERO SE | 49 | 24.990 | 1,224.510 | |
| | ユーロ 小計 | 44,944 | | 886,137.910 (140,497,166) | |
| 香港・ドル | CLP HOLDINGS LTD | 235 | 57.050 | 13,406.750 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 500 | 36.400 | 18,200.000 | |
| | HONG KONG EXCHANGES &CLEAR | 266 | 282.600 | 75,171.600 | |
| | MTR CORP | 403 | 29.950 | 12,069.850 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 100 | 92.800 | 9,280.000 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 86 | 20.350 | 1,750.100 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS | 67 | 37.350 | 2,502.450 | |

| | | | | |
|--------------------------------|---------|--------|----------------------------------|--|
| LTD | | | | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 1,515 | 5.500 | 8,332.500 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 537 | 43.300 | 23,252.100 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 684 | 20.800 | 14,227.200 | |
| SINO LAND CO | 576 | 8.570 | 4,936.320 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 500 | 81.350 | 40,675.000 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 273 | 67.800 | 18,509.400 | |
| AIA GROUP LTD | 2,351 | 66.750 | 156,929.250 | |
| HKT TRUST / HKT LTD | 1,080 | 8.120 | 8,769.600 | |
| SANDS CHINA LTD | 574 | 21.400 | 12,283.600 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 32 | 15.260 | 488.320 | |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LTD | 500 | 14.580 | 7,290.000 | |
| WH GROUP LTD | 1,500 | 4.360 | 6,540.000 | |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 534 | 39.900 | 21,306.600 | |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 534 | 38.850 | 20,745.900 | |
| 香港・ドル 小計 | 12,847 | | 476,666.540 (9,137,698) | |
| 合計 | 231,506 | | 1,503,637,038 (1,503,637,038) | |

(2) 株式以外の有価証券

2023年10月20日現在

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------------|------------------|--|-----------|---------------------------|----|
| 新株予約権証券 | カナダ・ドル | CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT | 4.000 | 0.000 | |
| | カナダ・ドル 小計 | | 4.000 | 0.000 (0) | |
| 新株予約権証券 合計 | | | 4 | 0 (0) | |
| 投資信託受益証券 | オーストラリア・ドル | DEXUS | 286.000 | 1,993.420 | |
| | | GOODMAN GROUP | 380.000 | 8,151.000 | |
| | | GPT GROUP | 525.000 | 1,984.500 | |
| | | MIRVAC GROUP | 1,078.000 | 2,209.900 | |
| | | SCENTRE GROUP | 1,109.000 | 2,794.680 | |
| | | STOCKLAND | 473.000 | 1,759.560 | |
| | VICINITY CENTRES | 700.000 | 1,228.500 | | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | | 4,551.000 | 20,121.560 (1,906,114) | |
| シンガポール・ドル | シンガポール・ドル | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 1,079.000 | 1,899.040 | |
| | | CAPLAND ASCENDAS REIT | 600.000 | 1,530.000 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 500.000 | 760.000 | |
| | | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL | 200.000 | 266.000 | |

| | | | | | |
|-----------------|---------------|--------------------------------------|-----------|-----------------------------|--|
| | シンガポール・ドル 小計 | | 2,379.000 | 4,455.040 (486,357) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | 6,930 | 2,392,471 (2,392,471) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 37.000 | 3,504.640 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT | 60.000 | 2,038.200 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 94.000 | 14,986.420 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 87.000 | 1,421.580 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 28.000 | 4,845.400 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 34.000 | 1,854.700 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 24.000 | 2,256.960 | |
| | | CROWN CASTLE INC | 85.000 | 7,300.650 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 58.000 | 6,707.120 | |
| | | EQUINIX INC | 19.000 | 13,372.390 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 30.000 | 1,968.000 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 80.000 | 4,679.200 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 13.000 | 2,785.900 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 41.000 | 4,612.500 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 50.000 | 2,282.500 | |
| | | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 96.000 | 1,394.880 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 90.000 | 1,501.200 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 154.000 | 2,425.500 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 119.000 | 3,755.640 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 60.000 | 3,585.000 | |
| | | KIMCO REALTY | 151.000 | 2,548.880 | |
| | | MID AMERICA | 24.000 | 3,141.600 | |
| | | PROLOGIS INC | 186.000 | 19,079.880 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 32.000 | 8,272.000 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 134.000 | 6,622.280 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 38.000 | 2,249.220 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 20.000 | 3,788.800 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 69.000 | 7,348.500 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 21.000 | 2,218.650 | |
| | | UDR INC | 65.000 | 2,287.350 | |
| | | VENTAS INC | 73.000 | 3,053.590 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 197.000 | 5,531.760 | |
| | WELLTOWER INC | 99.000 | 8,308.080 | | |
| WEYERHAEUSER CO | 146.000 | 4,282.180 | | | |
| WP CAREY INC | 53.000 | 2,836.560 | | | |
| | アメリカ・ドル 小計 | | 2,567.000 | 168,847.710 (25,320,402) | |
| | イギリス・ポンド | LAND SECURITIES GROUP | 134.000 | 764.870 | |

| | | | | |
|-------------|------------------------------------|---------|----------------------------|--|
| ド | PLC | | | |
| | SEGRO PLC | 218.000 | 1,543.440 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | 352.000 | 2,308.310 (419,743) | |
| カナダ・ドル | CANADIAN APT PPTYS REIT | 10.000 | 435.100 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 15.000 | 259.350 | |
| カナダ・ドル 小計 | | 25.000 | 694.450 (75,869) | |
| ユーロ | COVIVIO | 4.000 | 151.840 | |
| | GECINA SA | 7.000 | 641.550 | |
| | KLEPIERRE | 31.000 | 674.560 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD | 33.000 | 1,446.390 | |
| | WAREHOUSES DE PAUW | 41.000 | 926.600 | |
| ユーロ 小計 | | 116.000 | 3,840.940 (608,981) | |
| 香港・ドル | LINK REIT | 507.000 | 18,226.650 | |
| 香港・ドル 小計 | | 507.000 | 18,226.650 (349,405) | |
| 投資証券 合計 | | 3,567 | 26,774,400 (26,774,400) | |
| 合計 | | | 29,166,871 (29,166,871) | |

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

(注)

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式 時価比率 (%) | 組入新株 予約権証券 時価比率 (%) | 組入 投資信託受益証券 時価比率 (%) | 組入 投資証券 時価比率 (%) | 有価証券の合計金額 に対する比率 (%) |
|------------|--------------|---------------------|------------------------------|-------------------------------|---------------------------|----------------------------|
| アメリカ・ドル | 株式 604銘柄 | 66.49 | — | — | — | 74.90 |
| | 投資証券 35銘柄 | — | — | — | 1.50 | |
| イギリス・ポンド | 株式 81銘柄 | 3.96 | — | — | — | 4.39 |
| | 投資証券 2銘柄 | — | — | — | 0.02 | |
| イスラエル・シケル | 株式 8銘柄 | 0.09 | — | — | — | 0.10 |
| オーストラリア・ドル | 株式 52銘柄 | 1.79 | — | — | — | 2.09 |
| | 投資信託受益証券 7銘柄 | — | — | 0.11 | — | |
| カナダ・ドル | 株式 86銘柄 | 3.06 | — | — | — | 3.37 |
| | 新株予約権証券 1銘柄 | — | 0.00 | — | — | |
| | 投資証券 2銘柄 | — | — | — | 0.00 | |
| シンガポール・ドル | 株式 14銘柄 | 0.30 | — | — | — | 0.36 |
| | 投資信託受益証券 4銘柄 | — | — | 0.03 | — | |

| | | | | | | | |
|-------------|------|-------|------|---|---|------|------|
| スイス・フラン | 株式 | 43銘柄 | 2.57 | — | — | — | 2.83 |
| スウェーデン・クローナ | 株式 | 43銘柄 | 0.81 | — | — | — | 0.89 |
| デンマーク・クローネ | 株式 | 16銘柄 | 0.88 | — | — | — | 0.97 |
| ニュージーランド・ドル | 株式 | 6銘柄 | 0.05 | — | — | — | 0.05 |
| ノルウェー・クローネ | 株式 | 12銘柄 | 0.19 | — | — | — | 0.21 |
| ユーロ | 株式 | 221銘柄 | 8.32 | — | — | — | 9.21 |
| | 投資証券 | 5銘柄 | — | — | — | 0.04 | |
| 香港・ドル | 株式 | 21銘柄 | 0.54 | — | — | — | 0.62 |
| | 投資証券 | 1銘柄 | — | — | — | 0.02 | |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

海外国債マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年10月20日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 2023年10月20日現在 |
|---------------------------------------|----------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 5,227,014,118円 |
| 同期中追加設定元本額 | 12,277,243円 |
| 同期中一部解約元本額 | 245,007,400円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| 海外国債ファンド | 3,610,752,364円 |
| 海外国債ファンド（3ヵ月決算型） | 645,393,677円 |
| 新光7資産バランスファンド | 235,052,061円 |
| 海外国債ファンド（変額年金） | 503,085,859円 |
| 計 | 4,994,283,961円 |
| 2. 受益権の総数 | 4,994,283,961口 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2023年4月21日 至 2023年10月20日 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>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。</p> |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> |

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 2023年10月20日現在 |
|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額 | 2,6743円 |
| (1万口当たり純資産額) | (26,743円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年10月20日現在

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

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

(注)

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券 時価比率 (%) | 有価証券の合計金額に 対する比率 (%) |
|----------|-----------|---------------------|----------------------------|
| アメリカ・ドル | 国債証券 9銘柄 | 41.22 | 41.74 |
| イギリス・ポンド | 国債証券 5銘柄 | 7.27 | 7.36 |
| カナダ・ドル | 国債証券 5銘柄 | 4.32 | 4.38 |
| ユーロ | 国債証券 18銘柄 | 45.95 | 46.52 |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年10月20日現在

| | |
|--------------|-------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 3,944,834 |
| コール・ローン | 1,198,162 |
| 投資証券 | 580,946,250 |
| 未収配当金 | 653,652 |
| 流動資産合計 | 586,742,898 |
| 資産合計 | 586,742,898 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 流動負債合計 | — |
| 負債合計 | — |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 244,032,668 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金 (△) | 342,710,230 |
| 元本等合計 | 586,742,898 |
| 純資産合計 | 586,742,898 |
| 負債純資産合計 | 586,742,898 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 2023年10月20日現在 |
|---------------------------------------|---------------|
| 1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 244,032,668円 |
| 同期中追加設定元本額 | —円 |
| 同期中一部解約元本額 | —円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| 新光7資産バランスファンド | 244,032,668円 |
| 計 | 244,032,668円 |
| 2. 受益権の総数 | 244,032,668口 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年10月21日から2023年10月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2023年10月20日現在

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

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

| | | | |
|---------------------------------------|-----------|-------------|--|
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 330.000 | 3,534.300 | |
| ELME COMMUNITIES | 316.000 | 4,417.680 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 490.000 | 3,773.000 | |
| EPR PROPERTIES | 269.000 | 11,063.970 | |
| EQUINIX INC | 343.000 | 241,406.830 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 651.000 | 42,705.600 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 1,371.000 | 80,189.790 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 564.000 | 11,827.080 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 235.000 | 50,360.500 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 769.000 | 86,512.500 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 181.000 | 1,848.010 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 295.000 | 25,850.850 | |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 485.000 | 20,627.050 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 312.000 | 6,589.440 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 331.000 | 556.080 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 924.000 | 42,180.600 | |
| GETTY REALTY CORP | 161.000 | 4,264.890 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 143.000 | 1,733.160 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 121.000 | 1,677.060 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 231.000 | 2,007.390 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 700.000 | 5,649.000 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 1,391.000 | 20,211.230 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 2,004.000 | 33,426.720 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 109.000 | 1,076.920 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 378.000 | 7,064.820 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 2,589.000 | 40,776.750 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 472.000 | 2,411.920 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 812.000 | 10,921.400 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 220.000 | 514.800 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 100.000 | 7,517.000 | |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 245.000 | 6,095.600 | |
| INVITATION HOMES INC | 2,246.000 | 70,883.760 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 1,064.000 | 63,574.000 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 406.000 | 5,631.220 | |

| | | | |
|---|-----------|-------------|--|
| KILROY REALTY CORP | 423.000 | 12,334.680 | |
| KIMCO REALTY | 2,212.000 | 37,338.560 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 788.000 | 16,201.280 | |
| LAMAR ADVERTISING CO | 318.000 | 26,355.840 | |
| LTC PROPERTIES INC | 145.000 | 4,611.000 | |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 1,043.000 | 8,531.740 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 2,161.000 | 10,027.040 | |
| MID AMERICA | 427.000 | 55,894.300 | |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 151.000 | 7,415.610 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 291.000 | 8,910.420 | |
| NETSTREIT CORP | 244.000 | 3,369.640 | |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST | 112.000 | 898.240 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 82.000 | 2,481.320 | |
| NNN REIT INC | 665.000 | 23,521.050 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 162.000 | 742.770 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 858.000 | 28,682.940 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 55.000 | 1,016.400 | |
| ORION OFFICE REIT INC | 193.000 | 937.980 | |
| OUTFRONT MEDIA INC | 530.000 | 4,897.200 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 682.000 | 3,034.900 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 778.000 | 9,164.840 | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 131.000 | 1,811.730 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 440.000 | 5,799.200 | |
| PHILLIPS EDISON & CO INC | 424.000 | 14,479.600 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 859.000 | 9,689.520 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 456.000 | 2,362.080 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 155.000 | 3,117.050 | |
| POSTAL REALTY TRUST INC | 64.000 | 858.240 | |
| POTLATCH CORP | 288.000 | 12,709.440 | |
| PROLOGIS INC | 3,225.000 | 330,820.500 | |
| PUBLIC STORAGE | 576.000 | 148,896.000 | |
| RAYONIER INC | 537.000 | 13,854.600 | |
| REALTY INCOME CORP | 2,476.000 | 122,363.920 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 664.000 | 39,302.160 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 436.000 | 5,179.680 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 756.000 | 33,694.920 | |
| RLJ LODGING TRUST | 580.000 | 5,579.600 | |
| RPT REALTY | 307.000 | 3,131.400 | |
| RYMAN HOSPITALITY | 208.000 | 17,721.600 | |

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

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入 投資証券 | 有価証券の合計金額に 対する比率 |
|----|-----|------------|---------------------|
| | | | |

| | | 時価比率 (%) | (%) |
|---------|------------|-------------|--------|
| アメリカ・ドル | 投資証券 141銘柄 | 99.01 | 100.00 |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

フランクリン・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

「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」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

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

財政状態計算書

2023年5月31日現在

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

要約投資明細表（無監査）
2023年5月31日現在

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

| | 公正価値 (日本円) | 純資産比率 |
|--|---------------|-------|
| 債券 (続き) | | |
| コロンビア | | |
| Bogota Distrito Capital 9.750% due 26/07/2028 REGS | 371,257,044 | 2.79% |
| Colombia Government International Bond 7.500% 02/02/2034 | 205,953,090 | 1.55% |
| コロンビア合計 (取得原価 : 656,469,060円) | 577,210,134 | 4.34% |
| コスタリカ | | |
| Costa Rica Government International Bond 7.158% due 12/03/2045 | 239,193,114 | 1.80% |
| コスタリカ合計 (取得原価 : 177,131,168円) | 239,193,114 | 1.80% |
| コートジボワール | | |
| Ivory Coast Government International Bond 4.875% due 30/01/2032 REGS | 300,362,732 | 2.26% |
| コートジボワール合計 (取得原価 : 260,024,764円) | 300,362,732 | 2.26% |
| ドミニカ共和国 | | |
| Dominican Republic International Bond 9.750% due 05/06/2026 REGS | 491,843,073 | 3.69% |
| ドミニカ共和国合計 (取得原価 : 396,156,338円) | 491,843,073 | 3.69% |
| エジプト | | |
| Egypt Government International Bond 7.500% due 16/02/2061 REGS | 118,771,423 | 0.89% |
| Egypt Government International Bond 7.625% due 29/05/2032 REGS | 42,656,812 | 0.32% |
| エジプト合計 (取得原価 : 210,099,769円) | 161,428,235 | 1.21% |
| エチオピア | | |
| Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS | 224,797,705 | 1.69% |
| エチオピア合計 (取得原価 : 259,981,998円) | 224,797,705 | 1.69% |
| ジョージア | | |
| Georgia Treasury Bond 9.125% due 30/05/2025 | 66,989,140 | 0.50% |
| Georgian Railway JSC 4.000% due 17/06/2028 REGS | 122,484,635 | 0.92% |
| ジョージア合計 (取得原価 : 177,466,044円) | 189,473,775 | 1.42% |
| ガーナ | | |
| Saderea DAC 12.500% due 30/11/2026 REGS | 29,642,455 | 0.22% |
| ガーナ合計 (取得原価 : 57,254,212円) | 29,642,455 | 0.22% |

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

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

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

(FRN)変動利付債です。※

(Index Linked)インフレ連動債です。※

(REGS)Regulation Sの略。米国外での証券の募集に関して1990年に米証券取引委員会より定められた規制です。米国企業が米国外で募集した証券については当局での登録義務が免除されており、米国証券を購入する海外投資家の負担を軽減しています。※

※はアセットマネジメントOneにて追記

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年10月31日現在

| | |
|---------------------|----------------|
| I 資産総額 | 4,403,565,738円 |
| II 負債総額 | 1,497,704円 |
| III 純資産総額（I－II） | 4,402,068,034円 |
| IV 発行済数量 | 4,169,293,572口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.0558円 |

（参考）

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2023年10月31日現在

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

新光日本債券インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

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

新光J－REITマザーファンド

2023年10月31日現在

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

新光外国株式インデックスマザーファンド

2023年10月31日現在

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

海外国債マザーファンド

2023年10月31日現在

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

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2023年10月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2023年10月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第39期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年5月25日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

| | 第37期 (2022年3月31日現在) | 第38期 (2023年3月31日現在) |
|--------------|------------------------|------------------------|
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 1,445 | 1,481 |
| リース債務 | - | 1 |
| 未払金 | 7,616 | 7,246 |
| 未払収益分配金 | 0 | 0 |
| 未払償還金 | 9 | - |
| 未払手数料 | 7,430 | 7,005 |
| その他未払金 | 175 | 240 |
| 未払費用 | 8,501 | 7,716 |
| 未払法人税等 | 2,683 | 1,958 |
| 未払消費税等 | 1,330 | 277 |
| 賞与引当金 | 1,933 | 1,730 |
| 役員賞与引当金 | 69 | 48 |
| 流動負債計 | 23,581 | 20,460 |
| 固定負債 | | |
| リース債務 | - | 6 |
| 退職給付引当金 | 2,507 | 2,654 |
| 時効後支払損引当金 | 147 | 108 |
| 固定負債計 | 2,655 | 2,769 |
| 負債合計 | 26,236 | 23,230 |
| (純資産の部) | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000 | 2,000 |
| 資本剰余金 | 19,552 | 19,552 |
| 資本準備金 | 2,428 | 2,428 |
| その他資本剰余金 | 17,124 | 17,124 |
| 利益剰余金 | 56,020 | 57,481 |
| 利益準備金 | 123 | 123 |
| その他利益剰余金 | 55,896 | 57,358 |
| 別途積立金 | 31,680 | 31,680 |
| 繰越利益剰余金 | 24,216 | 25,678 |
| 株主資本計 | 77,573 | 79,034 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | △0 | △0 |
| 評価・換算差額等計 | △0 | △0 |
| 純資産合計 | 77,573 | 79,034 |
| 負債・純資産合計 | 103,810 | 102,265 |

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：百万円)

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

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

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

| | 評価・換算差額等 | | 純資産 合計 |
|-----------------------------|----------------------|----------------|-----------|
| | その他 有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | △0 | △0 | 77,573 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | △12,360 |
| 当期純利益 | | | 13,821 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | △0 | △0 | △0 |
| 当期変動額合計 | △0 | △0 | 1,461 |
| 当期末残高 | △0 | △0 | 79,034 |

重要な会計方針

| | |
|--------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p> |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 3. 固定資産の減価償却の方法 | <p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 … 8～18年</p> <p>器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p> |
| 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 |
| 5. 引当金の計上基準 | <p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> |
| 6. 収益及び費用の計上基準 | 当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投 |

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

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

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

注記事項

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

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

(損益計算書関係)

※1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

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

※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 発行済株式の種類 | 当事業年度期首 株式数(株) | 当事業年度 増加株式数(株) | 当事業年度 減少株式数(株) | 当事業年度末 株式数(株) |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式 | 24,490 | — | — | 24,490 |
| A種種類株式 | 15,510 | — | — | 15,510 |
| 合計 | 40,000 | — | — | 40,000 |

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の 種類 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり配 当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|------------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2021年6月16日 定時株主総会 | 普通株式 | 11,280 | 282,000 | 2021年3月31日 | 2021年6月17日 |
| | A種種類 株式 | | | | |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり配当額 (円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|--------|-----------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2022年6月16日 定時株主総会 | 普通株式 | 利益 剰余金 | 12,360 | 309,000 | 2022年3月31日 | 2022年6月17日 |
| | A種種類株式 | | | | | |

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 発行済株式の種類 | 当事業年度期首 株式数（株） | 当事業年度 増加株式数（株） | 当事業年度 減少株式数（株） | 当事業年度末 株式数（株） |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式 | 24,490 | — | — | 24,490 |
| A種種類株式 | 15,510 | — | — | 15,510 |
| 合計 | 40,000 | — | — | 40,000 |

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり配当額 (円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|--------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2022年6月16日 定時株主総会 | 普通株式 | 12,360 | 309,000 | 2022年3月31日 | 2022年6月17日 |
| | A種種類株式 | | | | |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり配当額 (円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|--------|-----------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2023年6月16日 定時株主総会 | 普通株式 | 利益 剰余金 | 11,040 | 276,000 | 2023年3月31日 | 2023年6月19日 |
| | A種種類株式 | | | | | |

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023年3月31日現在）

| | 貸借対照表計上額 (百万円) | 時価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|----------------------|-------------------|-------------|-------------|
| (1) 金銭の信託 | 29,184 | 29,184 | — |
| (2) 投資有価証券 其他有価証券 | 1 | 1 | — |
| 資産計 | 29,186 | 29,186 | — |

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023年3月31日現在）

| | 1年以内 (百万円) | 1年超5年以内 (百万円) | 5年超10年以内 (百万円) | 10年超 (百万円) |
|----------------------------|---------------|------------------|-------------------|---------------|
| (1) 現金・預金 | 33,770 | — | — | — |
| (2) 金銭の信託 | 29,184 | — | — | — |
| (3) 未収委託者報酬 | 16,279 | — | — | — |
| (4) 未収運用受託報酬 | 3,307 | — | — | — |
| (5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託) | — | 1 | — | — |
| 合計 | 82,540 | 1 | — | — |

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第37期（2022年3月31日現在）

| 区分 | 時価（百万円） | | | |
|-----------------------|---------|-------|------|-------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| (1) 金銭の信託 | — | 6,932 | — | 6,932 |
| (2) 投資有価証券 その他有価証券 | — | — | — | — |
| 資産計 | — | 6,932 | — | 6,932 |

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、投資有価証券1百万円となります。

第38期（2023年3月31日現在）

| 区分 | 時価（百万円） | | | |
|-----------------------|---------|--------|------|--------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| (1) 金銭の信託 | — | 29,184 | — | 29,184 |
| (2) 投資有価証券 その他有価証券 | — | — | — | — |
| 資産計 | — | 29,186 | — | 29,186 |

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

(百万円)

| | 第37期 (2022年3月31日現在) | 第38期 (2023年3月31日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 投資有価証券（その他有価証券） | | |
| 非上場株式 | 239 | 180 |
| 関係会社株式 | | |
| 非上場株式 | 5,349 | 5,810 |

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第37期（2022年3月31日現在）

(百万円)

| 区分 | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------------------|------------------------|------|----|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託 | — | — | — |
| 小計 | — | — | — |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託 | 1 | 2 | △0 |
| 小計 | 1 | 2 | △0 |
| 合計 | 1 | 2 | △0 |

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額239百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

第38期（2023年3月31日現在）

(百万円)

| 区分 | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------------------|------------------------|------|----|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託 | — | — | — |
| 小計 | — | — | — |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託 | 1 | 2 | △0 |
| 小計 | 1 | 2 | △0 |
| 合計 | 1 | 2 | △0 |

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額180百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

| 区分 | 売却額 (百万円) | 売却益の合計額 (百万円) | 売却損の合計額 (百万円) |
|----|--------------|------------------|------------------|
| 株式 | 13 | — | 6 |

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

| 区分 | 売却額 (百万円) | 売却益の合計額 (百万円) | 売却損の合計額 (百万円) |
|----|--------------|------------------|------------------|
| 株式 | 54 | 4 | 9 |

4. 減損処理を行った有価証券

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | (百万円) | |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| | 第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
| 退職給付債務の期首残高 | 2,479 | 2,576 |
| 勤務費用 | 295 | 279 |
| 利息費用 | 2 | 2 |
| 数理計算上の差異の発生額 | △14 | 31 |
| 退職給付の支払額 | △185 | △191 |
| 退職給付債務の期末残高 | 2,576 | 2,698 |

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

| | (百万円) | |
|---------------------|------------------------|------------------------|
| | 第37期 (2022年3月31日現在) | 第38期 (2023年3月31日現在) |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 2,576 | 2,698 |
| 未積立退職給付債務 | 2,576 | 2,698 |
| 未認識数理計算上の差異 | △35 | △44 |
| 未認識過去勤務費用 | △33 | 0 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 2,507 | 2,654 |
| 退職給付引当金 | 2,507 | 2,654 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 2,507 | 2,654 |

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において20百万円、当事業年度において24百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

| | 第37期 (2022年3月31日現在) | 第38期 (2023年3月31日現在) |
|-------|------------------------|------------------------|
| 割引率 | 0.09% | 0.09% |
| 予想昇給率 | 1.00%~3.76% | 1.00%~3.56% |

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度97百万円、当事業年度103百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

(注) 前事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

| | | |
|--------|-----------|-----------|
| のれん | 55,263百万円 | 51,451百万円 |
| 顧客関連資産 | 25,175百万円 | 20,947百万円 |

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

| | | |
|------------|----------|----------|
| のれんの償却額 | 3,811百万円 | 3,811百万円 |
| 顧客関連資産の償却額 | 4,618百万円 | 4,228百万円 |

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

| | 第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|---------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 委託者報酬 | 108,259百万円 | 95,739百万円 |
| 運用受託報酬 | 14,425百万円 | 14,651百万円 |
| 投資助言報酬 | 1,587百万円 | 2,048百万円 |
| 成功報酬(注) | 2,594百万円 | 1,499百万円 |
| その他営業収益 | 12百万円 | 23百万円 |
| 合計 | 126,879百万円 | 113,962百万円 |

(注) 成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(持分法損益等)

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容又は 職業 | 議決権 等の所有(被 所有) 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額 (百万円) | 科目 | 期末残高 (百万円) |
|---------------------------------|-------------------|-----------------|------------------|-------------------|----------------------------|----------------|---------------------|----------------------|---------------|-----------|---------------|
| | | | | | | 役員 の 兼任等 | 事業上 の 関係 | | | | |
| 親 会 社 の 子 会 社 | 株式会社 みずほ銀行 | 東京都 千代田 区 | 14,040 億円 | 銀行業 | — | — | 当社設定 投資信託 の販売 | 投資信託 の販売代 行手数料 | 7,789 | 未払 手数料 | 1,592 |
| | みずほ証 券株式会 社 | 東京都 千代田 区 | 1,251 億円 | 証券業 | — | — | 当社設定 投資信託 の販売 | 投資信託 の販売代 行手数料 | 16,373 | 未払 手数料 | 2,651 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容又は 職業 | 議決権 等の所有(被 所有) 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額 (百万円) | 科目 | 期末残高 (百万円) |
|---------------------------------|-------------------|-----------------|------------------|-------------------|----------------------------|----------------|---------------------|----------------------|---------------|-----------|---------------|
| | | | | | | 役員 の 兼任等 | 事業上 の 関係 | | | | |
| 親 会 社 の 子 会 社 | 株式会社 みずほ銀行 | 東京都 千代田 区 | 14,040 億円 | 銀行業 | — | — | 当社設定 投資信託 の販売 | 投資信託 の販売代 行手数料 | 7,474 | 未払 手数料 | 1,579 |
| | みずほ証 券株式会 社 | 東京都 千代田 区 | 1,251 億円 | 証券業 | — | — | 当社設定 投資信託 の販売 | 投資信託 の販売代 行手数料 | 13,932 | 未払 手数料 | 2,404 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

| | 第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 1,939,327円79銭 | 1,975,862円96銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 387,499円36銭 | 345,535円19銭 |

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|----------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期純利益金額 | 15,499百万円 | 13,821百万円 |
| 普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額 | — | — |
| 普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額 | 15,499百万円 | 13,821百万円 |
| 普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数 | 40,000株 | 40,000株 |
| (うち普通株式) | (24,490株) | (24,490株) |
| (うちA種種類株式) | (15,510株) | (15,510株) |

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森重 俊寛

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

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

6. 収益及び費用の計上基準

資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

(1) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(4) 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(金融商品関係)

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。
これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

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

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額4,888百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

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

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

(持分法損益等)

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第39期中間会計期間
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

約 款

追加型証券投資信託
[新光7資産バランスファンド] 約款

運用の基本方針

約款第24条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は、次のとおりとします。

1. 基本方針

この投資信託は、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ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①以下の投資信託証券を通じて、実質的にわが国および海外の、株式、公社債および不動産投資信託証券に分散投資を行ない、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ないます。

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
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） 新光米国REITマザーファンド受益証券
ケイマン諸島籍外国投資信託 フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・
マーケッツ・デット・ファンド円建受益証券

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

③各投資信託証券の構成比率については、原則として、6ヵ月毎にチェックを行ない、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ないます。

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

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

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

(3) 投資制限

①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。）以外には投資を行ないません。

②投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

④同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の50%未満とします。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10%以内とします。

⑤一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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、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。

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行いません。

- ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行な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前項にかかわらず、前項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せん。

追加型証券投資信託
[新光7資産バランスファンド] 約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

②この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人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なうものとします。

<信託の目的および金額>

第3条 委託者は、金16,951,402,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

<信託金の限度額>

第4条 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。

②追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から2026年10月20日までとします。

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

<当初の受益者>

第7条 この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<受益権の分割および再分割>

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については16,951,402,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、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。

<追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法>

第9条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②この約款において基準価額とは、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第25条に規定する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従って時

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。

<信託日時の異なる受益権の内容>

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第11条 この信託の全ての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

②委託者は、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、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、委託者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なわないものとします。

③委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

<受益権の設定にかかる受託者の通知>

第12条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

<受益権の申込単位および価額>

第13条 指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、指定販売会社が定める申込単位をもって取得申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める新光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。）を結んだ取得申込者には、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができるものとします。

②前項の規定にかかわらず、指定販売会社は、別に定める日のいずれかに該当する日においては、受益権の取得の申込みを受付けないものとします。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、受益権の取得の申込みの受付を中止することおよび既に受付けた取得申込の受付を取消することができます。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込みに限ってこれを受付けるものとします。

③受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前的取得申込にかかる価額は、1口につき1円に、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加算した価額とします。

④前項の手数料の額（その減免を含む）は、指定販売会社がそれぞれ独自に定めます。

- ⑤前2項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥第1項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

第14条 （削 除）

<受益権の譲渡にかかる記載または記録>

- 第15条 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、
- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、ただし、前項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なわれるよう通知するものとし、
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

<受益権の譲渡の対抗要件>

- 第16条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

第17条 （削 除）

第18条 （削 除）

第19条 （削 除）

第20条 （削 除）

<投資の対象とする資産の種類>

- 第21条 この信託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、
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

<運用の指図範囲等>

- 第22条 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・templton・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの円建受益証券
2. 証券投資信託 ニュー トピックス インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。） 受益証券
3. 証券投資信託 新光日本債券インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。） 受益証券
4. 証券投資信託 新光外国株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。） 受益証券
5. 証券投資信託 海外国債マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。） 受益証券
6. 証券投資信託 新光J-REITマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。） 受益証券
7. 証券投資信託 新光米国REITマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。） 受益証券
8. コマーシャル・ペーパー
9. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
10. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。）
11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
12. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

- ②委託者は、信託金を、前項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

- ③第1項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には、委託者は、信託金を、前項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。

<受託者の自己または利害関係人等との取引>

第23条 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、第30条第1項に定める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、第21条および第22条第1項および第2項に定める資産への投資を、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なうことができます。

- ④前項の取扱いは、第25条、第28条、第34条から第36条における委託者の指図による取引についても同様とします。

<運用の基本方針>

第24条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。

<公社債の借入れ>

第25条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができません。なお、当該公社債の借入れを行な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なうものとします。

②前項の指図は、当該借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。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の借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。

④第1項の借入れにかかる品借料は投資信託財産中から支弁します。

<同一銘柄の投資信託証券への投資制限>

第26条 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。

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

第27条 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。

<外国為替予約の指図>

第28条 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。

<外貨建資産の円換算および予約為替の評価>

第29条 投資信託財産に属する外貨建資産の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

②前条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

<デリバティブ取引等に係る投資制限>

第29条の2 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。

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第29条の3 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。

<信託業務の委託等>

第30条 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せん。）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な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
- ②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項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。
- ③前2項にかかわらず、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せん。）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. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第31条 （削除）

<混蔵寄託>

第32条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第2条第9項に規定する者をいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

<投資信託財産の登記等および記載等の留保等>

第33条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第34条 委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の受益証券にかかる投資信託契約の一部解約の請求および有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金、売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等

にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第36条 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。

- ②一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、借入指図を行な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。
- ③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弁さ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。
- ④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第37条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第38条 投資信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は、資金の立替えをすることができます。

- ②投資信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。
- ③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

<信託の計算期間>

第39条 この信託の計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。ただし、第1期計算期間は平成18年10月31日から平成19年1月22日までとします。

- ②前項にかかわらず、前項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、第5条に定める信託期間の終了日とします。

<投資信託財産に関する報告>

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ②受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

<信託事務の諸費用および監査報酬>

第41条 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、投資信託財産にかかる監査報酬、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替えた立替金の利息（以下「諸経費」

といひます。)は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

- ②前項の投資信託財産にかかる監査報酬は第39条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、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相当額とともに投資信託財産中から支弁します。

<信託報酬等の額および支弁の方法>

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の95の率を乗じて得た額とします。

- ②前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第43条 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」といひます。)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」といひます。)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。
- ②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。

<収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第44条 受託者は、収益分配金については毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金(信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいひます。以下同じ。)については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第45条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<収益分配金、償還金および一部解約金の支払い>

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行な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指定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)に支払います。

- ②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、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けを行ないます。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得

申込者とします。)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該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なわれます。

- ④一部解約金は、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営業日目から当該受益者に支払います。ただし、投資を行な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。
- ⑤前各項（第2項は除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとしします。
- ⑥収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金（所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとしします。）は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等（原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され収益分配のつど調整されるものとしします。）に応じて計算されるものとしします。

<収益分配金および償還金の時効>

第46条 受益者が、収益分配金については、前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については、前条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<投資信託契約の一部解約>

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に指定販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの投資信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該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なわれます。
- ③前項の一部解約の価額は、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。
- ④平成19年1月4日以降の投資信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするとき、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとしします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実なこの信託の受益証券をもって行なうものとしします。
- ⑤受益者は、別に定める日のいずれかに該当する日においては、第1項による一部解約の実行の請求を行なえないものとしします。
- ⑥委託者は、投資を行な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、第1項による一部解約の実行の請求の受け付け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け付けを取消することができます。
- ⑦前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合、またはすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けが取消された場合には、受益者は当該受付中止または取消し以前に行な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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止または取消しを解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額

とします。

<質権口記載または記録の受益権の取り扱い>

第47条の2 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け、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<投資信託契約の解約>

第48条 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。

- ②委託者は、前各項の事項について、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。
- ③前項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。
- ④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑤委託者は、前項の規定により、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。
- ⑥第3項から前項までの規定は、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、第3項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なうことが困難な場合には適用しません。

<投資信託契約に関する監督官庁の命令>

第49条 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。

- ②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、第53条の規定にしたがいます。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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。

- ②前項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投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第51条 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。

- ②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。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第52条 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、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

②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。

<投資信託約款の変更>

第53条 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。

②委託者は、前項の変更事項のうち、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。

③前項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。

④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託約款の変更をしません。

⑤委託者は、前項の規定により、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。

<反対者の買取請求権>

第54条 第48条第1項に規定する投資信託契約の解約または前条に規定する投資信託約款の変更を行なう場合において、第48条第3項または前条第3項の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取るべき旨を請求することができます。

②前項の買取請求の取扱いについては、委託者、受託者の協議により決定するものとします。

<信託期間の延長>

第55条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

<公告>

第56条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

②前項の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。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第56条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<投資信託約款に関する疑義の取扱い>

第57条 この投資信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付則)

第1条 平成18年12月29日現在の投資信託約款第11条、第12条、第14条から第20条の規定および受益権と読

み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成18年10月31日

委託者 東京都中央区日本橋一丁目17番10号
新光投信株式会社

受託者 大阪市中央区北浜四丁目5番33号
住友信託銀行株式会社

約 款 付 表

I. 申込み受付休止日

約款第13条第2項、または第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日