

## 【表紙】

|  |  |
|--|--|
| 【提出書類】                                   | 有価証券届出書  |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿  |
| 【提出日】                                    | 平成30年9月14日提出                                   |
| 【発行者名】                                   | アセットマネジメントOne株式会社                              |
| 【代表者の役職氏名】                               | 取締役社長 菅野 暁                                     |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号                              |
| 【事務連絡者氏名】                                | 三木谷 正直   |
| 【電話番号】                                   | 03-6774-5100                                   |
| 【届出の対象とした募集(売出)内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | グローバル・ナビ                                       |
| 【届出の対象とした募集(売出)内国投資<br>信託受益証券の金額】        | 継続募集額(平成30年9月15日から平成31年3月15日まで)<br>3兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】                               | 該当事項はありません。                                    |

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

グローバル・ナビ

愛称として「世界の潮流」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～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

### （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、2.7%（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。)(8%)が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

ただし、上記の申込手数料の優遇に関しては、優遇制度の取り扱い、優遇の内容、優遇を受けるための条件等は販売会社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をいいます。
- 2 「償還前乗り換え」とは、償還することが決定している証券投資信託の償還日前の一定期間内において、当該証券投資信託の一部解約金をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合をいいます。

#### (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～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

#### (7) 【申込期間】

平成30年 9月15日から平成31年 3月15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～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(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】

ファンドの振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(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、主としてマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」という場合があります。）および上場投資信託証券（以下「ETF」という場合があります。）に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の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5,000億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<br>(収益の源泉)           |
|------------|------------|-----------------------------|
| 単位型        | 国内         | 株 式<br>債 券                  |
| <b>追加型</b> | 海 外        | 不動産投信                       |
|            | <b>内 外</b> | その他資産<br>( )<br><b>資産複合</b> |

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 商品分類の定義

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

|      |  |
|------|--|
| 資産複合 | 目論見書または投資信託約款において、株式・債券・不動産投信（リート）・その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。 |
|------|--|

### 属性区分表

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

(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

|   |  |
|---|--|
| 資産複合(株式 一般、<br>その他資産(株式 一<br>般、債券 一般、不動産<br>投信)(資産配分変更<br>型)) | 目論見書または投資信託約款において、複数資産(株式 一般、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)を投資対象とするものをいう。<br>資産配分変更型とは、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、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 |
| 年1回   | 目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。   |

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
| グローバル(含む日本)<br>エマージング             | 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界(含む日本)・エマージング地域(複数の新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。 |
| ファミリーファンド                         | 目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。               |
| 為替ヘッジあり<br>(部分ヘッジ) <sup>(注)</sup> | 目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。                                      |

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

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(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

## b. ファンドの特色

### 1. 国内外の株式、債券、REIT<sup>\*1</sup>に分散投資を行います。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

投資信託証券への投資を通じて、国内外の株式、債券およびREITに実質的に投資することにより、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指します。

新興国株式については、ETF<sup>\*2</sup>への投資を行います。ETFについては、規模、流動性、ベンチマーク指数などを総合的に判断して、銘柄を決定します。

効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、国債先物取引などを利用することがあります。

\*1「REIT」とは、不動産投資信託証券を指します。

\*2「ETF」とは、Exchange Traded Fund(取引所で売買される投資信託)の略で、取引所に上場されている投資信託のことを指します。

### 2. 各資産の配分比率は、世界経済、金融市場の動向などを勘案して機動的に変更します。

各マザーファンドとETFを合算した投資比率は、原則として高位を保ちますが、市場環境などを勘案して、投資比率を引き上げる場合があります。

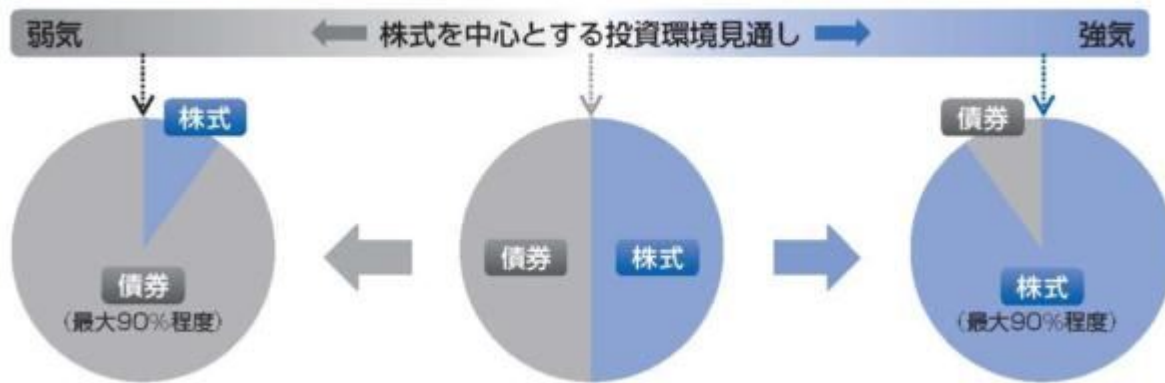
## <当ファンドの資産配分について>

### Step1 株式と債券の配分比率決定・見直し

主に株式を中心とする投資環境見直しに基づいて、株式(REITを含む)と債券(現預金などを含む)の配分比率を決定します。

配分比率は、株式比率で概ね10%~90%の範囲で、投資環境の変化に応じて機動的に見直しを行います。

### ＜配分比率決定・見直しのイメージ＞



## Step 2 各資産の配分比率決定

Step 1 の株式・債券の配分比率に基づき、各資産の魅力度評価とリスク判断に応じて、それぞれの配分比率を決定します。

株式・債券の配分比率内において、各資産の配分比率に制限はありません。

当ファンドの資金動向、市況動向などによっては、また、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。

## (参考)当ファンドが投資する各マザーファンドの運用方針

### 国内株式

#### ニュー トピックス インデックス マザーファンド

- ・東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資し、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。

### 先進国株式

#### 新光外国株式インデックスマザーファンド

- ・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。

### 国内債券

#### 新光日本債券インデックスマザーファンド

- ・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。

### 先進国債券

#### 海外国債マザーファンド



- ・主として日本を除く世界主要先進国(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)が発行する公社債に投資し、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。
- ・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します。
- ・外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。

### 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

- ・主として日本を除く世界主要国の公社債に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・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す。

## 新興国債券

### グローバル高金利通貨マザーファンド

- ・新興国を中心とする世界の国の中から、主として地域分散と金利水準の観点により選定した複数の通貨建ての国際機関債などに分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ・通貨配分は、北米・中南米、欧州、アジア・オセアニア、中東・アフリカの4地域について、それぞれ25%程度とすることを基本とします。各地域内における通貨配分は、金利水準や金利・為替動向、流動性などを勘案して決定します。

流動性の低下、市場規模の縮小、通貨制度の変更などにより、各地域に対する通貨配分比率を25%程度にできない場合があります。

- ・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。

## 国内REIT

### 新光J-REITマザーファンド

- ・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。

## 先進国REIT

### 新光米国REITマザーファンド

- ・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(REIT)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。
- ・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。

上記の各マザーファンドの運用方針は、各マザーファンド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、記載内容は2018年9月14日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

## (参考)当ファンドの投資対象候補であるETFの概要(2018年9月14日現在)

## 新興国株式

下記の投資対象候補およびその概要は2018年9月14日現在のものであり、今後予告なく変更する場合があります。

## 名称：iシェアーズ・コア MSCI エマージング・マーケット ETF

投資目的：MSCIエマージング・マーケットIMIインデックスと同等水準の投資成果を目指しています。

運用会社：ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ

上場取引所：NYSEアーカ取引所

## 分配方針

原則として、年1回（毎年12月15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、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します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。

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。

### （2）【ファンドの沿革】

平成26年1月6日

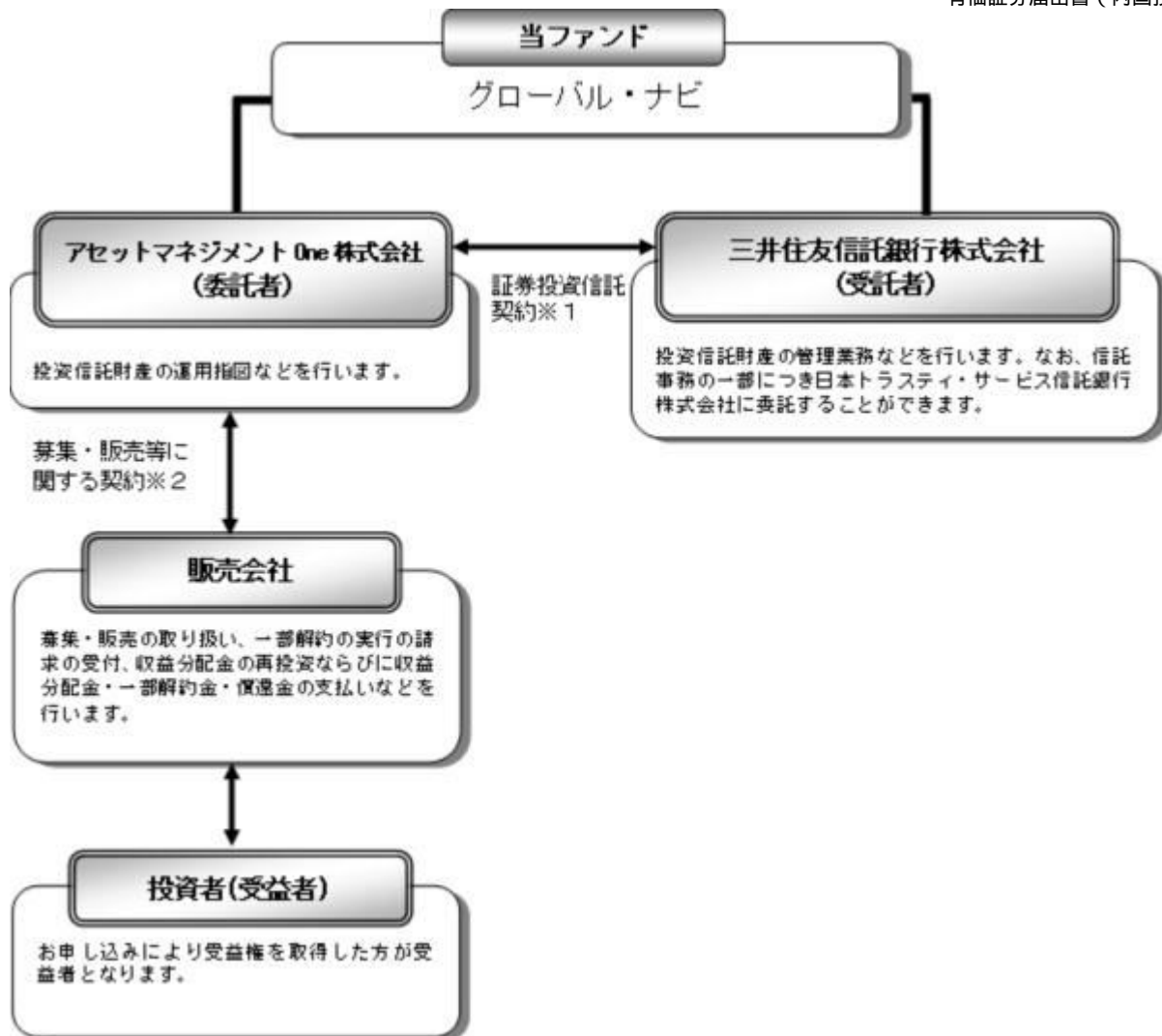
投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

平成28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

### （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。

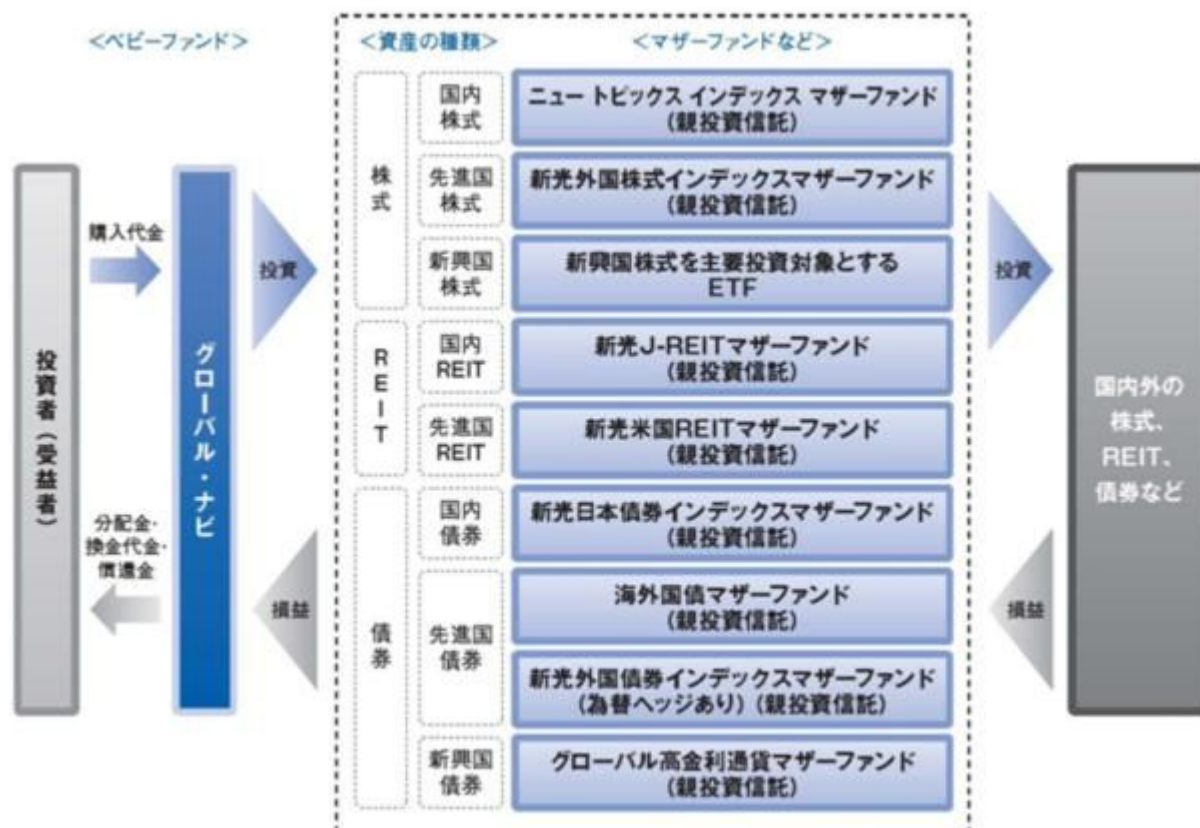
#### 2 募集・販売等に関する契約

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。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（当ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。

新興国株式については、ベビーファンド（当ファンド）から直接ETFに投資を行います。



## b. 委託会社の概況

(イ) 資本金の額 20億円 (平成30年 6月29日現在)

(ロ) 委託会社の沿革

|            |  |
|------------|--|
| 昭和60年7月1日  | 会社設立   |
| 平成10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  |
| 平成10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   |
| 平成11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、商号を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする |
| 平成20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   |
| 平成28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株式会社に變更 |

(ハ) 大株主の状況

(平成30年 6月29日現在)

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

- 1: A種類株式(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、安定した収益の確保と投資信託財産の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

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、新光外国株式インデックス 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、海外国債マザーファンド受益証券、新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり) 受益証券、グローバル高金利通貨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、新光米国REITマザーファンド受益証券、および新興国株式を主要投資対象とする上場投資信託証券(以下「新興国株ETF」といいます。)を主要投資対象とします。

##### (ロ) 投資態度

主としてマザーファンド受益証券、および新興国株ETFに投資することにより、実質的にわが国および海外の株式、債券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成長を目指して運用を行います。投資対象のマザーファンド、および上場投資信託証券は以下の通りとします。

|                 |                                   |
|-----------------|-----------------------------------|
| 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) | 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) | 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) | 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり) 受益証券 |
| 内国証券投資信託(親投資信託) | グローバル高金利通貨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               |
| 新興国株ETF         |                                   |

新興国株ETFについては、規模、流動性、ベンチマーク指数等を総合的に判断して、銘柄を決定します。

各マザーファンド受益証券、および上場投資信託証券等への投資比率は、世界経済、金融市場の動向等を勘案して機動的に変更します。

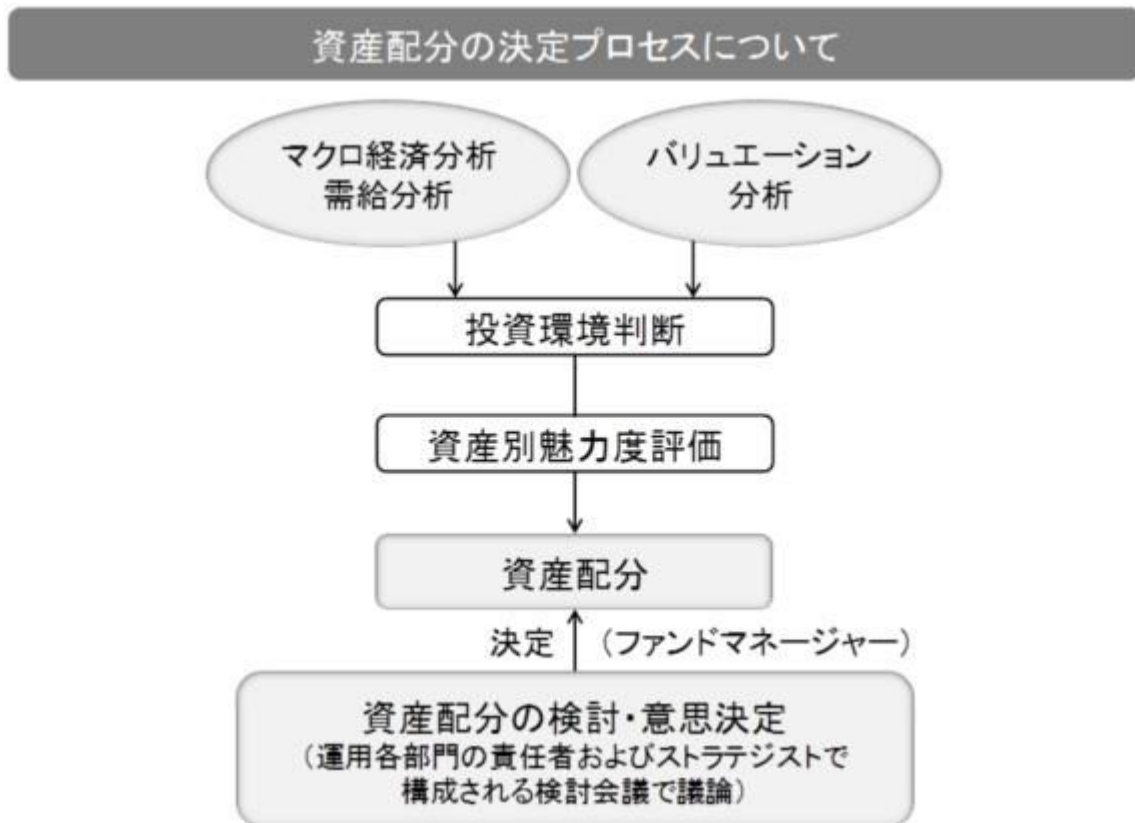
各マザーファンド受益証券と上場投資信託証券を合算した投資比率は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、国債先物取引等を利用することがあります。

当ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、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。

## 運用プロセス

当ファンドは、以下のプロセスにより、投資信託証券への投資を通じて、国内外の株式、債券およびREITへの投資を行います。



運用プロセスは平成30年 6月29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。

## 各マザーファンドの運用方針

### ニュー トピックス インデックス マザーファンド

#### 1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数に連動する投資成果をめざした運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。

##### (2) 投資態度

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。

資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。

株式の組入比率は、高位を保ちます。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、スワップ取引を行うことができます。

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等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。

### (3) 投資制限

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。

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

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。

## 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。

### ステップ 1

#### ポートフォリオの構築（頻度：適宜）

- TOPIX に含まれる銘柄から、時価総額が小さい銘柄等を除外。
- 投資にあたっては、東京証券取引所が日々発表している、指数用株式数を考慮して、ファンドの資産規模に応じて各銘柄の株数を決定。



### ステップ 2

#### 売買執行（頻度：適宜）

- ステップ 1 の結果に基づき、必要な売買を執行。  
※ 株価指数先物取引等を一部利用することがあります。
- 株式と株価指数先物取引等の合計の実質組入比率を高位に維持し、TOPIX 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。

運用プロセスは平成30年 6月29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。

## 新光外国株式インデックスマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、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。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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。

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

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、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割合には制限を設けません。

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

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。

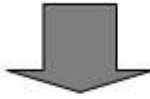
## 運用プロセス

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。



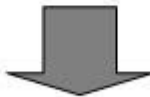
**ステップ 1**  
**リスクモニタリング**

- 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。

運用プロセスは平成30年 6月29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。

### 新光日本債券インデックスマザーファンド

#### 1. 基本方針

この投資信託は、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。

#### 2. 運用方針

##### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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。

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

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社

債の新株予約権に限り、)の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、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。

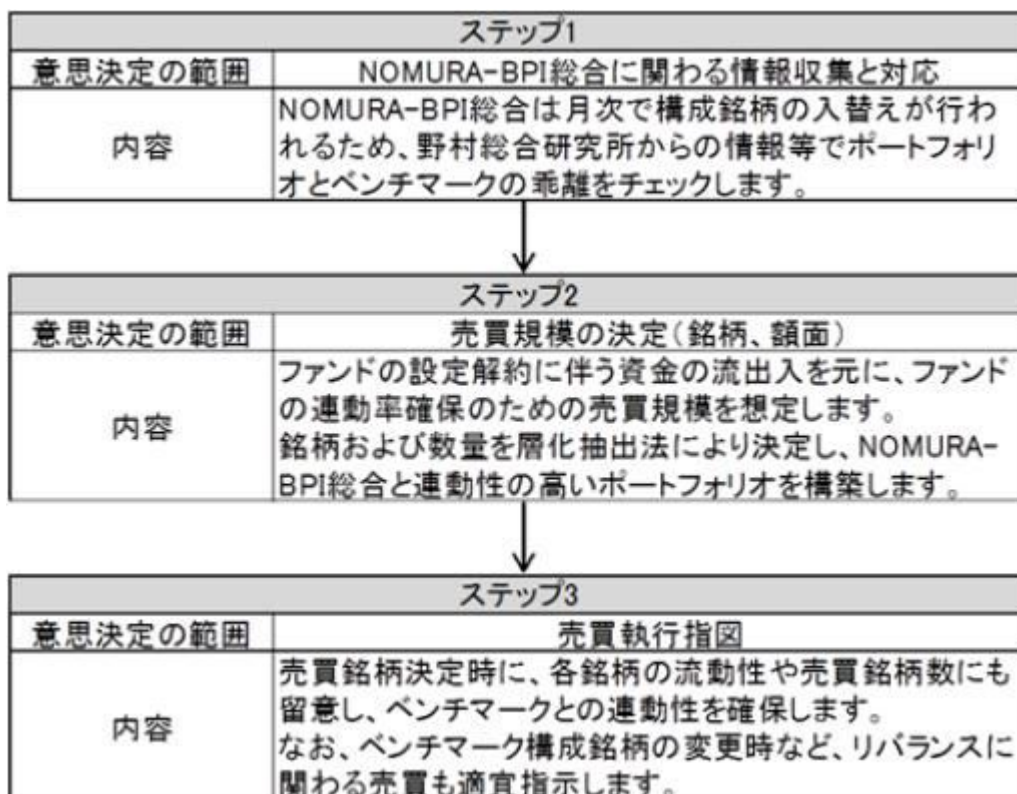
一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

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。

### 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。

運用プロセスは平成30年6月29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。

### 海外国債マザーファンド

#### 1. 基本方針

この投資信託は、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。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

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。

### (2) 投資態度

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。

#### (イ) 超過収益獲得の観点から

- ・通貨アロケーション： 投資環境判断に基づいて、通貨圏毎にオーバーウエイトやアンダーウエイトを行うこと。
- ・イールドカーブ戦略： 市場別のイールドカーブの形状予測に基づいて、ポートフォリオの構成を変化させること。
- ・セクターアロケーション： ある公社債と同等の格付けがありながら上乗せ金利のある他の公社債へ投資すること。アメリカを中心に、国債と格付けが同等で上乗せ金利のある政府機関債へ投資します。

#### (ロ) リスク管理の観点から

- ・デュレーション調整： ポートフォリオ全体のデュレーションを、ベンチマークのそれに近似させること。

外貨建資産については、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。

### (3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、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割合には特に制限を設けません。

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

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。

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。



運用プロセスは平成30年 6月29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。

#### 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

##### 1．基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・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ないます。

##### 2．運用方法

###### （1）投資対象

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

###### （2）投資態度

主として日本を除く世界主要国の公社債に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・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。

当ファンドの資金動向、市況動向等によっては、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

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、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割合には制限を設けません。

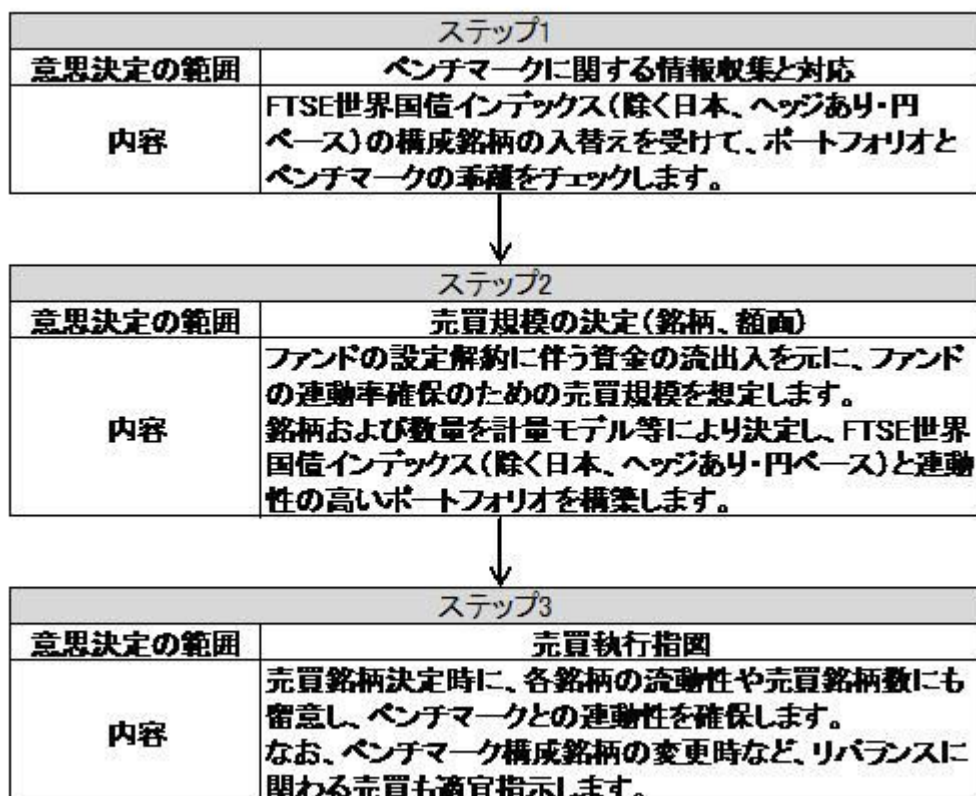
一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

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。

## 運用プロセス

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）は、以下のプロセスにより「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）」に連動する投資成果をめざした運用を行います。



なお、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは平成30年 6月29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。

## グローバル高金利通貨マザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

世界各国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

新興国を中心とする世界の国の中から主として地域分散と金利水準の観点により複数の通貨を選定し、当該通貨建ての国際機関債や政府機関債、州政府債を中心とする信用

力の高い公社債に分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

通貨配分は、北米・中南米、欧州、アジア・オセアニア、中東・アフリカの4地域についてそれぞれ25%程度とすることを基本とします。ただし、流動性の低下、市場規模の縮小、通貨制度の変更等により、各地域に対する通貨配分比率を25%程度とできない場合があります。

各地域内における通貨配分は、金利水準や金利・為替動向、流動性等を勘案して決定します。

投資対象とする公社債は、取得時において、スタンダード・アンド・プアーズ社およびムーディーズ社のいずれかよりAA/Aa2格以上の信用格付けを付与されているものとします。

組入公社債の平均残存期間は、1～3年程度とします。

公社債の組入比率は、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。

ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、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。

### (3) 投資制限

株式への投資割合は、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、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、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割合には制限を設けません。

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。

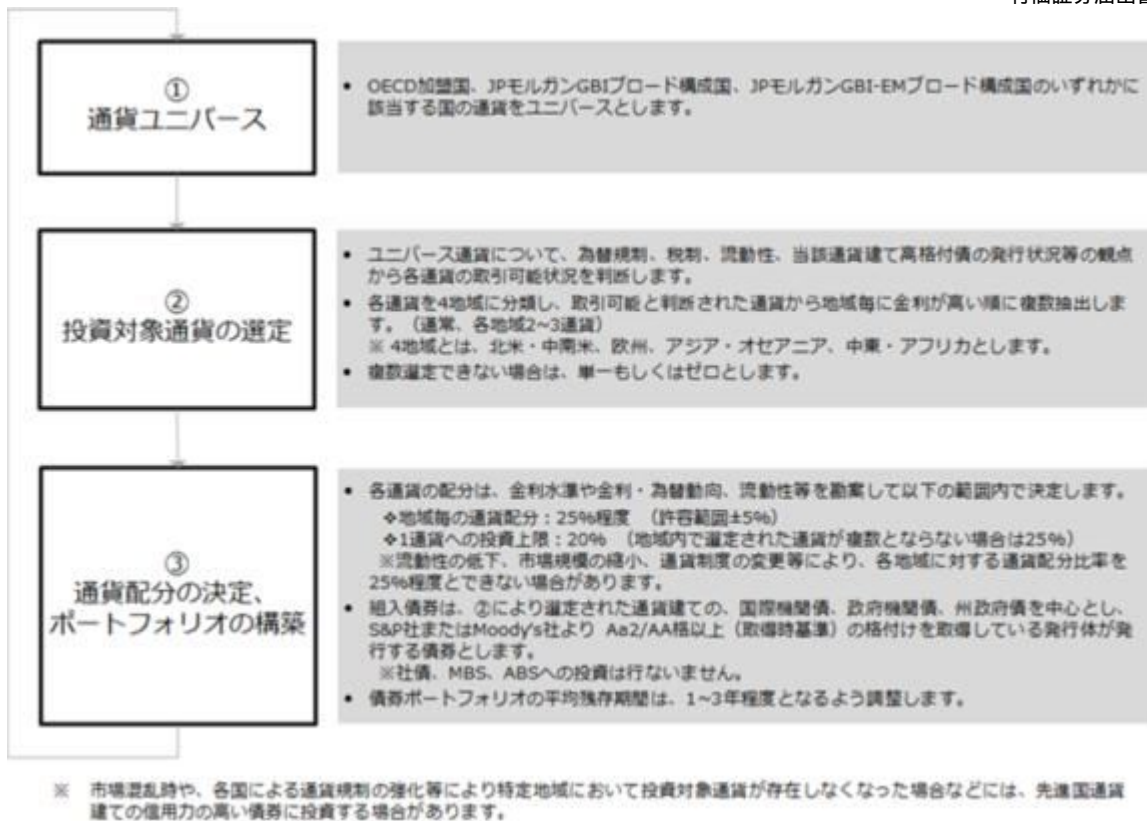
### 3. 収益分配方針

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。

### 運用プロセス

グローバル高金利通貨マザーファンドは、以下のプロセスにより新興国を中心とする世界の高金利通貨建債券に分散投資を行います。





運用プロセスは平成30年 6月29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。

## 新光J - R E I T マザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、東証 R E I T 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。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託受益証券および不動産投資法人投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

主として東証 R E I T 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 R E I T 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。

大量の追加設定・解約が発生した場合、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等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。

#### (3) 投資制限

不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。

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 R E I T 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入れることができます。

外貨建資産への投資は行いません。

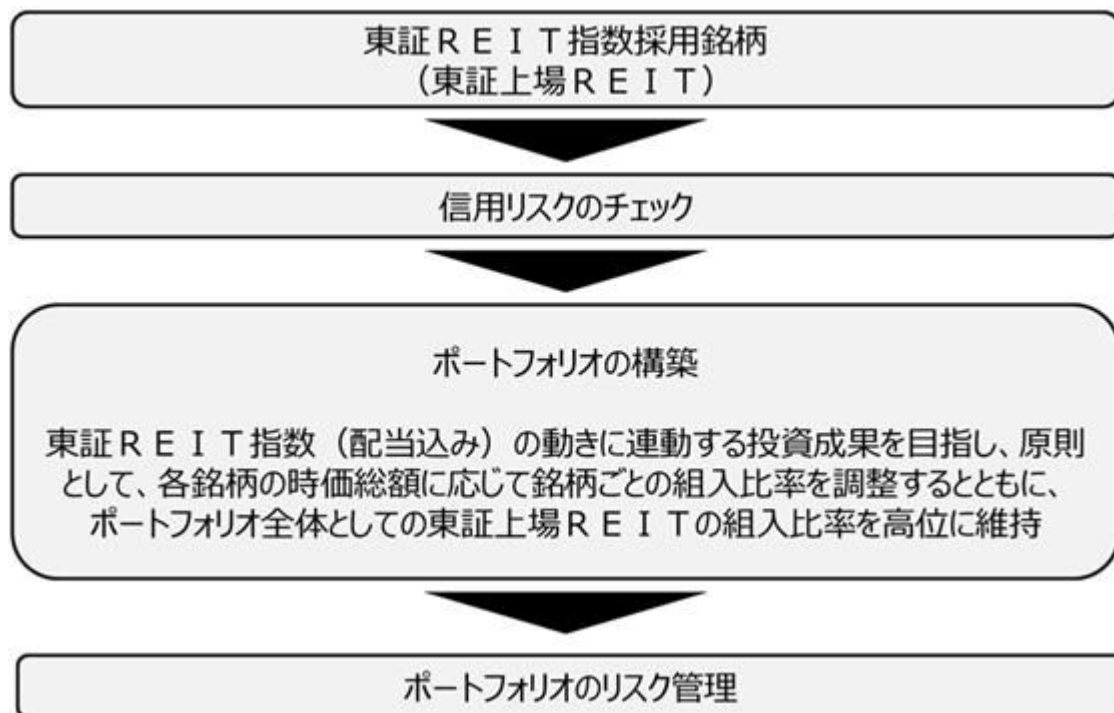
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

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。

## 運用プロセス

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



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

運用プロセスは平成30年 6月29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。

## 新光米国REITマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、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。



## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

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。)を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

主として米国の取引所上場および店頭市場登録のREIT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の組入比率については、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・解約が発生した場合、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等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。

### (3) 投資制限

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。

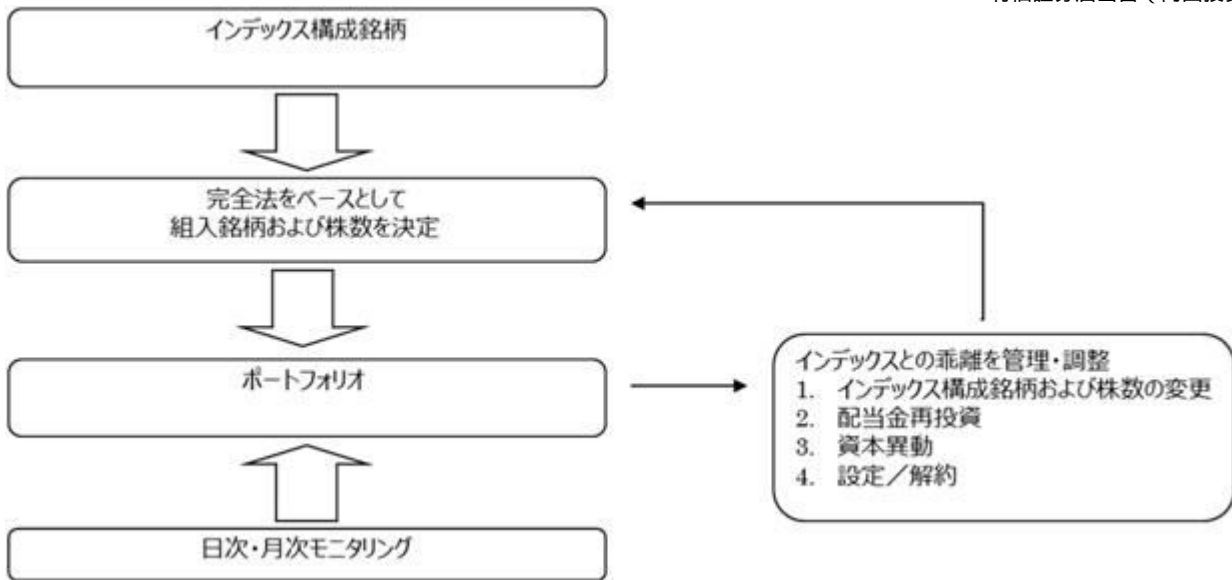
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしがたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 3. 収益分配方針

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。

## 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。



運用プロセスは平成30年 6月29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。

## （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．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款に定めるものに限りません。）

ハ．金銭債権

ニ．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．有価証券および金融商品の指図範囲等

（イ）委託者は、信託金を、主として第1号から第8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（以下第1号から第8号までの親投資信託を総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第9号から第29号までの有価証券（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．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
- 2．新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券
- 3．新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券
- 4．海外国債マザーファンド受益証券
- 5．新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券
- 6．グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券
- 7．新光J-REITマザーファンド受益証券
- 8．新光米国REITマザーファンド受益証券
- 9．株券または新株引受権証書
- 10．国債証券

11. 地方債証券
12. 特別の法律により法人の発行する債券
13. 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(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
14. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
15. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
16. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
17. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
18. コマーシャル・ペーパー
19. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
20. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第9号から第19号までの証券または証書の性質を有するもの
21. 投資信託または外国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。)
22. 投資証券、新投資口予約権証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
23. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
24. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
25. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
26. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
27. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
28. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
29. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第25号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、第9号の証券または証書、第20号、第25号ならびに第26号の証券または証書のうち第9号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第10号から第14号までの証券および第22号の証券のうち投資法人債券ならびに第20号、第25号および第26号の証券または証書のうち第10号から第14号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第21号および第22号の証券(新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

(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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(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には、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。

c. 先物

(イ) 委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。 )。

(ロ) 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(ハ) 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

d. スワップ

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。 )を行うことの指図をすることができます。

(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 上記(ハ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

e. 金利先渡取引および為替先渡取引

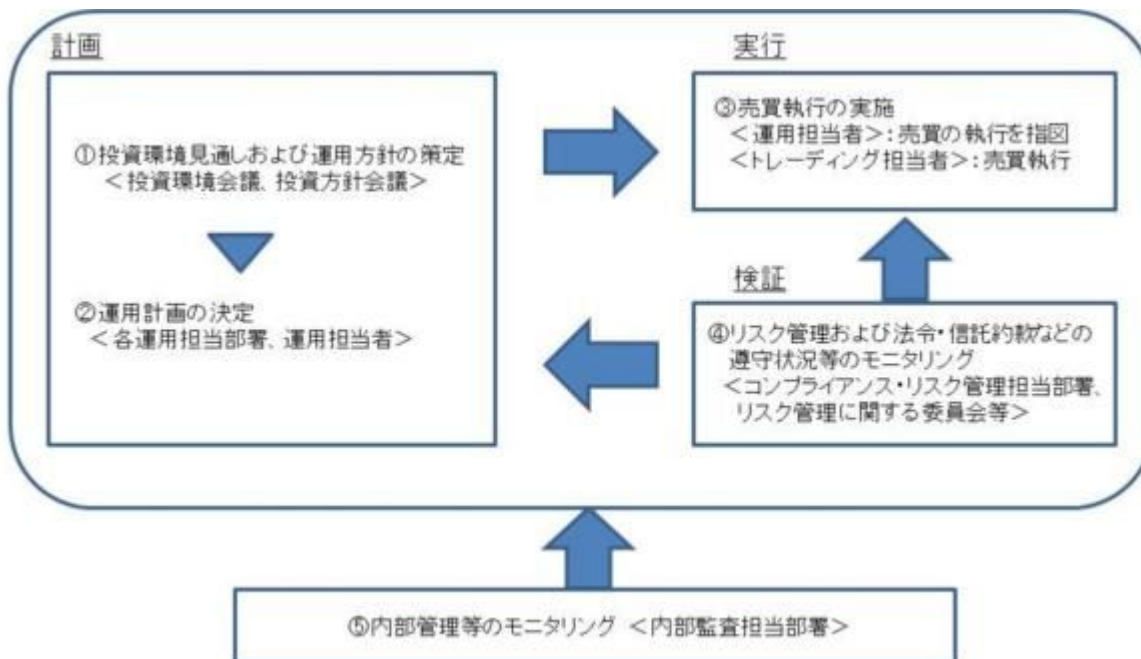
(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が当該保有金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産にかかる保有外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が当該保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ホ) 上記(ハ)(ニ)においてマザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ヘ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ト) 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。
- f. 直物為替先渡取引
- (イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 直物為替先渡取引の評価は、金融商品取引業者または銀行等が提示する価額もしくは価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。

（二）委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（３）【運用体制】

a．ファンドの運用体制



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。

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効

率性等の観点からモニタリングを実施します。

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成30年6月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。  
上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

a. 収益分配は年1回、原則として、12月15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、基準価額水準や市況動向などを勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。
3. 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. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料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．株式等への投資割合

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

### b．新株引受権証券等への投資割合

委託者は、取得時において投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

上記において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じ。

### c．投資信託証券への投資割合

委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、当該投資信託証券のうち取引所金融商品市場（金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。）または外国市場に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券の時価総額については、合計額の計算においてこれを算入しません。

### d．同一銘柄への投資割合

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、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。

(ロ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の上場投資信託証券の時価総額が、当該上場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。

(ハ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、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。

(ニ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、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．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。

### f．投資する株式等の範囲

(イ) 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

(ロ) 上記(イ)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものにつ



いては委託者が投資することを指図することができるものとします。

g. 信用取引の指図範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。)の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

h. 有価証券の貸し付けの指図および範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。
1. 株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  2. 公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)に定める限度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契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託者は、有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

i. 公社債の空売りの指図範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算においてする投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債(投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。)の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 売り付けの指図は、当該売り付け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で行うものとします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売り付け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売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

j. 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

ときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 借入れの指図は、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。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)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。

(二) 借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。

k. 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。

l. 外国為替予約の指図および範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図することができます。

(ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額(投資信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの投資信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

m. 資金の借入れ

(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。

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

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

(二) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

n. 利害関係人等との取引等

(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、投資信託財産と、受託者(第三者との間において投資信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。)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、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

(ロ) 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

(ハ) 委託者は、金融商品取引法、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、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等(金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。)または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

(ニ) 上記(イ)(ロ)(ハ)の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

o. 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。

p. 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。

法令に定める投資制限

a. 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのもつリスク

当ファンドは、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

当ファンドの实质資産配分において、配分比率が大きい資産の収益率が低下した場合や、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。

b．株価変動リスク

株式の価格は、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変動します。一般に、株価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REITの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

外貨建資産は、為替相場の変動により円換算価格が変動します。一般に、保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも、投資先の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が下落し、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

また、当ファンドは新興国通貨建証券にも実質的に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。

当ファンドが投資対象とする「新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」では、保有する外貨建資産について原則として為替ヘッジを行います。為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、円と投資先の通貨の為替変動の影響を受ける場合があります。為替ヘッジを行うにあたり、円金利が当該通貨の金利より低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

e．カントリーリスク

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

公社債の価格は、金利水準の変化にともない変動します。一般に、金利が上昇した場合には公社債の価格は下落し、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

有価証券などの発行体が業績悪化・経営不振あるいは倒産に陥った場合、当該有価証券の価値が大きく減少すること、もしくは無くなる場合があります。また、有価証券の信用力の低下や格付けの引き下げ、債務不履行が生じた場合には、当該有価証券の価格は下落します。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

有価証券などを売買する際、当該有価証券などの市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、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可能性があります。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．他のベビーファンドの影響

当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ファンド（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。これによ

り、マザーファンドの基準価額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。

j. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- (ロ) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- (ハ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ニ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われなことがあることがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ホ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。
- (ヘ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入る有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ト) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (チ) 投資信託の分配金は、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。

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。

投資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い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が小さかった場合も同様です。

## 東証株価指数について

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

東証株価指数の指数値およびTOPIXの商標は、株東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

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

株東京証券取引所は、東証株価指数の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

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

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

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

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

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

### MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）について

MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.（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對して、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關りなく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對して、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、またはそれらに關連する過誤、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關し、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、それらに關する特定目的に對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。

### **NOMURA - BPI総合について**

NOMURA - BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募利付債券市場全体の動向を表す投資収益指標で、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA - BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

### **FTSE世界国債インデックスについて**

FTSE世界国債インデックスは、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。

### **東証REIT指数（配当込み）について**

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

東証REIT指数（配当込み）の指数値および東証REIT指数の商標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

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

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数（配当込み）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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

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

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

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

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

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

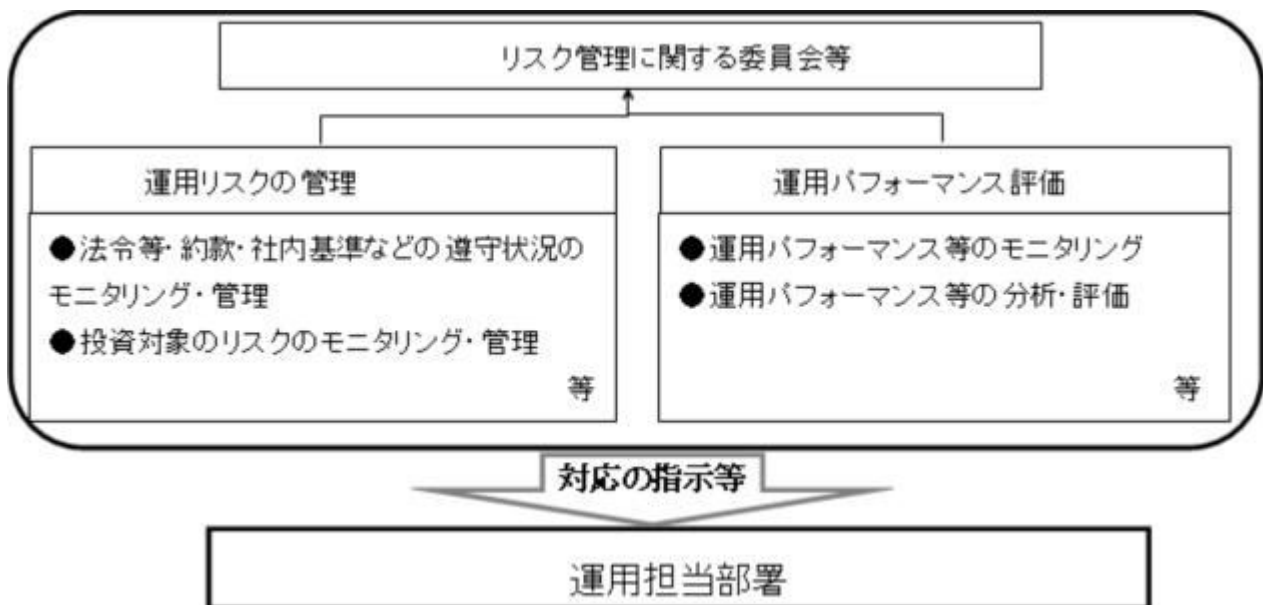
“FTSE” 及び “FTSE (R)” は、London Stock Exchange Groupの商標であり、ライセンスに基づいてFTSEが使

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

## （２）リスク管理体制

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

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

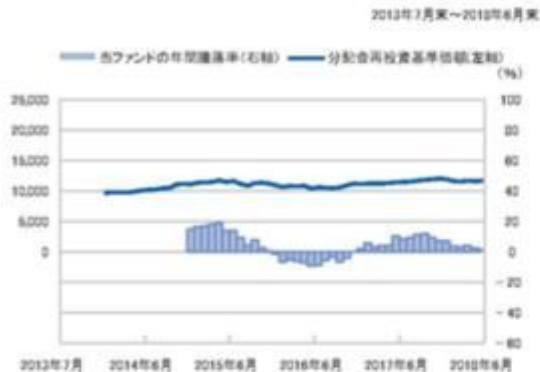


リスク管理体制は平成30年 6月29日現在のものであり、今後変更になることがあります。



## <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

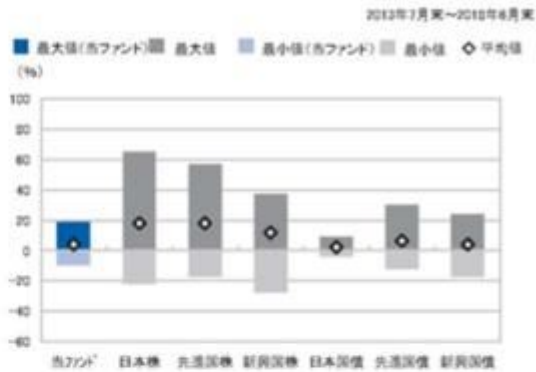


\*分配金再投資基準価額は、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

\*年間騰落率は、2015年1月から2018年6月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※分配金再投資基準価額は、新引当の分配金を再投資したものとみなして計算しています。\*  
\*で、実際の基準価額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



※最大の騰落率(当ファンド) 最大の騰落率 最大の騰落率(当ファンド) 最大の騰落率 平均値

| 当ファンド | 日本株  | 先進国株  | 新興国株  | 日本国債  | 先進国債 | 新興国債  |
|-------|------|-------|-------|-------|------|-------|
| 最大値   | 18.7 | 65.0  | 57.1  | 37.2  | 9.3  | 30.4  |
| 最小値   | -9.5 | -22.0 | -17.5 | -27.4 | -4.0 | -12.3 |
| 平均値   | 4.3  | 18.1  | 18.2  | 11.7  | 2.2  | 6.7   |

\*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*2013年7月から2018年6月の5年間の当ファンドは2015年1月から2018年6月の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

\*決算日に対応した数値とは異なります。

\*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

\*各資産クラスの指数  
日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)  
先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)  
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)  
日本国債・・・NOMURA-SPI国債  
先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
新興国債・・・JPモルガンGB-E4グローバル・ディバーシファイド(円ベース)  
(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。

●「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。

●「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。

●「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。

●「NOMURA-SPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●「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。

●「JPモルガンGB-E4グローバル・ディバーシファイド」は、JP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その他一切の権利はJP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。

「各資産クラスの騰落率」は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、その内容について、信頼性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

## 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、2.7%（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（8%）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

ただし、上記の申込手数料の優遇に関しては、優遇制度の取り扱い、優遇の内容、優遇を受けるための条件等は販売会社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はいいます。

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

## （2）【換金（解約）手数料】

### a．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

### b．信託財産留保額

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

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

## （3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.5336%（税抜1.42%）

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、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

| 支払先  | 内訳（税抜）  | 主な役務                                      |
|------|---------|---|
| 委託会社 | 年率0.67% | 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          |
| 販売会社 | 年率0.70% | 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |

|      |         |                               |
|------|---------|-------------------------------|
| 受託会社 | 年率0.05% | 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 |
|------|---------|-------------------------------|

ファンドが投資対象とするETFおよび実質的に投資対象とするREITについては、市場の需給により価格が形成されるため、その費用を表示することができません。

#### (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。
- b. 投資信託財産にかかる監査報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および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とともに投資信託財産中から支払われます。
- c. 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および資産を外国で保管する場合の費用、先物取引・オプション取引等に要する費用ならびに特定資産の価格調査費用についても投資信託財産が負担します。
- d. 「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### a. 個人の受益者に対する課税

###### (イ) 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### (ロ) 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

###### (ハ) 損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上

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

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

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

#### b. 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成30年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

#### c. 個別元本について

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合に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。

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

#### d. 収益分配金の課税について

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別

分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

#### グローバル・ナビ

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計(円)     | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-------------|---------|
| 投資信託受益証券            | アメリカ | 11,813,863  | 4.90    |
| 親投資信託受益証券           | 日本   | 218,124,444 | 90.47   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 11,144,538  | 4.62    |
| 純資産総額               |      | 241,082,845 | 100.00  |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

### (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計(円)       | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 株式                  | 日本   | 8,217,453,220 | 96.70   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 279,711,234   | 3.29    |
| 純資産総額               |      | 8,497,164,454 | 100.00  |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

### (参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円)       | 投資比率(%) |
|-------|------|---------------|---------|
| 株式    | アメリカ | 3,556,105,403 | 58.90   |

|                     |           |               |        |
|---------------------|-----------|---------------|--------|
|                     | カナダ       | 215,149,037   | 3.56   |
|                     | モーリシャス    | 405,727       | 0.00   |
|                     | パナマ       | 3,494,112     | 0.05   |
|                     | ドイツ       | 210,573,410   | 3.48   |
|                     | イタリア      | 44,165,195    | 0.73   |
|                     | フランス      | 221,894,031   | 3.67   |
|                     | オランダ      | 107,698,574   | 1.78   |
|                     | スペイン      | 66,817,453    | 1.10   |
|                     | ベルギー      | 24,776,083    | 0.41   |
|                     | オーストリア    | 6,423,011     | 0.10   |
|                     | ルクセンブルグ   | 8,586,479     | 0.14   |
|                     | フィンランド    | 24,640,743    | 0.40   |
|                     | アイルランド    | 86,104,135    | 1.42   |
|                     | ポルトガル     | 3,240,454     | 0.05   |
|                     | イギリス      | 380,570,332   | 6.30   |
|                     | スイス       | 186,668,438   | 3.09   |
|                     | スウェーデン    | 55,248,037    | 0.91   |
|                     | ノルウェー     | 17,032,180    | 0.28   |
|                     | デンマーク     | 38,303,548    | 0.63   |
|                     | ケイマン諸島    | 15,663,404    | 0.25   |
|                     | リベリア      | 3,527,634     | 0.05   |
|                     | オーストラリア   | 145,684,180   | 2.41   |
|                     | バミューダ諸島   | 31,877,647    | 0.52   |
|                     | ニュージーランド  | 4,477,904     | 0.07   |
|                     | パプアニューギニア | 2,180,243     | 0.03   |
|                     | 香港        | 52,241,248    | 0.86   |
|                     | シンガポール    | 28,799,100    | 0.47   |
|                     | イスラエル     | 13,766,331    | 0.22   |
|                     | キュラソー     | 13,925,697    | 0.23   |
|                     | ジャージー     | 27,369,211    | 0.45   |
|                     | 英ヴァージン諸島  | 1,324,915     | 0.02   |
|                     | 小計        | 5,598,733,896 | 92.73  |
| 投資証券                | アメリカ      | 106,312,542   | 1.76   |
|                     | カナダ       | 1,361,673     | 0.02   |
|                     | フランス      | 3,426,152     | 0.05   |
|                     | イギリス      | 3,372,394     | 0.05   |
|                     | オーストラリア   | 9,960,182     | 0.16   |
|                     | 香港        | 607,236       | 0.01   |
|                     | シンガポール    | 3,518,119     | 0.05   |
|                     | 小計        | 128,558,298   | 2.12   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |           | 310,083,085   | 5.13   |
| 純資産総額               |           | 6,037,375,279 | 100.00 |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計(円)        | 投資比率(%) |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券                | 日本   | 10,326,098,300 | 79.73   |
| 地方債証券               | 日本   | 960,256,400    | 7.41    |
| 特殊債券                | 日本   | 951,907,000    | 7.35    |
| 社債券                 | 日本   | 517,140,000    | 3.99    |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 194,612,117    | 1.50    |
| 純資産総額               |      | 12,950,013,817 | 100.00  |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考) 海外国債マザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計(円)        | 投資比率(%) |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券                | アメリカ | 9,618,197,695  | 46.69   |
|                     | カナダ  | 399,506,062    | 1.93    |
|                     | ドイツ  | 2,158,738,349  | 10.48   |
|                     | イタリア | 2,716,571,766  | 13.18   |
|                     | フランス | 4,378,997,571  | 21.26   |
|                     | イギリス | 930,011,555    | 4.51    |
|                     | 小計   | 20,202,022,998 | 98.08   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 395,280,673    | 1.91    |
| 純資産総額               |      | 20,597,303,671 | 100.00  |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考) 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円)       | 投資比率(%) |
|-------|------|---------------|---------|
| 国債証券  | アメリカ | 4,749,876,127 | 43.41   |
|       | カナダ  | 230,484,981   | 2.10    |
|       | メキシコ | 95,053,790    | 0.86    |
|       | ドイツ  | 734,132,688   | 6.70    |
|       | イタリア | 976,510,068   | 8.92    |
|       | フランス | 1,131,636,141 | 10.34   |

|                     |         |                |        |
|---------------------|---------|----------------|--------|
|                     | オランダ    | 242,667,015    | 2.21   |
|                     | スペイン    | 641,474,920    | 5.86   |
|                     | ベルギー    | 288,944,981    | 2.64   |
|                     | オーストリア  | 162,102,774    | 1.48   |
|                     | フィンランド  | 74,534,436     | 0.68   |
|                     | アイルランド  | 101,994,218    | 0.93   |
|                     | イギリス    | 726,807,082    | 6.64   |
|                     | スウェーデン  | 33,635,457     | 0.30   |
|                     | ノルウェー   | 33,828,759     | 0.30   |
|                     | デンマーク   | 51,783,182     | 0.47   |
|                     | ポーランド   | 66,308,276     | 0.60   |
|                     | オーストラリア | 220,750,492    | 2.01   |
|                     | シンガポール  | 48,020,146     | 0.43   |
|                     | 南アフリカ   | 66,083,469     | 0.60   |
|                     | 小計      | 10,676,629,002 | 97.57  |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |         | 265,083,673    | 2.42   |
| 純資産総額               |         | 10,941,712,675 | 100.00 |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考) グローバル高金利通貨マザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計(円)       | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 特殊債券                | 国際機関 | 5,420,928,690 | 96.68   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 186,074,183   | 3.31    |
| 純資産総額               |      | 5,607,002,873 | 100.00  |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考) 新光J-REITマザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計(円)       | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 投資証券                | 日本   | 2,343,261,330 | 98.38   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 38,548,231    | 1.61    |
| 純資産総額               |      | 2,381,809,561 | 100.00  |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考) 新光米国REITマザーファンド



| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計(円)     | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-------------|---------|
| 投資証券                | アメリカ | 813,768,304 | 98.68   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 10,823,911  | 1.31    |
| 純資産総額               |      | 824,592,215 | 100.00  |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### グローバル・ナビ

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成30年 6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類            | 銘柄名                                       | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|---------------|---|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | ニュー トピックス インデック<br>ス マザーファンド              | 21,282,059   | 2.2678            | 48,265,048        | 2.2528           | 47,944,222       | 19.88           |
| 2  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 海外国債マザーファンド                               | 16,528,373   | 2.2659            | 37,451,641        | 2.2078           | 36,491,341       | 15.13           |
| 3  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 新光日本債券インデックスマザー<br>ファンド                   | 28,624,619   | 1.2635            | 36,167,207        | 1.2709           | 36,379,028       | 15.08           |
| 4  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 新光外国株式インデックスマザー<br>ファンド                   | 15,508,213   | 2.2835            | 35,413,005        | 2.3183           | 35,952,690       | 14.91           |
| 5  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 新光外国債券インデックスマザー<br>ファンド(為替ヘッジあり)          | 18,094,683   | 1.3489            | 24,407,918        | 1.3408           | 24,261,350       | 10.06           |
| 6  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 新光米国REITマザーファンド                           | 7,676,353    | 1.5618            | 11,988,929        | 1.6341           | 12,543,928       | 5.20            |
| 7  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 新光J-REITマザーファンド                           | 7,202,981    | 1.5890            | 11,445,537        | 1.7117           | 12,329,342       | 5.11            |
| 8  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | グローバル高金利通貨マザーファ<br>ンド                     | 11,397,374   | 1.1401            | 12,995,228        | 1.0724           | 12,222,543       | 5.06            |
| 9  | アメリカ | 投資信託受<br>益証券  | ISHARES CORE MSCI EMERGING<br>MARKETS ETF | 2,070        | 6,218.38          | 12,872,066        | 5,707.1801       | 11,813,863       | 4.90            |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年 6月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ. 種類別投資比率

(平成30年 6月29日現在)

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券  | 4.90    |
| 親投資信託受益証券 | 90.47   |
| 合計        | 95.37   |

## (参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

## イ. 評価額上位銘柄明細

(平成30年 6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種     | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|----|-------------------|--------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 40,700       | 7,568.76          | 308,048,532       | 7,170.00         | 291,819,000      | 3.43            |
| 2  | 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 231,100      | 870.24            | 201,113,084       | 631.10           | 145,847,210      | 1.71            |
| 3  | 日本   | 株式 | ソニー               | 電気機器   | 22,400       | 5,517.33          | 123,588,192       | 5,664.00         | 126,873,600      | 1.49            |
| 4  | 日本   | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 23,600       | 5,215.23          | 123,079,428       | 5,036.00         | 118,849,600      | 1.39            |
| 5  | 日本   | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 14,900       | 8,932.03          | 133,087,247       | 7,973.00         | 118,797,700      | 1.39            |
| 6  | 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 25,000       | 5,179.72          | 129,493,000       | 4,306.00         | 107,650,000      | 1.26            |
| 7  | 日本   | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 1,600        | 66,050.00         | 105,680,000       | 62,560.00        | 100,096,000      | 1.17            |
| 8  | 日本   | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 30,100       | 3,963.16          | 119,291,116       | 3,253.00         | 97,915,300       | 1.15            |
| 9  | 日本   | 株式 | KDDI              | 情報・通信業 | 28,900       | 2,759.81          | 79,758,509        | 3,031.00         | 87,595,900       | 1.03            |
| 10 | 日本   | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 448,500      | 216.54            | 97,122,482        | 186.50           | 83,645,250       | 0.98            |
| 11 | 日本   | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 2,100        | 44,620.00         | 93,702,000        | 36,200.00        | 76,020,000       | 0.89            |
| 12 | 日本   | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 24,700       | 2,746.65          | 67,842,255        | 3,066.00         | 75,730,200       | 0.89            |
| 13 | 日本   | 株式 | 三菱商事              | 卸売業    | 23,100       | 3,265.17          | 75,425,427        | 3,078.00         | 71,101,800       | 0.83            |
| 14 | 日本   | 株式 | ファナック             | 電気機器   | 3,200        | 31,524.48         | 100,878,336       | 22,005.00        | 70,416,000       | 0.82            |
| 15 | 日本   | 株式 | 花王                | 化学     | 8,200        | 7,531.96          | 61,762,072        | 8,450.00         | 69,290,000       | 0.81            |
| 16 | 日本   | 株式 | 東海旅客鉄道            | 陸運業    | 3,000        | 20,844.08         | 62,532,240        | 22,960.00        | 68,880,000       | 0.81            |
| 17 | 日本   | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス   | 小売業    | 13,800       | 4,581.91          | 63,230,358        | 4,831.00         | 66,667,800       | 0.78            |
| 18 | 日本   | 株式 | NTTドコモ            | 情報・通信業 | 23,600       | 2,656.18          | 62,685,848        | 2,822.50         | 66,611,000       | 0.78            |
| 19 | 日本   | 株式 | 日本電産              | 電気機器   | 4,000        | 16,825.60         | 67,302,400        | 16,625.00        | 66,500,000       | 0.78            |
| 20 | 日本   | 株式 | キヤノン              | 電気機器   | 18,000       | 4,273.65          | 76,925,700        | 3,631.00         | 65,358,000       | 0.76            |
| 21 | 日本   | 株式 | 村田製作所             | 電気機器   | 3,500        | 15,407.52         | 53,926,320        | 18,620.00        | 65,170,000       | 0.76            |
| 22 | 日本   | 株式 | 東京海上ホールディングス      | 保険業    | 12,400       | 5,372.36          | 66,617,264        | 5,193.00         | 64,393,200       | 0.75            |
| 23 | 日本   | 株式 | 日本たばこ産業           | 食料品    | 20,800       | 3,590.75          | 74,687,600        | 3,095.00         | 64,376,000       | 0.75            |
| 24 | 日本   | 株式 | 東日本旅客鉄道           | 陸運業    | 6,000        | 11,444.33         | 68,665,980        | 10,615.00        | 63,690,000       | 0.74            |
| 25 | 日本   | 株式 | 日立製作所             | 電気機器   | 80,000       | 904.33            | 72,346,400        | 781.60           | 62,528,000       | 0.73            |
| 26 | 日本   | 株式 | ダイキン工業            | 機械     | 4,600        | 13,628.65         | 62,691,790        | 13,270.00        | 61,042,000       | 0.71            |
| 27 | 日本   | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 12,300       | 6,431.49          | 79,107,327        | 4,678.00         | 57,539,400       | 0.67            |
| 28 | 日本   | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 5,800        | 11,924.09         | 69,159,722        | 9,873.00         | 57,263,400       | 0.67            |
| 29 | 日本   | 株式 | パナソニック            | 電気機器   | 38,200       | 1,704.85          | 65,125,270        | 1,493.50         | 57,051,700       | 0.67            |
| 30 | 日本   | 株式 | アステラス製薬           | 医薬品    | 32,900       | 1,440.73          | 47,400,017        | 1,689.00         | 55,568,100       | 0.65            |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

(平成30年 6月29日現在)

| 種類     | 国内 / 外国 | 業種         | 投資比率<br>(%) |
|--------|---------|------------|-------------|
| 株式     | 国内      | 水産・農林業     | 0.10        |
|        |         | 鉱業         | 0.28        |
|        |         | 建設業        | 3.05        |
|        |         | 食料品        | 4.33        |
|        |         | 繊維製品       | 0.62        |
|        |         | パルプ・紙      | 0.25        |
|        |         | 化学         | 7.19        |
|        |         | 医薬品        | 4.60        |
|        |         | 石油・石炭製品    | 0.73        |
|        |         | ゴム製品       | 0.79        |
|        |         | ガラス・土石製品   | 0.97        |
|        |         | 鉄鋼         | 0.99        |
|        |         | 非鉄金属       | 0.82        |
|        |         | 金属製品       | 0.60        |
|        |         | 機械         | 5.00        |
|        |         | 電気機器       | 13.20       |
|        |         | 輸送用機器      | 8.36        |
|        |         | 精密機器       | 1.67        |
|        |         | その他製品      | 2.04        |
|        |         | 電気・ガス業     | 1.71        |
|        |         | 陸運業        | 4.26        |
|        |         | 海運業        | 0.18        |
|        |         | 空運業        | 0.56        |
|        |         | 倉庫・運輸関連業   | 0.17        |
|        |         | 情報・通信業     | 7.20        |
|        |         | 卸売業        | 4.62        |
|        |         | 小売業        | 4.80        |
|        |         | 銀行業        | 6.48        |
|        |         | 証券、商品先物取引業 | 0.89        |
|        |         | 保険業        | 2.19        |
| その他金融業 | 1.16    |            |             |
| 不動産業   | 2.34    |            |             |
| サービス業  | 4.41    |            |             |
| 合計     |         |            | 96.70       |

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成30年 6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名                         | 業種                     | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|----|-----------------------------|------------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 株式 | APPLE INC                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 7,233        | 19,429.61         | 140,534,411       | 20,505.1700      | 148,313,895      | 2.45            |
| 2  | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP              | ソフトウェア・サービス            | 10,387       | 9,340.63          | 97,021,124        | 10,902.5602      | 113,244,893      | 1.87            |
| 3  | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC              | 小売                     | 591          | 126,574.93        | 74,805,785        | 188,078.2825     | 111,154,265      | 1.84            |
| 4  | アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A              | ソフトウェア・サービス            | 3,495        | 19,802.13         | 69,208,464        | 21,691.2640      | 75,810,968       | 1.25            |
| 5  | アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO         | 銀行                     | 4,868        | 10,827.39         | 52,707,749        | 11,598.9622      | 56,463,748       | 0.93            |
| 6  | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C           | ソフトウェア・サービス            | 451          | 114,545.96        | 51,660,232        | 123,165.8780     | 55,547,811       | 0.92            |
| 7  | アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP            | エネルギー                  | 6,077        | 9,226.77          | 56,071,104        | 9,060.9637       | 55,063,477       | 0.91            |
| 8  | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A           | ソフトウェア・サービス            | 431          | 115,814.96        | 49,916,252        | 124,554.2621     | 53,682,887       | 0.88            |
| 9  | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 3,887        | 15,409.27         | 59,895,856        | 13,485.8801      | 52,419,616       | 0.86            |
| 10 | アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORPORATION | 銀行                     | 14,366       | 2,928.20          | 42,066,588        | 3,169.1818       | 45,528,466       | 0.75            |
| 11 | アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & COMPANY       | 銀行                     | 6,830        | 5,969.16          | 40,769,363        | 5,928.2601       | 40,490,017       | 0.67            |
| 12 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES     | ソフトウェア・サービス            | 2,670        | 12,399.27         | 33,106,056        | 14,673.0797      | 39,177,123       | 0.64            |
| 13 | アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC      | ヘルスケア機器・サービス           | 1,426        | 23,557.17         | 33,592,538        | 27,071.2461      | 38,603,597       | 0.63            |
| 14 | アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP                | エネルギー                  | 2,756        | 12,959.70         | 35,716,960        | 13,890.4564      | 38,282,098       | 0.63            |
| 15 | スイス  | 株式 | NESTLE SA-REGISTERED        | 食品・飲料・タバコ              | 4,523        | 9,269.56          | 41,926,256        | 8,460.1439       | 38,265,231       | 0.63            |
| 16 | アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融                   | 1,841        | 20,483.06         | 37,709,318        | 20,680.9288      | 38,073,590       | 0.63            |
| 17 | アメリカ | 株式 | INTEL CORP                  | 半導体・半導体製造装置            | 6,786        | 5,118.00          | 34,730,762        | 5,444.0950       | 36,943,629       | 0.61            |
| 18 | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC              | 小売                     | 1,670        | 18,047.86         | 30,139,936        | 21,578.5131      | 36,036,117       | 0.59            |
| 19 | アメリカ | 株式 | AT&T INC                    | 電気通信サービス               | 10,030       | 3,579.82          | 35,905,669        | 3,558.2825       | 35,689,574       | 0.59            |
| 20 | アメリカ | 株式 | PFIZER INC                  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8,556        | 3,891.00          | 33,291,465        | 4,019.2344       | 34,388,570       | 0.56            |
| 21 | アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS INC           | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 7,156        | 3,763.88          | 26,934,375        | 4,746.5876       | 33,966,581       | 0.56            |
| 22 | アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC  | 電気通信サービス               | 6,026        | 4,982.03          | 30,021,760        | 5,622.0643       | 33,878,560       | 0.56            |
| 23 | アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO         | 家庭用品・パーソナル用品           | 3,623        | 9,637.98          | 34,918,411        | 8,627.6469       | 31,257,965       | 0.51            |
| 24 | イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC(UK)       | 銀行                     | 29,627       | 1,072.85          | 31,785,558        | 1,026.2997       | 30,406,184       | 0.50            |
| 25 | アメリカ | 株式 | BOEING CO                   | 資本財                    | 816          | 29,038.85         | 23,695,708        | 36,992.2107      | 30,185,644       | 0.49            |
| 26 | アメリカ | 株式 | MASTERCARD INCORPORATED     | ソフトウェア・サービス            | 1,320        | 16,502.51         | 21,783,322        | 21,787.4340      | 28,759,413       | 0.47            |

|    |      |    |                  |                        |       |           |            |             |            |      |
|----|------|----|------------------|------------------------|-------|-----------|------------|-------------|------------|------|
| 27 | アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲料・タバコ              | 5,807 | 5,104.73  | 29,643,209 | 4,805.1737  | 27,903,644 | 0.46 |
| 28 | アメリカ | 株式 | NETFLIX INC      | 小売                     | 635   | 21,433.70 | 13,610,404 | 43,709.7275 | 27,755,677 | 0.45 |
| 29 | アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC. | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 4,059 | 6,213.45  | 25,220,407 | 6,665.5619  | 27,055,516 | 0.44 |
| 30 | アメリカ | 株式 | CITIGROUP INC    | 銀行                     | 3,553 | 8,006.41  | 28,446,783 | 7,392.9152  | 26,267,028 | 0.43 |

(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。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年6月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成30年6月29日現在)

| 種類                 | 国内 / 外国 | 業種                     | 投資比率 (%) |
|--------------------|---------|------------------------|----------|
| 株式                 | 外国      | エネルギー                  | 6.96     |
|                    |         | 素材                     | 4.48     |
|                    |         | 資本財                    | 6.78     |
|                    |         | 商業・専門サービス              | 0.88     |
|                    |         | 運輸                     | 1.93     |
|                    |         | 自動車・自動車部品              | 1.31     |
|                    |         | 耐久消費財・アパレル             | 1.91     |
|                    |         | 消費者サービス                | 1.69     |
|                    |         | メディア                   | 1.89     |
|                    |         | 小売                     | 4.75     |
|                    |         | 食品・生活必需品小売り            | 1.41     |
|                    |         | 食品・飲料・タバコ              | 4.61     |
|                    |         | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.82     |
|                    |         | ヘルスケア機器・サービス           | 4.42     |
|                    |         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.51     |
|                    |         | 銀行                     | 8.43     |
|                    |         | 各種金融                   | 4.15     |
|                    |         | 保険                     | 3.62     |
|                    |         | 不動産                    | 0.72     |
|                    |         | ソフトウェア・サービス            | 11.10    |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.09    |                        |          |
| 電気通信サービス           | 2.23    |                        |          |
| 公益事業               | 2.98    |                        |          |
| 半導体・半導体製造装置        | 2.96    |                        |          |
| 投資証券               |         |                        | 2.12     |
| 合計                 |         |                        | 94.86    |

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

## イ. 評価額上位銘柄明細

(平成30年 6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類    | 銘柄名                                   | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|-------|---------------------------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 国債証券  | 第123回利付<br>国債(5年)                     | 160,000,000  | 100.61            | 160,979,200       | 100.38           | 160,617,600      | 0.1000    | 2020.03.20 | 1.24            |
| 2  | 日本   | 国債証券  | 第306回利付<br>国債(10年)                    | 150,000,000  | 103.68            | 155,526,000       | 102.62           | 153,943,500      | 1.4000    | 2020.03.20 | 1.18            |
| 3  | 日本   | 国債証券  | 第124回利付<br>国債(5年)                     | 150,000,000  | 100.66            | 150,996,000       | 100.44           | 150,664,500      | 0.1000    | 2020.06.20 | 1.16            |
| 4  | 日本   | 国債証券  | 第312回利付<br>国債(10年)                    | 140,000,000  | 104.15            | 145,815,600       | 103.28           | 144,592,000      | 1.2000    | 2020.12.20 | 1.11            |
| 5  | 日本   | 国債証券  | 第308回利付<br>国債(10年)                    | 140,000,000  | 103.80            | 145,329,800       | 102.81           | 143,934,000      | 1.3000    | 2020.06.20 | 1.11            |
| 6  | 日本   | 国債証券  | 第126回利付<br>国債(5年)                     | 140,000,000  | 100.74            | 141,044,400       | 100.55           | 140,779,800      | 0.1000    | 2020.12.20 | 1.08            |
| 7  | 日本   | 国債証券  | 第332回利付<br>国債(10年)                    | 120,000,000  | 104.16            | 125,000,400       | 103.82           | 124,584,000      | 0.6000    | 2023.12.20 | 0.96            |
| 8  | 日本   | 国債証券  | 第335回利付<br>国債(10年)                    | 120,000,000  | 103.88            | 124,664,400       | 103.62           | 124,350,000      | 0.5000    | 2024.09.20 | 0.96            |
| 9  | 日本   | 国債証券  | 第338回利付<br>国債(10年)                    | 120,000,000  | 103.39            | 124,069,500       | 103.17           | 123,804,000      | 0.4000    | 2025.03.20 | 0.95            |
| 10 | 日本   | 国債証券  | 第303回利付<br>国債(10年)                    | 120,000,000  | 102.94            | 123,529,200       | 101.86           | 122,241,600      | 1.4000    | 2019.09.20 | 0.94            |
| 11 | 日本   | 特殊債券  | 第97回政府保<br>証日本高速道路<br>保有・債務返済<br>機構債券 | 100,000,000  | 122.24            | 122,240,000       | 121.59           | 121,590,000      | 2.1000    | 2029.12.28 | 0.93            |
| 12 | 日本   | 国債証券  | 第345回利付<br>国債(10年)                    | 120,000,000  | 100.81            | 120,981,600       | 101.01           | 121,220,400      | 0.1000    | 2026.12.20 | 0.93            |
| 13 | 日本   | 地方債証券 | 第18回東京都<br>公募債(20<br>年)               | 100,000,000  | 122.12            | 122,120,000       | 121.22           | 121,220,000      | 2.2200    | 2029.03.19 | 0.93            |
| 14 | 日本   | 国債証券  | 第128回利付<br>国債(5年)                     | 120,000,000  | 100.83            | 120,997,200       | 100.67           | 120,804,000      | 0.1000    | 2021.06.20 | 0.93            |
| 15 | 日本   | 国債証券  | 第127回利付<br>国債(5年)                     | 120,000,000  | 100.78            | 120,946,800       | 100.61           | 120,734,400      | 0.1000    | 2021.03.20 | 0.93            |
| 16 | 日本   | 国債証券  | 第125回利付<br>国債(5年)                     | 120,000,000  | 100.71            | 120,858,000       | 100.50           | 120,600,000      | 0.1000    | 2020.09.20 | 0.93            |
| 17 | 日本   | 国債証券  | 第340回利付<br>国債(10年)                    | 110,000,000  | 103.46            | 113,810,000       | 103.33           | 113,668,500      | 0.4000    | 2025.09.20 | 0.87            |
| 18 | 日本   | 国債証券  | 第310回利付<br>国債(10年)                    | 110,000,000  | 103.29            | 113,619,000       | 102.50           | 112,753,300      | 1.0000    | 2020.09.20 | 0.87            |
| 19 | 日本   | 社債券   | 第36回東日本<br>旅客鉄道社債                     | 100,000,000  | 113.95            | 113,950,000       | 112.73           | 112,730,000      | 2.1100    | 2024.12.20 | 0.87            |
| 20 | 日本   | 国債証券  | 第343回利付<br>国債(10年)                    | 110,000,000  | 100.94            | 111,039,400       | 101.11           | 111,229,800      | 0.1000    | 2026.06.20 | 0.85            |
| 21 | 日本   | 国債証券  | 第344回利付<br>国債(10年)                    | 110,000,000  | 100.88            | 110,972,400       | 101.07           | 111,178,100      | 0.1000    | 2026.09.20 | 0.85            |
| 22 | 日本   | 国債証券  | 第346回利付<br>国債(10年)                    | 110,000,000  | 100.74            | 110,820,600       | 100.95           | 111,054,900      | 0.1000    | 2027.03.20 | 0.85            |
| 23 | 日本   | 国債証券  | 第132回利付<br>国債(5年)                     | 110,000,000  | 101.01            | 111,118,700       | 100.85           | 110,941,600      | 0.1000    | 2022.06.20 | 0.85            |
| 24 | 日本   | 国債証券  | 第120回利付<br>国債(5年)                     | 110,000,000  | 100.71            | 110,785,400       | 100.40           | 110,442,200      | 0.2000    | 2019.09.20 | 0.85            |
| 25 | 日本   | 特殊債券  | 第49回政府保<br>証地方公共団体<br>金融機構債券          | 100,000,000  | 104.83            | 104,830,000       | 104.36           | 104,360,000      | 0.8820    | 2023.06.16 | 0.80            |
| 26 | 日本   | 国債証券  | 第334回利付<br>国債(10年)                    | 100,000,000  | 104.44            | 104,440,000       | 104.10           | 104,108,000      | 0.6000    | 2024.06.20 | 0.80            |
| 27 | 日本   | 国債証券  | 第313回利付<br>国債(10年)                    | 100,000,000  | 104.80            | 104,804,000       | 103.88           | 103,882,000      | 1.3000    | 2021.03.20 | 0.80            |

|    |    |      |                      |             |        |             |        |             |        |            |      |
|----|----|------|----------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|--------|------------|------|
| 28 | 日本 | 国債証券 | 第325回利付国債(10年)       | 100,000,000 | 104.38 | 104,385,000 | 103.87 | 103,879,000 | 0.8000 | 2022.09.20 | 0.80 |
| 29 | 日本 | 特殊債券 | 第58回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 103.93 | 103,930,000 | 103.62 | 103,620,000 | 0.6450 | 2024.03.15 | 0.80 |
| 30 | 日本 | 社債券  | 第4回第一三共社債            | 100,000,000 | 103.80 | 103,800,000 | 103.41 | 103,410,000 | 0.8460 | 2023.09.15 | 0.79 |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

#### ロ.種類別投資比率

(平成30年 6月29日現在)

| 種類    | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券  | 79.73   |
| 地方債証券 | 7.41    |
| 特殊債券  | 7.35    |
| 社債券   | 3.99    |
| 合計    | 98.49   |

#### (参考) 海外国債マザーファンド

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成30年 6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類   | 銘柄名                      | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|------|--------------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 10,000,000   | 10,566.24         | 1,056,624,744     | 10,516.8447      | 1,051,684,470    | 2.2500    | 2027.08.15 | 5.10            |
| 2  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 10,000,000   | 10,452.14         | 1,045,214,425     | 10,505.6180      | 1,050,561,802    | 2.2500    | 2027.11.15 | 5.10            |
| 3  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 8,000,000    | 10,631.97         | 850,557,629       | 10,643.7930      | 851,503,441      | 2.3750    | 2027.05.15 | 4.13            |
| 4  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 8,000,000    | 11,005.54         | 880,443,639       | 10,630.8390      | 850,467,124      | 2.2500    | 2025.11.15 | 4.12            |
| 5  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 8,000,000    | 10,431.94         | 834,555,410       | 10,545.3433      | 843,627,467      | 2.2500    | 2027.02.15 | 4.09            |
| 6  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 8,000,000    | 10,824.21         | 865,937,543       | 10,471.0742      | 837,685,940      | 2.0000    | 2025.08.15 | 4.06            |
| 7  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 8,000,000    | 10,197.10         | 815,768,619       | 10,357.9434      | 828,635,475      | 2.0000    | 2026.11.15 | 4.02            |
| 8  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 8,000,000    | 10,470.73         | 837,659,098       | 10,141.1814      | 811,294,514      | 1.6250    | 2026.02.15 | 3.93            |
| 9  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 8,000,000    | 10,444.11         | 835,529,233       | 10,111.8192      | 808,945,541      | 1.6250    | 2026.05.15 | 3.92            |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 8,000,000    | 10,314.76         | 825,181,100       | 9,980.5530       | 798,444,242      | 1.5000    | 2026.08.15 | 3.87            |
| 11 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 3,500,000    | 18,639.04         | 652,366,581       | 18,207.9884      | 637,279,597      | 6.0000    | 2025.10.25 | 3.09            |
| 12 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 4,000,000    | 15,412.86         | 616,514,688       | 15,382.4566      | 615,298,264      | 2.7500    | 2027.10.25 | 2.98            |
| 13 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 4,400,000    | 13,436.53         | 591,207,695       | 13,480.4349      | 593,139,136      | 1.0000    | 2025.11.25 | 2.87            |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 5,000,000    | 10,894.66         | 544,733,348       | 10,956.4139      | 547,820,698      | 2.7500    | 2028.02.15 | 2.65            |
| 15 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 4,300,000    | 12,475.30         | 536,437,912       | 12,614.4842      | 542,422,821      | 0.2500    | 2026.11.25 | 2.63            |
| 16 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 4,000,000    | 13,247.99         | 529,919,618       | 13,347.4085      | 533,896,340      | 1.0000    | 2027.05.25 | 2.59            |
| 17 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 3,200,000    | 16,119.21         | 515,814,982       | 15,901.7711      | 508,856,678      | 3.5000    | 2026.04.25 | 2.47            |
| 18 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,400,000    | 13,181.89         | 448,184,361       | 13,216.9402      | 449,375,970      | 0.5000    | 2026.02.15 | 2.18            |

|    |      |      |                                |           |           |             |             |             |        |            |      |
|----|------|------|--------------------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|--------|------------|------|
| 19 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREPUB.<br>DEUTSCHLAND    | 3,500,000 | 12,448.91 | 435,712,112 | 12,654.3921 | 442,903,724 | 0.0000 | 2026.08.15 | 2.15 |
| 20 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT<br>OF)            | 3,200,000 | 12,999.49 | 415,983,786 | 13,058.3319 | 417,866,621 | 0.5000 | 2025.05.25 | 2.02 |
| 21 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT<br>OF)            | 3,100,000 | 12,867.74 | 398,900,126 | 12,944.4920 | 401,279,252 | 0.5000 | 2026.05.25 | 1.94 |
| 22 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREPUB.<br>DEUTSCHLAND    | 3,000,000 | 12,452.29 | 373,568,829 | 12,853.8038 | 385,614,114 | 0.2500 | 2027.02.15 | 1.87 |
| 23 | イギリス | 国債証券 | TSY                            | 2,000,000 | 18,188.19 | 363,763,860 | 18,300.0333 | 366,000,667 | 4.2500 | 2027.12.07 | 1.77 |
| 24 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 2,000,000 | 17,940.27 | 358,805,457 | 17,223.0815 | 344,461,630 | 7.2500 | 2026.11.01 | 1.67 |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 3,000,000 | 11,290.55 | 338,716,668 | 11,250.8993 | 337,526,981 | 3.5000 | 2020.05.15 | 1.63 |
| 26 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 2,000,000 | 17,912.51 | 358,250,328 | 16,685.8595 | 333,717,190 | 6.5000 | 2027.11.01 | 1.62 |
| 27 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREPUB.<br>DEUTSCHLAND    | 2,500,000 | 12,630.19 | 315,754,789 | 13,075.5997 | 326,889,994 | 0.5000 | 2027.08.15 | 1.58 |
| 28 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 2,000,000 | 15,617.68 | 312,353,662 | 14,579.1818 | 291,583,636 | 4.5000 | 2026.03.01 | 1.41 |
| 29 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 2,500,000 | 12,310.77 | 307,769,366 | 11,577.1340 | 289,428,352 | 1.2500 | 2026.12.01 | 1.40 |
| 30 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREPUB.<br>DEUTSCHLAND    | 1,500,000 | 18,961.25 | 284,418,758 | 19,255.3156 | 288,829,734 | 5.6250 | 2028.01.04 | 1.40 |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年6月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ.種類別投資比率

(平成30年6月29日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.08   |
| 合計   | 98.08   |

(参考)新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成30年6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類   | 銘柄名             | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|------|-----------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2,100,000    | 11,548.83         | 242,525,622       | 11,250.8993      | 236,268,886      | 3.5000    | 2020.05.15 | 2.15            |
| 2  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2,000,000    | 11,531.56         | 230,631,348       | 11,252.6266      | 225,052,532      | 3.6250    | 2020.02.15 | 2.05            |
| 3  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,900,000    | 11,429.66         | 217,163,600       | 11,193.9021      | 212,684,140      | 3.3750    | 2019.11.15 | 1.94            |
| 4  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,700,000    | 11,332.94         | 192,659,993       | 11,066.9538      | 188,138,216      | 2.6250    | 2020.11.15 | 1.71            |
| 5  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,600,000    | 11,320.85         | 181,133,605       | 11,066.9538      | 177,071,261      | 2.6250    | 2020.08.15 | 1.61            |
| 6  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,550,000    | 11,696.51         | 181,295,963       | 11,340.7130      | 175,781,053      | 3.6250    | 2021.02.15 | 1.60            |
| 7  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,600,000    | 11,155.90         | 178,494,465       | 10,885.5992      | 174,169,588      | 2.1250    | 2021.08.15 | 1.59            |
| 8  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,500,000    | 11,539.95         | 173,099,319       | 11,212.0376      | 168,180,565      | 3.1250    | 2021.05.15 | 1.53            |
| 9  | イギリス | 国債証券 | TSY             | 680,000      | 22,976.79         | 156,242,218       | 23,412.7357      | 159,206,603      | 4.2500    | 2049.12.07 | 1.45            |



|    |      |      |                          |           |           |             |             |             |        |            |      |
|----|------|------|--------------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|--------|------------|------|
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1,210,000 | 13,680.14 | 165,529,764 | 12,958.2241 | 156,794,512 | 8.0000 | 2021.11.15 | 1.43 |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1,240,000 | 11,093.10 | 137,554,525 | 10,799.2398 | 133,910,574 | 2.0000 | 2022.02.15 | 1.22 |
| 12 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1,190,000 | 11,023.65 | 131,181,536 | 10,708.5625 | 127,431,894 | 2.0000 | 2023.02.15 | 1.16 |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1,150,000 | 10,958.97 | 126,028,173 | 10,673.1550 | 122,741,283 | 1.7500 | 2022.05.15 | 1.12 |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1,120,000 | 10,926.54 | 122,377,257 | 10,914.9614 | 122,247,568 | 1.5000 | 2019.10.31 | 1.11 |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1,000,000 | 11,275.08 | 112,750,800 | 10,881.2812 | 108,812,812 | 2.5000 | 2024.05.15 | 0.99 |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 1,000,000 | 10,864.00 | 108,640,094 | 10,558.2972 | 105,582,972 | 1.7500 | 2023.05.15 | 0.96 |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 940,000   | 11,183.33 | 105,123,318 | 10,790.6038 | 101,431,676 | 2.3750 | 2024.08.15 | 0.92 |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 890,000   | 11,298.35 | 100,555,329 | 10,924.4607 | 97,227,701  | 2.5000 | 2023.08.15 | 0.88 |
| 19 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 700,000   | 13,906.37 | 97,344,626  | 13,522.6451 | 94,658,516  | 3.7500 | 2019.10.25 | 0.86 |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 870,000   | 10,850.91 | 94,402,970  | 10,558.2971 | 91,857,185  | 1.6250 | 2022.11.15 | 0.83 |
| 21 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 800,000   | 11,454.50 | 91,636,002  | 11,050.5456 | 88,404,365  | 2.7500 | 2023.11.15 | 0.80 |
| 22 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 610,000   | 14,655.92 | 89,401,158  | 14,338.7108 | 87,466,136  | 3.0000 | 2022.04.25 | 0.79 |
| 23 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREP. DEUTSCHLAND   | 600,000   | 13,965.59 | 83,793,586  | 13,831.4200 | 82,988,520  | 1.5000 | 2022.09.04 | 0.75 |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 760,000   | 11,036.58 | 83,878,056  | 10,630.8389 | 80,794,376  | 2.2500 | 2025.11.15 | 0.73 |
| 25 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 590,000   | 14,117.42 | 83,292,818  | 13,520.3428 | 79,770,023  | 4.5000 | 2020.02.01 | 0.72 |
| 26 | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 500,000   | 16,100.03 | 80,500,159  | 15,766.1866 | 78,830,933  | 4.2500 | 2023.10.25 | 0.72 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 700,000   | 11,441.75 | 80,092,274  | 11,041.0458 | 77,287,321  | 2.7500 | 2024.02.15 | 0.70 |
| 28 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 770,000   | 10,341.35 | 79,628,420  | 9,980.5527  | 76,850,256  | 1.5000 | 2026.08.15 | 0.70 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 700,000   | 10,885.59 | 76,199,192  | 10,511.6630 | 73,581,641  | 2.0000 | 2025.02.15 | 0.67 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 690,000   | 10,555.40 | 72,832,275  | 10,576.4326 | 72,977,385  | 2.1250 | 2025.05.15 | 0.66 |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年6月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ.種類別投資比率

(平成30年6月29日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.57   |
| 合計   | 97.57   |

(参考)グローバル高金利通貨マザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成30年6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類   | 銘柄名                     | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|------|-------------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | 国際機関 | 特殊債券 | INTL FINANCE CORP       | 17,000,000   | 2,984.02          | 507,283,910       | 2,953.1242       | 502,031,114      | 10.0000   | 2019.06.14 | 8.95            |
| 2  | 国際機関 | 特殊債券 | INTL FINANCE CORP       | 206,500,000  | 190.64            | 393,681,925       | 186.2700         | 384,647,550      | 11.0000   | 2020.01.21 | 6.86            |
| 3  | 国際機関 | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP | 12,612,000   | 2,902.59          | 366,075,737       | 2,900.0779       | 365,757,831      | 1.5000    | 2020.07.31 | 6.52            |

|    |      |      |                          |                |           |             |             |             |         |            |      |
|----|------|------|--------------------------|----------------|-----------|-------------|-------------|-------------|---------|------------|------|
| 4  | 国際機関 | 特殊債券 | INTL FINANCE CORP        | 176,000,000    | 178.91    | 314,883,800 | 175.4637    | 308,816,200 | 6.3750  | 2022.04.11 | 5.50 |
| 5  | 国際機関 | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP  | 12,540,000     | 2,372.77  | 297,545,734 | 2,398.2659  | 300,742,556 | 9.6250  | 2018.07.13 | 5.36 |
| 6  | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 37,000,000     | 810.58    | 299,915,118 | 806.0902    | 298,253,374 | 9.0000  | 2018.12.21 | 5.31 |
| 7  | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV  | 12,130,000     | 2,335.01  | 283,237,259 | 2,333.8120  | 283,091,396 | 8.0000  | 2018.10.11 | 5.04 |
| 8  | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 1,730,000      | 16,413.85 | 283,959,723 | 16,275.0504 | 281,558,372 | 5.3750  | 2021.06.07 | 5.02 |
| 9  | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV  | 49,620,000     | 544.82    | 270,341,669 | 550.0319    | 272,925,878 | 4.5000  | 2018.12.18 | 4.86 |
| 10 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL FINANCE CORP        | 2,850,000      | 8,776.64  | 250,134,307 | 8,682.4967  | 247,451,158 | 5.7500  | 2020.07.28 | 4.41 |
| 11 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP  | 150,000,000    | 159.13    | 238,703,984 | 158.0796    | 237,119,400 | 5.7500  | 2019.10.28 | 4.22 |
| 12 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 2,850,000      | 8,214.20  | 234,104,803 | 8,189.0440  | 233,387,754 | 2.8000  | 2021.01.15 | 4.16 |
| 13 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 27,700,000     | 802.96    | 222,420,585 | 801.0375    | 221,887,415 | 7.5000  | 2019.01.30 | 3.95 |
| 14 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 26,300,000,000 | 0.77      | 203,602,977 | 0.7559      | 198,824,318 | 7.2000  | 2019.07.09 | 3.54 |
| 15 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP  | 28,800,000     | 550.20    | 158,457,600 | 556.8640    | 160,376,832 | 4.0000  | 2018.08.16 | 2.86 |
| 16 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP  | 20,000,000     | 745.05    | 149,011,600 | 760.8012    | 152,160,252 | 0.5000  | 2019.03.28 | 2.71 |
| 17 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP  | 5,300,000      | 2,903.05  | 153,862,005 | 2,860.1416  | 151,587,510 | 8.0000  | 2022.01.31 | 2.70 |
| 18 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV  | 17,300,000,000 | 0.79      | 136,700,102 | 0.7668      | 132,663,839 | 10.0000 | 2018.11.16 | 2.36 |
| 19 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL FINANCE CORP        | 70,000,000     | 161.87    | 113,309,280 | 161.2548    | 112,878,360 | 6.4500  | 2018.10.30 | 2.01 |
| 20 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 20,500,000     | 523.26    | 107,269,120 | 526.7360    | 107,980,880 | 4.0000  | 2020.02.25 | 1.92 |
| 21 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP  | 19,080,000     | 560.18    | 106,883,260 | 553.1287    | 105,536,975 | 7.5000  | 2020.03.05 | 1.88 |
| 22 | 国際機関 | 特殊債券 | INTER-AMERICAN DEVEL BK  | 10,550,000,000 | 0.76      | 80,963,674  | 0.7297      | 76,989,658  | 5.8000  | 2020.09.28 | 1.37 |
| 23 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL FINANCE CORP        | 34,900,000     | 161.49    | 56,362,732  | 157.8527    | 55,090,627  | 6.4500  | 2020.08.10 | 0.98 |
| 24 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 350,000        | 14,836.37 | 51,927,329  | 14,800.2322 | 51,800,813  | 2.2500  | 2020.03.07 | 0.92 |
| 25 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 1,500,000      | 2,849.81  | 42,747,202  | 2,795.4544  | 41,931,817  | 7.5000  | 2022.04.13 | 0.74 |
| 26 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV  | 5,700,000,000  | 0.78      | 44,544,839  | 0.7201      | 41,045,928  | 6.4500  | 2022.12.13 | 0.73 |
| 27 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV  | 21,800,000     | 158.14    | 34,475,479  | 155.9168    | 33,989,884  | 5.1500  | 2020.01.20 | 0.60 |
| 28 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP  | 10,100,000     | 182.84    | 18,466,840  | 182.2782    | 18,410,103  | 10.0000 | 2019.09.16 | 0.32 |
| 29 | 国際機関 | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK | 11,000,000     | 162.16    | 17,837,820  | 160.7526    | 17,682,786  | 6.6000  | 2019.03.04 | 0.31 |
| 30 | 国際機関 | 特殊債券 | INTL FINANCE CORP        | 2,200,000      | 546.05    | 12,013,108  | 553.5711    | 12,178,566  | 4.1500  | 2018.09.27 | 0.21 |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年6月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

## ロ.種類別投資比率

(平成30年6月29日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 特殊債券 | 96.68   |
| 合計   | 96.68   |

## (参考)新光J-REITマザーファンド

### イ.評価額上位銘柄明細

(平成30年6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類   | 銘柄名                | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|------|--------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人       | 274          | 555,504.89        | 152,208,339       | 639,000          | 175,086,000      | 7.35            |
| 2  | 日本   | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人   | 282          | 539,310.23        | 152,085,484       | 586,000          | 165,252,000      | 6.93            |
| 3  | 日本   | 投資証券 | 野村不動産マスタ・ファンド投資法人  | 838          | 142,703.67        | 119,585,675       | 156,300          | 130,979,400      | 5.49            |
| 4  | 日本   | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人    | 624          | 164,421.92        | 102,599,278       | 171,900          | 107,265,600      | 4.50            |
| 5  | 日本   | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人     | 534          | 204,864.96        | 109,397,888       | 199,600          | 106,586,400      | 4.47            |
| 6  | 日本   | 投資証券 | オリックス不動産投資法人       | 562          | 158,554.04        | 89,107,370        | 176,900          | 99,417,800       | 4.17            |
| 7  | 日本   | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人     | 377          | 240,179.5         | 90,547,671        | 229,800          | 86,634,600       | 3.63            |
| 8  | 日本   | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人       | 329          | 263,263.48        | 86,613,684        | 262,900          | 86,494,100       | 3.63            |
| 9  | 日本   | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人    | 262          | 266,307.91        | 69,772,672        | 283,800          | 74,355,600       | 3.12            |
| 10 | 日本   | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人    | 179          | 376,414.04        | 67,378,113        | 402,500          | 72,047,500       | 3.02            |
| 11 | 日本   | 投資証券 | GLP投資法人            | 588          | 116,741.82        | 68,644,190        | 117,600          | 69,148,800       | 2.90            |
| 12 | 日本   | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人   | 817          | 76,267.4          | 62,310,465        | 83,000           | 67,811,000       | 2.84            |
| 13 | 日本   | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人  | 128          | 450,436.21        | 57,655,834        | 508,000          | 65,024,000       | 2.73            |
| 14 | 日本   | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人    | 87           | 627,408.41        | 54,584,531        | 688,000          | 59,856,000       | 2.51            |
| 15 | 日本   | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人      | 709          | 67,041.96         | 47,532,749        | 72,600           | 51,473,400       | 2.16            |
| 16 | 日本   | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 94           | 434,245.06        | 40,819,035        | 504,000          | 47,376,000       | 1.98            |
| 17 | 日本   | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人        | 304          | 134,711.84        | 40,952,399        | 142,100          | 43,198,400       | 1.81            |
| 18 | 日本   | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人      | 96           | 446,105.72        | 42,826,149        | 445,000          | 42,720,000       | 1.79            |
| 19 | 日本   | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人  | 189          | 207,991.82        | 39,310,453        | 225,700          | 42,657,300       | 1.79            |
| 20 | 日本   | 投資証券 | 産業ファンド投資法人         | 329          | 116,992.96        | 38,490,683        | 123,400          | 40,598,600       | 1.70            |
| 21 | 日本   | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人       | 61           | 572,638.84        | 34,930,969        | 636,000          | 38,796,000       | 1.62            |
| 22 | 日本   | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人       | 776          | 46,762.67         | 36,287,831        | 49,900           | 38,722,400       | 1.62            |
| 23 | 日本   | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人     | 253          | 135,626.83        | 34,313,587        | 142,700          | 36,103,100       | 1.51            |
| 24 | 日本   | 投資証券 | イオンリート投資法人         | 269          | 116,782.84        | 31,414,583        | 127,700          | 34,351,300       | 1.44            |
| 25 | 日本   | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人      | 192          | 160,538.28        | 30,823,349        | 171,600          | 32,947,200       | 1.38            |
| 26 | 日本   | 投資証券 | 森トラスト総合リート投資法人     | 202          | 163,430.49        | 33,012,958        | 158,700          | 32,057,400       | 1.34            |

|    |    |      |                    |     |            |            |         |            |      |
|----|----|------|--------------------|-----|------------|------------|---------|------------|------|
| 27 | 日本 | 投資証券 | プレミア投資法人           | 256 | 103,804.54 | 26,573,962 | 112,400 | 28,774,400 | 1.20 |
| 28 | 日本 | 投資証券 | 日本賃貸住宅投資法人         | 318 | 79,609.96  | 25,315,967 | 89,100  | 28,333,800 | 1.18 |
| 29 | 日本 | 投資証券 | 東急リアル・エステート投資法人    | 190 | 136,285.76 | 25,894,294 | 149,000 | 28,310,000 | 1.18 |
| 30 | 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 107 | 233,307.6  | 24,963,913 | 261,000 | 27,927,000 | 1.17 |

(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。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

#### ロ.種類別投資比率

(平成30年 6月29日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.38   |
| 合計   | 98.38   |

#### (参考)新光米国REITマザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成30年 6月29日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類   | 銘柄名                                    | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|------|--|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 投資証券 | AMERICAN TOWER CORPORATION             | 3,141        | 15,298.15         | 48,051,499        | 15,946.5004      | 50,087,958       | 6.07            |
| 2  | アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP                   | 2,206        | 18,278.89         | 40,323,241        | 18,925.5534      | 41,749,771       | 5.06            |
| 3  | アメリカ | 投資証券 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION | 2,965        | 11,426.22         | 33,878,768        | 11,894.1038      | 35,266,018       | 4.27            |
| 4  | アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC                           | 3,794        | 7,129.82          | 27,050,575        | 7,201.6810       | 27,323,178       | 3.31            |
| 5  | アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE                         | 1,062        | 23,729.62         | 25,200,858        | 25,305.9218      | 26,874,889       | 3.25            |
| 6  | アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC                            | 567          | 51,922.67         | 29,440,155        | 47,206.1075      | 26,765,863       | 3.24            |
| 7  | アメリカ | 投資証券 | WEYERHAEUSER COMPANY                   | 5,443        | 3,889.75          | 21,171,910        | 3,991.5994       | 21,726,276       | 2.63            |
| 8  | アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC              | 988          | 19,924.83         | 19,685,737        | 18,947.6609      | 18,720,289       | 2.27            |
| 9  | アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC                          | 2,664        | 7,489.08          | 19,950,922        | 6,893.2743       | 18,363,683       | 2.22            |
| 10 | アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL                     | 2,568        | 7,283.48          | 18,703,978        | 6,997.1818       | 17,968,763       | 2.17            |
| 11 | アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC               | 1,471        | 13,627.37         | 20,045,863        | 12,202.5105      | 17,949,893       | 2.17            |
| 12 | アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC                             | 2,547        | 6,941.91          | 17,681,050        | 6,349.4177       | 16,171,967       | 1.96            |
| 13 | アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES INC                  | 1,105        | 13,661.63         | 15,096,111        | 13,810.8678      | 15,261,009       | 1.85            |
| 14 | アメリカ | 投資証券 | SBA COMMUNICATIONS CORP                | 815          | 16,417.40         | 13,380,181        | 18,231.3619      | 14,858,560       | 1.80            |
| 15 | アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC               | 476          | 28,649.81         | 13,637,313        | 26,042.1176      | 12,396,048       | 1.50            |
| 16 | アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP                     | 2,055        | 6,204.64          | 12,750,537        | 6,002.3221       | 12,334,772       | 1.49            |
| 17 | アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS                  | 5,240        | 2,192.00          | 11,486,123        | 2,305.8643       | 12,082,729       | 1.46            |
| 18 | アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE                 | 729          | 13,695.44         | 9,983,983         | 13,965.6241      | 10,180,940       | 1.23            |
| 19 | アメリカ | 投資証券 | GGP INC                                | 4,493        | 2,355.15          | 10,581,697        | 2,264.9646       | 10,176,486       | 1.23            |
| 20 | アメリカ | 投資証券 | VORNADO REALTY TRUST                   | 1,233        | 8,261.75          | 10,186,750        | 8,144.5871       | 10,042,276       | 1.21            |
| 21 | アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC                | 872          | 9,043.05          | 7,885,545         | 11,065.0538      | 9,648,727        | 1.17            |
| 22 | アメリカ | 投資証券 | HCP INC                                | 3,364        | 2,914.79          | 9,805,363         | 2,840.8781       | 9,556,714        | 1.15            |
| 23 | アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC  | 812          | 11,612.64         | 9,429,470         | 11,192.1748      | 9,088,046        | 1.10            |
| 24 | アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORP                       | 2,547        | 3,190.24          | 8,125,566         | 3,203.4491       | 8,159,185        | 0.98            |
| 25 | アメリカ | 投資証券 | UDR INC                                | 1,901        | 4,259.73          | 8,097,755         | 4,150.7769       | 7,890,627        | 0.95            |

|    |      |      |                             |       |           |           |             |           |      |
|----|------|------|-----------------------------|-------|-----------|-----------|-------------|-----------|------|
| 26 | アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC           | 2,054 | 4,471.23  | 9,183,907 | 3,830.2108  | 7,867,253 | 0.95 |
| 27 | アメリカ | 投資証券 | FEDERAL REALTY INVESTMENT   | 531   | 14,042.02 | 7,456,316 | 13,946.8323 | 7,405,768 | 0.89 |
| 28 | アメリカ | 投資証券 | REGENCY CENTERS CORPORATION | 1,068 | 7,128.24  | 7,612,963 | 6,904.3286  | 7,373,823 | 0.89 |
| 29 | アメリカ | 投資証券 | SL GREEN REALTY CORPORATION | 611   | 10,905.87 | 6,663,491 | 11,142.4320 | 6,808,026 | 0.82 |
| 30 | アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST       | 635   | 10,191.78 | 6,471,786 | 10,065.7732 | 6,391,766 | 0.77 |

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年6月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ.種類別投資比率

(平成30年6月29日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.68   |
| 合計   | 98.68   |

#### 【投資不動産物件】

##### グローバル・ナビ

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。

(参考)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。

(参考)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。

(参考)海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

(参考)グローバル高金利通貨マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

## グローバル・ナビ

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

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類    | 取引所   | 資産の名称    | 買建/<br>売建 | 数量 | 通貨  | 帳簿価額<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 投資比率<br>(%) |
|----------|-------|----------|-----------|----|-----|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | 東証株価指数先物 | 買建        | 15 | 日本円 | 265,739,860 | 259,575,000 | 3.05        |

(注)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及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

## (参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

| 資産の種類    | 地域      | 取引所                | 資産の名称        | 買建/<br>売建 | 数量 | 通貨        | 帳簿価額        | 帳簿価額<br>(円) | 評価額       | 評価額<br>(円)  | 投資比率<br>(%) |
|----------|---------|--------------------|--------------|-----------|----|-----------|-------------|-------------|-----------|-------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ    | シカゴ商業取引所           | S&P500 EMINI | 買建        | 15 | 米ドル       | 2,086,837.5 | 230,679,017 | 2,039,625 | 225,460,147 | 3.73        |
|          | カナダ     | モントリオール取引所         | S&P/TSE 60IX | 買建        | 1  | カナダドル     | 191,011.5   | 15,928,448  | 191,340   | 15,955,842  | 0.26        |
|          | ドイツ     | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所  | DJ EURO ST50 | 買建        | 12 | ユーロ       | 415,413     | 53,135,477  | 402,120   | 51,435,169  | 0.85        |
|          | オーストラリア | シドニー先物取引所          | SPI 200      | 買建        | 1  | オーストラリアドル | 150,080.5   | 12,180,533  | 154,300   | 12,522,988  | 0.20        |
|          | イギリス    | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | FTSE 100 IDX | 買建        | 2  | 英ポンド      | 152,994.5   | 22,121,474  | 151,020   | 21,835,981  | 0.36        |

(注)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及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外貨建先物取引については、平成30年 6月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

## (参考) 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。

## (参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

（参考）グローバル高金利通貨マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

グローバル・ナビ

| 期別                   | 純資産総額（円）    |             | 1口当たり純資産額（円） |        |
|----------------------|-------------|-------------|--------------|--------|
|                      | （分配落）       | （分配付）       | （分配落）        | （分配付）  |
| 第1計算期間末（平成26年12月15日） | 156,197,806 | 156,197,806 | 1.0986       | 1.0986 |
| 第2計算期間末（平成27年12月15日） | 192,855,223 | 192,855,223 | 1.1107       | 1.1107 |
| 第3計算期間末（平成28年12月15日） | 185,106,131 | 185,106,131 | 1.1246       | 1.1246 |
| 第4計算期間末（平成29年12月15日） | 156,391,984 | 156,391,984 | 1.1917       | 1.1917 |
| 平成29年 6月末日           | 164,079,232 |             | 1.1438       |        |
| 7月末日                 | 159,586,401 |             | 1.1470       |        |
| 8月末日                 | 156,526,959 |             | 1.1521       |        |
| 9月末日                 | 157,608,399 |             | 1.1676       |        |
| 10月末日                | 159,281,532 |             | 1.1829       |        |
| 11月末日                | 157,953,354 |             | 1.1894       |        |
| 12月末日                | 156,633,912 |             | 1.2012       |        |
| 平成30年 1月末日           | 154,752,927 |             | 1.1939       |        |
| 2月末日                 | 249,260,826 |             | 1.1643       |        |
| 3月末日                 | 244,757,834 |             | 1.1533       |        |
| 4月末日                 | 246,933,794 |             | 1.1711       |        |

|      |             |  |        |  |
|------|-------------|--|--------|--|
| 5月末日 | 242,602,689 |  | 1.1610 |  |
| 6月末日 | 241,082,845 |  | 1.1631 |  |

## 【分配の推移】

グローバル・ナビ

| 期      | 計算期間                      | 1口当たりの分配金(円) |
|--------|---------------------------|--------------|
| 第1計算期間 | 平成26年 1月 6日 ~ 平成26年12月15日 | 0.0000       |
| 第2計算期間 | 平成26年12月16日 ~ 平成27年12月15日 | 0.0000       |
| 第3計算期間 | 平成27年12月16日 ~ 平成28年12月15日 | 0.0000       |
| 第4計算期間 | 平成28年12月16日 ~ 平成29年12月15日 | 0.0000       |

## 【収益率の推移】

グローバル・ナビ

| 期        | 計算期間                      | 収益率(%) |
|----------|---------------------------|--------|
| 第1計算期間   | 平成26年 1月 6日 ~ 平成26年12月15日 | 9.9    |
| 第2計算期間   | 平成26年12月16日 ~ 平成27年12月15日 | 1.1    |
| 第3計算期間   | 平成27年12月16日 ~ 平成28年12月15日 | 1.3    |
| 第4計算期間   | 平成28年12月16日 ~ 平成29年12月15日 | 6.0    |
| 第5中間計算期間 | 平成29年12月16日 ~ 平成30年 6月15日 | 1.3    |

(注)収益率は各計算期間における騰落率を表示しており、当該計算期間の分配金額を加算して計算しています。

## (4) 【設定及び解約の実績】

グローバル・ナビ

| 期        | 計算期間                      | 設定口数(口)     | 解約口数(口)    |
|----------|---------------------------|-------------|------------|
| 第1計算期間   | 平成26年 1月 6日 ~ 平成26年12月15日 | 145,283,614 | 3,105,708  |
| 第2計算期間   | 平成26年12月16日 ~ 平成27年12月15日 | 46,534,790  | 15,084,083 |
| 第3計算期間   | 平成27年12月16日 ~ 平成28年12月15日 | 7,924,566   | 16,949,228 |
| 第4計算期間   | 平成28年12月16日 ~ 平成29年12月15日 | 1,346,866   | 34,711,182 |
| 第5中間計算期間 | 平成29年12月16日 ~ 平成30年 6月15日 | 86,007,033  | 9,172,636  |

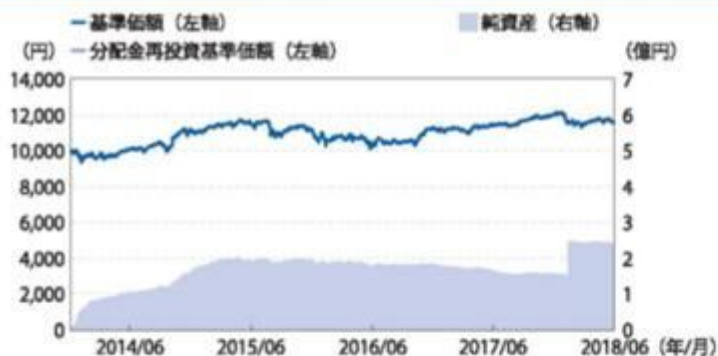
(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報



## 運用実績

## &lt;基準価額・純資産の推移&gt; (2014年1月6日～2018年6月29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、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: 2014年1月6日)  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、最近10年分を記載しています。

## &lt;分配の推移(税引前)&gt;

|          |    |
|----------|----|
| 2017年12月 | 0円 |
| 2016年12月 | 0円 |
| 2015年12月 | 0円 |
| 2014年12月 | 0円 |
| ・        | ・  |
| 設定来累計    | 0円 |

※分配金は1万口当たりです。

## &lt;主要な資産の状況&gt;

## 組入状況

| ファンド・銘柄名                               | 純資産比率  |
|--|--------|
| ニュー トピックス インデックス マザーファンド               | 19.88% |
| 海外国債マザーファンド                            | 15.13% |
| 新光日本債券インデックスマザーファンド                    | 15.06% |
| 新光外国株式インデックスマザーファンド                    | 14.91% |
| 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)           | 10.06% |
| 新光米国REITマザーファンド                        | 5.20%  |
| 新光J-REITマザーファンド                        | 5.11%  |
| グローバル高金利通貨マザーファンド                      | 5.06%  |
| ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF | 4.90%  |
| 合計                                     | 95.37% |

## ニュー トピックス インデックス マザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名              | 業種     | 純資産比率 |
|------------------|--------|-------|
| トヨタ自動車           | 輸送用機器  | 3.43% |
| 三菱UFJフィナンシャルグループ | 銀行業    | 1.71% |
| ソニー              | 電気機器   | 1.49% |
| 日本電信電話           | 情報・通信業 | 1.39% |
| ソフトバンクグループ       | 情報・通信業 | 1.39% |

※東証33業種分類にしたがって記載しています。純資産比率は、ニュー トピックス インデックス マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光外国株式インデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名                 | 国・地域 | 業種                 | 純資産比率 |
|---------------------|------|--------------------|-------|
| APPLE INC           | アメリカ | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.45% |
| MICROSOFT CORP      | アメリカ | ソフトウェア・サービス        | 1.87% |
| AMAZON.COM INC      | アメリカ | 小売                 | 1.84% |
| FACEBOOK INC-A      | アメリカ | ソフトウェア・サービス        | 1.25% |
| JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 銀行                 | 0.93% |

※世界業種分類基準(IGICS)にしたがって記載しています。純資産比率は、新光外国株式インデックスマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

・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。  
 ・表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。  
 ・委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2018年6月29日

## 新光J-REITマザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名               | 純資産比率 |
|-------------------|-------|
| 日本ビルファンド投資法人      | 7.35% |
| ジャパニリアルエステイト投資法人  | 6.93% |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 5.49% |
| ユナイテッド・アーバン投資法人   | 4.50% |
| 日本リテールファンド投資法人    | 4.47% |

※純資産比率は、新光J-REITマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光米国REITマザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名                                    | 純資産比率 |
|--|-------|
| AMERICAN TOWER CORPORATION             | 6.07% |
| SIMON PROPERTY GROUP                   | 5.06% |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION | 4.27% |
| PROLOGIS INC                           | 3.31% |
| PUBLIC STORAGE                         | 3.25% |

※純資産比率は、新光米国REITマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光日本債券インデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名            | 償還日        | 利率     | 純資産比率 |
|----------------|------------|--------|-------|
| 第123回利付国債(5年)  | 2020/03/20 | 0.100% | 1.24% |
| 第306回利付国債(10年) | 2020/03/20 | 1.400% | 1.18% |
| 第124回利付国債(5年)  | 2020/06/20 | 0.100% | 1.16% |
| 第312回利付国債(10年) | 2020/12/20 | 1.200% | 1.11% |
| 第308回利付国債(10年) | 2020/06/20 | 1.300% | 1.11% |

※純資産比率は、新光日本債券インデックスマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 海外国債マザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名             | 償還日        | 利率     | 通貨  | 純資産比率 |
|-----------------|------------|--------|-----|-------|
| US TREASURY N/B | 2027/08/15 | 2.250% | 米ドル | 5.10% |
| US TREASURY N/B | 2027/11/15 | 2.250% | 米ドル | 5.10% |
| US TREASURY N/B | 2027/05/15 | 2.375% | 米ドル | 4.13% |
| US TREASURY N/B | 2025/11/15 | 2.250% | 米ドル | 4.12% |
| US TREASURY N/B | 2027/02/15 | 2.250% | 米ドル | 4.09% |

※純資産比率は、海外国債マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)の組入上位5銘柄

| 銘柄名             | 償還日        | 利率     | 通貨  | 純資産比率 |
|-----------------|------------|--------|-----|-------|
| US TREASURY N/B | 2020/05/15 | 3.500% | 米ドル | 2.15% |
| US TREASURY N/B | 2020/02/15 | 3.625% | 米ドル | 2.05% |
| US TREASURY N/B | 2019/11/15 | 3.375% | 米ドル | 1.94% |
| US TREASURY N/B | 2020/11/15 | 2.625% | 米ドル | 1.71% |
| US TREASURY N/B | 2020/08/15 | 2.625% | 米ドル | 1.61% |

※純資産比率は、新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)の純資産総額に対する比率です。

## グローバル高金利通貨マザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名                     | 償還日        | 利率      | 通貨       | 純資産比率 |
|-------------------------|------------|---------|----------|-------|
| INTL FINANCE CORP       | 2019/06/14 | 10.000% | ブラジルレアル  | 8.95% |
| INTL FINANCE CORP       | 2020/01/21 | 11.000% | ロシアルーブル  | 6.86% |
| INTL BK RECON & DEVELOP | 2020/07/31 | 1.500%  | ポーランドズロチ | 6.52% |
| INTL FINANCE CORP       | 2022/04/11 | 6.375%  | ロシアルーブル  | 5.50% |
| INTL BK RECON & DEVELOP | 2018/07/13 | 9.625%  | トルコリラ    | 5.36% |

※純資産比率は、グローバル高金利通貨マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

・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。

・表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。

・当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。

## 運用実績

データの基準日:2018年6月29日

## &lt;年間収益率の推移(暦年ベース)&gt;



※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。

※2014年は設定日から年末までの収益率、および2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

・委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

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

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

(ロ) 「分配金再投資コース」での取得申込者は、販売会社との間で「グローバル・ナビ自動継続投資約款」（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およびすで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をもって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われます。

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

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

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

- (ホ) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、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。
- (ヘ) 委託者は、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受け付けないものとします。
- ・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、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には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の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～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

| 投資対象            | 評価方法            |
|-----------------|-----------------|
| マザーファンド<br>受益証券 | 計算日の基準価額        |
| 株式              | 計算日における取引所の最終相場 |
| 上場投資信託証券        | 計算日における取引所の最終相場 |

|                |  |
|----------------|--|
| 外貨建資産の<br>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<br>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                     |
| 直物為替先渡取引       | 金融商品取引業者または銀行等が提示する価額もしくは価格<br>情報会社の提供する価額 |

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

(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平成40年12月15日までです。

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

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎年12月16日から翌年12月15日までとします。

上記にかかわらず、上記の原則による該当日が休業日のとき、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30億口を下回る事となった場合、またはこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託者は、上記(イ)の事項について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしています。

(ハ) 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。

(ニ) 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、下記「c. 書面決議の手続き」の規定における書面決議が否決となる場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

(ホ) 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違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。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



変更等」の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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等

(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またはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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。

(ロ) 委託者は、上記(イ)の事項(投資信託約款の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしたがいます。

(ハ) 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)および(ロ)の規定にしたがいます。

この投資信託約款は上記に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

#### c. 書面決議の手続き

(イ) 委託者は、上記「a. 信託の終了(投資信託契約の解約)」(イ)について、または「b. 投資信託約款の変更等」(イ)の事項のうち重大な約款の変更等について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由または重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドにかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ロ) 上記(イ)の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ハ) 上記(イ)の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

(ニ) 重大な約款の変更等における書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

(ホ) 上記(イ)から(ニ)までの規定は、委託者が投資信託契約の解約または重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドにかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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つて、上記(イ)から(ハ)までに規定する当ファンドの解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

(ヘ) 上記(イ)から(ホ)の規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### d. 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託者が投資信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、投資信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### e. 運用報告書

委託者は、毎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「f. 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。

#### f. 公告

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

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

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

#### g. 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。

#### h. 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日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社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)における日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社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。

#### i. 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を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。

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



務

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

4．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

j．他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1．他の受益者の氏名または名称および住所

2．他の受益者が有する受益権の内容

k．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。

#### 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委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿

書類の閲覧または謄写を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(平成28年12月16日から平成29年12月15日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【グローバル・ナビ】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第3期<br>平成28年12月15日現在 | 第4期<br>平成29年12月15日現在 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| <b>資産の部</b>     |                      |                      |
| <b>流動資産</b>     |                      |                      |
| コール・ローン         | 10,353,464           | 9,047,861            |
| 投資信託受益証券        | 9,432,844            | 7,756,274            |
| 親投資信託受益証券       | 168,459,967          | 140,818,880          |
| 流動資産合計          | 188,246,275          | 157,623,015          |
| <b>資産合計</b>     | 188,246,275          | 157,623,015          |
| <b>負債の部</b>     |                      |                      |
| <b>流動負債</b>     |                      |                      |
| 未払解約金           | 1,734,576            | -                    |
| 未払受託者報酬         | 49,214               | 43,170               |
| 未払委託者報酬         | 1,348,420            | 1,182,929            |
| 未払利息            | 12                   | 14                   |
| その他未払費用         | 7,922                | 4,918                |
| 流動負債合計          | 3,140,144            | 1,231,031            |
| <b>負債合計</b>     | 3,140,144            | 1,231,031            |
| <b>純資産の部</b>    |                      |                      |
| <b>元本等</b>      |                      |                      |
| 元本              | 164,603,951          | 131,239,635          |
| 剰余金             |                      |                      |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 20,502,180           | 25,152,349           |
| （分配準備積立金）       | 14,290,999           | 20,068,299           |
| 元本等合計           | 185,106,131          | 156,391,984          |
| <b>純資産合計</b>    | 185,106,131          | 156,391,984          |
| <b>負債純資産合計</b>  | 188,246,275          | 157,623,015          |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                         | 第3期 |                              | 第4期 |                              |
|-------------------------|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
|                         | 自   | 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自   | 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
| 営業収益                    |     |                              |     |                              |
| 受取配当金                   |     | -                            |     | 161,682                      |
| 受取利息                    |     | 776                          |     | -                            |
| 有価証券売買等損益               |     | 3,933,505                    |     | 12,523,412                   |
| 為替差損益                   |     | 1,266,159                    |     | 418,351                      |
| 営業収益合計                  |     | 5,200,440                    |     | 12,266,743                   |
| 営業費用                    |     |                              |     |                              |
| 支払利息                    |     | 3,735                        |     | 5,036                        |
| 受託者報酬                   |     | 100,327                      |     | 90,664                       |
| 委託者報酬                   |     | 2,748,759                    |     | 2,484,402                    |
| その他費用                   |     | 423,794                      |     | 432,186                      |
| 営業費用合計                  |     | 3,276,615                    |     | 3,012,288                    |
| 営業利益                    |     | 1,923,825                    |     | 9,254,455                    |
| 経常利益                    |     | 1,923,825                    |     | 9,254,455                    |
| 当期純利益                   |     | 1,923,825                    |     | 9,254,455                    |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      |     | 472,593                      |     | 555,102                      |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）         |     | 19,226,610                   |     | 20,502,180                   |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          |     | 693,950                      |     | 194,876                      |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |     | 693,950                      |     | 194,876                      |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          |     | 1,814,798                    |     | 4,244,060                    |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 |     | 1,814,798                    |     | 4,244,060                    |
| 分配金                     |     | -                            |     | -                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）         |     | 20,502,180                   |     | 25,152,349                   |

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 第4期  |  |
|----------------------------|--|--|
|                            | 自平成28年12月16日<br>至平成29年12月15日   |  |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 投資信託受益証券<br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。<br>親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |  |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | 為替予約取引<br>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  |  |
| 3. 収益及び費用の計上基準             | 受取配当金<br>原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。  |  |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。  |  |

(貸借対照表に関する注記)

| 第3期<br>平成28年12月15日現在      |              | 第4期<br>平成29年12月15日現在      |              |
|---------------------------|--------------|---------------------------|--------------|
| 1. 計算期間末日における受益権の総数       | 164,603,951口 | 1. 計算期間末日における受益権の総数       | 131,239,635口 |
| 2. 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 |              | 2. 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 |              |
| 1口当たり純資産額                 | 1.1246円      | 1口当たり純資産額                 | 1.1917円      |
| (1万口当たり純資産額)              | (11,246円)    | (1万口当たり純資産額)              | (11,917円)    |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分       | 第3期                                |  | 第4期                          |  |
|----------|------------------------------------|--|------------------------------|--|
|          | 自平成27年12月16日<br>至平成28年12月15日       |  | 自平成28年12月16日<br>至平成29年12月15日 |  |
| 1. その他費用 | 主に、海外カストディアンに対するカスト<br>ディフィーであります。 |  | 同左                           |  |

|             |   |   |
|-------------|---|---|
| 2. 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,543,119円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(853,299円)、信託約款に定める収益調整金(6,211,181円)及び分配準備積立金(11,894,581円)より分配対象収益は20,502,180円(1万口当たり1,245.51円)であります。分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,572,164円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(6,127,189円)、信託約款に定める収益調整金(5,084,050円)及び分配準備積立金(11,368,946円)より分配対象収益は25,152,349円(1万口当たり1,916.48円)であります。分配を行っておりません。</p> |
|-------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 第3期<br>自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日   | 第4期<br>自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|-----------------|---|---------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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> <p>また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>  | 同左                                    |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | <p>当ファンドの投資している金融商品は、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。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資信託受益証券、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。</p> | 同左                                    |

|                           |   |    |
|---------------------------|---|----|
| 3.金融商品に係るリスクの管理体制         | <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。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左 |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>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又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>  | 同左 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 第3期<br>平成28年12月15日現在  | 第4期<br>平成29年12月15日現在                             |
|---|--|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> |



|  |    |
|--|----|
| 投資信託受益証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。                                   | 同左 |
| 親投資信託受益証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。                                  |    |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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。 |    |

## （関連当事者との取引に関する注記）

|  |                                       |                                       |
|--|---------------------------------------|---------------------------------------|
|  | 第3期<br>自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 第4期<br>自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|  | 該当事項はありません。                           | 同左                                    |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分        | 第3期<br>平成28年12月15日現在 | 第4期<br>平成29年12月15日現在 |
|-----------|----------------------|----------------------|
| 期首元本額     | 173,628,613円         | 164,603,951円         |
| 期中追加設定元本額 | 7,924,566円           | 1,346,866円           |
| 期中一部解約元本額 | 16,949,228円          | 34,711,182円          |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第3期<br>平成28年12月15日現在     | 第4期<br>平成29年12月15日現在     |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>（円） |
| 投資信託受益証券  | 484,300                  | 1,754,744                |
| 親投資信託受益証券 | 6,228,316                | 8,878,449                |
| 合計        | 5,744,016                | 10,633,193               |

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## (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

| 通貨     | 種類        | 銘柄                                     | 券面総額       | 評価額                        | 備考 |
|--------|-----------|--|------------|----------------------------|----|
| 日本円    | 親投資信託受益証券 | 海外国債マザーファンド                            | 13,524,271 | 31,228,894                 |    |
|        |           | ニュー トピックス インデックス マザーファンド               | 13,554,618 | 31,250,171                 |    |
|        |           | 新光外国株式インデックスマザーファンド                    | 6,745,097  | 15,651,997                 |    |
|        |           | 新光日本債券インデックスマザーファンド                    | 18,588,748 | 23,494,318                 |    |
|        |           | 新光J - R E I Tマザーファンド                   | 4,940,213  | 7,855,926                  |    |
|        |           | 新光米国R E I Tマザーファンド                     | 4,724,320  | 7,819,694                  |    |
|        |           | 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）           | 11,551,040 | 15,709,414                 |    |
|        |           | グローバル高金利通貨マザーファンド                      | 6,838,734  | 7,808,466                  |    |
| 日本円建小計 |           |  | 80,467,041 | 140,818,880                |    |
| 米ドル    | 投資信託受益証券  | ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF | 1,240      | 69,006.00                  |    |
| 米ドル建小計 |           |  | 1,240      | 69,006.00<br>(7,756,274)   |    |
| 合計     |           |  |            | 148,575,154<br>(7,756,274) |    |

(注1) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

- 小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

| 通貨  | 銘柄数          | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-----|--------------|------------------------|-------------------------|
| 米ドル | 投資信託受益証券 1銘柄 | 5.0%                   | 5.2%                    |

(注1) 組入投資信託受益証券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

(注2) 有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「新光外国株式インデックス マザーファンド」、「新光日本債券インデックスマザーファンド」、「海外国債マザーファンド」、「新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」、「グローバル高金利通貨マザーファンド」、「新光」- R E I Tマザーファンド」及び「新光米国 R E I Tマザーファンド」各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「親投資信託受益証券」は、これら同ファンドの受益証券であります。

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 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）         |                |
|--------------|----------------|----------------|
|              | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
| <b>資産の部</b>  |                |                |
| 流動資産         |                |                |
| コール・ローン      | 346,718,237    | 248,878,988    |
| 株式           | 11,633,008,450 | 10,615,297,800 |
| 派生商品評価勘定     | 11,674,480     | 1,425,788      |
| 未収入金         | 111,903,746    | -              |
| 未収配当金        | 1,299,900      | 1,234,744      |
| 流動資産合計       | 12,104,604,813 | 10,866,837,320 |
| 資産合計         | 12,104,604,813 | 10,866,837,320 |
| <b>負債の部</b>  |                |                |
| 流動負債         |                |                |
| 前受金          | 11,210,000     | 3,120,000      |
| 未払解約金        | 102,850,000    | 5,010,000      |
| 未払利息         | 428            | 395            |
| 流動負債合計       | 114,060,428    | 8,130,395      |
| 負債合計         | 114,060,428    | 8,130,395      |
| <b>純資産の部</b> |                |                |
| 元本等          |                |                |
| 元本           | 6,167,781,665  | 4,709,895,506  |
| 剰余金          |                |                |
| 剰余金又は欠損金（ ）  | 5,822,762,720  | 6,148,811,419  |
| 元本等合計        | 11,990,544,385 | 10,858,706,925 |
| 純資産合計        | 11,990,544,385 | 10,858,706,925 |
| 負債純資産合計      | 12,104,604,813 | 10,866,837,320 |

##### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分                    | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日   |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式<br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）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<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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及び外国金融商品市場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<br>原則として、株式の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)

| 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|---|---|
| 1. 担保資産<br>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。<br>株式 147,473,800円 | 1. 担保資産<br>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。<br>株式 165,293,350円 |
| 2. 計算日における受益権の総数<br>6,167,781,665口                                    | 2. 計算日における受益権の総数<br>4,709,895,506口                                    |
| 3. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.9441円<br>(1万口当たり純資産額) (19,441円) | 3. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 2.3055円<br>(1万口当たり純資産額) (23,055円) |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日  | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|-----------------|---|--------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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。<br>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。 | 同左                             |

| 区分                         | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日  | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|----------------------------|---|--------------------------------|
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドの投資している金融商品は、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。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが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。株価指数先物取引は株価の変動によるリスクを有しております。</p>   | 同左                             |
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制         | <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。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左                             |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>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又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>  | 同左                             |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在   |
|--|---|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に</p> <p>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</p> <p>す。</p> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

|  | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
|  | 該当事項はありません。                    | 同左                             |

(その他の注記)

1 元本の移動

| 区分                    | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
|-----------------------|----------------|----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首にお |                |                |
| ける当該親投資信託の元本額         | 6,660,217,405円 | 6,167,781,665円 |
| 期中追加設定元本額             | 1,102,399,473円 | 144,670,852円   |
| 期中一部解約元本額             | 1,594,835,213円 | 1,602,557,011円 |
| 同期末における元本の内訳          |                |                |
| ニュー トピックス インデックス      | 343,066,148円   | 278,691,777円   |
| 新光7資産バランスファンド         | 436,035,353円   | 352,965,055円   |
| ニュー トピックス インデックス(変額年  |                |                |
| 金)                    | 203,358,286円   | 136,781,156円   |
| 新光世界バランスファンド35VA(適格機関 |                |                |
| 投資家私募)                | 1,637,118,059円 | 1,114,063,006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)                | 1,434,508,196円 | 1,092,105,272円 |
| 新光世界バランス35VAT(適格機関投資家 |                |                |
| 私募)                   | 46,293,695円    | 38,083,520円    |
| ワールドバランスファンド30VA(適格機関 |                |                |
| 投資家私募)                | 1,480,979,179円 | 1,228,580,456円 |

| 区分                             | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）   | 535,137,423円   | 430,893,417円   |
| 世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募） | 2,036,363円     | - 円            |
| グローバル・ナビ                       | 19,508,624円    | 13,554,618円    |
| 太陽財形株投 太陽一般財形 30               | 5,853,652円     | 4,729,036円     |
| 太陽財形株投 太陽一般財形 50               | 20,053,296円    | 16,244,594円    |
| 太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30            | 3,833,391円     | 3,203,599円     |
| 合計                             | 6,167,781,665円 | 4,709,895,506円 |

2 有価証券関係  
 売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年12月15日現在      | 平成29年12月15日現在      |
|----|--------------------|--------------------|
|    | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式 | 1,110,465,404      | 1,445,844,858      |
| 合計 | 1,110,465,404      | 1,445,844,858      |

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

3 デリバティブ取引等関係  
 取引の時価等に関する事項  
 (株式関連)

| 種類       | 平成28年12月15日現在 |       |             |            | 平成29年12月15日現在 |       |             |           |
|----------|---------------|-------|-------------|------------|---------------|-------|-------------|-----------|
|          | 契約額等（円）       |       | 時価（円）       | 評価損益（円）    | 契約額等（円）       |       | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|          |               | うち1年超 |             |            |               | うち1年超 |             |           |
| 市場取引     |               |       |             |            |               |       |             |           |
| 株価指数先物取引 |               |       |             |            |               |       |             |           |
| 買建       | 282,065,520   | -     | 293,740,000 | 11,674,480 | 231,339,212   | -     | 232,765,000 | 1,425,788 |
| 東証株価指数先物 | 282,065,520   | -     | 293,740,000 | 11,674,480 | 231,339,212   | -     | 232,765,000 | 1,425,788 |
| 合計       | 282,065,520   | -     | 293,740,000 | 11,674,480 | 231,339,212   | -     | 232,765,000 | 1,425,788 |

時価の算定方法

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金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

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。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

| 銘柄              | 株式数    | 評価額       |            | 備考 |
|-----------------|--------|-----------|------------|----|
|                 |        | 単価        | 金額         |    |
| 極洋              | 200    | 3,970.00  | 794,000    |    |
| 日本水産            | 5,300  | 616.00    | 3,264,800  |    |
| マルハニチロ          | 900    | 3,350.00  | 3,015,000  |    |
| カネコ種苗           | 200    | 1,757.00  | 351,400    |    |
| サカタのタネ          | 700    | 3,955.00  | 2,768,500  |    |
| ホクト             | 500    | 2,034.00  | 1,017,000  |    |
| ホクリヨウ           | 100    | 1,153.00  | 115,300    |    |
| 日鉄鉱業            | 100    | 7,640.00  | 764,000    |    |
| 三井松島産業          | 200    | 1,484.00  | 296,800    |    |
| 国際石油開発帝石        | 22,700 | 1,304.50  | 29,612,150 |    |
| 石油資源開発          | 700    | 2,825.00  | 1,977,500  |    |
| K&Oエナジーグループ     | 300    | 1,838.00  | 551,400    |    |
| ショーボンドホールディングス  | 400    | 8,050.00  | 3,220,000  |    |
| ミライト・ホールディングス   | 1,400  | 1,621.00  | 2,269,400  |    |
| インベスターズクラウド     | 100    | 7,340.00  | 734,000    |    |
| ダイセキ環境ソリューション   | 100    | 1,420.00  | 142,000    |    |
| 安藤・間            | 3,600  | 900.00    | 3,240,000  |    |
| 東急建設            | 1,800  | 1,146.00  | 2,062,800  |    |
| コムシスホールディングス    | 1,600  | 3,270.00  | 5,232,000  |    |
| ミサワホーム          | 400    | 990.00    | 396,000    |    |
| 高松コンストラクショングループ | 300    | 3,100.00  | 930,000    |    |
| 東建コーポレーション      | 200    | 13,380.00 | 2,676,000  |    |
| ソネック            | 100    | 825.00    | 82,500     |    |
| ヤマウラ            | 200    | 883.00    | 176,600    |    |
| 大成建設            | 4,700  | 6,140.00  | 28,858,000 |    |
| 大林組             | 14,000 | 1,376.00  | 19,264,000 |    |
| 清水建設            | 14,300 | 1,232.00  | 17,617,600 |    |
| 飛島建設            | 4,200  | 163.00    | 684,600    |    |
| 長谷工コーポレーション     | 5,400  | 1,751.00  | 9,455,400  |    |
| 松井建設            | 500    | 968.00    | 484,000    |    |
| 銭高組             | 100    | 6,220.00  | 622,000    |    |
| 鹿島建設            | 21,000 | 1,156.00  | 24,276,000 |    |
| 不動テトラ           | 3,500  | 187.00    | 654,500    |    |
| 鉄建建設            | 300    | 3,350.00  | 1,005,000  |    |
| 西松建設            | 1,100  | 3,235.00  | 3,558,500  |    |
| 三井住友建設          | 3,400  | 628.00    | 2,135,200  |    |
| 大豊建設            | 2,000  | 569.00    | 1,138,000  |    |
| 前田建設工業          | 3,300  | 1,636.00  | 5,398,800  |    |
| 佐田建設            | 300    | 455.00    | 136,500    |    |
| ナカノフドー建設        | 400    | 620.00    | 248,000    |    |



|               |        |           |            |
|---------------|--------|-----------|------------|
| 奥村組           | 800    | 4,705.00  | 3,764,000  |
| 東鉄工業          | 600    | 3,730.00  | 2,238,000  |
| イチケン          | 100    | 2,377.00  | 237,700    |
| 浅沼組           | 2,000  | 406.00    | 812,000    |
| 戸田建設          | 5,000  | 877.00    | 4,385,000  |
| 熊谷組           | 700    | 3,120.00  | 2,184,000  |
| 青木あすなろ建設      | 300    | 1,004.00  | 301,200    |
| 北野建設          | 1,000  | 405.00    | 405,000    |
| 植木組           | 100    | 2,743.00  | 274,300    |
| 三井ホーム         | 1,000  | 735.00    | 735,000    |
| 矢作建設工業        | 600    | 984.00    | 590,400    |
| ピーエス三菱        | 600    | 975.00    | 585,000    |
| 日本ハウスホールディングス | 900    | 709.00    | 638,100    |
| 大東建託          | 1,700  | 23,170.00 | 39,389,000 |
| 新日本建設         | 600    | 990.00    | 594,000    |
| N I P P O     | 1,000  | 2,629.00  | 2,629,000  |
| 東亜道路工業        | 100    | 4,365.00  | 436,500    |
| 前田道路          | 1,000  | 2,652.00  | 2,652,000  |
| 日本道路          | 100    | 6,650.00  | 665,000    |
| 東亜建設工業        | 400    | 3,125.00  | 1,250,000  |
| 若築建設          | 300    | 1,760.00  | 528,000    |
| 東洋建設          | 1,500  | 659.00    | 988,500    |
| 五洋建設          | 5,500  | 869.00    | 4,779,500  |
| 世紀東急工業        | 600    | 622.00    | 373,200    |
| 福田組           | 200    | 6,790.00  | 1,358,000  |
| 住友林業          | 3,000  | 1,957.00  | 5,871,000  |
| 日本基礎技術        | 500    | 418.00    | 209,000    |
| 日成ビルド工業       | 700    | 1,433.00  | 1,003,100  |
| 巴コーポレーション     | 600    | 708.00    | 424,800    |
| 大和ハウス工業       | 13,800 | 4,295.00  | 59,271,000 |
| ライト工業         | 900    | 1,303.00  | 1,172,700  |
| 積水ハウス         | 15,200 | 2,027.00  | 30,810,400 |
| 日特建設          | 400    | 724.00    | 289,600    |
| 北陸電気工事        | 300    | 1,121.00  | 336,300    |
| ユアテック         | 700    | 958.00    | 670,600    |
| 西部電気工業        | 100    | 2,949.00  | 294,900    |
| 四電工           | 100    | 2,964.00  | 296,400    |
| 中電工           | 600    | 3,145.00  | 1,887,000  |
| 関電工           | 1,900  | 1,129.00  | 2,145,100  |
| きんでん          | 3,100  | 1,847.00  | 5,725,700  |
| 東京エネシス        | 500    | 1,265.00  | 632,500    |
| トーエネック        | 100    | 3,295.00  | 329,500    |

|                 |       |          |            |
|-----------------|-------|----------|------------|
| 住友電設            | 400   | 2,416.00 | 966,400    |
| 日本電設工業          | 700   | 2,390.00 | 1,673,000  |
| 協和エクシオ          | 1,700 | 2,861.00 | 4,863,700  |
| 新日本空調           | 400   | 1,505.00 | 602,000    |
| N D S           | 100   | 4,150.00 | 415,000    |
| 九電工             | 900   | 5,350.00 | 4,815,000  |
| 三機工業            | 1,000 | 1,341.00 | 1,341,000  |
| 日揮              | 4,000 | 2,044.00 | 8,176,000  |
| 中外炉工業           | 100   | 2,431.00 | 243,100    |
| ヤマト             | 400   | 860.00   | 344,000    |
| 太平電業            | 300   | 2,699.00 | 809,700    |
| 高砂熱学工業          | 1,300 | 2,091.00 | 2,718,300  |
| 三晃金属工業          | 100   | 4,145.00 | 414,500    |
| 朝日工業社           | 100   | 3,500.00 | 350,000    |
| 明星工業            | 800   | 804.00   | 643,200    |
| 大気社             | 600   | 3,690.00 | 2,214,000  |
| ダイダン            | 300   | 2,973.00 | 891,900    |
| 日比谷総合設備         | 500   | 2,407.00 | 1,203,500  |
| 東芝プラントシステム      | 1,000 | 2,149.00 | 2,149,000  |
| O S J Bホールディングス | 2,100 | 357.00   | 749,700    |
| 東洋エンジニアリング      | 500   | 1,253.00 | 626,500    |
| 千代田化工建設         | 3,000 | 730.00   | 2,190,000  |
| 新興プランテック        | 900   | 1,172.00 | 1,054,800  |
| 日本製粉            | 1,400 | 1,748.00 | 2,447,200  |
| 日清製粉グループ本社      | 5,100 | 2,283.00 | 11,643,300 |
| 昭和産業            | 400   | 2,882.00 | 1,152,800  |
| 鳥越製粉            | 400   | 1,043.00 | 417,200    |
| 中部飼料            | 500   | 2,435.00 | 1,217,500  |
| フィード・ワン         | 2,800 | 277.00   | 775,600    |
| 日本甜菜製糖          | 200   | 2,827.00 | 565,400    |
| 三井製糖            | 300   | 4,890.00 | 1,467,000  |
| 塩水港精糖           | 500   | 264.00   | 132,000    |
| 日新製糖            | 200   | 2,263.00 | 452,600    |
| 森永製菓            | 1,000 | 5,770.00 | 5,770,000  |
| 中村屋             | 100   | 5,040.00 | 504,000    |
| 江崎グリコ           | 1,200 | 5,700.00 | 6,840,000  |
| 名糖産業            | 200   | 1,593.00 | 318,600    |
| 不二家             | 300   | 2,739.00 | 821,700    |
| 山崎製パン           | 3,400 | 2,228.00 | 7,575,200  |
| モロゾフ            | 100   | 7,660.00 | 766,000    |
| 亀田製菓            | 300   | 5,020.00 | 1,506,000  |
| 寿スピリッツ          | 400   | 6,160.00 | 2,464,000  |

|                  |        |           |            |
|------------------|--------|-----------|------------|
| カルビー             | 1,900  | 3,720.00  | 7,068,000  |
| 森永乳業             | 800    | 4,750.00  | 3,800,000  |
| 六甲バター            | 200    | 2,868.00  | 573,600    |
| ヤクルト本社           | 2,500  | 8,620.00  | 21,550,000 |
| 明治ホールディングス       | 2,800  | 10,030.00 | 28,084,000 |
| 雪印メグミルク          | 1,000  | 3,255.00  | 3,255,000  |
| プリマハム            | 3,000  | 816.00    | 2,448,000  |
| 日本ハム             | 4,000  | 2,798.00  | 11,192,000 |
| 丸大食品             | 2,000  | 502.00    | 1,004,000  |
| S Foods          | 300    | 5,060.00  | 1,518,000  |
| 伊藤ハム米久ホールディングス   | 2,700  | 1,056.00  | 2,851,200  |
| サッポロホールディングス     | 1,500  | 3,570.00  | 5,355,000  |
| アサヒグループホールディングス  | 8,800  | 5,710.00  | 50,248,000 |
| キリンホールディングス      | 20,100 | 2,852.50  | 57,335,250 |
| 宝ホールディングス        | 3,400  | 1,303.00  | 4,430,200  |
| オエノンホールディングス     | 1,200  | 389.00    | 466,800    |
| 養命酒製造            | 100    | 2,595.00  | 259,500    |
| コカ・コーラボトラーズジャパン  | 2,900  | 4,280.00  | 12,412,000 |
| サントリー食品インターナショナル | 3,200  | 5,140.00  | 16,448,000 |
| ダイドーグループホールディングス | 200    | 5,870.00  | 1,174,000  |
| 伊藤園              | 1,400  | 4,470.00  | 6,258,000  |
| キーコーヒー           | 400    | 2,132.00  | 852,800    |
| ユニカフェ            | 100    | 1,446.00  | 144,600    |
| ジャパンフーズ          | 100    | 1,463.00  | 146,300    |
| 日清オイリオグループ       | 500    | 3,485.00  | 1,742,500  |
| 不二製油グループ本社       | 1,100  | 3,280.00  | 3,608,000  |
| J - オイルミルズ       | 200    | 3,995.00  | 799,000    |
| キッコーマン           | 3,300  | 4,560.00  | 15,048,000 |
| 味の素              | 9,600  | 2,113.00  | 20,284,800 |
| キューピー            | 2,300  | 2,997.00  | 6,893,100  |
| ハウス食品グループ本社      | 1,600  | 3,815.00  | 6,104,000  |
| カゴメ              | 1,700  | 4,270.00  | 7,259,000  |
| 焼津水産化学工業         | 200    | 1,248.00  | 249,600    |
| アリアケジャパン         | 400    | 9,880.00  | 3,952,000  |
| ピエトロ             | 100    | 1,705.00  | 170,500    |
| エバラ食品工業          | 100    | 2,129.00  | 212,900    |
| ニチレイ             | 2,000  | 3,190.00  | 6,380,000  |
| 東洋水産             | 2,300  | 4,865.00  | 11,189,500 |
| 日清食品ホールディングス     | 1,800  | 8,230.00  | 14,814,000 |
| 一正蒲鉾             | 200    | 1,296.00  | 259,200    |
| フジッコ             | 500    | 2,542.00  | 1,271,000  |
| ロック・フィールド        | 500    | 2,047.00  | 1,023,500  |

|                |        |          |            |
|----------------|--------|----------|------------|
| 日本たばこ産業        | 25,900 | 3,719.00 | 96,322,100 |
| ケンコーマヨネーズ      | 300    | 3,660.00 | 1,098,000  |
| わらべや日洋ホールディングス | 300    | 3,200.00 | 960,000    |
| なとり            | 200    | 2,068.00 | 413,600    |
| ユーグレナ          | 1,600  | 1,041.00 | 1,665,600  |
| ミヨシ油脂          | 200    | 1,560.00 | 312,000    |
| 理研ビタミン         | 200    | 4,570.00 | 914,000    |
| 片倉工業           | 500    | 1,410.00 | 705,000    |
| グンゼ            | 300    | 5,850.00 | 1,755,000  |
| 東洋紡            | 1,600  | 2,029.00 | 3,246,400  |
| ユニチカ           | 1,300  | 820.00   | 1,066,000  |
| 富士紡ホールディングス    | 200    | 3,635.00 | 727,000    |
| 倉敷紡績           | 4,000  | 349.00   | 1,396,000  |
| シキボウ           | 200    | 1,435.00 | 287,000    |
| 日本毛織           | 1,200  | 1,083.00 | 1,299,600  |
| 帝国繊維           | 500    | 2,217.00 | 1,108,500  |
| 帝人             | 3,600  | 2,401.00 | 8,643,600  |
| 東レ             | 31,600 | 1,055.50 | 33,353,800 |
| サカイオーベックス      | 100    | 2,759.00 | 275,900    |
| 住江織物           | 100    | 3,135.00 | 313,500    |
| 日本フェルト         | 200    | 509.00   | 101,800    |
| アツギ            | 300    | 1,332.00 | 399,600    |
| セーレン           | 1,000  | 2,075.00 | 2,075,000  |
| ソトー            | 200    | 1,137.00 | 227,400    |
| 小松精練           | 700    | 935.00   | 654,500    |
| ワコールホールディングス   | 1,200  | 3,560.00 | 4,272,000  |
| ホギメディカル        | 300    | 8,460.00 | 2,538,000  |
| T S Iホールディングス  | 1,600  | 836.00   | 1,337,600  |
| 三陽商会           | 200    | 2,191.00 | 438,200    |
| オンワードホールディングス  | 2,600  | 941.00   | 2,446,600  |
| ルック            | 1,000  | 383.00   | 383,000    |
| ゴールドウイン        | 100    | 8,340.00 | 834,000    |
| デサント           | 1,000  | 1,904.00 | 1,904,000  |
| キング            | 200    | 682.00   | 136,400    |
| ヤマトインターナショナル   | 300    | 445.00   | 133,500    |
| 特種東海製紙         | 300    | 4,040.00 | 1,212,000  |
| 王子ホールディングス     | 18,000 | 717.00   | 12,906,000 |
| 日本製紙           | 2,000  | 2,096.00 | 4,192,000  |
| 北越紀州製紙         | 2,400  | 627.00   | 1,504,800  |
| 中越パルプ工業        | 200    | 2,052.00 | 410,400    |
| 大王製紙           | 1,700  | 1,431.00 | 2,432,700  |
| レンゴー           | 4,200  | 794.00   | 3,334,800  |

|            |        |           |            |
|------------|--------|-----------|------------|
| トーマク       | 300    | 2,111.00  | 633,300    |
| ザ・パック      | 300    | 3,750.00  | 1,125,000  |
| クラレ        | 7,300  | 2,112.00  | 15,417,600 |
| 旭化成        | 27,200 | 1,444.00  | 39,276,800 |
| 共和レザー      | 300    | 1,020.00  | 306,000    |
| 昭和電工       | 2,900  | 4,470.00  | 12,963,000 |
| 住友化学       | 32,000 | 776.00    | 24,832,000 |
| 住友精化       | 200    | 6,170.00  | 1,234,000  |
| 日産化学工業     | 2,500  | 4,450.00  | 11,125,000 |
| クレハ        | 400    | 7,530.00  | 3,012,000  |
| 多木化学       | 100    | 5,640.00  | 564,000    |
| テイカ        | 300    | 2,991.00  | 897,300    |
| 石原産業       | 800    | 2,017.00  | 1,613,600  |
| 片倉コープアグリ   | 100    | 1,471.00  | 147,100    |
| 日東エフシー     | 300    | 807.00    | 242,100    |
| 日本曹達       | 3,000  | 738.00    | 2,214,000  |
| 東ソー        | 6,300  | 2,414.00  | 15,208,200 |
| トクヤマ       | 1,300  | 3,405.00  | 4,426,500  |
| セントラル硝子    | 900    | 2,385.00  | 2,146,500  |
| 東亜合成       | 2,600  | 1,407.00  | 3,658,200  |
| 大阪ソーダ      | 400    | 2,846.00  | 1,138,400  |
| 関東電化工業     | 1,000  | 1,270.00  | 1,270,000  |
| デンカ        | 1,600  | 4,245.00  | 6,792,000  |
| 信越化学工業     | 7,300  | 11,395.00 | 83,183,500 |
| 堺化学工業      | 300    | 2,722.00  | 816,600    |
| エア・ウォーター   | 3,600  | 2,353.00  | 8,470,800  |
| 大陽日酸       | 3,400  | 1,549.00  | 5,266,600  |
| 日本化学工業     | 200    | 2,479.00  | 495,800    |
| 東邦アセチレン    | 100    | 1,642.00  | 164,200    |
| 日本パーカライジング | 2,200  | 1,799.00  | 3,957,800  |
| 高压ガス工業     | 600    | 934.00    | 560,400    |
| 四国化成工業     | 600    | 1,755.00  | 1,053,000  |
| ステラ ケミファ   | 200    | 3,610.00  | 722,000    |
| 保土谷化学工業    | 100    | 6,350.00  | 635,000    |
| 日本触媒       | 700    | 7,910.00  | 5,537,000  |
| 大日精化工業     | 300    | 5,430.00  | 1,629,000  |
| カネカ        | 6,000  | 980.00    | 5,880,000  |
| 三菱瓦斯化学     | 3,800  | 3,105.00  | 11,799,000 |
| 三井化学       | 4,000  | 3,460.00  | 13,840,000 |
| J S R      | 4,400  | 2,205.00  | 9,702,000  |
| 東京応化工業     | 800    | 4,840.00  | 3,872,000  |
| 大阪有機化学工業   | 300    | 1,244.00  | 373,200    |

|                |        |          |            |
|----------------|--------|----------|------------|
| 三菱ケミカルホールディングス | 29,200 | 1,206.50 | 35,229,800 |
| KHネオケム         | 700    | 2,710.00 | 1,897,000  |
| ダイセル           | 5,900  | 1,300.00 | 7,670,000  |
| 住友ベークライト       | 4,000  | 921.00   | 3,684,000  |
| 積水化学工業         | 9,100  | 2,217.00 | 20,174,700 |
| 日本ゼオン          | 3,700  | 1,587.00 | 5,871,900  |
| アイカ工業          | 1,200  | 4,145.00 | 4,974,000  |
| 宇部興産           | 2,200  | 3,160.00 | 6,952,000  |
| 積水樹脂           | 700    | 2,225.00 | 1,557,500  |
| タキロンシーアイ       | 1,000  | 788.00   | 788,000    |
| 旭有機材           | 300    | 1,949.00 | 584,700    |
| 日立化成           | 2,200  | 2,828.00 | 6,221,600  |
| ニチバン           | 200    | 3,015.00 | 603,000    |
| リケンテクノス        | 900    | 609.00   | 548,100    |
| 大倉工業           | 1,000  | 692.00   | 692,000    |
| 積水化成成品工業       | 500    | 1,442.00 | 721,000    |
| 群栄化学工業         | 100    | 3,720.00 | 372,000    |
| タイガースポリマー      | 200    | 808.00   | 161,600    |
| ミライアル          | 100    | 1,765.00 | 176,500    |
| ダイキョーニシカワ      | 900    | 1,799.00 | 1,619,100  |
| 日本化薬           | 2,800  | 1,685.00 | 4,718,000  |
| カーリットホールディングス  | 400    | 1,032.00 | 412,800    |
| 日本精化           | 400    | 1,122.00 | 448,800    |
| 扶桑化学工業         | 300    | 3,165.00 | 949,500    |
| ADEKA          | 1,900  | 1,961.00 | 3,725,900  |
| 日油             | 1,700  | 2,939.00 | 4,996,300  |
| ハリマ化成グループ      | 300    | 898.00   | 269,400    |
| 花王             | 10,200 | 7,648.00 | 78,009,600 |
| 第一工業製薬         | 1,000  | 797.00   | 797,000    |
| 日華化学           | 100    | 1,289.00 | 128,900    |
| ニイタカ           | 100    | 1,856.00 | 185,600    |
| 三洋化成工業         | 300    | 5,860.00 | 1,758,000  |
| 大日本塗料          | 500    | 1,871.00 | 935,500    |
| 日本ペイントホールディングス | 3,400  | 3,630.00 | 12,342,000 |
| 関西ペイント         | 4,600  | 2,921.00 | 13,436,600 |
| 神東塗料           | 300    | 260.00   | 78,000     |
| 中国塗料           | 1,300  | 935.00   | 1,215,500  |
| 日本特殊塗料         | 300    | 2,093.00 | 627,900    |
| 藤倉化成           | 500    | 705.00   | 352,500    |
| 太陽ホールディングス     | 300    | 5,030.00 | 1,509,000  |
| DIC            | 1,700  | 4,225.00 | 7,182,500  |
| サカタインクス        | 900    | 1,768.00 | 1,591,200  |

|                  |       |           |            |
|------------------|-------|-----------|------------|
| 東洋インキＳＣホールディングス  | 4,000 | 656.00    | 2,624,000  |
| T&K TOKA         | 300   | 1,453.00  | 435,900    |
| 富士フイルムホールディングス   | 8,700 | 4,635.00  | 40,324,500 |
| 資生堂              | 7,800 | 5,399.00  | 42,112,200 |
| ライオン             | 5,800 | 2,082.00  | 12,075,600 |
| 高砂香料工業           | 300   | 3,440.00  | 1,032,000  |
| マンダム             | 800   | 3,680.00  | 2,944,000  |
| ミルボン             | 300   | 7,820.00  | 2,346,000  |
| ファンケル            | 1,000 | 3,285.00  | 3,285,000  |
| コーセー             | 700   | 17,400.00 | 12,180,000 |
| コタ               | 200   | 1,615.00  | 323,000    |
| シーズ・ホールディングス     | 600   | 5,540.00  | 3,324,000  |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 1,800 | 4,120.00  | 7,416,000  |
| ノエビアホールディングス     | 300   | 8,200.00  | 2,460,000  |
| アジュバンコスメジャパン     | 100   | 1,041.00  | 104,100    |
| エステー             | 300   | 2,816.00  | 844,800    |
| アグロ カネショウ        | 200   | 1,892.00  | 378,400    |
| コニシ              | 700   | 2,039.00  | 1,427,300  |
| 長谷川香料            | 600   | 2,296.00  | 1,377,600  |
| 星光PMC            | 200   | 1,185.00  | 237,000    |
| 小林製薬             | 1,200 | 7,350.00  | 8,820,000  |
| 荒川化学工業           | 400   | 2,288.00  | 915,200    |
| メック              | 300   | 2,360.00  | 708,000    |
| 日本高純度化学          | 100   | 2,601.00  | 260,100    |
| タカラバイオ           | 1,100 | 1,543.00  | 1,697,300  |
| JCU              | 300   | 5,390.00  | 1,617,000  |
| 新田ゼラチン           | 300   | 786.00    | 235,800    |
| デクセリアルズ          | 1,100 | 1,360.00  | 1,496,000  |
| アース製薬            | 300   | 5,700.00  | 1,710,000  |
| 北興化学工業           | 400   | 736.00    | 294,400    |
| 大成ラミック           | 100   | 3,110.00  | 311,000    |
| クミアイ化学工業         | 1,900 | 860.00    | 1,634,000  |
| 日本農薬             | 1,100 | 675.00    | 742,500    |
| アキレス             | 300   | 2,372.00  | 711,600    |
| 有沢製作所            | 700   | 1,233.00  | 863,100    |
| 日東電工             | 3,100 | 10,120.00 | 31,372,000 |
| レック              | 200   | 2,867.00  | 573,400    |
| きもと              | 700   | 329.00    | 230,300    |
| 藤森工業             | 300   | 3,715.00  | 1,114,500  |
| 前澤化成工業           | 300   | 1,263.00  | 378,900    |
| JSP              | 200   | 3,720.00  | 744,000    |
| エフピコ             | 300   | 6,060.00  | 1,818,000  |

|                 |        |          |            |                  |
|-----------------|--------|----------|------------|------------------|
| 天馬              | 300    | 2,138.00 | 641,400    |                  |
| 信越ポリマー          | 900    | 1,229.00 | 1,106,100  |                  |
| 東リ              | 1,000  | 437.00   | 437,000    |                  |
| ニフコ             | 800    | 7,300.00 | 5,840,000  |                  |
| 日本バルカー工業        | 300    | 2,855.00 | 856,500    |                  |
| ユニ・チャーム         | 8,800  | 2,970.50 | 26,140,400 |                  |
| 協和発酵キリン         | 5,200  | 2,159.00 | 11,226,800 |                  |
| 武田薬品工業          | 15,300 | 6,221.00 | 95,181,300 | 代用有価証券<br>2,600株 |
| アステラス製薬         | 42,800 | 1,431.50 | 61,268,200 |                  |
| 大日本住友製薬         | 3,100  | 1,636.00 | 5,071,600  |                  |
| 塩野義製薬           | 6,000  | 6,170.00 | 37,020,000 |                  |
| 田辺三菱製薬          | 5,100  | 2,399.00 | 12,234,900 |                  |
| あすか製薬           | 500    | 2,077.00 | 1,038,500  |                  |
| 日本新薬            | 1,100  | 8,200.00 | 9,020,000  |                  |
| ビオフェルミン製薬       | 100    | 3,040.00 | 304,000    |                  |
| 中外製薬            | 4,300  | 5,870.00 | 25,241,000 |                  |
| 科研製薬            | 800    | 5,800.00 | 4,640,000  |                  |
| エーザイ            | 5,000  | 6,895.00 | 34,475,000 |                  |
| ロート製薬           | 2,300  | 3,090.00 | 7,107,000  |                  |
| 小野薬品工業          | 9,800  | 2,633.50 | 25,808,300 |                  |
| 久光製薬            | 1,200  | 6,490.00 | 7,788,000  |                  |
| 持田製薬            | 300    | 8,320.00 | 2,496,000  |                  |
| 参天製薬            | 7,900  | 1,908.00 | 15,073,200 |                  |
| 扶桑薬品工業          | 100    | 2,867.00 | 286,700    |                  |
| 日本ケミファ          | 100    | 4,960.00 | 496,000    |                  |
| ツムラ             | 1,500  | 3,710.00 | 5,565,000  |                  |
| 日医工             | 1,100  | 1,712.00 | 1,883,200  |                  |
| キッセイ薬品工業        | 800    | 3,215.00 | 2,572,000  |                  |
| 生化学工業           | 800    | 1,645.00 | 1,316,000  |                  |
| 栄研化学            | 300    | 5,230.00 | 1,569,000  |                  |
| 日水製薬            | 200    | 1,568.00 | 313,600    |                  |
| 鳥居薬品            | 300    | 3,030.00 | 909,000    |                  |
| JCRファーマ         | 300    | 5,000.00 | 1,500,000  |                  |
| 東和薬品            | 200    | 6,350.00 | 1,270,000  |                  |
| 富士製薬工業          | 100    | 4,220.00 | 422,000    |                  |
| 沢井製薬            | 700    | 5,020.00 | 3,514,000  |                  |
| ゼリア新薬工業         | 900    | 2,187.00 | 1,968,300  |                  |
| 第一三共            | 11,900 | 2,850.00 | 33,915,000 |                  |
| キョーリン製薬ホールディングス | 1,200  | 2,125.00 | 2,550,000  |                  |
| 大幸薬品            | 200    | 2,355.00 | 471,000    |                  |
| ダイト             | 300    | 3,425.00 | 1,027,500  |                  |
| 大塚ホールディングス      | 8,700  | 4,999.00 | 43,491,300 |                  |



|                  |        |          |            |
|------------------|--------|----------|------------|
| 大正製薬ホールディングス     | 900    | 8,850.00 | 7,965,000  |
| ペプチドリーム          | 1,700  | 3,820.00 | 6,494,000  |
| 昭和シェル石油          | 3,900  | 1,544.00 | 6,021,600  |
| ニチレキ             | 500    | 1,421.00 | 710,500    |
| ユシロ化学工業          | 200    | 1,690.00 | 338,000    |
| ビーピー・カストロール      | 200    | 2,252.00 | 450,400    |
| MORESCO          | 200    | 2,156.00 | 431,200    |
| 出光興産             | 3,500  | 4,335.00 | 15,172,500 |
| JXTGホールディングス     | 66,500 | 685.50   | 45,585,750 |
| コスモエネルギーホールディングス | 1,200  | 3,840.00 | 4,608,000  |
| 横浜ゴム             | 2,400  | 2,586.00 | 6,206,400  |
| 東洋ゴム工業           | 2,500  | 2,247.00 | 5,617,500  |
| ブリヂストン           | 14,700 | 5,092.00 | 74,852,400 |
| 住友ゴム工業           | 4,100  | 2,008.00 | 8,232,800  |
| 藤倉ゴム工業           | 400    | 922.00   | 368,800    |
| オカモト             | 1,000  | 1,138.00 | 1,138,000  |
| フコク              | 200    | 1,105.00 | 221,000    |
| ニッタ              | 400    | 4,185.00 | 1,674,000  |
| 住友理工             | 800    | 1,175.00 | 940,000    |
| 三ツ星ベルト           | 1,000  | 1,444.00 | 1,444,000  |
| バンドー化学           | 800    | 1,287.00 | 1,029,600  |
| 日東紡績             | 600    | 3,215.00 | 1,929,000  |
| 旭硝子              | 4,300  | 4,690.00 | 20,167,000 |
| 日本板硝子            | 2,100  | 991.00   | 2,081,100  |
| 日本山村硝子           | 2,000  | 189.00   | 378,000    |
| 日本電気硝子           | 1,800  | 4,265.00 | 7,677,000  |
| オハラ              | 200    | 2,782.00 | 556,400    |
| 住友大阪セメント         | 8,000  | 528.00   | 4,224,000  |
| 太平洋セメント          | 2,600  | 4,780.00 | 12,428,000 |
| 日本ヒューム           | 400    | 773.00   | 309,200    |
| 日本コンクリート工業       | 900    | 480.00   | 432,000    |
| 三谷セキサン           | 200    | 2,598.00 | 519,600    |
| アジアパイルホールディングス   | 500    | 721.00   | 360,500    |
| 東海カーボン           | 3,800  | 1,306.00 | 4,962,800  |
| 日本カーボン           | 200    | 4,880.00 | 976,000    |
| 東洋炭素             | 300    | 3,320.00 | 996,000    |
| ノリタケカンパニーリミテド    | 200    | 5,670.00 | 1,134,000  |
| TOTO             | 3,200  | 6,220.00 | 19,904,000 |
| 日本碍子             | 5,100  | 2,090.00 | 10,659,000 |
| 日本特殊陶業           | 3,600  | 2,600.00 | 9,360,000  |
| MARUWA           | 100    | 7,210.00 | 721,000    |
| 品川リフラクトリーズ       | 100    | 3,280.00 | 328,000    |

|                    |        |          |            |
|--------------------|--------|----------|------------|
| 黒崎播磨               | 100    | 4,715.00 | 471,500    |
| ヨータイ               | 200    | 591.00   | 118,200    |
| 東京窯業               | 500    | 446.00   | 223,000    |
| ニッカトー              | 100    | 999.00   | 99,900     |
| フジインコーポレーテッド       | 400    | 2,423.00 | 969,200    |
| ニチアス               | 2,000  | 1,400.00 | 2,800,000  |
| ニチハ                | 600    | 4,315.00 | 2,589,000  |
| 新日鐵住金              | 18,400 | 2,799.00 | 51,501,600 |
| 神戸製鋼所              | 7,500  | 1,044.00 | 7,830,000  |
| 中山製鋼所              | 600    | 754.00   | 452,400    |
| 合同製鐵               | 200    | 2,216.00 | 443,200    |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 11,100 | 2,684.00 | 29,792,400 |
| 日新製鋼               | 1,100  | 1,769.00 | 1,945,900  |
| 東京製鐵               | 2,200  | 977.00   | 2,149,400  |
| 共英製鋼               | 500    | 2,061.00 | 1,030,500  |
| 大和工業               | 900    | 3,065.00 | 2,758,500  |
| 東京鐵鋼               | 200    | 1,977.00 | 395,400    |
| 大阪製鐵               | 300    | 2,233.00 | 669,900    |
| 淀川製鋼所              | 600    | 3,370.00 | 2,022,000  |
| 東洋鋼鋳               | 1,000  | 458.00   | 458,000    |
| 丸一鋼管               | 1,500  | 3,220.00 | 4,830,000  |
| モリ工業               | 100    | 3,525.00 | 352,500    |
| 大同特殊鋼              | 700    | 6,530.00 | 4,571,000  |
| 日本冶金工業             | 3,400  | 225.00   | 765,000    |
| 山陽特殊製鋼             | 500    | 2,799.00 | 1,399,500  |
| 愛知製鋼               | 200    | 4,495.00 | 899,000    |
| 日立金属               | 4,400  | 1,492.00 | 6,564,800  |
| 大平洋金属              | 300    | 2,897.00 | 869,100    |
| 新日本電工              | 2,500  | 447.00   | 1,117,500  |
| 栗本鐵工所              | 200    | 2,314.00 | 462,800    |
| 三菱製鋼               | 300    | 2,715.00 | 814,500    |
| 日亜鋼業               | 600    | 324.00   | 194,400    |
| 日本精線               | 100    | 5,180.00 | 518,000    |
| シンニッタン             | 300    | 759.00   | 227,700    |
| 新家工業               | 100    | 2,184.00 | 218,400    |
| 大紀アルミニウム工業所        | 700    | 767.00   | 536,900    |
| 日本輕金属ホールディングス      | 12,000 | 307.00   | 3,684,000  |
| 三井金属鋳業             | 1,100  | 6,030.00 | 6,633,000  |
| 東邦亜鉛               | 200    | 5,560.00 | 1,112,000  |
| 三菱マテリアル            | 2,700  | 3,715.00 | 10,030,500 |
| 住友金属鋳山             | 5,300  | 4,298.00 | 22,779,400 |
| DOWAホールディングス       | 1,000  | 4,290.00 | 4,290,000  |

|                  |        |           |            |
|------------------|--------|-----------|------------|
| 古河機械金属           | 700    | 2,164.00  | 1,514,800  |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ   | 400    | 1,897.00  | 758,800    |
| 東邦チタニウム          | 700    | 1,071.00  | 749,700    |
| UACJ             | 600    | 2,827.00  | 1,696,200  |
| 古河電気工業           | 1,400  | 5,400.00  | 7,560,000  |
| 住友電気工業           | 15,400 | 1,835.50  | 28,266,700 |
| フジクラ             | 5,000  | 977.00    | 4,885,000  |
| 東京特殊電線           | 100    | 2,628.00  | 262,800    |
| タツタ電線            | 800    | 857.00    | 685,600    |
| カナレ電気            | 100    | 2,559.00  | 255,900    |
| 平河ヒューテック         | 200    | 1,308.00  | 261,600    |
| リョービ             | 500    | 3,020.00  | 1,510,000  |
| アーレスティ           | 500    | 894.00    | 447,000    |
| アサヒホールディングス      | 700    | 1,962.00  | 1,373,400  |
| 稲葉製作所            | 200    | 1,455.00  | 291,000    |
| 宮地エンジニアリンググループ   | 100    | 2,582.00  | 258,200    |
| トーカロ             | 300    | 4,755.00  | 1,426,500  |
| アルファC o          | 100    | 2,348.00  | 234,800    |
| SUMCO            | 3,800  | 2,849.00  | 10,826,200 |
| 川田テクノロジーズ        | 100    | 6,190.00  | 619,000    |
| 東洋製罐グループホールディングス | 2,800  | 1,796.00  | 5,028,800  |
| ホッカンホールディングス     | 1,000  | 437.00    | 437,000    |
| コロナ              | 200    | 1,485.00  | 297,000    |
| 横河ブリッジホールディングス   | 800    | 2,524.00  | 2,019,200  |
| 駒井ハルテック          | 100    | 2,599.00  | 259,900    |
| 三和ホールディングス       | 4,000  | 1,489.00  | 5,956,000  |
| 文化シャッター          | 1,200  | 1,066.00  | 1,279,200  |
| 三協立山             | 600    | 1,652.00  | 991,200    |
| アルインコ            | 300    | 1,246.00  | 373,800    |
| LIXILグループ        | 6,100  | 3,005.00  | 18,330,500 |
| 日本フィルコン          | 300    | 770.00    | 231,000    |
| ノーリツ             | 900    | 2,145.00  | 1,930,500  |
| 長府製作所            | 500    | 2,678.00  | 1,339,000  |
| リンナイ             | 700    | 10,070.00 | 7,049,000  |
| ダイニチ工業           | 200    | 849.00    | 169,800    |
| 日東精工             | 600    | 649.00    | 389,400    |
| 三洋工業             | 100    | 2,136.00  | 213,600    |
| 岡部               | 800    | 1,070.00  | 856,000    |
| ジーテクト            | 500    | 2,233.00  | 1,116,500  |
| 東プレ              | 800    | 3,225.00  | 2,580,000  |
| 高周波熱錬            | 800    | 1,237.00  | 989,600    |
| 東京製綱             | 300    | 1,584.00  | 475,200    |

|             |       |           |            |  |
|-------------|-------|-----------|------------|--|
| サンコール       | 200   | 694.00    | 138,800    |  |
| モリテック スチール  | 200   | 742.00    | 148,400    |  |
| パイオラックス     | 600   | 3,275.00  | 1,965,000  |  |
| 日本発條        | 4,100 | 1,200.00  | 4,920,000  |  |
| アドバネクス      | 100   | 3,430.00  | 343,000    |  |
| 立川ブラインド工業   | 200   | 1,438.00  | 287,600    |  |
| 三益半導体工業     | 400   | 1,982.00  | 792,800    |  |
| 日本ドライケミカル   | 100   | 2,420.00  | 242,000    |  |
| 日本製鋼所       | 1,300 | 3,445.00  | 4,478,500  |  |
| 三浦工業        | 1,800 | 2,819.00  | 5,074,200  |  |
| タクマ         | 1,400 | 1,576.00  | 2,206,400  |  |
| ツガミ         | 1,000 | 1,320.00  | 1,320,000  |  |
| オークマ        | 500   | 6,990.00  | 3,495,000  |  |
| 東芝機械        | 2,000 | 779.00    | 1,558,000  |  |
| アマダホールディングス | 6,400 | 1,470.00  | 9,408,000  |  |
| アイダエンジニアリング | 1,000 | 1,314.00  | 1,314,000  |  |
| 滝澤鉄工所       | 100   | 2,082.00  | 208,200    |  |
| 富士機械製造      | 1,200 | 2,218.00  | 2,661,600  |  |
| 牧野フライス製作所   | 2,000 | 1,087.00  | 2,174,000  |  |
| オーエスジー      | 1,900 | 2,240.00  | 4,256,000  |  |
| 旭ダイヤモンド工業   | 1,200 | 1,253.00  | 1,503,600  |  |
| D M G 森精機   | 2,300 | 2,248.00  | 5,170,400  |  |
| ソディック       | 900   | 1,388.00  | 1,249,200  |  |
| ディスコ        | 600   | 24,660.00 | 14,796,000 |  |
| 日東工器        | 300   | 2,871.00  | 861,300    |  |
| 日進工具        | 100   | 2,515.00  | 251,500    |  |
| パンチ工業       | 200   | 2,407.00  | 481,400    |  |
| 富士ダイス       | 200   | 1,103.00  | 220,600    |  |
| 東洋機械金属      | 300   | 889.00    | 266,700    |  |
| 島精機製作所      | 500   | 7,080.00  | 3,540,000  |  |
| フリーー        | 300   | 1,071.00  | 321,300    |  |
| ヤマシンフィルタ    | 600   | 1,377.00  | 826,200    |  |
| 日阪製作所       | 600   | 1,247.00  | 748,200    |  |
| やまびこ        | 800   | 1,641.00  | 1,312,800  |  |
| 平田機工        | 100   | 11,400.00 | 1,140,000  |  |
| ペガサスミシン製造   | 400   | 767.00    | 306,800    |  |
| ナブテスコ       | 2,300 | 4,200.00  | 9,660,000  |  |
| 三井海洋開発      | 400   | 2,557.00  | 1,022,800  |  |
| レオン自動機      | 400   | 1,662.00  | 664,800    |  |
| S M C       | 1,300 | 44,760.00 | 58,188,000 |  |
| 新川          | 300   | 1,040.00  | 312,000    |  |
| ホソカワミクロン    | 200   | 7,820.00  | 1,564,000  |  |

|              |        |           |            |
|--------------|--------|-----------|------------|
| ユニオンツール      | 200    | 4,330.00  | 866,000    |
| オイレス工業       | 500    | 2,200.00  | 1,100,000  |
| 日精エー・エス・ピー機械 | 100    | 6,900.00  | 690,000    |
| サトーホールディングス  | 500    | 3,395.00  | 1,697,500  |
| 技研製作所        | 200    | 3,010.00  | 602,000    |
| 日本エアテック      | 100    | 956.00    | 95,600     |
| 日精樹脂工業       | 300    | 1,653.00  | 495,900    |
| オカダアイヨン      | 100    | 2,097.00  | 209,700    |
| 小松製作所        | 20,100 | 3,804.00  | 76,460,400 |
| 住友重機械工業      | 2,400  | 4,585.00  | 11,004,000 |
| 日立建機         | 1,900  | 3,865.00  | 7,343,500  |
| 日工           | 100    | 2,311.00  | 231,100    |
| 巴工業          | 200    | 2,087.00  | 417,400    |
| 井関農機         | 400    | 2,752.00  | 1,100,800  |
| TOWA         | 300    | 2,091.00  | 627,300    |
| 北川鉄工所        | 200    | 2,987.00  | 597,400    |
| ローツェ         | 200    | 2,630.00  | 526,000    |
| クボタ          | 22,500 | 2,091.50  | 47,058,750 |
| 荏原実業         | 100    | 1,993.00  | 199,300    |
| 三菱化工機        | 100    | 2,296.00  | 229,600    |
| 月島機械         | 800    | 1,293.00  | 1,034,400  |
| 帝国電機製作所      | 300    | 1,618.00  | 485,400    |
| 新東工業         | 1,000  | 1,392.00  | 1,392,000  |
| 澁谷工業         | 400    | 4,365.00  | 1,746,000  |
| アイチ コーポレーション | 700    | 815.00    | 570,500    |
| 小森コーポレーション   | 1,000  | 1,481.00  | 1,481,000  |
| 鶴見製作所        | 400    | 2,015.00  | 806,000    |
| 住友精密工業       | 1,000  | 371.00    | 371,000    |
| 酒井重工業        | 100    | 4,390.00  | 439,000    |
| 荏原製作所        | 1,700  | 4,235.00  | 7,199,500  |
| 石井鐵工所        | 100    | 1,734.00  | 173,400    |
| 西島製作所        | 400    | 1,183.00  | 473,200    |
| 北越工業         | 500    | 1,231.00  | 615,500    |
| ダイキン工業       | 5,700  | 13,215.00 | 75,325,500 |
| オルガノ         | 100    | 3,075.00  | 307,500    |
| トーヨーカネツ      | 200    | 4,365.00  | 873,000    |
| 栗田工業         | 2,300  | 3,675.00  | 8,452,500  |
| 椿本チエイン       | 2,000  | 870.00    | 1,740,000  |
| 大同工業         | 200    | 1,696.00  | 339,200    |
| アネスト岩田       | 700    | 1,214.00  | 849,800    |
| ダイフク         | 2,100  | 5,840.00  | 12,264,000 |
| 加藤製作所        | 200    | 3,160.00  | 632,000    |

|               |       |          |            |
|---------------|-------|----------|------------|
| 油研工業          | 100   | 2,703.00 | 270,300    |
| タダノ           | 2,000 | 1,727.00 | 3,454,000  |
| フジテック         | 1,300 | 1,579.00 | 2,052,700  |
| C K D         | 1,200 | 2,331.00 | 2,797,200  |
| キトー           | 300   | 1,613.00 | 483,900    |
| 平和            | 1,300 | 2,005.00 | 2,606,500  |
| 理想科学工業        | 400   | 2,055.00 | 822,000    |
| S A N K Y O   | 1,000 | 3,560.00 | 3,560,000  |
| 日本金銭機械        | 400   | 1,148.00 | 459,200    |
| マースエンジニアリング   | 300   | 2,461.00 | 738,300    |
| 福島工業          | 300   | 5,070.00 | 1,521,000  |
| オーイズミ         | 200   | 519.00   | 103,800    |
| ダイコク電機        | 200   | 1,759.00 | 351,800    |
| 竹内製作所         | 700   | 2,338.00 | 1,636,600  |
| アマノ           | 1,300 | 2,892.00 | 3,759,600  |
| J U K I       | 600   | 1,831.00 | 1,098,600  |
| サンデンホールディングス  | 500   | 2,208.00 | 1,104,000  |
| 蛇の目マシン工業      | 400   | 861.00   | 344,400    |
| マックス          | 600   | 1,552.00 | 931,200    |
| グローリー         | 1,200 | 4,390.00 | 5,268,000  |
| 新晃工業          | 400   | 2,112.00 | 844,800    |
| 大和冷機工業        | 700   | 1,353.00 | 947,100    |
| セガサミーホールディングス | 4,100 | 1,397.00 | 5,727,700  |
| 日本ピストンリング     | 200   | 2,225.00 | 445,000    |
| リケン           | 200   | 6,590.00 | 1,318,000  |
| T P R         | 500   | 3,645.00 | 1,822,500  |
| ツバキ・ナカシマ      | 400   | 2,563.00 | 1,025,200  |
| ホシザキ          | 1,300 | 9,920.00 | 12,896,000 |
| 大豊工業          | 300   | 1,659.00 | 497,700    |
| 日本精工          | 8,600 | 1,655.00 | 14,233,000 |
| N T N         | 9,600 | 530.00   | 5,088,000  |
| ジェイテクト        | 4,400 | 1,854.00 | 8,157,600  |
| 不二越           | 4,000 | 697.00   | 2,788,000  |
| 日本トムソン        | 1,300 | 719.00   | 934,700    |
| T H K         | 2,600 | 4,000.00 | 10,400,000 |
| ユーシン精機        | 200   | 3,180.00 | 636,000    |
| 前澤給装工業        | 200   | 1,882.00 | 376,400    |
| イーグル工業        | 500   | 1,955.00 | 977,500    |
| 前澤工業          | 300   | 423.00   | 126,900    |
| 日本ピラー工業       | 400   | 1,679.00 | 671,600    |
| キッツ           | 1,900 | 808.00   | 1,535,200  |
| マキタ           | 5,400 | 4,655.00 | 25,137,000 |

|                   |         |           |            |
|-------------------|---------|-----------|------------|
| 日立造船              | 3,300   | 565.00    | 1,864,500  |
| 三菱重工業             | 7,000   | 4,199.00  | 29,393,000 |
| I H I             | 3,200   | 3,660.00  | 11,712,000 |
| スター精密             | 700     | 1,863.00  | 1,304,100  |
| 日清紡ホールディングス       | 2,500   | 1,521.00  | 3,802,500  |
| イビデン              | 2,500   | 1,706.00  | 4,265,000  |
| コニカミノルタ           | 9,700   | 1,058.00  | 10,262,600 |
| ブラザー工業            | 5,100   | 2,750.00  | 14,025,000 |
| ミネベアミツミ           | 7,700   | 2,271.00  | 17,486,700 |
| 日立製作所             | 100,000 | 823.30    | 82,330,000 |
| 三菱電機              | 41,600  | 1,803.00  | 75,004,800 |
| 富士電機              | 13,000  | 798.00    | 10,374,000 |
| 安川電機              | 4,800   | 4,800.00  | 23,040,000 |
| シンフォニアテクノロジー      | 3,000   | 424.00    | 1,272,000  |
| 明電舎               | 4,000   | 450.00    | 1,800,000  |
| 山洋電気              | 200     | 7,850.00  | 1,570,000  |
| デンヨー              | 400     | 1,925.00  | 770,000    |
| 東芝テック             | 3,000   | 715.00    | 2,145,000  |
| マブチモーター           | 1,200   | 5,890.00  | 7,068,000  |
| 日本電産              | 5,000   | 15,305.00 | 76,525,000 |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 200     | 2,582.00  | 516,400    |
| 東光高岳              | 200     | 1,826.00  | 365,200    |
| ダブル・スコープ          | 600     | 2,142.00  | 1,285,200  |
| ダイヘン              | 2,000   | 984.00    | 1,968,000  |
| ヤーマン              | 500     | 1,890.00  | 945,000    |
| JVCケンウッド          | 3,100   | 379.00    | 1,174,900  |
| ミマキエンジニアリング       | 400     | 1,008.00  | 403,200    |
| 第一精工              | 200     | 2,959.00  | 591,800    |
| 日新電機              | 1,000   | 1,325.00  | 1,325,000  |
| 大崎電気工業            | 900     | 815.00    | 733,500    |
| オムロン              | 4,400   | 6,550.00  | 28,820,000 |
| 日東工業              | 700     | 1,762.00  | 1,233,400  |
| I D E C           | 500     | 2,462.00  | 1,231,000  |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 7,000   | 546.00    | 3,822,000  |
| サクサホールディングス       | 100     | 2,037.00  | 203,700    |
| メルコホールディングス       | 200     | 3,890.00  | 778,000    |
| テクノメディカ           | 100     | 1,980.00  | 198,000    |
| 日本電気              | 5,400   | 3,135.00  | 16,929,000 |
| 富士通               | 43,000  | 807.00    | 34,701,000 |
| 沖電気工業             | 1,700   | 1,597.00  | 2,714,900  |
| 岩崎通信機             | 200     | 839.00    | 167,800    |
| 電気興業              | 200     | 3,065.00  | 613,000    |

|                  |        |           |             |                  |
|------------------|--------|-----------|-------------|------------------|
| サンケン電気           | 2,000  | 667.00    | 1,334,000   |                  |
| ナカヨ              | 100    | 1,985.00  | 198,500     |                  |
| アイホン             | 200    | 1,935.00  | 387,000     |                  |
| ルネサスエレクトロニクス     | 2,200  | 1,263.00  | 2,778,600   |                  |
| セイコーエプソン         | 6,200  | 2,618.00  | 16,231,600  |                  |
| ワコム              | 3,200  | 599.00    | 1,916,800   |                  |
| アルバック            | 700    | 7,240.00  | 5,068,000   |                  |
| E I Z O          | 400    | 5,470.00  | 2,188,000   |                  |
| ジャパンディスプレイ       | 8,600  | 245.00    | 2,107,000   |                  |
| 日本信号             | 1,100  | 1,179.00  | 1,296,900   |                  |
| 京三製作所            | 1,000  | 665.00    | 665,000     |                  |
| 能美防災             | 600    | 2,029.00  | 1,217,400   |                  |
| ホーチキ             | 300    | 2,471.00  | 741,300     |                  |
| エレコム             | 400    | 2,607.00  | 1,042,800   |                  |
| パナソニック           | 47,600 | 1,668.50  | 79,420,600  | 代用有価証券<br>7,500株 |
| アンリツ             | 3,000  | 1,216.00  | 3,648,000   |                  |
| 富士通ゼネラル          | 1,300  | 2,436.00  | 3,166,800   |                  |
| 日立国際電気           | 800    | 3,105.00  | 2,484,000   |                  |
| ソニー              | 27,800 | 5,006.00  | 139,166,800 | 代用有価証券<br>3,700株 |
| T D K            | 2,200  | 8,640.00  | 19,008,000  |                  |
| 帝国通信工業           | 200    | 1,268.00  | 253,600     |                  |
| タムラ製作所           | 1,600  | 749.00    | 1,198,400   |                  |
| アルプス電気           | 3,600  | 3,180.00  | 11,448,000  |                  |
| パイオニア            | 6,900  | 219.00    | 1,511,100   |                  |
| 日本電波工業           | 400    | 755.00    | 302,000     |                  |
| 鈴木               | 200    | 1,109.00  | 221,800     |                  |
| 日本トリム            | 100    | 4,960.00  | 496,000     |                  |
| ローランド ディー . ジー . | 200    | 3,075.00  | 615,000     |                  |
| フォスター電機          | 500    | 2,732.00  | 1,366,000   |                  |
| クラリオン            | 2,000  | 421.00    | 842,000     |                  |
| S M K            | 1,000  | 531.00    | 531,000     |                  |
| ヨコオ              | 300    | 1,496.00  | 448,800     |                  |
| ホシデン             | 1,100  | 1,640.00  | 1,804,000   |                  |
| ヒロセ電機            | 700    | 15,960.00 | 11,172,000  |                  |
| 日本航空電子工業         | 1,000  | 1,877.00  | 1,877,000   |                  |
| T O A            | 400    | 1,458.00  | 583,200     |                  |
| マクセルホールディングス     | 800    | 2,404.00  | 1,923,200   |                  |
| 古野電気             | 500    | 806.00    | 403,000     |                  |
| アルパイン            | 1,000  | 2,271.00  | 2,271,000   |                  |
| スミダコーポレーション      | 400    | 1,874.00  | 749,600     |                  |
| アイコム             | 200    | 2,738.00  | 547,600     |                  |



|                  |       |           |             |
|------------------|-------|-----------|-------------|
| リオン              | 200   | 2,261.00  | 452,200     |
| 本多通信工業           | 300   | 1,103.00  | 330,900     |
| 船井電機             | 400   | 862.00    | 344,800     |
| 横河電機             | 4,200 | 2,094.00  | 8,794,800   |
| 新電元工業            | 100   | 7,840.00  | 784,000     |
| アズビル             | 1,200 | 4,775.00  | 5,730,000   |
| 東亜ディーケーケー        | 200   | 981.00    | 196,200     |
| 日本光電工業           | 1,700 | 2,543.00  | 4,323,100   |
| チノー              | 100   | 1,665.00  | 166,500     |
| 共和電業             | 500   | 461.00    | 230,500     |
| 日本電子材料           | 200   | 584.00    | 116,800     |
| 堀場製作所            | 800   | 6,740.00  | 5,392,000   |
| アドバンテスト          | 2,300 | 2,127.00  | 4,892,100   |
| エスベック            | 400   | 2,682.00  | 1,072,800   |
| キーエンス            | 2,000 | 63,320.00 | 126,640,000 |
| 日置電機             | 200   | 2,901.00  | 580,200     |
| シスメックス           | 3,200 | 8,640.00  | 27,648,000  |
| 日本マイクロニクス        | 700   | 1,143.00  | 800,100     |
| メガチップス           | 300   | 3,220.00  | 966,000     |
| OBARA GROUP      | 200   | 7,630.00  | 1,526,000   |
| コーセル             | 600   | 1,772.00  | 1,063,200   |
| イリソ電子工業          | 300   | 6,770.00  | 2,031,000   |
| オブテックスグループ       | 300   | 5,790.00  | 1,737,000   |
| 千代田インテグレ         | 200   | 2,763.00  | 552,600     |
| アイ・オー・データ機器      | 200   | 1,018.00  | 203,600     |
| レーザーテック          | 900   | 2,788.00  | 2,509,200   |
| スタンレー電気          | 3,200 | 4,575.00  | 14,640,000  |
| 岩崎電気             | 200   | 1,663.00  | 332,600     |
| ウシオ電機            | 2,500 | 1,595.00  | 3,987,500   |
| 岡谷電機産業           | 200   | 540.00    | 108,000     |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 400   | 1,016.00  | 406,400     |
| 日本セラミック          | 400   | 2,899.00  | 1,159,600   |
| 古河電池             | 300   | 1,075.00  | 322,500     |
| 山一電機             | 300   | 2,017.00  | 605,100     |
| 図研               | 300   | 1,884.00  | 565,200     |
| 日本電子             | 2,000 | 621.00    | 1,242,000   |
| カシオ計算機           | 3,300 | 1,601.00  | 5,283,300   |
| ファナック            | 4,000 | 26,170.00 | 104,680,000 |
| 日本シイエムケイ         | 700   | 982.00    | 687,400     |
| エンプラス            | 200   | 4,505.00  | 901,000     |
| ローム              | 1,900 | 11,650.00 | 22,135,000  |
| 浜松ホトニクス          | 3,000 | 3,730.00  | 11,190,000  |

|                     |        |           |             |                  |
|---------------------|--------|-----------|-------------|------------------|
| 三井ハイテック             | 500    | 1,967.00  | 983,500     |                  |
| 新光電気工業              | 1,600  | 873.00    | 1,396,800   |                  |
| 京セラ                 | 6,800  | 7,422.00  | 50,469,600  |                  |
| 太陽誘電                | 1,900  | 1,691.00  | 3,212,900   |                  |
| 村田製作所               | 4,400  | 14,565.00 | 64,086,000  |                  |
| 双葉電子工業              | 700    | 2,334.00  | 1,633,800   |                  |
| ニチコン                | 1,300  | 1,448.00  | 1,882,400   |                  |
| 日本ケミコン              | 300    | 3,525.00  | 1,057,500   |                  |
| K O A               | 600    | 2,147.00  | 1,288,200   |                  |
| 市光工業                | 600    | 995.00    | 597,000     |                  |
| 小糸製作所               | 2,500  | 7,540.00  | 18,850,000  |                  |
| ミツバ                 | 800    | 1,591.00  | 1,272,800   |                  |
| S C R E E Nホールディングス | 800    | 9,580.00  | 7,664,000   |                  |
| キャノン電子              | 400    | 2,469.00  | 987,600     |                  |
| キャノン                | 22,400 | 4,312.00  | 96,588,800  | 代用有価証券<br>4,100株 |
| リコー                 | 12,500 | 1,012.00  | 12,650,000  |                  |
| M U T O Hホールディングス   | 100    | 2,499.00  | 249,900     |                  |
| 東京エレクトロン            | 2,800  | 20,955.00 | 58,674,000  |                  |
| トヨタ紡織               | 1,200  | 2,255.00  | 2,706,000   |                  |
| ユニプレス               | 800    | 2,850.00  | 2,280,000   |                  |
| 豊田自動織機              | 3,400  | 6,990.00  | 23,766,000  |                  |
| モリタホールディングス         | 700    | 2,018.00  | 1,412,600   |                  |
| 三櫻工業                | 500    | 874.00    | 437,000     |                  |
| デンソー                | 9,200  | 6,364.00  | 58,548,800  |                  |
| 東海理化電機製作所           | 1,100  | 2,256.00  | 2,481,600   |                  |
| 三井造船                | 1,500  | 1,618.00  | 2,427,000   |                  |
| 川崎重工業               | 3,200  | 3,565.00  | 11,408,000  |                  |
| 名村造船所               | 1,200  | 666.00    | 799,200     |                  |
| 三菱ロジスネクスト           | 500    | 921.00    | 460,500     |                  |
| 日産自動車               | 49,100 | 1,096.50  | 53,838,150  |                  |
| いすゞ自動車              | 12,100 | 1,770.00  | 21,417,000  |                  |
| トヨタ自動車              | 50,600 | 6,966.00  | 352,479,600 | 代用有価証券<br>9,000株 |
| 日野自動車               | 5,900  | 1,414.00  | 8,342,600   |                  |
| 三菱自動車工業             | 15,400 | 794.00    | 12,227,600  |                  |
| エフテック               | 300    | 1,650.00  | 495,000     |                  |
| ファルテック              | 100    | 1,435.00  | 143,500     |                  |
| 武蔵精密工業              | 400    | 3,400.00  | 1,360,000   |                  |
| 日産車体                | 1,600  | 1,147.00  | 1,835,200   |                  |
| 新明和工業               | 1,800  | 1,037.00  | 1,866,600   |                  |
| 極東開発工業              | 800    | 1,974.00  | 1,579,200   |                  |
| 日信工業                | 800    | 2,143.00  | 1,714,400   |                  |

|            |        |           |             |                  |
|------------|--------|-----------|-------------|------------------|
| トピー工業      | 300    | 3,395.00  | 1,018,500   |                  |
| ティラド       | 200    | 3,905.00  | 781,000     |                  |
| 曙ブレーキ工業    | 1,900  | 309.00    | 587,100     |                  |
| タチエス       | 700    | 2,025.00  | 1,417,500   |                  |
| NOK        | 2,200  | 2,595.00  | 5,709,000   |                  |
| フタバ産業      | 1,300  | 1,022.00  | 1,328,600   |                  |
| KYB        | 400    | 6,430.00  | 2,572,000   |                  |
| 大同メタル工業    | 500    | 1,057.00  | 528,500     |                  |
| プレス工業      | 2,200  | 666.00    | 1,465,200   |                  |
| ミクニ        | 500    | 774.00    | 387,000     |                  |
| 太平洋工業      | 900    | 1,673.00  | 1,505,700   |                  |
| ケーヒン       | 1,000  | 2,181.00  | 2,181,000   |                  |
| 河西工業       | 500    | 1,737.00  | 868,500     |                  |
| アイシン精機     | 3,400  | 5,920.00  | 20,128,000  |                  |
| マツダ        | 13,100 | 1,500.50  | 19,656,550  |                  |
| 今仙電機製作所    | 400    | 1,337.00  | 534,800     |                  |
| 本田技研工業     | 37,500 | 3,782.00  | 141,825,000 | 代用有価証券<br>6,000株 |
| スズキ        | 8,300  | 6,320.00  | 52,456,000  |                  |
| SUBARU     | 12,900 | 3,672.00  | 47,368,800  |                  |
| 安永         | 200    | 2,652.00  | 530,400     |                  |
| ヤマハ発動機     | 5,900  | 3,525.00  | 20,797,500  |                  |
| ショーワ       | 1,100  | 1,281.00  | 1,409,100   |                  |
| TBK        | 500    | 535.00    | 267,500     |                  |
| エクセディ      | 500    | 3,390.00  | 1,695,000   |                  |
| 豊田合成       | 1,500  | 2,804.00  | 4,206,000   |                  |
| 愛三工業       | 700    | 1,251.00  | 875,700     |                  |
| 盟和産業       | 100    | 1,309.00  | 130,900     |                  |
| ヨロズ        | 400    | 2,490.00  | 996,000     |                  |
| エフ・シー・シー   | 700    | 2,921.00  | 2,044,700   |                  |
| シマノ        | 1,700  | 15,350.00 | 26,095,000  |                  |
| テイ・エス テック  | 1,000  | 4,515.00  | 4,515,000   |                  |
| ジャムコ       | 200    | 2,799.00  | 559,800     |                  |
| テルモ        | 6,400  | 5,280.00  | 33,792,000  |                  |
| クリエートメディック | 100    | 1,313.00  | 131,300     |                  |
| 日機装        | 1,400  | 1,056.00  | 1,478,400   |                  |
| 島津製作所      | 5,000  | 2,536.00  | 12,680,000  |                  |
| JMS        | 400    | 629.00    | 251,600     |                  |
| 長野計器       | 300    | 1,294.00  | 388,200     |                  |
| ブイ・テクノロジー  | 100    | 18,250.00 | 1,825,000   |                  |
| 東京計器       | 300    | 1,346.00  | 403,800     |                  |
| 愛知時計電機     | 100    | 4,415.00  | 441,500     |                  |
| オーバル       | 400    | 305.00    | 122,000     |                  |

|                   |        |          |            |
|-------------------|--------|----------|------------|
| 東京精密              | 800    | 4,495.00 | 3,596,000  |
| マニー               | 500    | 3,210.00 | 1,605,000  |
| ニコン               | 7,300  | 2,249.00 | 16,417,700 |
| トプコン              | 2,200  | 2,353.00 | 5,176,600  |
| オリンパス             | 6,200  | 4,220.00 | 26,164,000 |
| 理研計器              | 400    | 2,487.00 | 994,800    |
| タムロン              | 300    | 2,424.00 | 727,200    |
| HOYA              | 8,600  | 5,536.00 | 47,609,600 |
| ノーリツ鋼機            | 400    | 2,345.00 | 938,000    |
| シチズン時計            | 5,000  | 821.00   | 4,105,000  |
| リズム時計工業           | 200    | 2,328.00 | 465,600    |
| 大研医器              | 400    | 767.00   | 306,800    |
| メニコン              | 300    | 6,390.00 | 1,917,000  |
| 松風                | 200    | 1,476.00 | 295,200    |
| セイコーホールディングス      | 600    | 3,305.00 | 1,983,000  |
| ニプロ               | 2,900  | 1,541.00 | 4,468,900  |
| パラマウントベッドホールディングス | 400    | 5,370.00 | 2,148,000  |
| トランザクション          | 200    | 1,023.00 | 204,600    |
| ニホンフラッシュ          | 200    | 2,781.00 | 556,200    |
| 前田工織              | 400    | 2,026.00 | 810,400    |
| 永大産業              | 1,000  | 572.00   | 572,000    |
| アートネイチャー          | 400    | 798.00   | 319,200    |
| ダンロップスポーツ         | 300    | 1,580.00 | 474,000    |
| バンダイナムコホールディングス   | 4,300  | 3,715.00 | 15,974,500 |
| 共立印刷              | 700    | 370.00   | 259,000    |
| SHOEI             | 200    | 4,565.00 | 913,000    |
| フランスベッドホールディングス   | 500    | 1,012.00 | 506,000    |
| パイロットコーポレーション     | 700    | 5,400.00 | 3,780,000  |
| 萩原工業              | 200    | 1,947.00 | 389,400    |
| トッパン・フォームズ        | 900    | 1,224.00 | 1,101,600  |
| フジシールインターナショナル    | 900    | 3,760.00 | 3,384,000  |
| タカラトミー            | 1,700  | 1,517.00 | 2,578,900  |
| 廣濟堂               | 400    | 412.00   | 164,800    |
| As-me エステール       | 100    | 1,111.00 | 111,100    |
| タカノ               | 200    | 1,159.00 | 231,800    |
| プロネクサス            | 400    | 1,458.00 | 583,200    |
| ウッドワン             | 100    | 1,563.00 | 156,300    |
| 大建工業              | 300    | 2,912.00 | 873,600    |
| 凸版印刷              | 12,000 | 1,016.00 | 12,192,000 |
| 大日本印刷             | 5,500  | 2,473.00 | 13,601,500 |
| 図書印刷              | 300    | 983.00   | 294,900    |
| 共同印刷              | 100    | 3,680.00 | 368,000    |

|                |        |           |             |
|----------------|--------|-----------|-------------|
| N I S S H A    | 800    | 3,375.00  | 2,700,000   |
| 宝印刷            | 200    | 1,735.00  | 347,000     |
| アシックス          | 4,100  | 1,730.00  | 7,093,000   |
| ツツミ            | 100    | 2,131.00  | 213,100     |
| 小松ウオール工業       | 100    | 2,405.00  | 240,500     |
| ヤマハ            | 2,800  | 4,045.00  | 11,326,000  |
| 河合楽器製作所        | 100    | 2,594.00  | 259,400     |
| クリナップ          | 400    | 877.00    | 350,800     |
| ピジョン           | 2,500  | 4,365.00  | 10,912,500  |
| キングジム          | 300    | 1,002.00  | 300,600     |
| リンテック          | 1,000  | 3,015.00  | 3,015,000   |
| イトーキ           | 900    | 827.00    | 744,300     |
| 任天堂            | 2,600  | 43,030.00 | 111,878,000 |
| 三菱鉛筆           | 700    | 2,424.00  | 1,696,800   |
| タカラスタANDARD    | 900    | 1,782.00  | 1,603,800   |
| コクヨ            | 2,000  | 2,079.00  | 4,158,000   |
| ナカバヤシ          | 400    | 715.00    | 286,000     |
| グローブライド        | 200    | 1,993.00  | 398,600     |
| 岡村製作所          | 1,500  | 1,519.00  | 2,278,500   |
| 美津濃            | 400    | 3,325.00  | 1,330,000   |
| 東京電力ホールディングス   | 33,200 | 445.00    | 14,774,000  |
| 中部電力           | 12,700 | 1,379.50  | 17,519,650  |
| 関西電力           | 17,000 | 1,404.00  | 23,868,000  |
| 中国電力           | 5,800  | 1,206.00  | 6,994,800   |
| 北陸電力           | 4,100  | 941.00    | 3,858,100   |
| 東北電力           | 9,800  | 1,455.00  | 14,259,000  |
| 四国電力           | 3,700  | 1,292.00  | 4,780,400   |
| 九州電力           | 9,200  | 1,190.00  | 10,948,000  |
| 北海道電力          | 4,200  | 766.00    | 3,217,200   |
| 沖縄電力           | 700    | 2,866.00  | 2,006,200   |
| 電源開発           | 3,300  | 3,090.00  | 10,197,000  |
| エフオン           | 200    | 1,452.00  | 290,400     |
| イーレックス         | 700    | 1,036.00  | 725,200     |
| 東京瓦斯           | 8,900  | 2,560.00  | 22,784,000  |
| 大阪瓦斯           | 8,100  | 2,189.50  | 17,734,950  |
| 東邦瓦斯           | 2,100  | 3,080.00  | 6,468,000   |
| 北海道瓦斯          | 1,000  | 294.00    | 294,000     |
| 広島ガス           | 900    | 368.00    | 331,200     |
| 西部瓦斯           | 500    | 2,677.00  | 1,338,500   |
| 静岡ガス           | 1,200  | 945.00    | 1,134,000   |
| メタウォーター        | 200    | 2,765.00  | 553,000     |
| S B S ホールディングス | 400    | 1,038.00  | 415,200     |

|                  |        |           |            |
|------------------|--------|-----------|------------|
| 東武鉄道             | 4,500  | 3,745.00  | 16,852,500 |
| 相鉄ホールディングス       | 1,300  | 2,973.00  | 3,864,900  |
| 東京急行電鉄           | 11,300 | 1,834.00  | 20,724,200 |
| 京浜急行電鉄           | 5,700  | 2,187.00  | 12,465,900 |
| 小田急電鉄            | 6,200  | 2,457.00  | 15,233,400 |
| 京王電鉄             | 2,300  | 5,100.00  | 11,730,000 |
| 京成電鉄             | 2,900  | 3,685.00  | 10,686,500 |
| 富士急行             | 600    | 3,270.00  | 1,962,000  |
| 新京成電鉄            | 100    | 2,151.00  | 215,100    |
| 東日本旅客鉄道          | 7,500  | 11,150.00 | 83,625,000 |
| 西日本旅客鉄道          | 3,800  | 8,332.00  | 31,661,600 |
| 東海旅客鉄道           | 3,700  | 20,885.00 | 77,274,500 |
| 西武ホールディングス       | 5,300  | 2,121.00  | 11,241,300 |
| 鴻池運輸             | 600    | 1,896.00  | 1,137,600  |
| 西日本鉄道            | 1,200  | 3,040.00  | 3,648,000  |
| ハマキョウレックス        | 300    | 3,080.00  | 924,000    |
| サカイ引越センター        | 200    | 5,540.00  | 1,108,000  |
| 近鉄グループホールディングス   | 3,900  | 4,425.00  | 17,257,500 |
| 阪急阪神ホールディングス     | 5,300  | 4,625.00  | 24,512,500 |
| 南海電気鉄道           | 1,900  | 2,827.00  | 5,371,300  |
| 京阪ホールディングス       | 1,800  | 3,380.00  | 6,084,000  |
| 名古屋鉄道            | 3,000  | 2,830.00  | 8,490,000  |
| 山陽電気鉄道           | 300    | 2,811.00  | 843,300    |
| 日本通運             | 1,500  | 7,300.00  | 10,950,000 |
| ヤマトホールディングス      | 6,900  | 2,318.00  | 15,994,200 |
| 山九               | 1,000  | 4,840.00  | 4,840,000  |
| 丸運               | 200    | 332.00    | 66,400     |
| 丸全昭和運輸           | 1,000  | 524.00    | 524,000    |
| センコーグループホールディングス | 2,400  | 797.00    | 1,912,800  |
| トナミホールディングス      | 100    | 5,640.00  | 564,000    |
| ニッコンホールディングス     | 1,500  | 3,050.00  | 4,575,000  |
| 福山通運             | 600    | 4,195.00  | 2,517,000  |
| セイノーホールディングス     | 3,000  | 1,784.00  | 5,352,000  |
| 神奈川中央交通          | 100    | 3,620.00  | 362,000    |
| 日立物流             | 900    | 2,939.00  | 2,645,100  |
| 丸和運輸機関           | 200    | 3,490.00  | 698,000    |
| C & F ロジホールディングス | 400    | 1,607.00  | 642,800    |
| 九州旅客鉄道           | 3,300  | 3,575.00  | 11,797,500 |
| 日本郵船             | 3,300  | 2,715.00  | 8,959,500  |
| 商船三井             | 2,500  | 3,605.00  | 9,012,500  |
| 川崎汽船             | 1,800  | 2,850.00  | 5,130,000  |
| N S ユナイテッド海運     | 200    | 2,872.00  | 574,400    |

|                        |       |          |            |
|------------------------|-------|----------|------------|
| 飯野海運                   | 2,000 | 598.00   | 1,196,000  |
| 日本航空                   | 7,300 | 4,292.00 | 31,331,600 |
| ANAホールディングス            | 7,700 | 4,635.00 | 35,689,500 |
| ランコム                   | 100   | 7,940.00 | 794,000    |
| 日新                     | 300   | 3,255.00 | 976,500    |
| 三菱倉庫                   | 1,400 | 2,964.00 | 4,149,600  |
| 三井倉庫ホールディングス           | 2,000 | 370.00   | 740,000    |
| 住友倉庫                   | 3,000 | 806.00   | 2,418,000  |
| 澁澤倉庫                   | 200   | 2,048.00 | 409,600    |
| 東陽倉庫                   | 700   | 335.00   | 234,500    |
| 日本トランスシティ              | 1,000 | 476.00   | 476,000    |
| 中央倉庫                   | 200   | 1,197.00 | 239,400    |
| 川西倉庫                   | 100   | 2,684.00 | 268,400    |
| 安田倉庫                   | 400   | 929.00   | 371,600    |
| 宇徳                     | 300   | 544.00   | 163,200    |
| 上組                     | 2,500 | 2,550.00 | 6,375,000  |
| キムラユニティー               | 100   | 1,184.00 | 118,400    |
| キューソー流通システム            | 100   | 3,130.00 | 313,000    |
| 近鉄エクスプレス               | 700   | 2,313.00 | 1,619,100  |
| 東海運                    | 200   | 411.00   | 82,200     |
| エーアイティー                | 300   | 1,358.00 | 407,400    |
| 内外トランスライン              | 100   | 1,987.00 | 198,700    |
| 日本コンセプト                | 100   | 1,304.00 | 130,400    |
| NEC ネットエスアイ            | 500   | 2,931.00 | 1,465,500  |
| システナ                   | 300   | 3,590.00 | 1,077,000  |
| デジタルアーツ                | 200   | 4,740.00 | 948,000    |
| 新日鉄住金ソリューションズ          | 600   | 2,903.00 | 1,741,800  |
| キューブシステム               | 200   | 815.00   | 163,000    |
| コア                     | 200   | 1,558.00 | 311,600    |
| ソフトクリエイティブホールディングス     | 200   | 1,549.00 | 309,800    |
| T I S                  | 1,400 | 3,995.00 | 5,593,000  |
| 電算システム                 | 100   | 2,170.00 | 217,000    |
| グリー                    | 2,500 | 738.00   | 1,845,000  |
| コーエーテクモホールディングス        | 700   | 2,345.00 | 1,641,500  |
| 三菱総合研究所                | 200   | 3,655.00 | 731,000    |
| A G S                  | 200   | 887.00   | 177,400    |
| ヒト・コミュニケーションズ          | 100   | 2,448.00 | 244,800    |
| K L a b                | 800   | 1,845.00 | 1,476,000  |
| ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 300   | 2,046.00 | 613,800    |
| ネクソン                   | 4,600 | 3,200.00 | 14,720,000 |
| アイスタイル                 | 900   | 900.00   | 810,000    |
| エイチーム                  | 300   | 3,110.00 | 933,000    |

|                      |        |           |            |
|----------------------|--------|-----------|------------|
| テクノスジャパン             | 400    | 962.00    | 384,800    |
| コロプラ                 | 1,300  | 1,260.00  | 1,638,000  |
| ブロードリーフ              | 1,000  | 1,143.00  | 1,143,000  |
| ハーツユナイテッドグループ        | 200    | 1,777.00  | 355,400    |
| ベリサーブ                | 100    | 3,880.00  | 388,000    |
| ティーガイア               | 400    | 2,656.00  | 1,062,400  |
| 豆蔵ホールディングス           | 300    | 1,283.00  | 384,900    |
| テクマトリックス             | 200    | 1,810.00  | 362,000    |
| プロシップ                | 100    | 2,269.00  | 226,900    |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 11,100 | 316.00    | 3,507,600  |
| GMOペイメントゲートウェイ       | 300    | 9,040.00  | 2,712,000  |
| インターネットイニシアティブ       | 700    | 2,036.00  | 1,425,200  |
| GMOクラウド              | 100    | 2,444.00  | 244,400    |
| SRAホールディングス          | 200    | 3,615.00  | 723,000    |
| Minor iソリューションズ      | 100    | 1,490.00  | 149,000    |
| 朝日ネット                | 400    | 523.00    | 209,200    |
| コムチュア                | 200    | 2,839.00  | 567,800    |
| gumi                 | 500    | 1,122.00  | 561,000    |
| オープンドア               | 100    | 5,940.00  | 594,000    |
| アカツキ                 | 100    | 7,210.00  | 721,000    |
| LINE                 | 1,200  | 4,755.00  | 5,706,000  |
| オークネット               | 100    | 1,457.00  | 145,700    |
| AOI TYO Holdings     | 300    | 1,265.00  | 379,500    |
| マクロミル                | 500    | 2,635.00  | 1,317,500  |
| フェイス                 | 100    | 1,359.00  | 135,900    |
| ハイマックス               | 100    | 1,756.00  | 175,600    |
| 野村総合研究所              | 2,700  | 5,250.00  | 14,175,000 |
| サイバネットシステム           | 300    | 716.00    | 214,800    |
| インテージホールディングス        | 500    | 1,429.00  | 714,500    |
| 東邦システムサイエンス          | 100    | 805.00    | 80,500     |
| クレスコ                 | 100    | 4,610.00  | 461,000    |
| フジ・メディア・ホールディングス     | 4,300  | 1,741.00  | 7,486,300  |
| オービック                | 1,300  | 8,060.00  | 10,478,000 |
| ジャストシステム             | 700    | 2,235.00  | 1,564,500  |
| TDCソフト               | 200    | 1,112.00  | 222,400    |
| ヤフー                  | 29,500 | 507.00    | 14,956,500 |
| トレンドマイクロ             | 2,000  | 6,420.00  | 12,840,000 |
| インフォメーション・ディベロプメント   | 100    | 1,335.00  | 133,500    |
| 日本オラクル               | 700    | 10,230.00 | 7,161,000  |
| アルファシステムズ            | 100    | 2,420.00  | 242,000    |
| フューチャー               | 600    | 1,281.00  | 768,600    |
| CAC Holdings         | 300    | 1,082.00  | 324,600    |



|                     |        |           |             |
|---------------------|--------|-----------|-------------|
| ソフトバンク・テクノロジー       | 200    | 1,844.00  | 368,800     |
| トーセ                 | 100    | 2,156.00  | 215,600     |
| オービックビジネスコンサルタント    | 200    | 6,210.00  | 1,242,000   |
| 伊藤忠テクノソリューションズ      | 900    | 4,865.00  | 4,378,500   |
| アイティフォー             | 500    | 793.00    | 396,500     |
| 東計電算                | 100    | 3,375.00  | 337,500     |
| 大塚商会                | 1,200  | 8,670.00  | 10,404,000  |
| サイボウズ               | 500    | 505.00    | 252,500     |
| 電通国際情報サービス          | 300    | 2,555.00  | 766,500     |
| デジタルガレージ            | 700    | 3,170.00  | 2,219,000   |
| EMシステムズ             | 100    | 2,488.00  | 248,800     |
| ウェザーニューズ            | 100    | 3,365.00  | 336,500     |
| C I J               | 300    | 713.00    | 213,900     |
| WOWOW               | 200    | 3,325.00  | 665,000     |
| イマジカ・ロボット ホールディングス  | 300    | 1,107.00  | 332,100     |
| ネットワンシステムズ          | 1,700  | 1,710.00  | 2,907,000   |
| アルゴグラフィックス          | 200    | 3,435.00  | 687,000     |
| マーベラス               | 700    | 1,054.00  | 737,800     |
| エイベックス              | 800    | 1,637.00  | 1,309,600   |
| 日本ユニシス              | 1,100  | 2,236.00  | 2,459,600   |
| 兼松エレクトロニクス          | 300    | 3,325.00  | 997,500     |
| 東京放送ホールディングス        | 2,500  | 2,783.00  | 6,957,500   |
| 日本テレビホールディングス       | 3,800  | 2,004.00  | 7,615,200   |
| 朝日放送                | 400    | 888.00    | 355,200     |
| テレビ朝日ホールディングス       | 1,100  | 2,314.00  | 2,545,400   |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 3,100  | 498.00    | 1,543,800   |
| テレビ東京ホールディングス       | 300    | 2,430.00  | 729,000     |
| 日本BS放送              | 100    | 1,270.00  | 127,000     |
| ビジョン                | 100    | 2,613.00  | 261,300     |
| コネクシオ               | 300    | 2,365.00  | 709,500     |
| 日本通信                | 3,700  | 114.00    | 421,800     |
| 日本電信電話              | 29,300 | 5,351.00  | 156,784,300 |
| K D D I             | 36,800 | 2,922.00  | 107,529,600 |
| 光通信                 | 500    | 15,750.00 | 7,875,000   |
| N T T ドコモ           | 30,300 | 2,686.00  | 81,385,800  |
| エムティーアイ             | 600    | 649.00    | 389,400     |
| G M O インターネット       | 1,500  | 2,031.00  | 3,046,500   |
| カドカワ                | 1,200  | 1,411.00  | 1,693,200   |
| 学研ホールディングス          | 100    | 4,595.00  | 459,500     |
| ゼンリン                | 500    | 3,760.00  | 1,880,000   |
| アイネット               | 200    | 1,703.00  | 340,600     |
| 松竹                  | 300    | 19,140.00 | 5,742,000   |

|                      |        |           |             |
|----------------------|--------|-----------|-------------|
| 東宝                   | 2,700  | 3,900.00  | 10,530,000  |
| 東映                   | 200    | 11,860.00 | 2,372,000   |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 12,700 | 1,314.00  | 16,687,800  |
| ピー・シー・エー             | 100    | 1,742.00  | 174,200     |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 100    | 1,790.00  | 179,000     |
| D T S                | 400    | 3,605.00  | 1,442,000   |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 1,900  | 5,520.00  | 10,488,000  |
| シーイーシー               | 200    | 2,909.00  | 581,800     |
| カプコン                 | 900    | 3,500.00  | 3,150,000   |
| ジャステック               | 200    | 1,270.00  | 254,000     |
| S C S K              | 1,000  | 5,280.00  | 5,280,000   |
| 日本システムウエア            | 100    | 2,567.00  | 256,700     |
| アイネス                 | 500    | 1,124.00  | 562,000     |
| T K C                | 400    | 4,090.00  | 1,636,000   |
| 富士ソフト                | 600    | 3,600.00  | 2,160,000   |
| N S D                | 700    | 2,401.00  | 1,680,700   |
| コナミホールディングス          | 1,700  | 6,400.00  | 10,880,000  |
| 福井コンピュータホールディングス     | 100    | 3,405.00  | 340,500     |
| J B C Cホールディングス      | 300    | 1,151.00  | 345,300     |
| ミロク情報サービス            | 400    | 2,979.00  | 1,191,600   |
| ソフトバンクグループ           | 18,500 | 8,931.00  | 165,223,500 |
| 高千穂交易                | 200    | 1,162.00  | 232,400     |
| 伊藤忠食品                | 100    | 6,190.00  | 619,000     |
| エレマテック               | 200    | 2,668.00  | 533,600     |
| J A L U X            | 100    | 2,823.00  | 282,300     |
| あらた                  | 200    | 6,280.00  | 1,256,000   |
| トーメンデバイス             | 100    | 3,500.00  | 350,000     |
| 東京エレクトロン デバイス        | 100    | 1,989.00  | 198,900     |
| フィールズ                | 300    | 1,260.00  | 378,000     |
| 双日                   | 24,300 | 323.00    | 7,848,900   |
| アルフレッサ ホールディングス      | 4,600  | 2,599.00  | 11,955,400  |
| 横浜冷凍                 | 1,000  | 1,164.00  | 1,164,000   |
| ラサ商事                 | 200    | 930.00    | 186,000     |
| アルコニックス              | 400    | 2,165.00  | 866,000     |
| 神戸物産                 | 300    | 5,190.00  | 1,557,000   |
| ペッパーフードサービス          | 200    | 5,880.00  | 1,176,000   |
| あい ホールディングス          | 600    | 2,721.00  | 1,632,600   |
| ディーブイエックス            | 100    | 1,374.00  | 137,400     |
| ダイワボウホールディングス        | 300    | 4,700.00  | 1,410,000   |
| マクニカ・富士エレホールディングス    | 800    | 2,436.00  | 1,948,800   |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス  | 800    | 1,006.00  | 804,800     |
| 八洲電機                 | 300    | 1,010.00  | 303,000     |

|                   |       |          |           |
|-------------------|-------|----------|-----------|
| U K Cホールディングス     | 300   | 2,143.00 | 642,900   |
| O C H Iホールディングス   | 100   | 1,492.00 | 149,200   |
| T O K A Iホールディングス | 2,200 | 891.00   | 1,960,200 |
| 三洋貿易              | 200   | 2,700.00 | 540,000   |
| ウイン・パートナーズ        | 300   | 1,375.00 | 412,500   |
| シップヘルスケアホールディングス  | 900   | 3,595.00 | 3,235,500 |
| 明治電機工業            | 100   | 1,782.00 | 178,200   |
| デリカフーズホールディングス    | 100   | 1,521.00 | 152,100   |
| コメダホールディングス       | 800   | 1,983.00 | 1,586,400 |
| 富士興産              | 200   | 582.00   | 116,400   |
| 小野建               | 400   | 2,011.00 | 804,400   |
| 佐島電機              | 300   | 1,016.00 | 304,800   |
| 伯東                | 200   | 1,867.00 | 373,400   |
| コンドーテック           | 300   | 1,057.00 | 317,100   |
| 中山福               | 200   | 788.00   | 157,600   |
| ナガイレーベン           | 500   | 2,669.00 | 1,334,500 |
| 三菱食品              | 500   | 3,400.00 | 1,700,000 |
| 松田産業              | 300   | 1,869.00 | 560,700   |
| 第一興商              | 600   | 5,410.00 | 3,246,000 |
| メディバルホールディングス     | 4,100 | 2,201.00 | 9,024,100 |
| S P K             | 100   | 3,220.00 | 322,000   |
| 萩原電気              | 100   | 3,270.00 | 327,000   |
| アズワン              | 300   | 6,770.00 | 2,031,000 |
| スズデン              | 100   | 1,610.00 | 161,000   |
| 尾家産業              | 100   | 1,341.00 | 134,100   |
| シモジマ              | 300   | 1,265.00 | 379,500   |
| ドウシシャ             | 400   | 2,313.00 | 925,200   |
| 小津産業              | 100   | 2,167.00 | 216,700   |
| 高速                | 200   | 1,233.00 | 246,600   |
| たけびし              | 100   | 1,924.00 | 192,400   |
| 黒田電気              | 500   | 2,701.00 | 1,350,500 |
| リックス              | 100   | 1,856.00 | 185,600   |
| 丸文                | 400   | 1,085.00 | 434,000   |
| ハピネット             | 300   | 1,960.00 | 588,000   |
| 橋本総業ホールディングス      | 100   | 1,750.00 | 175,000   |
| 日本ライフライン          | 600   | 4,515.00 | 2,709,000 |
| エクセル              | 200   | 2,603.00 | 520,600   |
| マルカキカイ            | 100   | 2,149.00 | 214,900   |
| I D O M           | 1,200 | 815.00   | 978,000   |
| 日本エム・ディ・エム        | 300   | 892.00   | 267,600   |
| 進和                | 200   | 2,629.00 | 525,800   |
| ダイトロン             | 200   | 2,439.00 | 487,800   |

|                 |        |          |            |                  |
|-----------------|--------|----------|------------|------------------|
| シークス            | 300    | 4,710.00 | 1,413,000  |                  |
| 田中商事            | 100    | 792.00   | 79,200     |                  |
| オーハシテクニカ        | 200    | 1,734.00 | 346,800    |                  |
| 白銅              | 100    | 2,283.00 | 228,300    |                  |
| 伊藤忠商事           | 30,100 | 1,913.50 | 57,596,350 |                  |
| 丸紅              | 33,700 | 759.90   | 25,608,630 |                  |
| 長瀬産業            | 2,500  | 2,006.00 | 5,015,000  |                  |
| 蝶理              | 300    | 2,119.00 | 635,700    |                  |
| 豊田通商            | 4,600  | 4,270.00 | 19,642,000 |                  |
| 三共生興            | 700    | 487.00   | 340,900    |                  |
| 兼松              | 1,700  | 1,475.00 | 2,507,500  |                  |
| 三井物産            | 34,800 | 1,719.50 | 59,838,600 |                  |
| 日本紙パルプ商事        | 200    | 4,115.00 | 823,000    |                  |
| 日立ハイテクノロジーズ     | 1,400  | 4,540.00 | 6,356,000  |                  |
| カメイ             | 500    | 1,857.00 | 928,500    |                  |
| 東都水産            | 100    | 2,036.00 | 203,600    |                  |
| OUGホールディングス     | 100    | 2,714.00 | 271,400    |                  |
| スターゼン           | 200    | 5,590.00 | 1,118,000  |                  |
| 山善              | 1,600  | 1,311.00 | 2,097,600  |                  |
| 椿本興業            | 100    | 2,776.00 | 277,600    |                  |
| 住友商事            | 25,900 | 1,807.50 | 46,814,250 |                  |
| 内田洋行            | 200    | 3,230.00 | 646,000    |                  |
| 三菱商事            | 28,800 | 2,888.00 | 83,174,400 | 代用有価証券<br>5,200株 |
| 第一実業            | 200    | 3,325.00 | 665,000    |                  |
| キャノンマーケティングジャパン | 1,200  | 3,000.00 | 3,600,000  |                  |
| 西華産業            | 300    | 2,833.00 | 849,900    |                  |
| 佐藤商事            | 400    | 1,242.00 | 496,800    |                  |
| 菱洋エレクトロ         | 400    | 1,976.00 | 790,400    |                  |
| 東京産業            | 400    | 521.00   | 208,400    |                  |
| ユアサ商事           | 400    | 4,000.00 | 1,600,000  |                  |
| 小林産業            | 300    | 391.00   | 117,300    |                  |
| 阪和興業            | 800    | 4,620.00 | 3,696,000  |                  |
| 正栄食品工業          | 200    | 5,370.00 | 1,074,000  |                  |
| カナデン            | 400    | 1,550.00 | 620,000    |                  |
| 菱電商事            | 300    | 1,777.00 | 533,100    |                  |
| フルサト工業          | 200    | 1,852.00 | 370,400    |                  |
| 岩谷産業            | 900    | 3,485.00 | 3,136,500  |                  |
| 極東貿易            | 1,000  | 459.00   | 459,000    |                  |
| イワキ             | 1,000  | 485.00   | 485,000    |                  |
| 三愛石油            | 1,100  | 1,675.00 | 1,842,500  |                  |
| 稲畑産業            | 1,000  | 1,664.00 | 1,664,000  |                  |
| 明和産業            | 400    | 468.00   | 187,200    |                  |

|                   |       |          |            |
|-------------------|-------|----------|------------|
| ワキタ               | 900   | 1,306.00 | 1,175,400  |
| 東邦ホールディングス        | 1,200 | 2,450.00 | 2,940,000  |
| サンゲツ              | 1,400 | 2,065.00 | 2,891,000  |
| ミツウロコグループホールディングス | 600   | 823.00   | 493,800    |
| シナネンホールディングス      | 200   | 2,578.00 | 515,600    |
| 伊藤忠エネクス           | 900   | 1,094.00 | 984,600    |
| サンリオ              | 1,200 | 1,885.00 | 2,262,000  |
| サンワテクノス           | 200   | 2,109.00 | 421,800    |
| リョーサン             | 500   | 4,240.00 | 2,120,000  |
| 新光商事              | 400   | 1,946.00 | 778,400    |
| トーホー              | 200   | 2,794.00 | 558,800    |
| 三信電気              | 400   | 1,756.00 | 702,400    |
| 東陽テクニカ            | 500   | 984.00   | 492,000    |
| モスフードサービス         | 500   | 3,425.00 | 1,712,500  |
| 加賀電子              | 400   | 3,205.00 | 1,282,000  |
| ソーダニッカ            | 400   | 593.00   | 237,200    |
| 立花エレテック           | 300   | 1,886.00 | 565,800    |
| フォーバル             | 200   | 861.00   | 172,200    |
| PALTA C           | 600   | 5,260.00 | 3,156,000  |
| 三谷産業              | 400   | 431.00   | 172,400    |
| ヤマタネ              | 200   | 2,320.00 | 464,000    |
| 日鉄住金物産            | 300   | 6,000.00 | 1,800,000  |
| トラスコ中山            | 900   | 3,260.00 | 2,934,000  |
| オートバックスセブン        | 1,600 | 2,146.00 | 3,433,600  |
| モリト               | 300   | 1,033.00 | 309,900    |
| 加藤産業              | 600   | 4,075.00 | 2,445,000  |
| イノテック             | 400   | 1,060.00 | 424,000    |
| イエローハット           | 400   | 3,325.00 | 1,330,000  |
| J Kホールディングス       | 400   | 980.00   | 392,000    |
| 日伝                | 300   | 2,296.00 | 688,800    |
| 杉本商事              | 200   | 1,732.00 | 346,400    |
| 因幡電機産業            | 500   | 5,100.00 | 2,550,000  |
| バイテックホールディングス     | 200   | 1,730.00 | 346,000    |
| ミスミグループ本社         | 4,800 | 3,165.00 | 15,192,000 |
| タキヒヨー             | 100   | 2,381.00 | 238,100    |
| 蔵王産業              | 100   | 1,873.00 | 187,300    |
| スズケン              | 1,900 | 4,545.00 | 8,635,500  |
| ジェコス              | 300   | 1,380.00 | 414,000    |
| ルネサスイーストン         | 400   | 711.00   | 284,400    |
| ローソン              | 1,000 | 7,920.00 | 7,920,000  |
| サンエー              | 300   | 5,470.00 | 1,641,000  |
| カワチ薬品             | 300   | 2,798.00 | 839,400    |

|                    |       |           |            |
|--------------------|-------|-----------|------------|
| エービーシー・マート         | 700   | 6,440.00  | 4,508,000  |
| ハードオフコーポレーション      | 200   | 1,236.00  | 247,200    |
| アスクル               | 400   | 3,195.00  | 1,278,000  |
| ゲオホールディングス         | 700   | 2,201.00  | 1,540,700  |
| アダストリア             | 600   | 2,511.00  | 1,506,600  |
| ジーフット              | 200   | 780.00    | 156,000    |
| くらコーポレーション         | 200   | 6,290.00  | 1,258,000  |
| キャンドウ              | 200   | 1,767.00  | 353,400    |
| パルグループホールディングス     | 200   | 3,530.00  | 706,000    |
| エディオン              | 1,600 | 1,307.00  | 2,091,200  |
| サーラコーポレーション        | 700   | 696.00    | 487,200    |
| ワッツ                | 200   | 1,200.00  | 240,000    |
| ハローズ               | 200   | 2,629.00  | 525,800    |
| あみやき亭              | 100   | 5,200.00  | 520,000    |
| ひらまつ               | 600   | 568.00    | 340,800    |
| ゲンキー               | 200   | 4,070.00  | 814,000    |
| 大黒天物産              | 100   | 5,150.00  | 515,000    |
| ハニーズホールディングス       | 400   | 1,157.00  | 462,800    |
| アルペン               | 300   | 2,336.00  | 700,800    |
| クオール               | 400   | 2,192.00  | 876,800    |
| ジーンズ               | 300   | 6,000.00  | 1,800,000  |
| ビックカメラ             | 2,400 | 1,672.00  | 4,012,800  |
| D C Mホールディングス      | 2,200 | 1,087.00  | 2,391,400  |
| Monotaro           | 1,500 | 3,355.00  | 5,032,500  |
| アークランドサービスホールディングス | 300   | 2,668.00  | 800,400    |
| J.フロント リテイリング      | 4,900 | 1,988.00  | 9,741,200  |
| ドトール・日レスホールディングス   | 700   | 2,778.00  | 1,944,600  |
| マツモトキヨシホールディングス    | 800   | 9,240.00  | 7,392,000  |
| ブロンコビリー            | 200   | 3,670.00  | 734,000    |
| スタートトゥデイ           | 4,000 | 3,550.00  | 14,200,000 |
| トレジャー・ファクトリー       | 100   | 973.00    | 97,300     |
| 物語コーポレーション         | 100   | 11,090.00 | 1,109,000  |
| ココカラファイン           | 400   | 7,350.00  | 2,940,000  |
| 三越伊勢丹ホールディングス      | 7,700 | 1,374.00  | 10,579,800 |
| ウエルシアホールディングス      | 1,100 | 5,010.00  | 5,511,000  |
| クリエイティブSDホールディングス  | 600   | 3,060.00  | 1,836,000  |
| 丸善CHIホールディングス      | 500   | 347.00    | 173,500    |
| チムニー               | 100   | 2,875.00  | 287,500    |
| シュッピン              | 100   | 3,175.00  | 317,500    |
| ネクステージ             | 400   | 848.00    | 339,200    |
| ジョイフル本田            | 700   | 3,465.00  | 2,425,500  |
| 鳥貴族                | 200   | 3,650.00  | 730,000    |

|                           |        |           |            |
|---------------------------|--------|-----------|------------|
| すかいらーく                    | 2,500  | 1,650.00  | 4,125,000  |
| 綿半ホールディングス                | 200    | 3,020.00  | 604,000    |
| ヨシックス                     | 100    | 3,775.00  | 377,500    |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 1,400  | 1,160.00  | 1,624,000  |
| ブックオフコーポレーション             | 200    | 816.00    | 163,200    |
| あさひ                       | 300    | 1,371.00  | 411,300    |
| 日本調剤                      | 100    | 3,520.00  | 352,000    |
| コスモス薬品                    | 200    | 24,240.00 | 4,848,000  |
| トーエル                      | 200    | 1,044.00  | 208,800    |
| オンリー                      | 100    | 955.00    | 95,500     |
| セブン&アイ・ホールディングス           | 17,200 | 4,737.00  | 81,476,400 |
| 薬王堂                       | 200    | 3,340.00  | 668,000    |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス     | 1,100  | 1,305.00  | 1,435,500  |
| ツルハホールディングス               | 800    | 16,420.00 | 13,136,000 |
| サンマルクホールディングス             | 300    | 3,025.00  | 907,500    |
| フェリシモ                     | 100    | 1,391.00  | 139,100    |
| トリドールホールディングス             | 500    | 4,050.00  | 2,025,000  |
| TOKYO BASE                | 100    | 4,905.00  | 490,500    |
| クスリのアオキホールディングス           | 300    | 6,380.00  | 1,914,000  |
| スシローグローバルホールディングス         | 400    | 4,340.00  | 1,736,000  |
| LIXILピバ                   | 400    | 1,916.00  | 766,400    |
| 総合メディカル                   | 200    | 6,180.00  | 1,236,000  |
| はるやまホールディングス              | 200    | 1,045.00  | 209,000    |
| ノジマ                       | 700    | 2,681.00  | 1,876,700  |
| カップ・クリエイト                 | 500    | 1,299.00  | 649,500    |
| ライトオン                     | 300    | 908.00    | 272,400    |
| 良品計画                      | 500    | 35,550.00 | 17,775,000 |
| 三城ホールディングス                | 500    | 479.00    | 239,500    |
| アドヴァン                     | 400    | 1,054.00  | 421,600    |
| アルビス                      | 100    | 4,125.00  | 412,500    |
| コナカ                       | 500    | 630.00    | 315,000    |
| ハウスオブローゼ                  | 100    | 1,877.00  | 187,700    |
| G-7ホールディングス               | 100    | 2,714.00  | 271,400    |
| イオン北海道                    | 400    | 757.00    | 302,800    |
| ヒマラヤ                      | 100    | 1,123.00  | 112,300    |
| コーナン商事                    | 600    | 2,473.00  | 1,483,800  |
| エコス                       | 200    | 1,251.00  | 250,200    |
| ワタミ                       | 500    | 1,618.00  | 809,000    |
| ドンキホーテホールディングス            | 2,700  | 5,720.00  | 15,444,000 |
| 西松屋チェーン                   | 900    | 1,314.00  | 1,182,600  |
| ゼンショーホールディングス             | 2,100  | 1,939.00  | 4,071,900  |

|                      |        |           |            |
|----------------------|--------|-----------|------------|
| ハークスレイ               | 100    | 1,229.00  | 122,900    |
| サイゼリヤ                | 600    | 3,715.00  | 2,229,000  |
| V Tホールディングス          | 1,400  | 570.00    | 798,000    |
| 魚力                   | 100    | 1,182.00  | 118,200    |
| フジ・コーポレーション          | 100    | 2,249.00  | 224,900    |
| ユナイテッドアローズ           | 500    | 4,535.00  | 2,267,500  |
| ハイデイ日高               | 400    | 3,765.00  | 1,506,000  |
| 京都きもの友禅              | 300    | 805.00    | 241,500    |
| コロワイド                | 1,400  | 2,205.00  | 3,087,000  |
| ピーシーデポコーポレーション       | 600    | 868.00    | 520,800    |
| 鳧番屋                  | 300    | 4,500.00  | 1,350,000  |
| P L A N T            | 100    | 1,340.00  | 134,000    |
| スギホールディングス           | 900    | 5,860.00  | 5,274,000  |
| スクロール                | 600    | 518.00    | 310,800    |
| ヨンドシーホールディングス        | 400    | 2,935.00  | 1,174,000  |
| ユニー・ファミリーマートホールディングス | 1,300  | 8,060.00  | 10,478,000 |
| 木曽路                  | 500    | 2,767.00  | 1,383,500  |
| ケーヨー                 | 800    | 732.00    | 585,600    |
| 上新電機                 | 500    | 4,160.00  | 2,080,000  |
| 日本瓦斯                 | 800    | 3,940.00  | 3,152,000  |
| ロイヤルホールディングス         | 700    | 3,215.00  | 2,250,500  |
| いなげや                 | 500    | 1,867.00  | 933,500    |
| 島忠                   | 1,000  | 3,345.00  | 3,345,000  |
| チヨダ                  | 500    | 3,045.00  | 1,522,500  |
| ライフコーポレーション          | 300    | 3,040.00  | 912,000    |
| リンガーハット              | 500    | 2,615.00  | 1,307,500  |
| MrMaxHD              | 500    | 892.00    | 446,000    |
| AOKIホールディングス         | 800    | 1,677.00  | 1,341,600  |
| オークワ                 | 1,000  | 1,166.00  | 1,166,000  |
| コメリ                  | 600    | 3,220.00  | 1,932,000  |
| 青山商事                 | 800    | 4,275.00  | 3,420,000  |
| しまむら                 | 500    | 13,360.00 | 6,680,000  |
| はせがわ                 | 200    | 503.00    | 100,600    |
| 高島屋                  | 6,000  | 1,138.00  | 6,828,000  |
| 松屋                   | 800    | 1,426.00  | 1,140,800  |
| エイチ・ツー・オー リテイリング     | 1,900  | 2,234.00  | 4,244,600  |
| 近鉄百貨店                | 200    | 3,995.00  | 799,000    |
| パルコ                  | 400    | 1,623.00  | 649,200    |
| 丸井グループ               | 3,900  | 2,012.00  | 7,846,800  |
| アクシアル リテイリング         | 300    | 4,330.00  | 1,299,000  |
| イオン                  | 15,800 | 1,931.00  | 30,509,800 |
| イズミ                  | 700    | 6,910.00  | 4,837,000  |



|                     |         |           |             |
|---------------------|---------|-----------|-------------|
| 平和堂                 | 800     | 2,492.00  | 1,993,600   |
| フジ                  | 500     | 2,451.00  | 1,225,500   |
| ヤオコー                | 500     | 5,450.00  | 2,725,000   |
| ゼビオホールディングス         | 600     | 2,173.00  | 1,303,800   |
| ケーズホールディングス         | 1,700   | 2,940.00  | 4,998,000   |
| 日産東京販売ホールディングス      | 600     | 397.00    | 238,200     |
| アインホールディングス         | 600     | 7,410.00  | 4,446,000   |
| 元気寿司                | 100     | 4,035.00  | 403,500     |
| ヤマダ電機               | 13,700  | 637.00    | 8,726,900   |
| アークランドサカモト          | 700     | 1,934.00  | 1,353,800   |
| ニトリホールディングス         | 1,600   | 17,280.00 | 27,648,000  |
| ケーユーホールディングス        | 200     | 1,263.00  | 252,600     |
| 吉野家ホールディングス         | 1,300   | 1,927.00  | 2,505,100   |
| 松屋フーズ               | 200     | 4,150.00  | 830,000     |
| サガミチェーン             | 500     | 1,416.00  | 708,000     |
| 関西スーパーマーケット         | 300     | 1,243.00  | 372,900     |
| 王将フードサービス           | 300     | 5,220.00  | 1,566,000   |
| プレナス                | 500     | 2,408.00  | 1,204,000   |
| ミニストップ              | 300     | 2,467.00  | 740,100     |
| アークス                | 800     | 2,672.00  | 2,137,600   |
| パローホールディングス         | 1,000   | 2,655.00  | 2,655,000   |
| ベルク                 | 200     | 6,680.00  | 1,336,000   |
| 大庄                  | 200     | 1,743.00  | 348,600     |
| ファーストリテイリング         | 700     | 44,600.00 | 31,220,000  |
| サンドラッグ              | 1,700   | 5,320.00  | 9,044,000   |
| サックスパーホールディングス      | 400     | 1,353.00  | 541,200     |
| ヤマザワ                | 100     | 1,743.00  | 174,300     |
| やまや                 | 100     | 3,150.00  | 315,000     |
| ベルーナ                | 1,000   | 1,330.00  | 1,330,000   |
| じもとホールディングス         | 2,800   | 194.00    | 543,200     |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 21,300  | 470.00    | 10,011,000  |
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ     | 600     | 3,075.00  | 1,845,000   |
| 九州フィナンシャルグループ       | 6,700   | 691.00    | 4,629,700   |
| ゆうちょ銀行              | 11,600  | 1,465.00  | 16,994,000  |
| 富山第一銀行              | 1,000   | 537.00    | 537,000     |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 25,000  | 673.00    | 16,825,000  |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 2,800   | 1,326.00  | 3,712,800   |
| 新生銀行                | 3,600   | 1,918.00  | 6,904,800   |
| あおぞら銀行              | 2,400   | 4,370.00  | 10,488,000  |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ   | 290,200 | 798.50    | 231,724,700 |
| りそなホールディングス         | 45,100  | 624.60    | 28,169,460  |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 8,100   | 4,363.00  | 35,340,300  |

|                 |        |          |             |
|-----------------|--------|----------|-------------|
| 三井住友フィナンシャルグループ | 31,100 | 4,792.00 | 149,031,200 |
| 第四銀行            | 500    | 5,000.00 | 2,500,000   |
| 北越銀行            | 400    | 2,610.00 | 1,044,000   |
| 千葉銀行            | 15,000 | 913.00   | 13,695,000  |
| 群馬銀行            | 8,300  | 686.00   | 5,693,800   |
| 武蔵野銀行           | 700    | 3,700.00 | 2,590,000   |
| 千葉興業銀行          | 1,100  | 583.00   | 641,300     |
| 筑波銀行            | 1,700  | 391.00   | 664,700     |
| 七十七銀行           | 1,300  | 2,756.00 | 3,582,800   |
| 青森銀行            | 300    | 3,515.00 | 1,054,500   |
| 秋田銀行            | 300    | 3,085.00 | 925,500     |
| 山形銀行            | 500    | 2,493.00 | 1,246,500   |
| 岩手銀行            | 300    | 4,535.00 | 1,360,500   |
| 東邦銀行            | 3,700  | 407.00   | 1,505,900   |
| 東北銀行            | 200    | 1,526.00 | 305,200     |
| みちのく銀行          | 300    | 1,796.00 | 538,800     |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 17,000 | 619.00   | 10,523,000  |
| 静岡銀行            | 11,000 | 1,145.00 | 12,595,000  |
| 十六銀行            | 600    | 3,340.00 | 2,004,000   |
| スルガ銀行           | 4,200  | 2,348.00 | 9,861,600   |
| 八十二銀行           | 7,400  | 647.00   | 4,787,800   |
| 山梨中央銀行          | 3,000  | 489.00   | 1,467,000   |
| 大垣共立銀行          | 600    | 2,875.00 | 1,725,000   |
| 福井銀行            | 400    | 2,688.00 | 1,075,200   |
| 北國銀行            | 500    | 4,475.00 | 2,237,500   |
| 清水銀行            | 100    | 3,250.00 | 325,000     |
| 富山銀行            | 100    | 4,290.00 | 429,000     |
| 滋賀銀行            | 4,000  | 591.00   | 2,364,000   |
| 南都銀行            | 500    | 3,105.00 | 1,552,500   |
| 百五銀行            | 3,900  | 542.00   | 2,113,800   |
| 京都銀行            | 1,600  | 5,880.00 | 9,408,000   |
| 紀陽銀行            | 1,500  | 1,857.00 | 2,785,500   |
| 三重銀行            | 200    | 2,593.00 | 518,600     |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 2,700  | 1,744.00 | 4,708,800   |
| 広島銀行            | 6,100  | 920.00   | 5,612,000   |
| 山陰合同銀行          | 2,400  | 1,047.00 | 2,512,800   |
| 中国銀行            | 2,800  | 1,526.00 | 4,272,800   |
| 鳥取銀行            | 100    | 1,823.00 | 182,300     |
| 伊予銀行            | 5,900  | 916.00   | 5,404,400   |
| 百十四銀行           | 4,000  | 369.00   | 1,476,000   |
| 四国銀行            | 600    | 1,574.00 | 944,400     |
| 阿波銀行            | 3,000  | 705.00   | 2,115,000   |

|                      |         |          |             |
|----------------------|---------|----------|-------------|
| 大分銀行                 | 200     | 4,390.00 | 878,000     |
| 宮崎銀行                 | 300     | 3,750.00 | 1,125,000   |
| 佐賀銀行                 | 200     | 2,619.00 | 523,800     |
| 十八銀行                 | 3,000   | 311.00   | 933,000     |
| 沖縄銀行                 | 400     | 4,495.00 | 1,798,000   |
| 琉球銀行                 | 800     | 1,663.00 | 1,330,400   |
| セブン銀行                | 15,400  | 381.00   | 5,867,400   |
| みずほフィナンシャルグループ       | 558,100 | 200.80   | 112,066,480 |
| 高知銀行                 | 100     | 1,315.00 | 131,500     |
| 山口フィナンシャルグループ        | 4,000   | 1,354.00 | 5,416,000   |
| 長野銀行                 | 100     | 1,970.00 | 197,000     |
| 名古屋銀行                | 300     | 4,445.00 | 1,333,500   |
| 北洋銀行                 | 6,200   | 374.00   | 2,318,800   |
| 愛知銀行                 | 100     | 5,420.00 | 542,000     |
| 第三銀行                 | 200     | 1,858.00 | 371,600     |
| 中京銀行                 | 200     | 2,337.00 | 467,400     |
| 大光銀行                 | 100     | 2,568.00 | 256,800     |
| 愛媛銀行                 | 600     | 1,381.00 | 828,600     |
| トマト銀行                | 200     | 1,564.00 | 312,800     |
| みなと銀行                | 400     | 2,082.00 | 832,800     |
| 京葉銀行                 | 4,000   | 510.00   | 2,040,000   |
| 関西アーバン銀行             | 600     | 1,472.00 | 883,200     |
| 栃木銀行                 | 2,100   | 464.00   | 974,400     |
| 北日本銀行                | 100     | 3,155.00 | 315,500     |
| 東和銀行                 | 700     | 1,478.00 | 1,034,600   |
| 福島銀行                 | 400     | 923.00   | 369,200     |
| 大東銀行                 | 200     | 1,681.00 | 336,200     |
| トモニホールディングス          | 3,400   | 588.00   | 1,999,200   |
| フィデアホールディングス         | 4,000   | 203.00   | 812,000     |
| 池田泉州ホールディングス         | 4,400   | 413.00   | 1,817,200   |
| F P G                | 1,500   | 1,387.00 | 2,080,500   |
| S B Iホールディングス        | 4,600   | 2,568.00 | 11,812,800  |
| ジャフコ                 | 600     | 6,620.00 | 3,972,000   |
| 大和証券グループ本社           | 35,000  | 694.00   | 24,290,000  |
| 野村ホールディングス           | 74,100  | 656.80   | 48,668,880  |
| 岡三証券グループ             | 3,000   | 696.00   | 2,088,000   |
| 丸三証券                 | 1,300   | 1,042.00 | 1,354,600   |
| 東洋証券                 | 1,000   | 313.00   | 313,000     |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 4,700   | 715.00   | 3,360,500   |
| 光世証券                 | 100     | 1,517.00 | 151,700     |
| 水戸証券                 | 1,300   | 411.00   | 534,300     |
| いちよし証券               | 900     | 1,290.00 | 1,161,000   |

|                               |        |          |            |
|-------------------------------|--------|----------|------------|
| 松井証券                          | 2,000  | 950.00   | 1,900,000  |
| マネックスグループ                     | 4,400  | 336.00   | 1,478,400  |
| カブドットコム証券                     | 2,600  | 345.00   | 897,000    |
| 極東証券                          | 600    | 1,634.00 | 980,400    |
| 岩井コスモホールディングス                 | 400    | 1,435.00 | 574,000    |
| 藍澤證券                          | 800    | 760.00   | 608,000    |
| かんぽ生命保険                       | 1,600  | 2,613.00 | 4,180,800  |
| S O M P Oホールディングス             | 8,100  | 4,278.00 | 34,651,800 |
| アニコム ホールディングス                 | 300    | 3,410.00 | 1,023,000  |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 10,700 | 3,702.00 | 39,611,400 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス            | 3,400  | 1,946.00 | 6,616,400  |
| 第一生命ホールディングス                  | 23,200 | 2,286.00 | 53,035,200 |
| 東京海上ホールディングス                  | 15,500 | 4,999.00 | 77,484,500 |
| T & Dホールディングス                 | 12,700 | 1,888.00 | 23,977,600 |
| 全国保証                          | 1,200  | 4,985.00 | 5,982,000  |
| クレディセゾン                       | 3,100  | 2,025.00 | 6,277,500  |
| 芙蓉総合リース                       | 500    | 7,400.00 | 3,700,000  |
| 興銀リース                         | 800    | 2,830.00 | 2,264,000  |
| 東京センチュリー                      | 800    | 5,150.00 | 4,120,000  |
| 日本証券金融                        | 1,700  | 609.00   | 1,035,300  |
| アイフル                          | 6,900  | 395.00   | 2,725,500  |
| リコーリース                        | 300    | 3,785.00 | 1,135,500  |
| イオンフィナンシャルサービス                | 2,900  | 2,499.00 | 7,247,100  |
| アコム                           | 8,300  | 484.00   | 4,017,200  |
| ジャックス                         | 500    | 2,564.00 | 1,282,000  |
| オリエントコーポレーション                 | 8,900  | 180.00   | 1,602,000  |
| 日立キャピタル                       | 1,100  | 2,757.00 | 3,032,700  |
| オリックス                         | 27,400 | 1,875.50 | 51,388,700 |
| 三菱UFJリース                      | 10,400 | 665.00   | 6,916,000  |
| 日本取引所グループ                     | 12,100 | 1,959.00 | 23,703,900 |
| イー・ギャランティ                     | 100    | 3,270.00 | 327,000    |
| アサックス                         | 100    | 1,899.00 | 189,900    |
| N E Cキャピタルソリューション             | 200    | 2,257.00 | 451,400    |
| いちご                           | 5,900  | 429.00   | 2,531,100  |
| 日本駐車場開発                       | 5,000  | 195.00   | 975,000    |
| ヒューリック                        | 8,600  | 1,290.00 | 11,094,000 |
| 三栄建築設計                        | 200    | 2,568.00 | 513,600    |
| スター・マイカ                       | 100    | 1,703.00 | 170,300    |
| 野村不動産ホールディングス                 | 2,700  | 2,546.00 | 6,874,200  |
| 三重交通グループホールディングス              | 800    | 476.00   | 380,800    |
| サムティ                          | 300    | 1,663.00 | 498,900    |
| 日本商業開発                        | 200    | 1,714.00 | 342,800    |

|                |        |          |            |
|----------------|--------|----------|------------|
| プレサンスコーポレーション  | 600    | 1,500.00 | 900,000    |
| ユニゾホールディングス    | 500    | 3,010.00 | 1,505,000  |
| 日本管理センター       | 300    | 1,563.00 | 468,900    |
| サンセイランディック     | 100    | 1,054.00 | 105,400    |
| フージャースホールディングス | 500    | 1,298.00 | 649,000    |
| オープンハウス        | 700    | 5,820.00 | 4,074,000  |
| 東急不動産ホールディングス  | 9,900  | 807.00   | 7,989,300  |
| 飯田グループホールディングス | 3,400  | 2,082.00 | 7,078,800  |
| ムゲンエステート       | 300    | 1,153.00 | 345,900    |
| ファーストブラザーズ     | 100    | 1,097.00 | 109,700    |
| シーアールイー        | 100    | 1,545.00 | 154,500    |
| ケイアイスター不動産     | 100    | 2,913.00 | 291,300    |
| パーク24          | 2,300  | 2,950.00 | 6,785,000  |
| パラカ            | 100    | 2,509.00 | 250,900    |
| 三井不動産          | 20,500 | 2,544.50 | 52,162,250 |
| 三菱地所           | 30,600 | 1,968.00 | 60,220,800 |
| 平和不動産          | 700    | 2,042.00 | 1,429,400  |
| 東京建物           | 4,500  | 1,550.00 | 6,975,000  |
| ダイビル           | 1,100  | 1,358.00 | 1,493,800  |
| 京阪神ビルディング      | 700    | 864.00   | 604,800    |
| 住友不動産          | 10,000 | 3,705.00 | 37,050,000 |
| 大京             | 700    | 2,192.00 | 1,534,400  |
| テーオーシー         | 1,400  | 987.00   | 1,381,800  |
| 東京楽天地          | 100    | 5,980.00 | 598,000    |
| レオパレス21        | 4,900  | 916.00   | 4,488,400  |
| スターツコーポレーション   | 600    | 2,927.00 | 1,756,200  |
| フジ住宅           | 500    | 858.00   | 429,000    |
| 空港施設           | 400    | 670.00   | 268,000    |
| 明和地所           | 200    | 874.00   | 174,800    |
| ゴールドクレスト       | 300    | 2,287.00 | 686,100    |
| 日本エスリード        | 200    | 2,490.00 | 498,000    |
| 日神不動産          | 500    | 919.00   | 459,500    |
| 日本エスコン         | 700    | 698.00   | 488,600    |
| タカラレーベン        | 1,900  | 499.00   | 948,100    |
| サンヨーハウジング名古屋   | 200    | 1,195.00 | 239,000    |
| イオンモール         | 2,600  | 2,169.00 | 5,639,400  |
| ファースト住建        | 200    | 1,770.00 | 354,000    |
| トーセイ           | 500    | 1,102.00 | 551,000    |
| エヌ・ティ・ティ都市開発   | 2,600  | 1,291.00 | 3,356,600  |
| サンフロンティア不動産    | 400    | 1,279.00 | 511,600    |
| エフ・ジェー・ネクスト    | 300    | 1,031.00 | 309,300    |
| グランディハウス       | 400    | 587.00   | 234,800    |

|                  |       |          |            |
|------------------|-------|----------|------------|
| 日本空港ビルデング        | 1,200 | 4,325.00 | 5,190,000  |
| 日本工営             | 300   | 3,675.00 | 1,102,500  |
| L I F U L L      | 1,400 | 1,084.00 | 1,517,600  |
| ジェイエイシーリクルートメント  | 300   | 2,176.00 | 652,800    |
| 日本M&Aセンター        | 1,400 | 5,580.00 | 7,812,000  |
| タケエイ             | 400   | 1,288.00 | 515,200    |
| トラスト・テック         | 200   | 3,435.00 | 687,000    |
| コシダカホールディングス     | 200   | 5,210.00 | 1,042,000  |
| パソナグループ          | 300   | 1,880.00 | 564,000    |
| リンクアンドモチベーション    | 700   | 917.00   | 641,900    |
| G C A            | 500   | 1,086.00 | 543,000    |
| エス・エム・エス         | 800   | 3,760.00 | 3,008,000  |
| パーソルホールディングス     | 3,700 | 2,657.00 | 9,830,900  |
| リニカル             | 300   | 1,559.00 | 467,700    |
| クックパッド           | 1,200 | 635.00   | 762,000    |
| アイ・ケイ・ケイ         | 200   | 871.00   | 174,200    |
| 学情               | 200   | 1,841.00 | 368,200    |
| スタジオアリス          | 200   | 2,845.00 | 569,000    |
| シミックホールディングス     | 200   | 1,771.00 | 354,200    |
| N J S            | 100   | 1,554.00 | 155,400    |
| 総合警備保障           | 1,600 | 5,970.00 | 9,552,000  |
| カカクコム            | 3,100 | 1,805.00 | 5,595,500  |
| セントケア・ホールディング    | 200   | 827.00   | 165,400    |
| ルネサンス            | 200   | 1,935.00 | 387,000    |
| ディップ             | 600   | 2,942.00 | 1,765,200  |
| ツクイ              | 900   | 1,040.00 | 936,000    |
| エムスリー            | 4,200 | 3,890.00 | 16,338,000 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 300   | 663.00   | 198,900    |
| アウトソーシング         | 1,200 | 2,047.00 | 2,456,400  |
| ウェルネット           | 300   | 1,207.00 | 362,100    |
| ワールドホールディングス     | 100   | 3,310.00 | 331,000    |
| ディー・エヌ・エー        | 2,100 | 2,315.00 | 4,861,500  |
| 博報堂DYホールディングス    | 5,500 | 1,478.00 | 8,129,000  |
| ぐるなび             | 600   | 1,354.00 | 812,400    |
| エスアールジータカミヤ      | 500   | 645.00   | 322,500    |
| ファンコミュニケーションズ    | 1,100 | 972.00   | 1,069,200  |
| ライク              | 200   | 2,579.00 | 515,800    |
| W D B ホールディングス   | 200   | 3,580.00 | 716,000    |
| ティア              | 200   | 1,018.00 | 203,600    |
| バリューコマース         | 400   | 758.00   | 303,200    |
| インフォマート          | 2,000 | 668.00   | 1,336,000  |
| J P ホールディングス     | 1,200 | 346.00   | 415,200    |

|                  |        |           |            |
|------------------|--------|-----------|------------|
| EPSホールディングス      | 600    | 2,522.00  | 1,513,200  |
| レックス             | 100    | 920.00    | 92,000     |
| プレステージ・インターナショナル | 800    | 1,395.00  | 1,116,000  |
| アミューズ            | 300    | 3,130.00  | 939,000    |
| クイック             | 200    | 1,792.00  | 358,400    |
| ケネディクス           | 5,500  | 734.00    | 4,037,000  |
| 電通               | 4,800  | 4,820.00  | 23,136,000 |
| ぴあ               | 100    | 7,060.00  | 706,000    |
| イオンファンタジー        | 100    | 5,030.00  | 503,000    |
| シーティーエス          | 400    | 810.00    | 324,000    |
| ネクシィーズグループ       | 200    | 1,839.00  | 367,800    |
| みらかホールディングス      | 1,200  | 4,865.00  | 5,838,000  |
| アルプス技研           | 200    | 4,285.00  | 857,000    |
| ダイオーズ            | 100    | 1,405.00  | 140,500    |
| 日本空調サービス         | 400    | 801.00    | 320,400    |
| オリエンタルランド        | 4,700  | 10,610.00 | 49,867,000 |
| ダスキン             | 1,100  | 2,962.00  | 3,258,200  |
| 明光ネットワークジャパン     | 500    | 1,356.00  | 678,000    |
| ファルコホールディングス     | 200    | 1,766.00  | 353,200    |
| ラウンドワン           | 1,200  | 1,774.00  | 2,128,800  |
| リゾートトラスト         | 1,700  | 2,535.00  | 4,309,500  |
| ビー・エム・エル         | 500    | 2,851.00  | 1,425,500  |
| りらいあコミュニケーションズ   | 600    | 1,237.00  | 742,200    |
| リソー教育            | 700    | 856.00    | 599,200    |
| 早稲田アカデミー         | 100    | 1,709.00  | 170,900    |
| ユー・エス・エス         | 4,900  | 2,408.00  | 11,799,200 |
| 東京個別指導学院         | 100    | 1,028.00  | 102,800    |
| サイバーエージェント       | 2,600  | 4,205.00  | 10,933,000 |
| 楽天               | 20,400 | 1,025.00  | 20,910,000 |
| クリーク・アンド・リバー社    | 200    | 1,132.00  | 226,400    |
| テー・オー・ダブリュー      | 300    | 917.00    | 275,100    |
| セントラルスポーツ        | 100    | 4,335.00  | 433,500    |
| フルキャストホールディングス   | 300    | 2,189.00  | 656,700    |
| テクノプロ・ホールディングス   | 700    | 6,050.00  | 4,235,000  |
| ジャパンマテリアル        | 400    | 3,635.00  | 1,454,000  |
| ベクトル             | 500    | 1,626.00  | 813,000    |
| ウチヤマホールディングス     | 200    | 558.00    | 111,600    |
| I B J            | 300    | 1,069.00  | 320,700    |
| アサンテ             | 100    | 1,892.00  | 189,200    |
| M&Aキャピタルパートナーズ   | 100    | 7,400.00  | 740,000    |
| 日本ビューホテル         | 100    | 1,387.00  | 138,700    |
| リクルートホールディングス    | 30,700 | 2,750.00  | 84,425,000 |

|                  |           |          |                |
|------------------|-----------|----------|----------------|
| 日本郵政             | 22,600    | 1,305.00 | 29,493,000     |
| ベルシステム24ホールディングス | 700       | 1,356.00 | 949,200        |
| ソラスト             | 200       | 2,800.00 | 560,000        |
| リログループ           | 2,200     | 2,934.00 | 6,454,800      |
| 東祥               | 200       | 3,550.00 | 710,000        |
| エイチ・アイ・エス        | 600       | 4,095.00 | 2,457,000      |
| 共立メンテナンス         | 700       | 4,670.00 | 3,269,000      |
| イチネンホールディングス     | 400       | 1,593.00 | 637,200        |
| 建設技術研究所          | 300       | 1,206.00 | 361,800        |
| スペース             | 200       | 1,783.00 | 356,600        |
| 燦ホールディングス        | 100       | 3,380.00 | 338,000        |
| タナベ経営            | 100       | 1,674.00 | 167,400        |
| ナガワ              | 100       | 4,870.00 | 487,000        |
| よみうりランド          | 100       | 5,030.00 | 503,000        |
| 東京都競馬            | 300       | 4,170.00 | 1,251,000      |
| 常磐興産             | 200       | 1,887.00 | 377,400        |
| カナモト             | 600       | 3,425.00 | 2,055,000      |
| 東京ドーム            | 1,600     | 1,168.00 | 1,868,800      |
| 西尾レントオール         | 400       | 3,585.00 | 1,434,000      |
| トランス・コスモス        | 400       | 2,788.00 | 1,115,200      |
| 乃村工藝社            | 900       | 2,556.00 | 2,300,400      |
| 藤田観光             | 200       | 3,565.00 | 713,000        |
| KNT-CTホールディングス   | 200       | 1,735.00 | 347,000        |
| 日本管財             | 400       | 1,990.00 | 796,000        |
| トーカイ             | 200       | 4,960.00 | 992,000        |
| セコム              | 4,200     | 8,468.00 | 35,565,600     |
| セントラル警備保障        | 200       | 2,313.00 | 462,600        |
| 丹青社              | 800       | 1,221.00 | 976,800        |
| メイテック            | 500       | 5,730.00 | 2,865,000      |
| アサツー ディ・ケイ       | 800       | 3,620.00 | 2,896,000      |
| 応用地質             | 400       | 1,486.00 | 594,400        |
| 船井総研ホールディングス     | 600       | 3,730.00 | 2,238,000      |
| 進学会ホールディングス      | 200       | 696.00   | 139,200        |
| いであ              | 100       | 1,177.00 | 117,700        |
| ベネッセホールディングス     | 1,500     | 4,080.00 | 6,120,000      |
| イオンディライト         | 500       | 4,230.00 | 2,115,000      |
| ナック              | 300       | 968.00   | 290,400        |
| ニチイ学館            | 800       | 1,473.00 | 1,178,400      |
| ダイセキ             | 700       | 3,025.00 | 2,117,500      |
| ステップ             | 100       | 1,724.00 | 172,400        |
| 合計               | 4,947,100 |          | 10,615,297,800 |

## (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

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 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）        |               |
|----------------|---------------|---------------|
|                | 平成28年12月15日現在 | 平成29年12月15日現在 |
| <b>資産の部</b>    |               |               |
| 流動資産           |               |               |
| 預金             | 524,371,743   | 282,648,160   |
| コール・ローン        | 11,080,161    | 18,131,948    |
| 株式             | 8,968,321,954 | 6,696,430,666 |
| 投資信託受益証券       | 984,139       | 553,008       |
| 投資証券           | 240,057,661   | 180,480,661   |
| 派生商品評価勘定       | 695,270       | 288,422       |
| 未収入金           | 48,564        | 259,046       |
| 未収配当金          | 13,789,091    | 9,803,505     |
| 差入委託証拠金        | 120,783,244   | 47,924,176    |
| 流動資産合計         | 9,880,131,827 | 7,236,519,592 |
| <b>負債の部</b>    |               |               |
| 流動負債           |               |               |
| 派生商品評価勘定       | 158,094       | 533,571       |
| 未払解約金          | 9,400,000     | 8,831,000     |
| 未払利息           | 13            | 28            |
| 流動負債合計         | 9,558,107     | 9,364,599     |
| <b>負債合計</b>    |               |               |
|                | 9,558,107     | 9,364,599     |
| <b>純資産の部</b>   |               |               |
| 元本等            |               |               |
| 元本             | 4,896,090,685 | 3,114,466,882 |
| 剰余金            |               |               |
| 剰余金又は欠損金（ ）    | 4,974,483,035 | 4,112,688,111 |
| 元本等合計          | 9,870,573,720 | 7,227,154,993 |
| <b>純資産合計</b>   |               |               |
|                | 9,870,573,720 | 7,227,154,993 |
| <b>負債純資産合計</b> |               |               |
|                | 9,880,131,827 | 7,236,519,592 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分                 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|--------------------|--------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式                             |

|                            |   |
|----------------------------|---|
|                            | <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）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</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。</p> <p>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及び外国金融商品市場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>為替予約取引</p> <p>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> <p>受取配当金</p> <p>(1) 株式及び投資証券</p> <p>原則として、株式及び投資証券の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> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>  |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>  |

## (貸借対照表に関する注記)

| 平成28年12月15日現在          |                | 平成29年12月15日現在          |                |
|------------------------|----------------|------------------------|----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 4,896,090,685口 | 1. 計算日における受益権の総数       | 3,114,466,882口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額              | 2.0160円        | 1口当たり純資産額              | 2.3205円        |
| (1万口当たり純資産額)           | (20,160円)      | (1万口当たり純資産額)           | (23,205円)      |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

|    |                                |                                |
|----|--------------------------------|--------------------------------|
| 区分 | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|----|--------------------------------|--------------------------------|

|                   |   |    |
|-------------------|---|----|
| 1.金融商品に対する取組方針    | <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>  | 同左 |
| 2.金融商品の内容及びリスク    | <p>当ファンドの投資している金融商品は、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。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。株価指数先物取引は株価の変動によるリスク、為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>  | 同左 |
| 3.金融商品に係るリスクの管理体制 | <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。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左 |

|                           |   |    |
|---------------------------|---|----|
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。<br><br>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又は計算上の想定元本であり、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。 | 同左 |
|---------------------------|---|----|

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|---|---|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>投資信託受益証券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>投資証券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

## （関連当事者との取引に関する注記）

|  | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
|  | 該当事項はありません。                    | 同左                             |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分 | 平成28年12月15日現在 | 平成29年12月15日現在 |
|----|---------------|---------------|
|    |               |               |

|                                    |                |                |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 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 | 5,926,931,068円 | 4,896,090,685円 |
| 期中追加設定元本額                          | 452,223,412円   | 19,412,390円    |
| 期中一部解約元本額                          | 1,483,063,795円 | 1,801,036,193円 |
| 同期末における元本の内訳                       |                |                |
| 新光7資産バランスファンド                      | 460,374,939円   | 337,087,470円   |
| 新光外国株式インデックスVA                     | 1,672,011,555円 | 625,788,705円   |
| 新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）        | 654,333,976円   | 445,286,203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）        | 471,641,390円   | 362,959,887円   |
| 新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）           | 113,178,248円   | 95,365,946円    |
| ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）        | 978,293,980円   | 815,266,296円   |
| ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）       | 529,043,683円   | 425,967,278円   |
| 世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）     | 2,716,665円     | -円             |
| グローバル・ナビ                           | 14,496,249円    | 6,745,097円     |
| 合計                                 | 4,896,090,685円 | 3,114,466,882円 |

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

| 種類       | 平成28年12月15日現在      | 平成29年12月15日現在      |
|----------|--------------------|--------------------|
|          | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式       | 333,899,189        | 104,369,180        |
| 投資信託受益証券 | 22,367             | 20,232             |
| 投資証券     | 3,971,403          | 945,052            |
| 合計       | 337,892,959        | 103,403,896        |

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

## 3 デリバティブ取引等関係

### 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

| 種類   | 平成28年12月15日現在 |  |       | 平成29年12月15日現在 |         |  |       |         |
|------|---------------|--|-------|---------------|---------|--|-------|---------|
|      | 契約額等（円）       |  | 時価（円） | 評価損益（円）       | 契約額等（円） |  | 時価（円） | 評価損益（円） |
|      | うち1年超         |  |       |               | うち1年超   |  |       |         |
| 市場取引 |               |  |       |               |         |  |       |         |

| 株価指数先物取引     |             |   |             |         |             |   |             |         |  |
|--------------|-------------|---|-------------|---------|-------------|---|-------------|---------|--|
| 買建           | 417,374,209 | - | 417,943,927 | 569,718 | 339,075,042 | - | 338,819,694 | 255,348 |  |
| S&P500 EMINI | 317,930,171 | - | 318,126,528 | 196,357 | 223,719,555 | - | 223,892,370 | 172,815 |  |
| S&P/TSE 601X | 31,687,461  | - | 31,608,264  | 79,197  | 16,772,454  | - | 16,704,800  | 67,654  |  |
| DJ EURO ST50 | 23,599,132  | - | 23,741,358  | 142,226 | 52,197,083  | - | 51,726,675  | 470,408 |  |
| FTSE 100 IDX | 20,131,752  | - | 20,352,617  | 220,865 | 33,459,599  | - | 33,533,325  | 73,726  |  |
| SPI 200      | 24,025,693  | - | 24,115,160  | 89,467  | 12,926,351  | - | 12,962,524  | 36,173  |  |
| 合計           | 417,374,209 | - | 417,943,927 | 569,718 | 339,075,042 | - | 338,819,694 | 255,348 |  |

## 時価の算定方法

### 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金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

契約額等及び時価の邦貨換算額は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

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。

### (通貨関連)

| 種類        | 平成28年12月15日現在 |       |             |         | 平成29年12月15日現在 |       |       |         |
|-----------|---------------|-------|-------------|---------|---------------|-------|-------|---------|
|           | 契約額等（円）       |       | 時価（円）       | 評価損益（円） | 契約額等（円）       |       | 時価（円） | 評価損益（円） |
|           |               | うち1年超 |             |         |               | うち1年超 |       |         |
| 市場取引以外の取引 |               |       |             |         |               |       |       |         |
| 為替予約取引    |               |       |             |         |               |       |       |         |
| 売建        | 241,510,317   | -     | 241,577,370 | 67,053  | -             | -     | -     | -       |
| 米ドル       | 132,294,800   | -     | 132,283,560 | 11,240  | -             | -     | -     | -       |
| ユーロ       | 77,078,175    | -     | 77,156,250  | 78,075  | -             | -     | -     | -       |
| 英ポンド      | 32,137,342    | -     | 32,137,560  | 218     | -             | -     | -     | -       |
| 合計        | 241,510,317   | -     | 241,577,370 | 67,053  | -             | -     | -     | -       |

## 時価の算定方法

### 為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2)計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

| 通貨                         | 銘柄                             | 株式数   | 評価額       |            | 備考 |
|----------------------------|--------------------------------|-------|-----------|------------|----|
|                            |                                |       | 単価        | 金額         |    |
| 米ドル                        | ANADARKO PETROLEUM CORP        | 923   | 47.89     | 44,202.47  |    |
|                            | ANDEAVOR                       | 311   | 108.96    | 33,886.56  |    |
|                            | ANTERO RESOURCES CORPORATION   | 453   | 17.92     | 8,117.76   |    |
|                            | BAKER HUGHES A GE CO LLC       | 861   | 30.59     | 26,337.99  |    |
|                            | CABOT OIL & GAS CORPORATION    | 1,029 | 27.26     | 28,050.54  |    |
|                            | CHENIERE ENERGY INC            | 442   | 49.78     | 22,002.76  |    |
|                            | CHEVRON CORP                   | 3,007 | 119.53    | 359,426.71 |    |
|                            | CONCHO RESOURCES INC           | 236   | 136.80    | 32,284.80  |    |
|                            | CONOCOPHILLIPS                 | 2,037 | 52.31     | 106,555.47 |    |
|                            | CONTINENTAL RESOURCES INC      | 189   | 47.36     | 8,951.04   |    |
|                            | DEVON ENERGY CORPORATION       | 1,011 | 38.00     | 38,418.00  |    |
|                            | DIAMONDBACK ENERGY INC         | 190   | 111.03    | 21,095.70  |    |
|                            | EOG RESOURCES INC              | 950   | 99.64     | 94,658.00  |    |
|                            | EQT CORPORATION                | 382   | 56.01     | 21,395.82  |    |
|                            | EXXON MOBIL CORP               | 6,726 | 82.90     | 557,585.40 |    |
|                            | HALLIBURTON CO                 | 1,378 | 44.41     | 61,196.98  |    |
|                            | HELMERICH & PAYNE INC          | 236   | 56.78     | 13,400.08  |    |
|                            | HESS CORPORATION               | 611   | 42.67     | 26,071.37  |    |
|                            | HOLLYFRONTIER CORPORATION      | 378   | 47.80     | 18,068.40  |    |
|                            | KINDER MORGAN INC              | 3,575 | 17.84     | 63,778.00  |    |
|                            | MARATHON OIL CORP              | 1,874 | 15.12     | 28,334.88  |    |
|                            | MARATHON PETROLEUM CORPORATION | 923   | 64.66     | 59,681.18  |    |
|                            | NATIONAL OILWELL VARCO INC     | 810   | 32.43     | 26,268.30  |    |
|                            | NEWFIELD EXPLORATION CO        | 440   | 28.63     | 12,597.20  |    |
|                            | NOBLE ENERGY INC               | 1,002 | 26.46     | 26,512.92  |    |
|                            | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP      | 1,259 | 70.55     | 88,822.45  |    |
| ONEOK INC                  | 750                            | 52.74 | 39,555.00 |            |    |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A | 480                            | 26.42 | 12,681.60 |            |    |

|  |       |        |            |
|--|-------|--------|------------|
| PHILLIPS 66                            | 781   | 99.55  | 77,748.55  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO           | 270   | 156.58 | 42,276.60  |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A             | 317   | 21.18  | 6,714.06   |
| RANGE RESOURCES CORP                   | 508   | 15.99  | 8,122.92   |
| SCHLUMBERGER LIMITED                   | 2,288 | 62.37  | 142,702.56 |
| TARGA RESOURCES CORPORATION            | 442   | 47.00  | 20,774.00  |
| TECHNIPFMC PLC                         | 950   | 27.61  | 26,229.50  |
| VALERO ENERGY CORP                     | 796   | 87.48  | 69,634.08  |
| WILLIAMS COS INC                       | 1,470 | 29.68  | 43,629.60  |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC           | 387   | 160.53 | 62,125.11  |
| ALBEMARLE CORPORATION                  | 241   | 127.58 | 30,746.78  |
| AVERY DENNISON CORPORATION             | 197   | 114.28 | 22,513.16  |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD             | 479   | 31.50  | 15,088.50  |
| BALL CORPORATION                       | 712   | 38.29  | 27,262.48  |
| CELANESE CORP-SERIES A                 | 289   | 105.73 | 30,555.97  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC             | 516   | 41.02  | 21,166.32  |
| CROWN HOLDINGS INC                     | 308   | 57.41  | 17,682.28  |
| DOWDUPONT INC                          | 3,841 | 70.32  | 270,099.12 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY               | 301   | 91.01  | 27,394.01  |
| ECOLAB INC                             | 464   | 134.37 | 62,347.68  |
| FMC CORPORATION                        | 296   | 89.86  | 26,598.56  |
| FREEMPORT-MCMORAN INC                  | 2,774 | 16.19  | 44,911.06  |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | 176   | 151.63 | 26,686.88  |
| INTERNATIONAL PAPER CO                 | 301   | 55.18  | 16,609.18  |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A   | 609   | 105.43 | 64,206.87  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC          | 129   | 202.20 | 26,083.80  |
| MONSANTO CO                            | 722   | 117.85 | 85,087.70  |
| NEWMONT MINING CORP                    | 846   | 35.90  | 30,371.40  |
| PACKAGING CORPORATION OF AMERICA       | 208   | 114.89 | 23,897.12  |
| PPG INDUSTRIES INC                     | 456   | 113.82 | 51,901.92  |
| PRAXAIR INC                            | 454   | 149.14 | 67,709.56  |
| SEALED AIR CORPORATION                 | 428   | 48.03  | 20,556.84  |
| STEEL DYNAMICS INC                     | 498   | 39.84  | 19,840.32  |
| THE MOSAIC COMPANY                     | 736   | 24.90  | 18,326.40  |
| THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY           | 138   | 400.23 | 55,231.74  |
| VULCAN MATERIALS CO                    | 284   | 120.24 | 34,148.16  |
| WESTROCK COMPANY                       | 49    | 62.55  | 3,064.95   |
| WR GRACE & CO                          | 161   | 69.98  | 11,266.78  |
| 3M CO                                  | 983   | 238.08 | 234,032.64 |
| A.O. SMITH CORPORATION                 | 327   | 60.04  | 19,633.08  |
| ACUITY BRANDS INC                      | 98    | 161.53 | 15,829.94  |
| AERCAP HOLDINGS NV                     | 342   | 52.12  | 17,825.04  |



|                                    |        |        |            |
|------------------------------------|--------|--------|------------|
| AGCO CORPORATION                   | 132    | 72.17  | 9,526.44   |
| ALLEGION PUBLIC LIMITED COMPANY    | 196    | 81.68  | 16,009.28  |
| ARCONIC INC                        | 810    | 24.99  | 20,241.90  |
| BOEING CO                          | 944    | 293.88 | 277,422.72 |
| CATERPILLAR INC                    | 935    | 146.28 | 136,771.80 |
| CUMMINS INC                        | 263    | 168.55 | 44,328.65  |
| DEERE & CO                         | 481    | 149.44 | 71,880.64  |
| DOVER CORP                         | 3      | 95.75  | 287.25     |
| EATON CORPORATION PLC              | 796    | 76.44  | 60,846.24  |
| EMERSON ELECTRIC CO                | 1,023  | 66.51  | 68,039.73  |
| FASTENAL CO                        | 594    | 52.54  | 31,208.76  |
| FLOWSERVE CORPORATION              | 289    | 40.20  | 11,617.80  |
| FLUOR CORP                         | 308    | 49.87  | 15,359.96  |
| FORTIVE CORPORATION                | 555    | 71.40  | 39,627.00  |
| GENERAL DYNAMICS CORP              | 422    | 196.22 | 82,804.84  |
| GENERAL ELECTRIC CO(US)            | 14,297 | 17.64  | 252,199.08 |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC             | 414    | 37.84  | 15,665.76  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC        | 1,192  | 153.23 | 182,650.16 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC  | 100    | 233.88 | 23,388.00  |
| IDEX CORPORATION                   | 157    | 129.24 | 20,290.68  |
| ILLINOIS TOOL WORKS                | 494    | 162.65 | 80,349.10  |
| INGERSOLL-RAND PLC                 | 406    | 86.03  | 34,928.18  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC       | 259    | 66.13  | 17,127.67  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LIMITED     | 400    | 62.30  | 24,920.00  |
| JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED | 500    | 39.72  | 19,860.00  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 1,489  | 37.41  | 55,703.49  |
| L3 TECHNOLOGIES INC                | 160    | 192.41 | 30,785.60  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC           | 79     | 204.15 | 16,127.85  |
| LOCKHEED MARTIN CORP               | 429    | 317.01 | 135,997.29 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP              | 263    | 306.91 | 80,717.33  |
| PACCAR INC                         | 558    | 69.22  | 38,624.76  |
| PARKER HANNIFIN CORP               | 211    | 191.70 | 40,448.70  |
| PENTAIR PLC                        | 354    | 68.84  | 24,369.36  |
| RAYTHEON COMPANY                   | 479    | 188.78 | 90,425.62  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC            | 229    | 189.45 | 43,384.05  |
| ROCKWELL COLLINS INC.              | 267    | 133.71 | 35,700.57  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC             | 162    | 252.38 | 40,885.56  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV    | 378    | 52.17  | 19,720.26  |
| SNAP-ON INC                        | 128    | 165.50 | 21,184.00  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC         | 252    | 164.94 | 41,564.88  |
| TEXTRON INC                        | 55     | 54.38  | 2,990.90   |
| THE MIDDLEBY CORPORATION           | 127    | 129.36 | 16,428.72  |

|  |       |        |            |
|--|-------|--------|------------|
| TRANSDIGM GROUP INC                    | 114   | 274.48 | 31,290.72  |
| UNITED RENTALS INC                     | 186   | 161.17 | 29,977.62  |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP               | 1,253 | 123.76 | 155,071.28 |
| WABCO HOLDINGS INC                     | 116   | 140.90 | 16,344.40  |
| WABTEC CORPORATION                     | 191   | 76.87  | 14,682.17  |
| WW GRAINGER INC                        | 125   | 222.67 | 27,833.75  |
| CINTAS CORPORATION                     | 186   | 157.18 | 29,235.48  |
| EQUIFAX INC                            | 257   | 118.19 | 30,374.83  |
| IHS MARKIT LIMITED                     | 769   | 44.88  | 34,512.72  |
| MANPOWER GROUP                         | 148   | 122.60 | 18,144.80  |
| NIELSEN HOLDINGS PLC                   | 767   | 36.60  | 28,072.20  |
| REPUBLIC SERVICES INC                  | 510   | 64.85  | 33,073.50  |
| ROBERT HALF INTL INC                   | 285   | 54.22  | 15,452.70  |
| ROLLINS INC                            | 201   | 45.70  | 9,185.70   |
| STERICYCLE INC                         | 188   | 65.86  | 12,381.68  |
| VERISK ANALYTICS INC                   | 324   | 94.73  | 30,692.52  |
| WASTE CONNECTIONS INC                  | 564   | 69.53  | 39,214.92  |
| WASTE MANAGEMENT INC                   | 786   | 84.66  | 66,542.76  |
| AMERCO                                 | 16    | 375.68 | 6,010.88   |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC            | 278   | 50.21  | 13,958.38  |
| C H ROBINSON WORLDWIDE INC             | 310   | 85.79  | 26,594.90  |
| CSX CORP                               | 1,519 | 57.31  | 87,053.89  |
| DELTA AIR LINES INC                    | 375   | 55.25  | 20,718.75  |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON | 24    | 64.06  | 1,537.44   |
| FEDEX CORP                             | 418   | 238.50 | 99,693.00  |
| J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC       | 199   | 111.39 | 22,166.61  |
| KANSAS CITY SOUTHERN                   | 219   | 109.87 | 24,061.53  |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION   | 172   | 64.58  | 11,107.76  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP                  | 516   | 140.86 | 72,683.76  |
| SOUTHWEST AIRLINES COMPANY             | 340   | 63.85  | 21,709.00  |
| SWIFT TRANSPORTATION COMPANY           | 237   | 43.09  | 10,212.33  |
| UNION PACIFIC CORP                     | 1,329 | 129.17 | 171,666.93 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC        | 175   | 63.13  | 11,047.75  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B             | 1,134 | 116.84 | 132,496.56 |
| APTIV PLC                              | 441   | 83.05  | 36,625.05  |
| AUTOLIV INC                            | 195   | 125.55 | 24,482.25  |
| BORGWARNER INC                         | 471   | 51.54  | 24,275.34  |
| FORD MOTOR CO                          | 5,898 | 12.46  | 73,489.08  |
| GENERAL MOTORS CO                      | 2,236 | 40.81  | 91,251.16  |
| HARLEY-DAVIDSON INC                    | 391   | 50.02  | 19,557.82  |
| TESLA INC                              | 240   | 337.89 | 81,093.60  |
| THE GOODYEAR TIRE & RUBBER COMPANY     | 517   | 31.30  | 16,182.10  |

|   |       |          |            |
|---|-------|----------|------------|
| DR HORTON INC                           | 728   | 50.34    | 36,647.52  |
| GARMIN LIMITED                          | 262   | 59.46    | 15,578.52  |
| HANESBRANDS INC                         | 836   | 21.26    | 17,773.36  |
| HASBRO INC                              | 230   | 95.87    | 22,050.10  |
| LEGGETT & PLATT INC                     | 296   | 45.99    | 13,613.04  |
| LENNAR CORPORATION-CLASS A              | 15    | 61.14    | 917.10     |
| LULULEMON ATHLETICA INC                 | 234   | 74.78    | 17,498.52  |
| MATTEL INC                              | 757   | 16.24    | 12,293.68  |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED           | 363   | 61.41    | 22,291.83  |
| MOHAWK INDUSTRIES INC                   | 41    | 273.56   | 11,215.96  |
| NEWELL BRANDS INC                       | 990   | 30.48    | 30,175.20  |
| NIKE INC -CL B                          | 2,176 | 64.53    | 140,417.28 |
| NVR INC                                 | 7     | 3,405.54 | 23,838.78  |
| POLARIS INDUSTRIES INC                  | 135   | 127.19   | 17,170.65  |
| PVH CORPORATION                         | 177   | 131.69   | 23,309.13  |
| RALPH LAUREN CORPORATION                | 125   | 96.85    | 12,106.25  |
| TAPESTRY INC                            | 576   | 42.82    | 24,664.32  |
| TOLL BROTHERS INC                       | 357   | 47.08    | 16,807.56  |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A                | 421   | 13.82    | 5,818.22   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C                | 429   | 12.45    | 5,341.05   |
| VF CORP                                 | 540   | 73.35    | 39,609.00  |
| WHIRLPOOL CORP                          | 161   | 163.92   | 26,391.12  |
| ARAMARK                                 | 514   | 42.00    | 21,588.00  |
| CARNIVAL CORP(US)                       | 553   | 65.18    | 36,044.54  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC              | 53    | 314.02   | 16,643.06  |
| DARDEN RESTAURANTS INC                  | 259   | 86.96    | 22,522.64  |
| DOMINO'S PIZZA INC                      | 106   | 182.52   | 19,347.12  |
| H&R BLOCK INC                           | 425   | 26.89    | 11,428.25  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC           | 96    | 76.02    | 7,297.92   |
| LAS VEGAS SANDS CORP                    | 629   | 70.55    | 44,375.95  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A             | 573   | 127.72   | 73,183.56  |
| MCDONALD'S CORP                         | 1,342 | 173.14   | 232,353.88 |
| MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LTD-ADR | 436   | 26.54    | 11,571.44  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL               | 984   | 32.83    | 32,304.72  |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD      | 352   | 52.81    | 18,589.12  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD             | 306   | 121.66   | 37,227.96  |
| STARBUCKS CORP                          | 2,299 | 59.70    | 137,250.30 |
| VAIL RESORTS INC                        | 82    | 218.61   | 17,926.02  |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION           | 215   | 110.77   | 23,815.55  |
| WYNN RESORTS LTD                        | 180   | 165.00   | 29,700.00  |
| YUM! BRANDS INC                         | 589   | 82.04    | 48,321.56  |
| CBS CORP-CLASS B                        | 308   | 58.13    | 17,904.04  |

|  |       |          |            |
|--|-------|----------|------------|
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-CL A          | 355   | 328.68   | 116,681.40 |
| COMCAST CORP-CL A                        | 7,793 | 39.12    | 304,862.16 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS -C              | 493   | 18.65    | 9,194.45   |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A          | 348   | 20.04    | 6,973.92   |
| DISH NETWORK CORPORATION-A               | 486   | 48.52    | 23,580.72  |
| INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC       | 878   | 20.18    | 17,718.04  |
| LIBERTY BROADBAND-C                      | 237   | 84.89    | 20,118.93  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A                     | 540   | 32.33    | 17,458.20  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C                     | 224   | 31.43    | 7,040.32   |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP                   | 211   | 42.25    | 8,914.75   |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C                 | 366   | 42.02    | 15,379.32  |
| NEWS CORPRATION-CLASS A                  | 845   | 16.22    | 13,705.90  |
| OMNICOM GROUP                            | 86    | 73.10    | 6,286.60   |
| SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE INC         | 179   | 81.44    | 14,577.76  |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC                   | 3,387 | 5.66     | 19,170.42  |
| THE WALT DISNEY CO.                      | 2,576 | 110.57   | 284,828.32 |
| TIME WARNER INC                          | 1,277 | 89.65    | 114,483.05 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A     | 1,872 | 34.88    | 65,295.36  |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B     | 47    | 34.22    | 1,608.34   |
| VIACOM INC-CLASS B                       | 713   | 29.71    | 21,183.23  |
| ADVANCE AUTO PARTS INC                   | 163   | 100.20   | 16,332.60  |
| AMAZON.COM INC                           | 680   | 1,174.26 | 798,496.80 |
| AUTONATION INC                           | 156   | 52.42    | 8,177.52   |
| AUTOZONE INC                             | 12    | 701.23   | 8,414.76   |
| BEST BUY CO INC                          | 580   | 63.75    | 36,975.00  |
| CARMAX INC                               | 384   | 67.09    | 25,762.56  |
| DOLLAR GENERAL CORPORATION               | 435   | 90.79    | 39,493.65  |
| DOLLAR TREE INC                          | 376   | 104.65   | 39,348.40  |
| EXPEDIA INC                              | 265   | 119.90   | 31,773.50  |
| GAP INC/THE                              | 529   | 33.18    | 17,552.22  |
| GENUINE PARTS CO                         | 319   | 91.48    | 29,182.12  |
| HOME DEPOT INC                           | 1,898 | 182.13   | 345,682.74 |
| KOHL'S CORP                              | 397   | 49.78    | 19,762.66  |
| L BRANDS INC                             | 521   | 58.57    | 30,514.97  |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A | 920   | 24.10    | 22,172.00  |
| LKQ CORPORATION                          | 82    | 39.31    | 3,223.42   |
| LOWE'S COS INC                           | 1,354 | 85.58    | 115,875.32 |
| MACY'S INC                               | 676   | 24.80    | 16,764.80  |
| NETFLIX INC                              | 710   | 189.56   | 134,587.60 |
| NORDSTROM INC                            | 288   | 44.96    | 12,948.48  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC                  | 79    | 241.45   | 19,074.55  |
| PRICELINE GROUP INC/THE                  | 81    | 1,760.92 | 142,634.52 |

|                                  |       |        |            |
|----------------------------------|-------|--------|------------|
| ROSS STORES INC                  | 622   | 75.51  | 46,967.22  |
| TARGET CORP                      | 933   | 61.94  | 57,790.02  |
| TIFFANY & CO                     | 275   | 99.34  | 27,318.50  |
| TJX COMPANIES INC                | 1,059 | 73.42  | 77,751.78  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY           | 290   | 66.78  | 19,366.20  |
| TRIPADVISOR INC                  | 274   | 34.49  | 9,450.26   |
| ULTA BEAUTY INC                  | 121   | 217.17 | 26,277.57  |
| COSTCO WHOLESALE CORP            | 722   | 186.53 | 134,674.66 |
| CVS HEALTH CORPORATION           | 1,617 | 70.80  | 114,483.60 |
| KROGER CO                        | 936   | 25.90  | 24,242.40  |
| SYSCO CORP                       | 905   | 60.90  | 55,114.50  |
| WAL-MART STORES INC              | 2,496 | 97.13  | 242,436.48 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC     | 1,513 | 70.36  | 106,454.68 |
| ALTRIA GROUP INC                 | 3,180 | 71.79  | 228,292.20 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO        | 902   | 39.57  | 35,692.14  |
| BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B | 421   | 65.84  | 27,718.64  |
| BUNGE LIMITED                    | 286   | 66.12  | 18,910.32  |
| CAMPBELL SOUP COMPANY            | 378   | 48.56  | 18,355.68  |
| COCA-COLA CO/THE                 | 7,220 | 46.03  | 332,336.60 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS      | 480   | 39.10  | 18,768.00  |
| CONAGRA BRANDS INC               | 189   | 37.01  | 6,994.89   |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A       | 305   | 222.75 | 67,938.75  |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)  | 394   | 92.98  | 36,634.12  |
| GENERAL MILLS INC                | 1,025 | 56.13  | 57,533.25  |
| HERSHEY CO/THE                   | 309   | 113.36 | 35,028.24  |
| HORMEL FOODS CORPORATION         | 644   | 36.62  | 23,583.28  |
| INGREDION INCORPORATED           | 160   | 138.98 | 22,236.80  |
| KELLOGG COMPANY                  | 126   | 65.05  | 8,196.30   |
| KRAFT HEINZ CO/THE               | 966   | 78.98  | 76,294.68  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS      | 233   | 100.24 | 23,355.92  |
| MOLSON COORS BREWING CO-B        | 66    | 79.37  | 5,238.42   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC       | 2,498 | 42.77  | 106,839.46 |
| MONSTER BEVERAGE CORPORATION     | 631   | 63.13  | 39,835.03  |
| PEPSICO INC                      | 2,352 | 118.02 | 277,583.04 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC  | 2,557 | 107.68 | 275,337.76 |
| THE JM SMUCKER COMPANY           | 23    | 118.52 | 2,725.96   |
| TYSON FOODS INC-CL A             | 589   | 80.71  | 47,538.19  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC           | 523   | 48.46  | 25,344.58  |
| CLOROX COMPANY                   | 276   | 146.26 | 40,367.76  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO             | 1,332 | 73.24  | 97,555.68  |
| COTY INC-CL A                    | 1,073 | 19.54  | 20,966.42  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A  | 355   | 127.81 | 45,372.55  |

|                                     |       |        |            |
|-------------------------------------|-------|--------|------------|
| KIMBERLY-CLARK CORP                 | 563   | 117.25 | 66,011.75  |
| PROCTER & GAMBLE CO                 | 4,461 | 91.00  | 405,951.00 |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC        | 59    | 109.45 | 6,457.55   |
| ABBOTT LABORATORIES                 | 2,857 | 54.73  | 156,363.61 |
| AETNA INC                           | 527   | 178.49 | 94,064.23  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC                | 159   | 233.80 | 37,174.20  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP              | 334   | 89.31  | 29,829.54  |
| ANTHEM INC                          | 421   | 227.12 | 95,617.52  |
| BARD (C.R.) INC                     | 115   | 332.10 | 38,191.50  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.           | 871   | 64.78  | 56,423.38  |
| BECTON DICKINSON & CO               | 405   | 218.77 | 88,601.85  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP              | 2,541 | 25.62  | 65,100.42  |
| CARDINAL HEALTH INC                 | 179   | 60.35  | 10,802.65  |
| CENTENE CORPORATION                 | 366   | 99.02  | 36,241.32  |
| CERNER CORPORATION                  | 609   | 68.57  | 41,759.13  |
| CIGNA CORP                          | 421   | 203.63 | 85,728.23  |
| DANAHER CORP                        | 1,028 | 92.85  | 95,449.80  |
| DAVITA INC                          | 320   | 69.03  | 22,089.60  |
| DENTSPLY SIRONA INC                 | 149   | 65.65  | 9,781.85   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION    | 333   | 114.31 | 38,065.23  |
| ENVISION HEALTHCARE CORPORATION     | 260   | 32.96  | 8,569.60   |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO          | 1,056 | 69.02  | 72,885.12  |
| HCA HEALTHCARE INC                  | 466   | 86.15  | 40,145.90  |
| HENRY SCHEIN INC                    | 326   | 68.69  | 22,392.94  |
| HOLOGIC INC                         | 554   | 42.96  | 23,799.84  |
| HUMANA INC                          | 257   | 250.61 | 64,406.77  |
| IDEXX LABORATORIES INC              | 181   | 155.25 | 28,100.25  |
| INTUITIVE SURGICAL INC              | 182   | 360.56 | 65,621.92  |
| LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | 221   | 155.84 | 34,440.64  |
| MCKESSON CORP                       | 375   | 157.20 | 58,950.00  |
| MEDTRONIC PLC                       | 2,254 | 81.83  | 184,444.82 |
| QUEST DIAGNOSTICS                   | 46    | 97.12  | 4,467.52   |
| RESMED INC                          | 312   | 83.93  | 26,186.16  |
| STRYKER CORP                        | 534   | 151.34 | 80,815.56  |
| TELEFLEX INC                        | 97    | 249.35 | 24,186.95  |
| THE COOPER COS INC                  | 108   | 224.86 | 24,284.88  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC              | 1,687 | 221.25 | 373,248.75 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B         | 198   | 112.93 | 22,360.14  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC          | 207   | 109.77 | 22,722.39  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A           | 219   | 55.58  | 12,172.02  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC          | 214   | 112.82 | 24,143.48  |
| ABBVIE INC                          | 2,620 | 96.30  | 252,306.00 |

|                                  |        |        |            |
|----------------------------------|--------|--------|------------|
| AGILENT TECHNOLOGIES INC         | 661    | 66.51  | 43,963.11  |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC      | 400    | 113.09 | 45,236.00  |
| ALKERMES PLC                     | 336    | 51.56  | 17,324.16  |
| ALLERGAN PLC                     | 553    | 170.94 | 94,529.82  |
| AMGEN INC                        | 1,211  | 174.92 | 211,828.12 |
| BIOGEN INC                       | 339    | 323.55 | 109,683.45 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC      | 369    | 88.53  | 32,667.57  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO          | 2,712  | 62.13  | 168,496.56 |
| CELGENE CORP                     | 1,286  | 108.24 | 139,196.64 |
| ELI LILLY & CO                   | 1,635  | 86.50  | 141,427.50 |
| GILEAD SCIENCES INC              | 2,151  | 74.34  | 159,905.34 |
| ILLUMINA INC                     | 260    | 210.85 | 54,821.00  |
| INCYTE CORP                      | 350    | 95.97  | 33,589.50  |
| IQIVA HOLDINGS INC               | 291    | 101.47 | 29,527.77  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC         | 133    | 135.50 | 18,021.50  |
| JOHNSON & JOHNSON                | 4,630  | 141.65 | 655,839.50 |
| MERCK & CO. INC.                 | 4,503  | 56.01  | 252,213.03 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | 56     | 629.93 | 35,276.08  |
| MYLAN NV                         | 975    | 40.01  | 39,009.75  |
| PERRIGO CO PLC                   | 265    | 84.04  | 22,270.60  |
| PFIZER INC                       | 9,473  | 36.46  | 345,385.58 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS INC    | 139    | 383.12 | 53,253.68  |
| SEATTLE GENETICS INC             | 219    | 51.82  | 11,348.58  |
| TESARO INC                       | 77     | 83.87  | 6,457.99   |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR       | 1,874  | 17.30  | 32,420.20  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC     | 644    | 188.32 | 121,278.08 |
| UNITED THERAPEUTICS CORPORATION  | 94     | 135.78 | 12,763.32  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC       | 463    | 142.53 | 65,991.39  |
| WATERS CORP                      | 164    | 193.98 | 31,812.72  |
| ZOETIS INC                       | 873    | 71.76  | 62,646.48  |
| BANK OF AMERICA CORPORATION      | 15,797 | 28.73  | 453,847.81 |
| BB&T CORPORATION                 | 1,444  | 48.97  | 70,712.68  |
| CIT GROUP INC                    | 297    | 49.14  | 14,594.58  |
| CITIGROUP INC                    | 4,370  | 73.92  | 323,030.40 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC     | 1,045  | 40.87  | 42,709.15  |
| COMERICA INC                     | 381    | 83.75  | 31,908.75  |
| EAST WEST BANCORP INC            | 296    | 58.91  | 17,437.36  |
| FIFTH THIRD BANCORP              | 602    | 29.67  | 17,861.34  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA           | 331    | 88.54  | 29,306.74  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC        | 459    | 14.44  | 6,627.96   |
| JPMORGAN CHASE & CO              | 5,913  | 104.66 | 618,854.58 |
| KEYCORP                          | 2,215  | 19.52  | 43,236.80  |

|                                   |       |        |            |
|-----------------------------------|-------|--------|------------|
| M & T BANK CORP                   | 285   | 169.04 | 48,176.40  |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC    | 1,078 | 12.89  | 13,895.42  |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC     | 689   | 18.50  | 12,746.50  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP      | 768   | 142.97 | 109,800.96 |
| REGIONS FINANCIAL CORP            | 2,474 | 16.91  | 41,835.34  |
| SIGNATURE BANK                    | 119   | 133.43 | 15,878.17  |
| SUNTRUST BANKS INC                | 860   | 64.05  | 55,083.00  |
| SVB FINANCIAL GROUP               | 107   | 229.67 | 24,574.69  |
| US BANCORP                        | 2,775 | 54.15  | 150,266.25 |
| WELLS FARGO & COMPANY             | 7,536 | 59.22  | 446,281.92 |
| ZIONS BANCORPORATION              | 415   | 49.22  | 20,426.30  |
| ALLY FINANCIAL INC                | 939   | 28.49  | 26,752.11  |
| AMERICAN EXPRESS CO               | 1,251 | 97.15  | 121,534.65 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC          | 242   | 165.45 | 40,038.90  |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE  | 1,712 | 54.02  | 92,482.24  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B       | 2,190 | 196.66 | 430,685.40 |
| BLACKROCK INC                     | 200   | 506.75 | 101,350.00 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP        | 767   | 94.06  | 72,144.02  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC           | 207   | 126.06 | 26,094.42  |
| CME GROUP INC                     | 539   | 150.42 | 81,076.38  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES       | 626   | 73.67  | 46,117.42  |
| E*TRADE FINANCIAL CORP            | 606   | 48.43  | 29,348.58  |
| EATON VANCE CORPORATION           | 260   | 55.55  | 14,443.00  |
| FRANKLIN RESOURCES INC            | 696   | 43.07  | 29,976.72  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC           | 583   | 255.48 | 148,944.84 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC     | 940   | 70.32  | 66,100.80  |
| LEUCADIA NATIONAL CORPORATION     | 717   | 25.46  | 18,254.82  |
| MOODY'S CORP                      | 273   | 149.50 | 40,813.50  |
| MORGAN STANLEY                    | 2,202 | 52.64  | 115,913.28 |
| MSCI INC                          | 198   | 127.55 | 25,254.90  |
| NASDAQ INC                        | 247   | 77.47  | 19,135.09  |
| NORTHERN TRUST CORP               | 346   | 96.59  | 33,420.14  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC       | 283   | 86.64  | 24,519.12  |
| S&P GLOBAL INC                    | 409   | 167.59 | 68,544.31  |
| SEI INVESTMENTS COMPANY           | 297   | 70.67  | 20,988.99  |
| STATE STREET CORP                 | 669   | 97.97  | 65,541.93  |
| SYNCHRONY FINANCIAL               | 1,287 | 36.99  | 47,606.13  |
| T ROWE PRICE GROUP INC            | 429   | 101.59 | 43,582.11  |
| TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION | 582   | 50.88  | 29,612.16  |
| THE CHARLES SCHWAB CORPORATION    | 1,981 | 50.20  | 99,446.20  |
| VOYA FINANCIAL INC                | 431   | 45.50  | 19,610.50  |
| AFLAC INC                         | 706   | 88.42  | 62,424.52  |



|                                       |       |          |            |
|---------------------------------------|-------|----------|------------|
| ALLEGHANY CORPORATION                 | 34    | 562.64   | 19,129.76  |
| ALLSTATE CORP                         | 649   | 102.65   | 66,619.85  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC          | 153   | 103.26   | 15,798.78  |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP          | 1,464 | 58.11    | 85,073.04  |
| AON PLC                               | 467   | 136.58   | 63,782.86  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                | 252   | 89.80    | 22,629.60  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO               | 394   | 63.69    | 25,093.86  |
| ASSURANT INC                          | 126   | 97.79    | 12,321.54  |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A            | 156   | 50.24    | 7,837.44   |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED         | 196   | 49.79    | 9,758.84   |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC             | 173   | 58.73    | 10,160.29  |
| CHUBB LIMITED                         | 769   | 146.12   | 112,366.28 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION      | 346   | 72.65    | 25,136.90  |
| EVEREST RE GROUP LTD                  | 90    | 217.70   | 19,593.00  |
| FNF GROUP                             | 541   | 39.54    | 21,391.14  |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | 760   | 55.21    | 41,959.60  |
| LINCOLN NATIONAL CORP                 | 48    | 75.70    | 3,633.60   |
| LOEWS CORPORATION                     | 614   | 49.45    | 30,362.30  |
| MARKEL CORPORATION                    | 30    | 1,120.40 | 33,612.00  |
| MARSH & MCLENNAN COS                  | 818   | 83.02    | 67,910.36  |
| METLIFE INC                           | 1,627 | 52.49    | 85,401.23  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP             | 457   | 69.89    | 31,939.73  |
| PROGRESSIVE CORP                      | 1,034 | 55.14    | 57,014.76  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC              | 681   | 114.47   | 77,954.07  |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA          | 142   | 156.53   | 22,227.26  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD            | 94    | 124.42   | 11,695.48  |
| TORCHMARK CORPORATION                 | 249   | 88.86    | 22,126.14  |
| TRAVELERS COS INC/THE                 | 497   | 132.58   | 65,892.26  |
| UNUM GROUP                            | 471   | 54.26    | 25,556.46  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC              | 266   | 153.48   | 40,825.68  |
| WR BERKLEY CORP                       | 215   | 70.25    | 15,103.75  |
| XL GROUP LIMITED                      | 544   | 35.11    | 19,099.84  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD            | 2,643 | 7.23     | 19,108.89  |
| JONES LANG LASALLE INCORPORATED       | 104   | 145.48   | 15,129.92  |
| ACCENTURE PLC                         | 1,021 | 151.21   | 154,385.41 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC               | 1,136 | 65.03    | 73,874.08  |
| ADOBE SYSTEMS INC                     | 814   | 175.00   | 142,450.00 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES                   | 383   | 56.76    | 21,739.08  |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP            | 103   | 236.29   | 24,337.87  |
| ALPHABET INC-CL A                     | 472   | 1,057.47 | 499,125.84 |
| ALPHABET INC-CL C                     | 550   | 1,049.15 | 577,032.50 |
| ANSYS INC                             | 175   | 144.51   | 25,289.25  |

|  |        |        |              |
|--|--------|--------|--------------|
| AUTODESK INC                           | 315    | 106.25 | 33,468.75    |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING              | 737    | 116.46 | 85,831.02    |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS         | 263    | 88.84  | 23,364.92    |
| CA INC                                 | 693    | 33.19  | 23,000.67    |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC             | 572    | 43.19  | 24,704.68    |
| CDK GLOBAL INC                         | 281    | 69.59  | 19,554.79    |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES      | 281    | 106.30 | 29,870.30    |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A  | 970    | 71.81  | 69,655.70    |
| COSTAR GROUP INC                       | 72     | 287.80 | 20,721.60    |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V             | 444    | 79.76  | 35,413.44    |
| DXC TECHNOLOGY CO                      | 466    | 94.20  | 43,897.20    |
| EBAY INC                               | 1,632  | 37.60  | 61,363.20    |
| ELECTRONIC ARTS INC                    | 575    | 106.42 | 61,191.50    |
| FACEBOOK INC-A                         | 3,963  | 178.39 | 706,959.57   |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 588    | 93.60  | 55,036.80    |
| FIRST DATA CORP- CLASS A               | 711    | 16.26  | 11,560.86    |
| FISERV INC                             | 378    | 129.90 | 49,102.20    |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC              | 188    | 188.50 | 35,438.00    |
| FORTINET INC                           | 325    | 42.71  | 13,880.75    |
| GARTNER INC                            | 194    | 120.05 | 23,289.70    |
| GLOBAL PAYMENTS INC                    | 330    | 99.54  | 32,848.20    |
| INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION     | 1,469  | 154.00 | 226,226.00   |
| INTUIT INC                             | 433    | 156.19 | 67,630.27    |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC            | 159    | 116.06 | 18,453.54    |
| LEIDOS HOLDINGS INC                    | 293    | 63.87  | 18,713.91    |
| MASTERCARD INCORPORATED                | 1,562  | 151.93 | 237,314.66   |
| MERCADOLIBRE INC                       | 88     | 321.01 | 28,248.88    |
| MICROSOFT CORP                         | 12,322 | 84.69  | 1,043,550.18 |
| ORACLE CORPORATION                     | 5,081  | 50.19  | 255,015.39   |
| PAYCHEX INC                            | 663    | 68.33  | 45,302.79    |
| PAYPAL HOLDINGS INC                    | 1,879  | 74.26  | 139,534.54   |
| RED HAT INC                            | 293    | 126.13 | 36,956.09    |
| SABRE CORPORATION                      | 465    | 20.22  | 9,402.30     |
| SALESFORCE COM INC                     | 1,074  | 104.24 | 111,953.76   |
| SERVICENOW INC                         | 270    | 126.17 | 34,065.90    |
| SPLUNK INC                             | 298    | 81.19  | 24,194.62    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC         | 356    | 41.30  | 14,702.80    |
| SYMANTEC CORPORATION                   | 1,270  | 28.75  | 36,512.50    |
| SYNOPSYS INC                           | 309    | 87.98  | 27,185.82    |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC              | 366    | 76.63  | 28,046.58    |
| TWITTER INC                            | 1,265  | 22.58  | 28,563.70    |
| VANTIV INC-CLASS A                     | 345    | 74.88  | 25,833.60    |

|                                     |       |        |              |
|-------------------------------------|-------|--------|--------------|
| VISA INC-CLASS A SHARES             | 3,141 | 112.92 | 354,681.72   |
| VMWARE INC-CLASS A                  | 142   | 121.25 | 17,217.50    |
| WESTERN UNION COMPANY               | 1,073 | 19.35  | 20,762.55    |
| WORKDAY INC-CLASS A                 | 270   | 103.35 | 27,904.50    |
| ZILLOW GROUP INC-C                  | 254   | 40.72  | 10,342.88    |
| AMPHENOL CORPORATION-CL A           | 503   | 89.23  | 44,882.69    |
| APPLE INC                           | 8,629 | 172.22 | 1,486,086.38 |
| ARISTA NETWORKS INC                 | 95    | 226.72 | 21,538.40    |
| ARROW ELECTRONICS INC               | 201   | 77.22  | 15,521.22    |
| AVNET INC                           | 282   | 38.67  | 10,904.94    |
| CDW CORPORATION                     | 320   | 67.60  | 21,632.00    |
| CISCO SYSTEMS INC                   | 8,232 | 37.90  | 311,992.80   |
| COMMSCOPE HOLDING COMPANY INC       | 400   | 38.01  | 15,204.00    |
| CORNING INC                         | 1,637 | 31.81  | 52,072.97    |
| F5 NETWORKS INC                     | 145   | 130.23 | 18,883.35    |
| FLEX LTD                            | 1,195 | 17.83  | 21,306.85    |
| FLIR SYSTEMS INC                    | 301   | 47.14  | 14,189.14    |
| HARRIS CORPORATION                  | 255   | 141.27 | 36,023.85    |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE COMPANY  | 2,613 | 14.24  | 37,209.12    |
| HP INC                              | 2,995 | 20.74  | 62,116.30    |
| JUNIPER NETWORKS INC                | 757   | 28.80  | 21,801.60    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC              | 1     | 92.20  | 92.20        |
| NETAPP INC                          | 565   | 57.37  | 32,414.05    |
| PALO ALTO NETWORKS INC              | 203   | 145.43 | 29,522.29    |
| SEAGATE TECHNOLOGY                  | 606   | 41.94  | 25,415.64    |
| TE CONNECTIVITY LIMITED             | 632   | 95.51  | 60,362.32    |
| TRIMBLE INC                         | 554   | 40.24  | 22,292.96    |
| WESTERN DIGITAL CORPORATION         | 462   | 82.64  | 38,179.68    |
| XEROX CORPORATION                   | 476   | 29.31  | 13,951.56    |
| AT&T INC                            | 9,759 | 37.74  | 368,304.66   |
| CENTURYLINK INC                     | 2,109 | 16.47  | 34,735.23    |
| SPRINT CORPORATION                  | 1,762 | 5.63   | 9,920.06     |
| T-MOBILE US INC                     | 618   | 62.56  | 38,662.08    |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC          | 6,475 | 52.34  | 338,901.50   |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC             | 350   | 36.48  | 12,768.00    |
| AES CORP                            | 1,458 | 10.63  | 15,498.54    |
| ALLIANT ENERGY CORP                 | 503   | 43.95  | 22,106.85    |
| AMEREN CORPORATION                  | 520   | 60.83  | 31,631.60    |
| AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY INC | 875   | 76.29  | 66,753.75    |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC         | 382   | 90.35  | 34,513.70    |
| ATMOS ENERGY CORPORATION            | 230   | 89.42  | 20,566.60    |
| CENTERPOINT ENERGY INC              | 840   | 28.62  | 24,040.80    |

|                                     |       |        |            |
|-------------------------------------|-------|--------|------------|
| CMS ENERGY CORPORATION              | 575   | 49.07  | 28,215.25  |
| CONSOLIDATED EDISON INC             | 485   | 87.59  | 42,481.15  |
| DOMINION ENERGY INC                 | 998   | 84.38  | 84,211.24  |
| DTE ENERGY COMPANY                  | 368   | 113.62 | 41,812.16  |
| DUKE ENERGY CORPORATION             | 1,111 | 87.56  | 97,279.16  |
| EDISON INTERNATIONAL                | 517   | 69.29  | 35,822.93  |
| ENERGY CORP                         | 384   | 82.66  | 31,741.44  |
| EVERSOURCE ENERGY                   | 650   | 64.78  | 42,107.00  |
| EXELON CORP                         | 1,648 | 40.81  | 67,254.88  |
| FIRSTENERGY CORP                    | 942   | 32.12  | 30,257.04  |
| NEXTERA ENERGY INC                  | 771   | 157.98 | 121,802.58 |
| NISOURCE INC                        | 714   | 26.48  | 18,906.72  |
| OGE ENERGY CORPORATION              | 442   | 33.85  | 14,961.70  |
| P G & E CORPORATION                 | 909   | 52.72  | 47,922.48  |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION   | 246   | 88.97  | 21,886.62  |
| PPL CORPORATION                     | 1,084 | 33.80  | 36,639.20  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC | 803   | 51.94  | 41,707.82  |
| SCANA CORPORATION                   | 300   | 42.78  | 12,834.00  |
| SEMPRA ENERGY                       | 424   | 115.78 | 49,090.72  |
| SOUTHERN CO                         | 1,637 | 51.52  | 84,338.24  |
| UGI CORPORATION                     | 383   | 47.31  | 18,119.73  |
| WEC ENERGY GROUP INC                | 648   | 67.70  | 43,869.60  |
| WESTAR ENERGY INC                   | 314   | 54.99  | 17,266.86  |
| XCEL ENERGY INC                     | 806   | 50.39  | 40,614.34  |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC          | 1,743 | 10.13  | 17,656.59  |
| ANALOG DEVICES INC                  | 604   | 85.44  | 51,605.76  |
| APPLIED MATERIALS INC               | 1,769 | 51.31  | 90,767.39  |
| BROADCOM LTD                        | 661   | 259.34 | 171,423.74 |
| INTEL CORP                          | 7,475 | 43.26  | 323,368.50 |
| KLA-TENCOR CORPORATION              | 335   | 104.42 | 34,980.70  |
| LAM RESEARCH CORP                   | 287   | 182.10 | 52,262.70  |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD        | 834   | 21.65  | 18,056.10  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC       | 65    | 51.28  | 3,333.20   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC            | 463   | 85.47  | 39,572.61  |
| MICRON TECHNOLOGY INC               | 1,870 | 42.24  | 78,988.80  |
| NVIDIA CORP                         | 980   | 186.47 | 182,740.60 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV               | 616   | 115.88 | 71,382.08  |
| QORVO INC                           | 260   | 65.23  | 16,959.80  |
| QUALCOMM INC                        | 2,432 | 64.70  | 157,350.40 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC              | 380   | 94.09  | 35,754.20  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC               | 1,640 | 100.25 | 164,410.00 |
| XILINX INC                          | 511   | 68.07  | 34,783.77  |

|                              |                                   |         |            |                                  |
|------------------------------|-----------------------------------|---------|------------|----------------------------------|
|                              | 米ドル 建小計                           | 518,675 |            | 38,984,260.69<br>(4,381,830,901) |
| カナダドル                        | ALTAGAS LIMITED                   | 279     | 29.20      | 8,146.80                         |
|                              | ARC RESOURCES LIMITED             | 819     | 14.07      | 11,523.33                        |
|                              | CAMECO CORP (CA)                  | 772     | 13.17      | 10,167.24                        |
|                              | CANADIAN NATURAL RESOURCES        | 1,995   | 42.97      | 85,725.15                        |
|                              | CENOVUS ENERGY INC                | 2,196   | 11.26      | 24,726.96                        |
|                              | CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION | 1,193   | 8.49       | 10,128.57                        |
|                              | ENBRIDGE INC                      | 2,685   | 49.32      | 132,424.20                       |
|                              | ENCANA CORP                       | 2,096   | 14.81      | 31,041.76                        |
|                              | HUSKY ENERGY INC                  | 825     | 16.32      | 13,464.00                        |
|                              | IMPERIAL OIL LTD                  | 597     | 37.91      | 22,632.27                        |
|                              | INTER PIPELINE LIMITED            | 790     | 27.27      | 21,543.30                        |
|                              | KEYERA CORP                       | 410     | 35.82      | 14,686.20                        |
|                              | PEMBINA PIPELINE CORPORATION      | 767     | 44.77      | 34,338.59                        |
|                              | PRAIRIESKY ROYALTY LTD            | 351     | 31.79      | 11,158.29                        |
|                              | SEVEN GENERATIONS ENERGY - A      | 500     | 16.39      | 8,195.00                         |
|                              | SUNCOR ENERGY INC                 | 2,727   | 43.59      | 118,869.93                       |
|                              | TOURMALINE OIL CORPORATION        | 500     | 21.42      | 10,710.00                        |
|                              | TRANSCANADA CORPORATION           | 1,462   | 61.81      | 90,366.22                        |
|                              | VERMILION ENERGY INC              | 154     | 42.33      | 6,518.82                         |
|                              | AGNICO EAGLE MINES LIMITED        | 431     | 54.65      | 23,554.15                        |
|                              | AGRIUM INC                        | 224     | 142.28     | 31,870.72                        |
|                              | BARRICK GOLD CORP                 | 763     | 18.06      | 13,779.78                        |
|                              | CCL INDUSTRIES INC - CL B         | 300     | 59.70      | 17,910.00                        |
|                              | FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED    | 1,500   | 16.37      | 24,555.00                        |
|                              | FRANCO-NEVADA CORPORATION         | 321     | 98.11      | 31,493.31                        |
|                              | GOLDCORP INC                      | 22      | 15.83      | 348.26                           |
|                              | KINROSS GOLD CORP                 | 2,930   | 5.17       | 15,148.10                        |
|                              | METHANEX CORPORATION              | 234     | 73.17      | 17,121.78                        |
|                              | POTASH CORP OF SASKATCHEWAN       | 147     | 25.44      | 3,739.68                         |
|                              | TECK RESOURCES LIMITED-CL B       | 1,197   | 29.86      | 35,742.42                        |
|                              | TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED  | 2,200   | 3.94       | 8,668.00                         |
|                              | WEST FRASER TIMBER CO LIMITED     | 100     | 77.67      | 7,767.00                         |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 909                               | 27.43   | 24,933.87  |                                  |
| BOMBARDIER INC 'B'           | 4,400                             | 3.07    | 13,508.00  |                                  |
| CAE INC                      | 604                               | 22.29   | 13,463.16  |                                  |
| FINNING INTERNATIONAL INC    | 337                               | 31.42   | 10,588.54  |                                  |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        | 341                               | 56.12   | 19,136.92  |                                  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 1,306                             | 103.10  | 134,648.60 |                                  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 241                               | 229.83  | 55,389.03  |                                  |
| LINAMAR CORPORATION          | 100                               | 65.02   | 6,502.00   |                                  |

|   |       |        |            |
|---|-------|--------|------------|
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                       | 542   | 40.82  | 22,124.44  |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC         | 400   | 78.03  | 31,212.00  |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B                   | 891   | 29.49  | 26,275.59  |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A                    | 126   | 163.90 | 20,651.40  |
| DOLLARAMA INC                               | 200   | 154.39 | 30,878.00  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B                 | 815   | 66.99  | 54,596.85  |
| EMPIRE COMPANY LIMITED A                    | 450   | 23.83  | 10,723.50  |
| GEORGE WESTON LIMITED                       | 100   | 109.92 | 10,992.00  |
| JEAN COUTU GROUP INC A                      | 200   | 24.44  | 4,888.00   |
| LOBLAW COMPANIES LTD                        | 413   | 67.89  | 28,038.57  |
| METRO INC                                   | 513   | 40.60  | 20,827.80  |
| SAPUTO INC                                  | 400   | 44.62  | 17,848.00  |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC   | 700   | 25.11  | 17,577.00  |
| BANK OF MONTREAL                            | 1,007 | 100.30 | 101,002.10 |
| BANK OF NOVA SCOTIA                         | 1,893 | 82.44  | 156,058.92 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE                 | 792   | 119.73 | 94,826.16  |
| ROYAL BANK OF CANADA                        | 2,433 | 101.46 | 246,852.18 |
| TORONTO-DOMINION BANK(CA)                   | 2,962 | 71.70  | 212,375.40 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A                | 582   | 55.90  | 32,533.80  |
| CI FINANCIAL CORPORATION                    | 483   | 29.49  | 14,243.67  |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP               | 800   | 10.24  | 8,192.00   |
| IGM FINANCIAL INC                           | 193   | 44.76  | 8,638.68   |
| ONEX CORPORATION                            | 100   | 95.30  | 9,530.00   |
| THOMSON REUTERS CORP(CA)                    | 633   | 56.60  | 35,827.80  |
| GREAT-WEST LIFECO INC                       | 600   | 34.96  | 20,976.00  |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL | 242   | 58.82  | 14,234.44  |
| INTACT FINANCIAL CORPORATION                | 200   | 106.14 | 21,228.00  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP                     | 3,460 | 26.39  | 91,309.40  |
| POWER CORP OF CANADA                        | 729   | 32.26  | 23,517.54  |
| POWER FINANCIAL CORP                        | 473   | 34.93  | 16,521.89  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                      | 1,150 | 51.75  | 59,512.50  |
| FIRST CAPITAL REALTY INC                    | 300   | 20.98  | 6,294.00   |
| CGI GROUP INC -CL A                         | 377   | 68.19  | 25,707.63  |
| OPEN TEXT CORPORATION                       | 478   | 41.92  | 20,037.76  |
| SHOPIFY INC - CLASS A                       | 100   | 131.59 | 13,159.00  |
| BLACKBERRY LIMITED                          | 1,100 | 13.62  | 14,982.00  |
| BCE INC                                     | 336   | 61.69  | 20,727.84  |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B                 | 683   | 64.91  | 44,333.53  |
| TELUS CORPORATION                           | 44    | 47.98  | 2,111.12   |
| ATCO LIMITED                                | 194   | 45.20  | 8,768.80   |
| CANADIAN UTILITIES LTD A                    | 328   | 37.87  | 12,421.36  |
| EMERA INC                                   | 100   | 47.64  | 4,764.00   |

|     |   |        |          |                               |
|-----|---|--------|----------|-------------------------------|
|     | FORTIS INC                                  | 800    | 47.09    | 37,672.00                     |
|     | HYDRO ONE LIMITED                           | 600    | 22.48    | 13,488.00                     |
|     | カナダドル 建小計                                   | 69,647 |          | 2,864,715.62<br>(251,865,797) |
| ユーロ | ENAGAS SA                                   | 502    | 25.01    | 12,555.02                     |
|     | ENI SPA                                     | 4,038  | 13.95    | 56,330.10                     |
|     | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS                 | 1,109  | 15.66    | 17,366.94                     |
|     | KONINKLIJKE VOPAK NV                        | 161    | 36.74    | 5,915.94                      |
|     | NESTE OYJ                                   | 284    | 51.90    | 14,739.60                     |
|     | OMV AG                                      | 326    | 52.26    | 17,036.76                     |
|     | SNAM SPA                                    | 4,670  | 4.07     | 19,044.26                     |
|     | TENARIS SA                                  | 1,045  | 12.91    | 13,490.95                     |
|     | TOTAL SA                                    | 3,883  | 47.20    | 183,297.01                    |
|     | AIR LIQUIDE SA                              | 705    | 107.05   | 75,470.25                     |
|     | AKZO NOBEL                                  | 400    | 74.38    | 29,752.00                     |
|     | ARCELORMITTAL                               | 1,315  | 26.63    | 35,025.02                     |
|     | ARKEMA                                      | 150    | 103.90   | 15,585.00                     |
|     | BASF SE                                     | 1,512  | 93.75    | 141,750.00                    |
|     | COVESTRO AG                                 | 195    | 85.44    | 16,660.80                     |
|     | CRH PLC(IE)                                 | 1,488  | 28.78    | 42,824.64                     |
|     | EVONIK INDUSTRIES AG                        | 361    | 31.30    | 11,299.30                     |
|     | FUCHS PETROLUB SE-PREF                      | 159    | 43.95    | 6,988.84                      |
|     | IMERYS SA                                   | 82     | 77.82    | 6,381.24                      |
|     | K+S AG                                      | 439    | 20.09    | 8,821.70                      |
|     | KONINKLIJKE DSM NV                          | 372    | 80.33    | 29,882.76                     |
|     | LANXESS AG                                  | 202    | 64.56    | 13,041.12                     |
|     | LINDE AG - TENDER                           | 329    | 194.65   | 64,039.85                     |
|     | STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)                    | 1,219  | 13.29    | 16,200.51                     |
|     | THYSSENKRUPP AG                             | 814    | 23.73    | 19,316.22                     |
|     | UMICORE                                     | 408    | 39.43    | 16,087.44                     |
|     | UPM-KYMMENE OYJ                             | 1,145  | 25.59    | 29,300.55                     |
|     | VOESTALPINE AG                              | 261    | 49.02    | 12,794.22                     |
|     | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS | 506    | 32.01    | 16,197.06                     |
|     | AIRBUS SE                                   | 956    | 85.34    | 81,585.04                     |
|     | ALSTOM                                      | 339    | 33.89    | 11,488.71                     |
|     | ANDRITZ AG                                  | 167    | 46.65    | 7,790.55                      |
|     | BOSKALIS WESTMINSTER NV                     | 209    | 30.70    | 6,416.30                      |
|     | BOUYGUES SA                                 | 461    | 44.04    | 20,302.44                     |
|     | BRENNTAG AG                                 | 342    | 53.14    | 18,173.88                     |
|     | CNH INDUSTRIAL NV                           | 2,096  | 11.13    | 23,328.48                     |
|     | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN                   | 889    | 46.86    | 41,658.54                     |
|     | DASSAULT AVIATION SA                        | 5      | 1,319.80 | 6,599.00                      |

|   |       |        |            |
|---|-------|--------|------------|
| EIFFAGE SA                                | 151   | 91.60  | 13,831.60  |
| FERROVIAL SA                              | 993   | 18.04  | 17,918.68  |
| GEA GROUP AG                              | 405   | 39.50  | 15,997.50  |
| HOCHTIEF AG                               | 43    | 146.50 | 6,299.50   |
| KION GROUP AG                             | 126   | 69.32  | 8,734.32   |
| KONE OYJ-B                                | 724   | 43.81  | 31,718.44  |
| LEGRAND SA                                | 422   | 62.91  | 26,548.02  |
| LEONARDO SPA                              | 895   | 9.94   | 8,900.77   |
| MAN SE                                    | 81    | 94.86  | 7,683.66   |
| METSO OYJ                                 | 259   | 29.86  | 7,733.74   |
| OSRAM LICHT AG                            | 172   | 72.30  | 12,435.60  |
| PRYSMIAN SPA                              | 432   | 26.97  | 11,651.04  |
| REXEL SA                                  | 670   | 15.33  | 10,271.10  |
| SAFRAN SA                                 | 557   | 85.83  | 47,807.31  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                     | 893   | 70.66  | 63,099.38  |
| SIEMENS AG-REG                            | 1,259 | 116.20 | 146,295.80 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY           | 489   | 11.54  | 5,643.06   |
| THALES SA                                 | 217   | 87.00  | 18,879.00  |
| VINCI SA                                  | 799   | 86.45  | 69,073.55  |
| WARTSILA OYJ-B SHARES                     | 327   | 53.25  | 17,412.75  |
| ZODIAC AEROSPACE                          | 466   | 24.83  | 11,570.78  |
| BUREAU VERITAS SA                         | 569   | 22.64  | 12,882.16  |
| EDENRED                                   | 483   | 23.76  | 11,478.49  |
| RANDSTAD HOLDING NV                       | 263   | 51.89  | 13,647.07  |
| RELX NV                                   | 130   | 19.38  | 2,519.40   |
| SOCIETE BIC SA                            | 66    | 94.00  | 6,204.00   |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA                | 1,424 | 18.60  | 26,486.40  |
| AENA SME SA                               | 139   | 169.25 | 23,525.75  |
| AEROPORTS DE PARIS(ADP)                   | 68    | 159.40 | 10,839.20  |
| ATLANTIA SPA                              | 913   | 26.75  | 24,422.75  |
| BOLLORE                                   | 2,000 | 4.49   | 8,988.00   |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG                    | 538   | 29.95  | 16,113.10  |
| DEUTSCHE POST AG-REG                      | 1,728 | 40.30  | 69,638.40  |
| FRAPORT AG                                | 95    | 89.08  | 8,462.60   |
| GROUPE EUROTUNNEL SE                      | 1,034 | 10.62  | 10,981.08  |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP | 1,306 | 7.23   | 9,451.52   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG               | 589   | 86.18  | 50,760.02  |
| BMW-PFD                                   | 126   | 74.35  | 9,368.10   |
| CONTINENTAL AG                            | 181   | 223.60 | 40,471.60  |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES              | 1,585 | 70.89  | 112,360.65 |
| FERRARI NV                                | 272   | 89.80  | 24,425.60  |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV              | 2,195 | 15.00  | 32,925.00  |



|                                     |       |        |            |
|-------------------------------------|-------|--------|------------|
| MICHELIN (CGDE)-B                   | 272   | 120.80 | 32,857.60  |
| NOKIAN RENKAAT OYJ                  | 265   | 36.03  | 9,547.95   |
| PEUGEOT SA                          | 1,075 | 17.27  | 18,570.62  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD       | 339   | 71.00  | 24,069.00  |
| RENAULT SA                          | 364   | 85.05  | 30,958.20  |
| SCHAEFFLER AG                       | 367   | 13.85  | 5,084.78   |
| VOLKSWAGEN AG                       | 74    | 170.60 | 12,624.40  |
| VOLKSWAGEN AG-PFD                   | 330   | 169.65 | 55,984.50  |
| ADIDAS AG                           | 299   | 169.10 | 50,560.90  |
| HERMES INTERNATIONAL                | 43    | 442.45 | 19,025.35  |
| HUGO BOSS AG-ORD                    | 153   | 70.87  | 10,843.11  |
| KERING                              | 135   | 388.65 | 52,467.75  |
| LUXOTTICA GROUP SPA                 | 375   | 50.75  | 19,031.25  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 460   | 244.35 | 112,401.00 |
| SEB SA                              | 50    | 149.00 | 7,450.00   |
| ACCOR SA                            | 378   | 41.93  | 15,851.43  |
| PADDY POWER BETFAIR PLC             | 176   | 96.62  | 17,005.12  |
| SODEXO                              | 189   | 111.35 | 21,045.15  |
| ALTICE SA-A                         | 818   | 8.12   | 6,642.16   |
| AXEL SPRINGER SE                    | 99    | 67.17  | 6,649.83   |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS             | 400   | 18.69  | 7,478.00   |
| JC DECAUX SA                        | 170   | 33.79  | 5,744.30   |
| LAGARDERE S.C.A.                    | 271   | 27.55  | 7,467.40   |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG        | 515   | 29.03  | 14,950.45  |
| PUBLICIS GROUPE                     | 412   | 57.42  | 23,657.04  |
| RTL GROUP SA                        | 89    | 68.00  | 6,052.00   |
| SES                                 | 806   | 13.87  | 11,183.25  |
| TELENET GROUP HOLDING NV            | 121   | 56.81  | 6,874.01   |
| VIVENDI                             | 1,635 | 22.30  | 36,460.50  |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA       | 1,731 | 30.72  | 53,176.32  |
| ZALANDO SE                          | 198   | 46.00  | 9,108.00   |
| CARREFOUR SA                        | 1,216 | 17.52  | 21,304.32  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON SA        | 127   | 48.72  | 6,187.44   |
| COLRUYT SA                          | 154   | 42.64  | 6,567.33   |
| JERONIMO MARTINS SGPS SA            | 577   | 15.85  | 9,145.45   |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV       | 2,034 | 18.49  | 37,608.66  |
| METRO AG                            | 394   | 16.43  | 6,473.42   |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV          | 1,254 | 93.70  | 117,499.80 |
| DANONE                              | 937   | 70.73  | 66,274.01  |
| HEINEKEN HOLDING NV                 | 223   | 81.29  | 18,127.67  |
| HEINEKEN NV                         | 473   | 85.99  | 40,673.27  |
| KERRY GROUP PLC-A                   | 340   | 93.50  | 31,790.00  |

|  |        |        |            |
|--|--------|--------|------------|
| PERNOD-RICARD SA                         | 378    | 129.05 | 48,780.90  |
| REMY COINTREAU SA                        | 51     | 116.10 | 5,921.10   |
| BEIERSDORF AG                            | 223    | 99.60  | 22,210.80  |
| HENKEL AG & CO KGAA                      | 213    | 102.80 | 21,896.40  |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG               | 283    | 112.50 | 31,837.50  |
| L'OREAL                                  | 414    | 186.45 | 77,190.30  |
| UNILEVER NV-CVA                          | 2,682  | 48.18  | 129,232.17 |
| ESSILOR INTERNATIONAL SA                 | 329    | 112.50 | 37,012.50  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA      | 101    | 87.57  | 8,844.57   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA                   | 739    | 64.58  | 47,724.62  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV                   | 1,654  | 32.52  | 53,796.35  |
| BAYER AG                                 | 1,361  | 105.10 | 143,041.10 |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE                   | 24     | 510.40 | 12,249.60  |
| GRIFOLS SA                               | 660    | 24.32  | 16,051.20  |
| IPSEN SA                                 | 77     | 101.45 | 7,811.65   |
| MERCK KGAA                               | 277    | 90.05  | 24,943.85  |
| ORION OYJ-CLASS B                        | 221    | 30.73  | 6,791.33   |
| QIAGEN NV                                | 485    | 27.18  | 13,182.30  |
| RECORDATI SPA                            | 215    | 37.02  | 7,959.30   |
| SANOFI                                   | 1,867  | 73.77  | 137,728.59 |
| UCB SA                                   | 280    | 64.06  | 17,936.80  |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA                    | 624    | 26.83  | 16,741.92  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA       | 10,978 | 7.13   | 78,349.98  |
| BANCO DE SABADELL SA                     | 11,804 | 1.64   | 19,417.58  |
| BANCO ESPIRITO SANTO-REG                 | 7,632  | 0.00   | 0.00       |
| BANCO SANTANDER SA                       | 25,641 | 5.61   | 143,999.85 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC                | 2,028  | 6.96   | 14,129.07  |
| BANKIA SA                                | 2,068  | 4.04   | 8,373.33   |
| BANKINTER SA                             | 1,491  | 7.89   | 11,775.91  |
| BNP PARIBAS                              | 1,848  | 63.49  | 117,329.52 |
| CAIXABANK                                | 7,696  | 3.92   | 30,191.40  |
| COMMERZBANK AG                           | 2,355  | 12.59  | 29,661.22  |
| CREDIT AGRICOLE SA                       | 2,410  | 14.33  | 34,547.35  |
| ERSTE GROUP BANK AG                      | 666    | 35.20  | 23,443.20  |
| ING GROEP NV-CVA                         | 6,396  | 15.50  | 99,138.00  |
| INTESA SANPAOLO                          | 23,649 | 2.80   | 66,406.39  |
| INTESA SANPAOLO-RSP                      | 2,139  | 2.69   | 5,771.02   |
| IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE) | 9,000  | 0.00   | 0.00       |
| KBC GROEP NV                             | 446    | 71.48  | 31,880.08  |
| MEDIOBANCA SPA                           | 1,301  | 9.54   | 12,411.54  |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG         | 269    | 29.93  | 8,052.51   |
| SOCIETE GENERALE                         | 1,218  | 44.02  | 53,622.45  |

|                                   |        |        |            |
|-----------------------------------|--------|--------|------------|
| UNICREDIT SPA                     | 3,564  | 16.46  | 58,663.44  |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED       | 3,856  | 16.36  | 63,103.44  |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 396    | 97.65  | 38,669.40  |
| EURAZEO                           | 95     | 75.77  | 7,198.15   |
| EXOR NV                           | 240    | 51.55  | 12,372.00  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA       | 178    | 90.50  | 16,109.00  |
| NATIXIS SA                        | 2,082  | 6.58   | 13,709.97  |
| WENDEL                            | 62     | 141.85 | 8,794.70   |
| AEGON NV                          | 3,901  | 5.30   | 20,679.20  |
| AGEAS                             | 431    | 41.52  | 17,895.12  |
| ALLIANZ SE-REG                    | 752    | 195.75 | 147,204.00 |
| ASSICURAZIONI GENERALI            | 64     | 15.45  | 988.80     |
| AXA                               | 3,196  | 25.25  | 80,699.00  |
| CNP ASSURANCES                    | 394    | 19.28  | 7,598.29   |
| HANNOVER RUECK SE                 | 133    | 107.40 | 14,284.20  |
| MAPFRE SA                         | 2,472  | 2.66   | 6,590.35   |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG  | 276    | 184.25 | 50,853.00  |
| NN GROUP NV                       | 619    | 37.48  | 23,203.21  |
| POSTE ITALIANE SPA                | 1,156  | 6.11   | 7,068.94   |
| SAMPO OYJ-A SHS                   | 710    | 45.54  | 32,333.40  |
| SCOR SE                           | 361    | 34.65  | 12,510.45  |
| UNIPOLSAI SPA                     | 2,504  | 1.95   | 4,885.30   |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                | 761    | 36.44  | 27,730.84  |
| VONOVIA SE                        | 748    | 40.94  | 30,623.12  |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS         | 781    | 60.35  | 47,133.35  |
| ATOS SE                           | 197    | 130.20 | 25,649.40  |
| DASSAULT SYSTEMES SA              | 264    | 89.50  | 23,628.00  |
| SAP SE                            | 1,618  | 96.77  | 156,573.86 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE      | 272    | 58.16  | 15,819.52  |
| INGENICO GROUP                    | 122    | 87.09  | 10,624.98  |
| NOKIA OYJ                         | 10,385 | 3.91   | 40,626.12  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG           | 5,197  | 15.17  | 78,864.47  |
| ELISA OYJ                         | 315    | 32.80  | 10,332.00  |
| ILIAD SA                          | 58     | 203.50 | 11,803.00  |
| KONINKLIJKE KPN NV                | 7,012  | 2.88   | 20,208.58  |
| ORANGE                            | 3,550  | 14.57  | 51,741.25  |
| PROXIMUS                          | 337    | 27.46  | 9,255.70   |
| TELECOM ITALIA-RSP                | 13,336 | 0.60   | 8,001.60   |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 1,645  | 4.22   | 6,955.06   |
| TELEFONICA SA                     | 7,197  | 8.23   | 59,296.08  |
| E.ON SE                           | 3,917  | 9.18   | 35,969.81  |
| ELECTRICITE DE FRANCE             | 1,126  | 10.47  | 11,794.85  |

|     |                                    |         |        |                               |
|-----|------------------------------------|---------|--------|-------------------------------|
|     | ENDESA SA                          | 703     | 18.41  | 12,942.23                     |
|     | ENEL SPA                           | 13,390  | 5.33   | 71,435.65                     |
|     | ENERGIAS DE PORTUGAL SA            | 5,258   | 2.89   | 15,232.42                     |
|     | ENGIE                              | 3,395   | 14.47  | 49,125.65                     |
|     | FORTUM OYJ                         | 983     | 16.94  | 16,652.02                     |
|     | GAS NATURAL SDG SA                 | 775     | 18.98  | 14,713.37                     |
|     | IBERDROLA SA                       | 10,205  | 6.51   | 66,516.19                     |
|     | INNOGY SE                          | 307     | 32.19  | 9,883.86                      |
|     | RED ELECTRICA CORPORACION SA       | 958     | 18.80  | 18,010.40                     |
|     | RWE AG                             | 1,083   | 17.27  | 18,703.41                     |
|     | SUEZ                               | 726     | 14.77  | 10,726.65                     |
|     | TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA | 2,888   | 5.02   | 14,512.20                     |
|     | VEOLIA ENVIRONNEMENT               | 1,059   | 20.84  | 22,074.85                     |
|     | ASML HOLDING NV                    | 615     | 146.25 | 89,943.75                     |
|     | INFINEON TECHNOLOGIES AG           | 1,869   | 22.80  | 42,622.54                     |
|     | STMICROELECTRONICS NV              | 1,410   | 18.57  | 26,183.70                     |
|     | ユーロ 建小計                            | 346,063 |        | 6,827,176.36<br>(904,600,867) |
| 英債券 | BP PLC                             | 32,400  | 5.04   | 163,296.00                    |
|     | JOHN WOOD GROUP PLC                | 1,202   | 6.21   | 7,464.42                      |
|     | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS        | 7,370   | 23.95  | 176,511.50                    |
|     | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS        | 6,166   | 24.29  | 149,802.97                    |
|     | ANGLO AMERICAN PLC                 | 2,118   | 13.88  | 29,408.43                     |
|     | ANTOFAGASTA PLC                    | 904     | 9.15   | 8,271.60                      |
|     | BHP BILLITON PLC(UK)               | 3,758   | 13.88  | 52,161.04                     |
|     | CRODA INTERNATIONAL PLC            | 290     | 42.91  | 12,443.90                     |
|     | FRESNILLO PLC                      | 507     | 13.05  | 6,616.35                      |
|     | GLENCORE PLC                       | 20,144  | 3.57   | 71,984.58                     |
|     | JOHNSON MATTHEY PLC                | 428     | 30.18  | 12,917.04                     |
|     | MONDI PLC                          | 812     | 17.75  | 14,413.00                     |
|     | RANDGOLD RESOURCES LIMITED         | 208     | 69.20  | 14,393.60                     |
|     | RIO TINTO PLC(UK)                  | 2,032   | 35.62  | 72,379.84                     |
|     | ASHTREAD GROUP PLC                 | 1,104   | 19.22  | 21,218.88                     |
|     | BAE SYSTEMS PLC                    | 5,054   | 5.62   | 28,428.75                     |
|     | COBHAM PLC                         | 5,128   | 1.24   | 6,379.23                      |
|     | DCC PUBLIC LIMITED COMPANY         | 196     | 70.75  | 13,867.00                     |
|     | IMI PLC                            | 624     | 12.56  | 7,837.44                      |
|     | MEGGITT PLC                        | 1,716   | 4.74   | 8,138.98                      |
|     | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC           | 3,397   | 8.23   | 27,957.31                     |
|     | SMITHS GROUP PLC                   | 875     | 14.45  | 12,643.75                     |
|     | THE WEIR GROUP PLC                 | 482     | 20.12  | 9,697.84                      |
|     | TRAVIS PERKINS PLC                 | 553     | 15.20  | 8,405.60                      |

|                                   |        |       |            |
|-----------------------------------|--------|-------|------------|
| BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC   | 580    | 6.75  | 3,915.00   |
| CAPITA PLC                        | 1,476  | 4.07  | 6,008.79   |
| EXPERIAN PLC                      | 430    | 15.86 | 6,819.80   |
| G4S PLC                           | 3,433  | 2.51  | 8,644.29   |
| INTERTEK GROUP PLC                | 357    | 50.20 | 17,921.40  |
| RELX PLC                          | 1,701  | 17.27 | 29,376.27  |
| EASYJET PLC                       | 372    | 14.26 | 5,304.72   |
| ROYAL MAIL PLC                    | 1,991  | 4.45  | 8,859.95   |
| GKN PLC                           | 3,793  | 2.97  | 11,269.00  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC          | 2,227  | 6.30  | 14,030.10  |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC       | 303    | 41.01 | 12,426.03  |
| BURBERRY GROUP PLC                | 975    | 17.31 | 16,877.25  |
| PERSIMMON PLC                     | 682    | 26.52 | 18,086.64  |
| TAYLOR WIMPEY PLC                 | 7,223  | 2.01  | 14,547.12  |
| CARNIVAL PLC(UK)                  | 388    | 47.77 | 18,534.76  |
| COMPASS GROUP PLC                 | 2,814  | 15.24 | 42,885.36  |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC         | 1,573  | 3.62  | 5,702.12   |
| TUI AG                            | 904    | 14.33 | 12,954.32  |
| WHITBREAD PLC                     | 405    | 38.30 | 15,511.50  |
| ITV PLC                           | 8,015  | 1.66  | 13,328.94  |
| PEARSON PLC                       | 1,819  | 7.38  | 13,424.22  |
| SKY PLC                           | 2,212  | 9.90  | 21,898.80  |
| WPP PLC                           | 531    | 13.54 | 7,189.74   |
| KINGFISHER PLC                    | 4,954  | 3.33  | 16,521.59  |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC         | 3,595  | 3.09  | 11,119.33  |
| NEXT PLC                          | 309    | 43.45 | 13,426.05  |
| SAINSBURY (J) PLC                 | 3,629  | 2.36  | 8,586.21   |
| TESCO PLC                         | 17,530 | 2.06  | 36,278.33  |
| WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC | 4,908  | 2.13  | 10,473.67  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC      | 764    | 28.60 | 21,850.40  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)  | 3,787  | 49.24 | 186,490.81 |
| COCA-COLA HBC AG-CDI              | 402    | 23.23 | 9,338.46   |
| DIAGEO PLC                        | 4,145  | 26.32 | 109,096.40 |
| IMPERIAL BRANDS PLC               | 1,522  | 30.50 | 46,421.00  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 1,099  | 67.00 | 73,633.00  |
| UNILEVER PLC                      | 2,109  | 41.40 | 87,312.60  |
| CONVATEC GROUP PLC                | 2,403  | 2.03  | 4,882.89   |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC      | 845    | 6.21  | 5,251.67   |
| SMITH & NEPHEW PLC                | 250    | 12.88 | 3,220.00   |
| ASTRAZENECA PLC                   | 2,084  | 48.84 | 101,792.98 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC               | 8,097  | 12.90 | 104,491.78 |
| SHIRE PLC                         | 1,441  | 36.85 | 53,100.85  |

|        |                                     |         |          |                               |  |
|--------|-------------------------------------|---------|----------|-------------------------------|--|
|        | BARCLAYS PLC                        | 27,035  | 2.02     | 54,799.94                     |  |
|        | HSBC HOLDINGS PLC(UK)               | 31,826  | 7.56     | 240,763.69                    |  |
|        | LLOYDS BANKING GROUP PLC            | 113,905 | 0.66     | 75,530.40                     |  |
|        | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC    | 7,280   | 2.77     | 20,231.12                     |  |
|        | STANDARD CHARTERED PLC(UK)          | 5,855   | 7.59     | 44,462.87                     |  |
|        | 3I GROUP PLC                        | 2,152   | 8.91     | 19,174.32                     |  |
|        | HARGREAVES LANSDOWN PLC             | 598     | 17.09    | 10,219.82                     |  |
|        | INVESTEC PLC                        | 1,506   | 4.77     | 7,197.17                      |  |
|        | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC     | 676     | 37.99    | 25,681.24                     |  |
|        | SCHRODERS PLC                       | 255     | 34.71    | 8,851.05                      |  |
|        | ST JAMES'S PLACE PLC                | 1,167   | 11.72    | 13,677.24                     |  |
|        | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC          | 360     | 4.13     | 1,489.68                      |  |
|        | ADMIRAL GROUP PLC                   | 409     | 19.15    | 7,832.35                      |  |
|        | AVIVA PLC                           | 7,235   | 5.00     | 36,211.17                     |  |
|        | DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC     | 3,042   | 3.64     | 11,082.00                     |  |
|        | LEGAL & GENERAL GROUP PLC           | 10,597  | 2.66     | 28,188.02                     |  |
|        | OLD MUTUAL PLC                      | 10,119  | 2.01     | 20,399.90                     |  |
|        | PRUDENTIAL PLC                      | 4,104   | 18.43    | 75,657.24                     |  |
|        | RSA INSURANCE GROUP PLC             | 2,255   | 6.02     | 13,575.10                     |  |
|        | AUTO TRADER GROUP PLC               | 2,260   | 3.48     | 7,871.58                      |  |
|        | MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC(UK)   | 468     | 24.89    | 11,648.52                     |  |
|        | SAGE GROUP PLC (THE)                | 2,389   | 7.83     | 18,717.81                     |  |
|        | WORLDPAY GROUP PLC                  | 3,982   | 4.29     | 17,090.74                     |  |
|        | BT GROUP PLC                        | 15,065  | 2.73     | 41,255.50                     |  |
|        | VODAFONE GROUP PLC                  | 43,833  | 2.29     | 100,684.40                    |  |
|        | CENTRICA PLC                        | 11,768  | 1.38     | 16,251.60                     |  |
|        | NATIONAL GRID PLC                   | 5,456   | 8.61     | 47,019.80                     |  |
|        | SEVERN TRENT PLC                    | 521     | 20.64    | 10,753.44                     |  |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC          | 1,509   | 8.00     | 12,072.00                     |  |
|        | 英ボンド 建小計                            | 523,172 |          | 3,163,832.90<br>(477,738,767) |  |
| スイスフラン | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG           | 18      | 661.50   | 11,907.00                     |  |
|        | GIVAUDAN-REG                        | 19      | 2,233.00 | 42,427.00                     |  |
|        | LAFARGEHOLCIM LTD-REG               | 810     | 52.70    | 42,687.00                     |  |
|        | SIKA AG-BR                          | 4       | 7,600.00 | 30,400.00                     |  |
|        | ABB LIMITED-REG                     | 3,282   | 25.85    | 84,839.70                     |  |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG            | 46      | 218.10   | 10,032.60                     |  |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT         | 90      | 222.70   | 20,043.00                     |  |
|        | KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG | 119     | 173.30   | 20,622.70                     |  |
|        | CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG        | 829     | 88.15    | 73,076.35                     |  |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-REG             | 114     | 74.45    | 8,487.30                      |  |
|        | THE SWATCH GROUP AG-B               | 63      | 392.50   | 24,727.50                     |  |

|                |                              |        |          |                               |
|----------------|------------------------------|--------|----------|-------------------------------|
|                | DUFREY AG                    | 75     | 136.00   | 10,200.00                     |
|                | BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 5      | 1,929.00 | 9,645.00                      |
|                | LINDT&SPRUENGLI AG-PC        | 2      | 5,720.00 | 11,440.00                     |
|                | NESTLE SA-REGISTERED         | 4,940  | 85.00    | 419,900.00                    |
|                | SONOVA HOLDING AG-REG        | 116    | 155.60   | 18,049.60                     |
|                | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 20     | 696.50   | 13,930.00                     |
|                | LONZA GROUP AG-REG           | 118    | 264.70   | 31,234.60                     |
|                | NOVARTIS AG-REG SHS          | 3,531  | 83.85    | 296,074.35                    |
|                | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 1,157  | 241.70   | 279,646.90                    |
|                | VIFOR PHARMA AG              | 100    | 124.90   | 12,490.00                     |
|                | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 4,321  | 17.39    | 75,142.19                     |
|                | PARGESA HOLDING SA-BR        | 80     | 84.45    | 6,756.00                      |
|                | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 38     | 667.50   | 25,365.00                     |
|                | UBS GROUP AG                 | 5,808  | 17.92    | 104,079.36                    |
|                | BALOISE HOLDING AG-REG       | 111    | 152.30   | 16,905.30                     |
|                | SWISS RE AG                  | 577    | 92.10    | 53,141.70                     |
|                | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 240    | 300.50   | 72,120.00                     |
|                | SWISS PRIME SITE AG-REG      | 158    | 87.90    | 13,888.20                     |
|                | SWISSCOM AG-REG              | 53     | 520.00   | 27,560.00                     |
|                | スイスフラン 建小計                   | 26,844 |          | 1,866,818.35<br>(212,219,910) |
| スウェーデンク<br>ローナ | LUNDIN PETROLEUM AB          | 414    | 190.80   | 78,991.20                     |
|                | BOLIDEN AB                   | 605    | 268.40   | 162,382.00                    |
|                | ALFA LAVAL AB                | 650    | 192.40   | 125,060.00                    |
|                | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 1,106  | 351.60   | 388,869.60                    |
|                | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 801    | 313.70   | 251,273.70                    |
|                | SANDVIK AB                   | 2,287  | 142.40   | 325,668.80                    |
|                | SKANSKA AB-B SHS             | 752    | 181.20   | 136,262.40                    |
|                | SKF AB-B SHARES              | 774    | 182.90   | 141,564.60                    |
|                | VOLVO AB-B SHS               | 2,559  | 157.50   | 403,042.50                    |
|                | SECURITAS AB-B SHS           | 693    | 143.90   | 99,722.70                     |
|                | ELECTROLUX AB-SER B          | 532    | 268.80   | 143,001.60                    |
|                | HUSQVARNA AB-B SHS           | 955    | 81.15    | 77,498.25                     |
|                | HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 1,507  | 200.30   | 301,852.10                    |
|                | ICA GRUPPEN AB               | 185    | 297.60   | 55,056.00                     |
|                | SWEDISH MATCH AB             | 418    | 326.10   | 136,309.80                    |
|                | ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 1,249  | 243.20   | 303,756.80                    |
|                | GETINGE AB-B SHS             | 459    | 120.80   | 55,447.20                     |
|                | NORDEA BANK AB               | 5,662  | 100.00   | 566,200.00                    |
|                | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 3,135  | 112.80   | 353,628.00                    |
|                | SWEDBANK AB-A SHARES         | 1,859  | 198.80   | 369,569.20                    |
|                | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 377    | 199.90   | 75,362.30                     |

|            |                                |        |            |                              |
|------------|--------------------------------|--------|------------|------------------------------|
|            | INVESTOR AB-B SHS              | 935    | 386.00     | 360,910.00                   |
|            | KINNEVIK AB-B                  | 518    | 280.40     | 145,247.20                   |
|            | L E LUNDBERGFÖRETAGEN AB-B SHS | 84     | 623.00     | 52,332.00                    |
|            | ERICSSON LM-B SHS              | 6,300  | 55.45      | 349,335.00                   |
|            | HEXAGON AB-B SHS               | 572    | 407.30     | 232,975.60                   |
|            | MILLICOM INTL CELLULAR -SDR    | 152    | 546.50     | 83,068.00                    |
|            | TELE2 AB-B SHS                 | 828    | 103.30     | 85,532.40                    |
|            | TELIA CO AB                    | 5,333  | 37.22      | 198,494.26                   |
|            | スウェーデンクローナ 建小計                 | 41,701 |            | 6,058,413.21<br>(80,698,063) |
| ノルウェークローネ  | STATOIL ASA                    | 1,882  | 169.70     | 319,375.40                   |
|            | NORSK HYDRO ASA                | 2,975  | 57.10      | 169,872.50                   |
|            | YARA INTERNATIONAL ASA         | 393    | 370.20     | 145,488.60                   |
|            | SCHIBSTED ASA-B SHS            | 197    | 215.50     | 42,453.50                    |
|            | MARINE HARVEST                 | 846    | 135.00     | 114,210.00                   |
|            | ORKLA ASA                      | 1,803  | 85.05      | 153,345.15                   |
|            | DNB ASA                        | 1,551  | 154.40     | 239,474.40                   |
|            | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA      | 459    | 150.70     | 69,171.30                    |
|            | TELENOR ASA                    | 1,541  | 177.00     | 272,757.00                   |
|            | ノルウェークローネ 建小計                  | 11,647 |            | 1,526,147.85<br>(20,679,303) |
| デンマーククローネ  | CHR HANSEN HOLDING A/S         | 219    | 558.50     | 122,311.50                   |
|            | VESTAS WIND SYSTEMS A/S        | 383    | 424.40     | 162,545.20                   |
|            | ISS A/S                        | 370    | 232.50     | 86,025.00                    |
|            | A P MOLLER - MAERSK A/S-A      | 8      | 10,110.00  | 80,880.00                    |
|            | A P MOLLER - MAERSK A/S-B      | 13     | 10,550.00  | 137,150.00                   |
|            | DSV A/S                        | 42     | 488.30     | 20,508.60                    |
|            | PANDORA A/S                    | 246    | 625.50     | 153,873.00                   |
|            | CARLSBERG AS-B                 | 220    | 733.50     | 161,370.00                   |
|            | COLOPLAST A/S                  | 263    | 490.00     | 128,870.00                   |
|            | WILLIAM DEMANT HOLDING A/S     | 275    | 174.40     | 47,960.00                    |
|            | GENMAB A/S                     | 118    | 1,034.00   | 122,012.00                   |
|            | H LUNDBECK A/S                 | 142    | 303.20     | 43,054.40                    |
|            | NOVO NORDISK A/S-B             | 3,070  | 336.40     | 1,032,748.00                 |
|            | DANSKE BANK A/S                | 1,190  | 241.70     | 287,623.00                   |
|            | TRYG A/S                       | 259    | 153.70     | 39,808.30                    |
|            | TDC A/S                        | 1,862  | 38.16      | 71,053.92                    |
| ORSTED A/S | 337                            | 346.20 | 116,669.40 |                              |
|            | デンマーククローネ 建小計                  | 9,017  |            | 2,814,462.32<br>(50,097,429) |
| オーストラリアドル  | CALTEX AUSTRALIA LIMITED       | 577    | 34.77      | 20,062.29                    |
|            | OIL SEARCH LIMITED             | 3,032  | 7.39       | 22,406.48                    |



|                                    |        |        |            |
|------------------------------------|--------|--------|------------|
| ORIGIN ENERGY LIMITED              | 3,882  | 9.17   | 35,597.94  |
| SANTOS LTD                         | 4,195  | 5.06   | 21,226.70  |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD             | 1,349  | 32.12  | 43,329.88  |
| ALUMINA LIMITED                    | 5,614  | 2.31   | 12,968.34  |
| BHP BILLITON LIMITED(AU)           | 5,115  | 27.70  | 141,685.50 |
| BLUESCOPE STEEL LTD                | 1,175  | 14.19  | 16,673.25  |
| BORAL LIMITED                      | 2,577  | 7.72   | 19,894.44  |
| FORTESCUE METALS GROUP LIMITED     | 3,444  | 4.76   | 16,393.44  |
| INCITEC PIVOT LIMITED              | 3,870  | 3.79   | 14,667.30  |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC        | 975    | 22.16  | 21,606.00  |
| NEWCREST MINING LIMITED            | 1,574  | 21.90  | 34,470.60  |
| ORICA LTD                          | 829    | 18.02  | 14,938.58  |
| RIO TINTO LIMITED(AU)              | 755    | 69.78  | 52,683.90  |
| SOUTH32 LIMITED                    | 11,778 | 3.26   | 38,396.28  |
| CIMIC GROUP LIMITED                | 223    | 51.09  | 11,393.07  |
| BRAMBLES LTD                       | 3,261  | 9.97   | 32,512.17  |
| SEEK LIMITED                       | 758    | 18.39  | 13,939.62  |
| AURIZON HOLDINGS LIMITED           | 4,539  | 5.44   | 24,692.16  |
| SYDNEY AIRPORT CO LIMITED          | 2,439  | 7.31   | 17,829.09  |
| TRANSURBAN GROUP                   | 3,652  | 12.28  | 44,846.56  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD             | 1,198  | 23.10  | 27,673.80  |
| CROWN RESORTS LIMITED              | 835    | 12.45  | 10,395.75  |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED | 138    | 44.92  | 6,198.96   |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED | 123    | 45.01  | 5,536.23   |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED           | 4,515  | 5.17   | 23,342.55  |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD         | 1,276  | 4.12   | 5,257.12   |
| WESFARMERS LIMITED                 | 1,618  | 44.45  | 71,920.10  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD               | 1,703  | 26.88  | 45,776.64  |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED           | 1,314  | 8.57   | 11,260.98  |
| TREASURY WINE ESTATES LIMITED      | 1,633  | 15.85  | 25,883.05  |
| COCHLEAR LIMITED                   | 127    | 175.94 | 22,344.38  |
| HEALTHSCOPE LTD                    | 3,707  | 2.00   | 7,414.00   |
| RAMSAY HEALTH CARE LIMITED         | 313    | 69.07  | 21,618.91  |
| SONIC HEALTHCARE LTD               | 874    | 22.95  | 20,058.30  |
| CSL LIMITED                        | 699    | 140.81 | 98,426.19  |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LTD      | 4,624  | 28.50  | 131,784.00 |
| BANK OF QUEENSLAND LIMITED         | 888    | 12.66  | 11,242.08  |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED  | 1,084  | 11.52  | 12,487.68  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA     | 2,848  | 80.44  | 229,093.12 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD        | 4,261  | 29.82  | 127,063.02 |
| WESTPAC BANKING CORPORATION        | 5,526  | 31.55  | 174,345.30 |
| ASX LTD                            | 428    | 55.64  | 23,813.92  |

|            |  |         |        |                               |
|------------|--|---------|--------|-------------------------------|
|            | CHALLENGER FINANCIAL SERVICE           | 1,311   | 14.00  | 18,354.00                     |
|            | MACQUARIE GROUP LIMITED                | 375     | 97.40  | 36,525.00                     |
|            | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD          | 4,859   | 7.28   | 35,373.52                     |
|            | MEDIBANK PRIVATE LIMITED               | 6,093   | 3.28   | 19,985.04                     |
|            | LENLEASE GROUP                         | 1,225   | 16.03  | 19,636.75                     |
|            | COMPUTERSHARE LIMITED                  | 1,027   | 16.26  | 16,699.02                     |
|            | REA GROUP LIMITED                      | 121     | 75.31  | 9,112.51                      |
|            | TELSTRA CORPORATION                    | 8,965   | 3.68   | 32,991.20                     |
|            | TPG TELECOM LIMITED                    | 751     | 6.38   | 4,791.38                      |
|            | AGL ENERGY LIMITED                     | 1,443   | 24.71  | 35,656.53                     |
|            | APA GROUP                              | 2,465   | 8.67   | 21,371.55                     |
|            | AUSNET SERVICES                        | 4,089   | 1.87   | 7,666.87                      |
|            | オーストラリアドル 建小計                          | 138,069 |        | 2,043,313.04<br>(176,194,883) |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LIMITED              | 1,535   | 7.67   | 11,773.45                     |
|            | AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED | 2,108   | 6.74   | 14,207.92                     |
|            | RYMAN HEALTHCARE LIMITED               | 860     | 10.20  | 8,772.00                      |
|            | SPARK NEW ZEALAND LIMITED              | 4,053   | 3.69   | 14,955.57                     |
|            | MERCURY NZ LTD                         | 1,606   | 3.39   | 5,444.34                      |
|            | MERIDIAN ENERGY LTD                    | 2,939   | 2.93   | 8,625.96                      |
|            | ニュージーランドドル 建小計                         | 13,101  |        | 63,779.24<br>(5,011,134)      |
| 香港ドル       | CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED          | 4,534   | 96.25  | 436,397.50                    |
|            | NWS HOLDINGS LIMITED                   | 2,500   | 13.70  | 34,250.00                     |
|            | MTR CORPORATION                        | 2,903   | 45.40  | 131,796.20                    |
|            | LI & FUNG LIMITED                      | 14,000  | 4.08   | 57,120.00                     |
|            | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED       | 2,773   | 46.05  | 127,696.65                    |
|            | YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED   | 1,338   | 29.15  | 39,002.70                     |
|            | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED     | 4,537   | 60.75  | 275,622.75                    |
|            | MGM CHINA HOLDINGS LIMITED             | 2,155   | 23.95  | 51,612.25                     |
|            | SANDS CHINA LIMITED                    | 4,974   | 40.55  | 201,695.70                    |
|            | SHANGRI-LA ASIA LIMITED                | 1,813   | 16.50  | 29,914.50                     |
|            | SJM HOLDINGS LIMITED                   | 4,000   | 6.79   | 27,160.00                     |
|            | WYNN MACAU LIMITED                     | 3,499   | 24.20  | 84,675.80                     |
|            | WH GROUP LTD                           | 18,000  | 8.60   | 154,800.00                    |
|            | BANK OF EAST ASIA                      | 2,667   | 33.10  | 88,277.70                     |
|            | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD             | 7,684   | 39.50  | 303,518.00                    |
|            | HANG SENG BANK LTD                     | 1,600   | 188.30 | 301,280.00                    |
|            | FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED          | 4,000   | 5.37   | 21,480.00                     |
|            | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED | 2,066   | 229.00 | 473,114.00                    |
|            | AIA GROUP LIMITED                      | 19,751  | 62.20  | 1,228,512.20                  |
|            | CK ASSET HOLDINGS LTD                  | 4,534   | 65.70  | 297,883.80                    |

|          |   |         |        |                              |
|----------|---|---------|--------|------------------------------|
|          | HANG LUNG GROUP LTD                     | 2,000   | 28.45  | 56,900.00                    |
|          | HANG LUNG PROPERTIES LTD                | 3,864   | 18.70  | 72,256.80                    |
|          | HENDERSON LAND DEVELOPMENT              | 1,725   | 49.85  | 85,991.25                    |
|          | HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED       | 1,000   | 41.30  | 41,300.00                    |
|          | KERRY PROPERTIES LIMITED                | 1,452   | 32.85  | 47,698.20                    |
|          | NEW WORLD DEVELOPMENT                   | 11,562  | 11.40  | 131,806.80                   |
|          | SINO LAND CO                            | 6,576   | 13.74  | 90,354.24                    |
|          | SUN HUNG KAI PROPERTIES                 | 2,000   | 127.50 | 255,000.00                   |
|          | SWIRE PACIFIC LTD 'A'                   | 1,000   | 74.10  | 74,100.00                    |
|          | SWIRE PROPERTIES LIMITED                | 2,632   | 25.30  | 66,589.60                    |
|          | WHARF HOLDINGS LTD                      | 2,000   | 26.50  | 53,000.00                    |
|          | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT            | 2,000   | 51.45  | 102,900.00                   |
|          | WHELOCK AND COMPANY LTD                 | 2,000   | 53.90  | 107,800.00                   |
|          | HKT TRUST AND HKT LIMITED               | 8,080   | 9.81   | 79,264.80                    |
|          | PCCW LIMITED                            | 8,884   | 4.64   | 41,221.76                    |
|          | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD          | 1,000   | 66.60  | 66,600.00                    |
|          | CLP HOLDINGS LTD                        | 235     | 79.00  | 18,565.00                    |
|          | HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC | 6,000   | 7.12   | 42,720.00                    |
|          | HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED   | 2,062   | 15.26  | 31,466.12                    |
|          | POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED           | 2,567   | 65.55  | 168,266.85                   |
|          | ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED          | 500     | 102.40 | 51,200.00                    |
|          | 香港ドル 建小計                                | 178,467 |        | 6,050,811.17<br>(87,071,172) |
| シンガポールドル | KEPPEL CORPORATION LIMITED              | 3,200   | 7.61   | 24,352.00                    |
|          | SEBACORP INDUSTRIES LTD                 | 2,300   | 3.04   | 6,992.00                     |
|          | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD  | 3,600   | 3.21   | 11,556.00                    |
|          | YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD    | 4,369   | 1.52   | 6,640.88                     |
|          | COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED       | 4,900   | 1.95   | 9,555.00                     |
|          | SATS LTD                                | 1,500   | 5.22   | 7,830.00                     |
|          | SINGAPORE AIRLINES LTD                  | 1,200   | 10.52  | 12,624.00                    |
|          | GENTING SINGAPORE PLC                   | 13,400  | 1.33   | 17,822.00                    |
|          | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD            | 3,500   | 2.59   | 9,065.00                     |
|          | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED        | 200     | 41.31  | 8,262.00                     |
|          | GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED           | 16,200  | 0.37   | 6,075.00                     |
|          | WILMAR INTERNATIONAL LTD                | 3,300   | 3.14   | 10,362.00                    |
|          | DBS GROUP HOLDINGS LIMITED              | 3,300   | 24.98  | 82,434.00                    |
|          | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP            | 5,600   | 12.31  | 68,936.00                    |
|          | UNITED OVERSEAS BANK LTD                | 2,300   | 26.41  | 60,743.00                    |
|          | SINGAPORE EXCHANGE LIMITED              | 1,800   | 7.58   | 13,644.00                    |
|          | CAPITALAND LTD                          | 5,700   | 3.53   | 20,121.00                    |
|          | CITY DEVELOPMENTS LTD                   | 900     | 12.40  | 11,160.00                    |
|          | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED      | 5,900   | 3.36   | 19,824.00                    |

|           |                                       |           |        |                                  |  |
|-----------|---------------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|--|
|           | UOL GROUP LIMITED                     | 1,100     | 8.68   | 9,548.00                         |  |
|           | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS          | 13,000    | 3.77   | 49,010.00                        |  |
|           | STARHUB LIMITED                       | 1,300     | 2.93   | 3,809.00                         |  |
|           | シンガポールドル 建小計                          | 98,569    |        | 470,364.88<br>(39,294,282)       |  |
| イスラエルシュケル | FRUTAROM                              | 85        | 306.40 | 26,044.00                        |  |
|           | ISRAEL CHEMICALS LIMITED              | 1,130     | 14.33  | 16,192.90                        |  |
|           | ELBIT SYSTEMS LIMITED                 | 52        | 464.90 | 24,174.80                        |  |
|           | BANK HAPOALIM BM                      | 2,357     | 23.56  | 55,530.92                        |  |
|           | BANK LEUMI LE-ISRAEL                  | 3,201     | 19.11  | 61,171.11                        |  |
|           | MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED          | 319       | 60.83  | 19,404.77                        |  |
|           | AZRIELI GROUP                         | 94        | 181.20 | 17,032.80                        |  |
|           | NICE LIMITED                          | 137       | 309.10 | 42,346.70                        |  |
|           | BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD | 4,757     | 5.09   | 24,251.18                        |  |
|           | イスラエルシュケル 建小計                         | 12,132    |        | 286,149.18<br>(9,128,158)        |  |
|           | 合 計                                   | 1,987,104 |        | 6,696,430,666<br>(6,696,430,666) |  |

(注)外貨建株式の評価額の単価は、小数点第3位以下を切り捨てて表示しております。

(2)株式以外の有価証券

| 通貨  | 種 類                      | 銘 柄                           | 券面総額                                   | 評価額                   | 備考        |  |
|-----|--------------------------|-------------------------------|--|-----------------------|-----------|--|
| 米ドル | 投資信託受益証券                 | HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | 12,000                                 | 4,920.00              |           |  |
|     |                          | 投資信託受益証券 小計                   | 12,000                                 | 4,920.00<br>(553,008) |           |  |
|     | 投資証券                     |                               | AGNC INVESTMENT CORP                   | 732                   | 14,947.44 |  |
|     |                          |                               | ALEXANDRIA REAL ESTATE                 | 176                   | 23,212.64 |  |
|     |                          |                               | AMERICAN TOWER CORPORATION             | 675                   | 96,957.00 |  |
|     |                          |                               | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC          | 2,091                 | 25,426.56 |  |
|     |                          |                               | AVALONBAY COMMUNITIES INC              | 219                   | 39,939.03 |  |
|     |                          |                               | BOSTON PROPERTIES INC                  | 244                   | 30,917.24 |  |
|     |                          |                               | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC             | 673                   | 12,161.11 |  |
|     |                          |                               | CAMDEN PROPERTY TRUST                  | 194                   | 17,830.54 |  |
|     |                          |                               | COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A           | 1,164                 | 14,061.12 |  |
|     |                          |                               | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION | 639                   | 70,679.79 |  |
|     |                          |                               | DIGITAL REALTY TRUST INC               | 341                   | 39,307.07 |  |
|     |                          |                               | DUKE REALTY CORP                       | 785                   | 21,830.85 |  |
|     |                          |                               | EQUINIX INC                            | 139                   | 63,988.65 |  |
|     |                          |                               | EQUITY RESIDENTIAL                     | 583                   | 38,128.20 |  |
|     | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 141                           | 35,109.00                              |                       |           |  |

|          |      |  |        |              |               |
|----------|------|--|--------|--------------|---------------|
|          |      | EXTRA SPACE STORAGE INC                  | 278    | 24,074.80    |               |
|          |      | FEDERAL REALTY INVESTMENT                | 159    | 20,786.07    |               |
|          |      | GGP INC                                  | 1,235  | 28,923.70    |               |
|          |      | HCP INC                                  | 1,003  | 26,890.43    |               |
|          |      | HOST HOTELS & RESORTS                    | 1,587  | 31,390.86    |               |
|          |      | INVITATION HOMES INC                     | 494    | 11,737.44    |               |
|          |      | IRON MOUNTAIN INC                        | 554    | 21,029.84    |               |
|          |      | KIMCO REALTY CORPORATION                 | 940    | 17,258.40    |               |
|          |      | LIBERTY PROPERTY TRUST                   | 325    | 14,280.50    |               |
|          |      | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC    | 233    | 23,870.85    |               |
|          |      | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC           | 325    | 13,958.75    |               |
|          |      | PROLOGIS INC                             | 944    | 62,219.04    |               |
|          |      | PUBLIC STORAGE                           | 278    | 58,663.56    |               |
|          |      | REALTY INCOME CORP                       | 555    | 31,618.35    |               |
|          |      | REGENCY CENTERS CORPORATION              | 338    | 23,389.60    |               |
|          |      | SBA COMMUNICATIONS CORP                  | 80     | 13,264.00    |               |
|          |      | SIMON PROPERTY GROUP                     | 514    | 85,133.82    |               |
|          |      | SL GREEN REALTY CORPORATION              | 206    | 21,244.78    |               |
|          |      | THE MACERICH COMPANY                     | 270    | 17,973.90    |               |
|          |      | UDR INC                                  | 591    | 23,108.10    |               |
|          |      | VENTAS INC                               | 563    | 35,727.98    |               |
|          |      | VEREIT INC                               | 2,155  | 17,024.50    |               |
|          |      | WELLTOWER INC                            | 581    | 38,514.49    |               |
|          |      | WEYERHAEUSER COMPANY                     | 1,194  | 42,566.10    |               |
|          |      | 投資証券 小計                                  | 24,198 | 1,249,146.10 | (140,404,021) |
| 米ドル建小計   |      |  | 36,198 | 1,254,066.10 | (140,957,029) |
| カナダドル    | 投資証券 | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST         | 300    | 6,312.00     |               |
|          |      | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST      | 297    | 7,401.24     |               |
|          |      | SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 100    | 3,097.00     |               |
| カナダドル建小計 |      |  | 697    | 16,810.24    | (1,477,956)   |
| ユーロ      | 投資証券 | FONCIERE DES REGIONS                     | 76     | 6,974.52     |               |
|          |      | GECINA SA                                | 93     | 13,536.15    |               |
|          |      | ICADE                                    | 85     | 6,848.45     |               |
|          |      | KLEPIERRE                                | 487    | 17,171.62    |               |
|          |      | UNIBAIL-RODAMCO SE                       | 158    | 33,353.80    |               |
| ユーロ建小計   |      |  | 899    | 77,884.54    | (10,319,701)  |
| 英ポンド     | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC                      | 2,164  | 14,466.34    |               |
|          |      | HAMMERSON PLC                            | 1,755  | 9,327.82     |               |

|              |      |                                       |        |                              |
|--------------|------|---------------------------------------|--------|------------------------------|
|              |      | LAND SECURITIES GROUP PLC             | 1,639  | 16,037.61                    |
|              |      | SEGRO PLC                             | 2,136  | 12,132.48                    |
| 英ポンド建小計      |      |                                       | 7,694  | 51,964.25<br>(7,846,601)     |
| オーストラリアドル    | 投資証券 | DEXUS                                 | 2,141  | 22,352.04                    |
|              |      | GOODMAN GROUP                         | 3,672  | 32,276.88                    |
|              |      | GPT GROUP                             | 3,978  | 21,520.98                    |
|              |      | MIRVAC GROUP                          | 8,197  | 20,000.68                    |
|              |      | SCENTRE GROUP                         | 9,474  | 41,401.38                    |
|              |      | STOCKLAND                             | 5,321  | 25,221.54                    |
|              |      | VICINITY CENTRES                      | 7,444  | 21,289.84                    |
| オーストラリアドル建小計 |      |                                       | 40,227 | 184,063.34<br>(15,871,781)   |
| 香港ドル         | 投資証券 | LINK REIT                             | 607    | 42,186.50                    |
| 香港ドル建小計      |      |                                       | 607    | 42,186.50<br>(607,063)       |
| シンガポールドル     | 投資証券 | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 5,500  | 14,795.00                    |
|              |      | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST           | 4,769  | 9,061.10                     |
|              |      | CAPITALAND MALL TRUST                 | 5,700  | 12,084.00                    |
|              |      | SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   | 5,500  | 11,385.00                    |
| シンガポールドル建小計  |      |                                       | 21,469 | 47,325.10<br>(3,953,538)     |
| 合計           |      |                                       |        | 181,033,669<br>(181,033,669) |

(注1) 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、口数及び証券数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

- 小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

| 通貨    | 銘柄数              | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-------|------------------|--------------|------------------------|----------------|-------------------------|
| 米ドル   | 株式 574銘柄         | 60.6%        |                        |                | 63.7%                   |
|       | 投資信託受<br>益証券 1銘柄 |              | 0.0%                   |                | 0.0%                    |
|       | 投資証券 39銘柄        |              |                        | 1.9%           | 2.0%                    |
| カナダドル | 株式 84銘柄          | 3.5%         |                        |                | 3.7%                    |
|       | 投資証券 3銘柄         |              |                        | 0.0%           | 0.0%                    |
| ユーロ   | 株式 222銘柄         | 12.5%        |                        |                | 13.2%                   |
|       | 投資証券 5銘柄         |              |                        | 0.1%           | 0.2%                    |
| 英ポンド  | 株式 95銘柄          | 6.6%         |                        |                | 6.9%                    |
|       | 投資証券 4銘柄         |              |                        | 0.1%           | 0.1%                    |

|            |      |      |      |  |      |      |
|------------|------|------|------|--|------|------|
| スイスフラン     | 株式   | 30銘柄 | 2.9% |  |      | 3.1% |
| スウェーデンクローナ | 株式   | 29銘柄 | 1.1% |  |      | 1.2% |
| ノルウェークローネ  | 株式   | 9銘柄  | 0.3% |  |      | 0.3% |
| デンマーククローネ  | 株式   | 17銘柄 | 0.7% |  |      | 0.7% |
| オーストラリアドル  | 株式   | 56銘柄 | 2.4% |  |      | 2.6% |
|            | 投資証券 | 7銘柄  |      |  | 0.2% | 0.2% |
| ニュージーランドドル | 株式   | 6銘柄  | 0.1% |  |      | 0.1% |
| 香港ドル       | 株式   | 41銘柄 | 1.2% |  |      | 1.3% |
|            | 投資証券 | 1銘柄  |      |  | 0.0% | 0.0% |
| シンガポールドル   | 株式   | 22銘柄 | 0.5% |  |      | 0.6% |
|            | 投資証券 | 4銘柄  |      |  | 0.1% | 0.1% |
| イスラエルシェケル  | 株式   | 9銘柄  | 0.1% |  |      | 0.1% |

（注1）組入株式時価比率、組入投資信託受益証券時価比率及び組入投資証券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

（注2）有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

## 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

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 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）

|              | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
|--------------|----------------|----------------|
| <b>資産の部</b>  |                |                |
| 流動資産         |                |                |
| コール・ローン      | 17,333,117     | 160,930,930    |
| 国債証券         | 12,070,151,900 | 11,653,361,000 |
| 地方債証券        | 935,429,700    | 964,002,300    |
| 特殊債券         | 1,021,147,000  | 1,005,740,000  |
| 社債券          | 425,240,000    | 418,500,000    |
| 未収入金         | 11,065,700     | -              |
| 未収利息         | 49,481,424     | 44,397,990     |
| 前払費用         | 1,942,230      | 1,143,925      |
| 流動資産合計       | 14,531,791,071 | 14,248,076,145 |
| 資産合計         | 14,531,791,071 | 14,248,076,145 |
| <b>負債の部</b>  |                |                |
| 流動負債         |                |                |
| 未払解約金        | 19,090,000     | 1,816,100      |
| 未払利息         | 21             | 255            |
| 流動負債合計       | 19,090,021     | 1,816,355      |
| 負債合計         | 19,090,021     | 1,816,355      |
| <b>純資産の部</b> |                |                |

|             | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
|-------------|----------------|----------------|
| 元本等         |                |                |
| 元本          | 11,537,354,195 | 11,271,523,135 |
| 剰余金         |                |                |
| 剰余金又は欠損金( ) | 2,975,346,855  | 2,974,736,655  |
| 元本等合計       | 14,512,701,050 | 14,246,259,790 |
| 純資産合計       | 14,512,701,050 | 14,246,259,790 |
| 負債純資産合計     | 14,531,791,071 | 14,248,076,145 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分              | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日   |
|-----------------|--|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</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。</p> <p>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(ただし、売気配は使用いたしません。)、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)に基づいて評価しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br>11,537,354,195口                                   | 1. 計算日における受益権の総数<br>11,271,523,135口                                   |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.2579円<br>(1万口当たり純資産額) (12,579円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.2639円<br>(1万口当たり純資産額) (12,639円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日  | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|-----------------|---|--------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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リスク | <p>当ファンドの投資している金融商品は、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。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券であり、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> | 同左                             |



| 区分                         | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日  | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|----------------------------|---|--------------------------------|
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制         | <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。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左                             |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。  | 同左                             |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在   |
|--|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> |

| 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在 |
|--|---------------|
| 国債証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>地方債証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>特殊債証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>社債証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 同左            |

（関連当事者との取引に関する注記）

|  | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
|  | 該当事項はありません。                    | 同左                             |

（その他の注記）

1 元本の移動

| 区分                                 | 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 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 | 13,221,766,651円 | 11,537,354,195円 |
| 期中追加設定元本額                          | 1,508,695,506円  | 1,551,451,534円  |
| 期中一部解約元本額                          | 3,193,107,962円  | 1,817,282,594円  |
| 同期末における元本の内訳                       |                 |                 |
| 新光日本債券インデックスファンド（DC年金）             | 110,461,603円    | 119,255,850円    |
| 新光7資産バランスファンド                      | 628,025,669円    | 628,025,669円    |
| 日本債券ファンド                           | 1,819,119,780円  | 2,356,091,933円  |
| 新光日本債券インデックスVA                     | 709,938,253円    | 88,825,755円     |
| 新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）        | 1,921,679,694円  | 1,635,780,036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）        | 2,061,416,851円  | 1,990,052,772円  |
| 新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）           | 134,440,365円    | 137,775,069円    |
| ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）        | 2,841,249,070円  | 2,987,480,092円  |

| 区分                           | 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|------------------------------|-----------------|-----------------|
| ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募) | 1,289,698,831円  | 1,309,647,211円  |
| グローバル・ナビ                     | 21,324,079円     | 18,588,748円     |
| 合計                           | 11,537,354,195円 | 11,271,523,135円 |

2 有価証券関係  
 売買目的有価証券

| 種類    | 平成28年12月15日現在      | 平成29年12月15日現在      |
|-------|--------------------|--------------------|
|       | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券  | 211,061,200        | 613,300            |
| 地方債証券 | 4,479,300          | 944,400            |
| 特殊債券  | 5,028,000          | 1,197,000          |
| 社債券   | 2,160,000          | 317,000            |
| 合計    | 222,728,500        | 3,071,700          |

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

3 デリバティブ取引等関係  
 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

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

(単位:円)

| 種類   | 銘柄            | 券面総額        | 評価額         | 備考 |
|------|---------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券 | 第117回利付国債(5年) | 160,000,000 | 160,689,600 |    |
|      | 第118回利付国債(5年) | 100,000,000 | 100,519,000 |    |
|      | 第120回利付国債(5年) | 110,000,000 | 110,666,600 |    |
|      | 第122回利付国債(5年) | 70,000,000  | 70,337,400  |    |
|      | 第123回利付国債(5年) | 160,000,000 | 160,865,600 |    |
|      | 第124回利付国債(5年) | 150,000,000 | 150,883,500 |    |
|      | 第125回利付国債(5年) | 120,000,000 | 120,778,800 |    |
|      | 第126回利付国債(5年) | 140,000,000 | 140,991,200 |    |
|      | 第127回利付国債(5年) | 120,000,000 | 120,900,000 |    |
|      | 第128回利付国債(5年) | 120,000,000 | 120,949,200 |    |

|                |             |             |  |
|----------------|-------------|-------------|--|
| 第129回利付国債(5年)  | 140,000,000 | 141,160,600 |  |
| 第130回利付国債(5年)  | 80,000,000  | 80,707,200  |  |
| 第131回利付国債(5年)  | 120,000,000 | 121,126,800 |  |
| 第132回利付国債(5年)  | 110,000,000 | 111,094,500 |  |
| 第133回利付国債(5年)  | 50,000,000  | 50,525,500  |  |
| 第1回利付国債(40年)   | 20,000,000  | 28,523,000  |  |
| 第2回利付国債(40年)   | 20,000,000  | 27,550,800  |  |
| 第3回利付国債(40年)   | 20,000,000  | 27,674,400  |  |
| 第4回利付国債(40年)   | 30,000,000  | 41,687,400  |  |
| 第5回利付国債(40年)   | 30,000,000  | 40,054,800  |  |
| 第6回利付国債(40年)   | 30,000,000  | 39,235,200  |  |
| 第7回利付国債(40年)   | 30,000,000  | 37,429,200  |  |
| 第8回利付国債(40年)   | 30,000,000  | 34,570,200  |  |
| 第9回利付国債(40年)   | 40,000,000  | 33,130,400  |  |
| 第10回利付国債(40年)  | 30,000,000  | 29,486,700  |  |
| 第299回利付国債(10年) | 80,000,000  | 81,446,400  |  |
| 第300回利付国債(10年) | 40,000,000  | 40,823,200  |  |
| 第301回利付国債(10年) | 180,000,000 | 184,455,000 |  |
| 第302回利付国債(10年) | 70,000,000  | 71,626,800  |  |
| 第303回利付国債(10年) | 120,000,000 | 123,258,000 |  |
| 第305回利付国債(10年) | 60,000,000  | 61,735,200  |  |
| 第306回利付国債(10年) | 150,000,000 | 155,194,500 |  |
| 第308回利付国債(10年) | 140,000,000 | 145,023,200 |  |
| 第309回利付国債(10年) | 20,000,000  | 20,617,200  |  |
| 第310回利付国債(10年) | 110,000,000 | 113,418,800 |  |
| 第311回利付国債(10年) | 50,000,000  | 51,277,500  |  |
| 第312回利付国債(10年) | 140,000,000 | 145,590,200 |  |
| 第313回利付国債(10年) | 100,000,000 | 104,649,000 |  |
| 第315回利付国債(10年) | 160,000,000 | 167,454,400 |  |
| 第317回利付国債(10年) | 50,000,000  | 52,299,500  |  |
| 第318回利付国債(10年) | 80,000,000  | 83,377,600  |  |
| 第319回利付国債(10年) | 30,000,000  | 31,471,800  |  |
| 第320回利付国債(10年) | 50,000,000  | 52,252,000  |  |
| 第321回利付国債(10年) | 50,000,000  | 52,403,000  |  |
| 第322回利付国債(10年) | 20,000,000  | 20,875,600  |  |
| 第323回利付国債(10年) | 110,000,000 | 115,051,200 |  |
| 第325回利付国債(10年) | 100,000,000 | 104,348,000 |  |
| 第326回利付国債(10年) | 60,000,000  | 62,428,800  |  |
| 第327回利付国債(10年) | 50,000,000  | 52,275,500  |  |
| 第328回利付国債(10年) | 50,000,000  | 51,874,000  |  |
| 第329回利付国債(10年) | 70,000,000  | 73,484,600  |  |
| 第330回利付国債(10年) | 40,000,000  | 42,070,800  |  |

|                |             |             |  |
|----------------|-------------|-------------|--|
| 第332回利付国債(10年) | 120,000,000 | 124,996,800 |  |
| 第333回利付国債(10年) | 80,000,000  | 83,442,400  |  |
| 第334回利付国債(10年) | 150,000,000 | 156,666,000 |  |
| 第335回利付国債(10年) | 120,000,000 | 124,682,400 |  |
| 第336回利付国債(10年) | 70,000,000  | 72,807,700  |  |
| 第337回利付国債(10年) | 30,000,000  | 30,780,900  |  |
| 第338回利付国債(10年) | 120,000,000 | 124,063,200 |  |
| 第339回利付国債(10年) | 90,000,000  | 93,049,200  |  |
| 第340回利付国債(10年) | 150,000,000 | 155,133,000 |  |
| 第341回利付国債(10年) | 140,000,000 | 143,763,200 |  |
| 第342回利付国債(10年) | 150,000,000 | 151,549,500 |  |
| 第343回利付国債(10年) | 160,000,000 | 161,564,800 |  |
| 第344回利付国債(10年) | 110,000,000 | 111,010,900 |  |
| 第345回利付国債(10年) | 120,000,000 | 121,024,800 |  |
| 第346回利付国債(10年) | 150,000,000 | 151,246,500 |  |
| 第347回利付国債(10年) | 80,000,000  | 80,606,400  |  |
| 第348回利付国債(10年) | 30,000,000  | 30,204,000  |  |
| 第5回利付国債(30年)   | 20,000,000  | 25,275,800  |  |
| 第7回利付国債(30年)   | 20,000,000  | 25,776,800  |  |
| 第10回利付国債(30年)  | 20,000,000  | 22,349,400  |  |
| 第11回利付国債(30年)  | 20,000,000  | 24,165,400  |  |
| 第12回利付国債(30年)  | 10,000,000  | 12,698,100  |  |
| 第13回利付国債(30年)  | 30,000,000  | 37,672,200  |  |
| 第15回利付国債(30年)  | 20,000,000  | 26,770,800  |  |
| 第17回利付国債(30年)  | 20,000,000  | 26,536,800  |  |
| 第19回利付国債(30年)  | 20,000,000  | 26,258,200  |  |
| 第20回利付国債(30年)  | 10,000,000  | 13,492,200  |  |
| 第21回利付国債(30年)  | 10,000,000  | 13,157,600  |  |
| 第22回利付国債(30年)  | 10,000,000  | 13,525,600  |  |
| 第23回利付国債(30年)  | 10,000,000  | 13,535,900  |  |
| 第24回利付国債(30年)  | 20,000,000  | 27,137,400  |  |
| 第26回利付国債(30年)  | 30,000,000  | 40,256,100  |  |
| 第27回利付国債(30年)  | 30,000,000  | 40,896,900  |  |
| 第28回利付国債(30年)  | 30,000,000  | 40,994,700  |  |
| 第29回利付国債(30年)  | 40,000,000  | 54,086,400  |  |
| 第30回利付国債(30年)  | 40,000,000  | 53,470,400  |  |
| 第31回利付国債(30年)  | 40,000,000  | 52,822,800  |  |
| 第32回利付国債(30年)  | 40,000,000  | 53,822,800  |  |
| 第33回利付国債(30年)  | 50,000,000  | 64,336,000  |  |
| 第34回利付国債(30年)  | 50,000,000  | 66,594,000  |  |
| 第35回利付国債(30年)  | 50,000,000  | 64,553,000  |  |
| 第36回利付国債(30年)  | 50,000,000  | 64,613,000  |  |

|               |            |            |  |
|---------------|------------|------------|--|
| 第37回利付国債(30年) | 50,000,000 | 63,597,500 |  |
| 第38回利付国債(30年) | 40,000,000 | 50,085,600 |  |
| 第39回利付国債(30年) | 30,000,000 | 38,286,900 |  |
| 第40回利付国債(30年) | 30,000,000 | 37,610,700 |  |
| 第41回利付国債(30年) | 30,000,000 | 36,924,300 |  |
| 第42回利付国債(30年) | 30,000,000 | 36,939,000 |  |
| 第43回利付国債(30年) | 30,000,000 | 36,954,000 |  |
| 第44回利付国債(30年) | 30,000,000 | 36,968,100 |  |
| 第45回利付国債(30年) | 40,000,000 | 47,374,800 |  |
| 第46回利付国債(30年) | 40,000,000 | 47,376,800 |  |
| 第47回利付国債(30年) | 40,000,000 | 48,357,600 |  |
| 第48回利付国債(30年) | 40,000,000 | 46,345,200 |  |
| 第49回利付国債(30年) | 40,000,000 | 46,338,400 |  |
| 第50回利付国債(30年) | 40,000,000 | 40,278,400 |  |
| 第51回利付国債(30年) | 50,000,000 | 43,892,000 |  |
| 第52回利付国債(30年) | 50,000,000 | 46,385,000 |  |
| 第53回利付国債(30年) | 30,000,000 | 28,553,700 |  |
| 第54回利付国債(30年) | 40,000,000 | 40,094,800 |  |
| 第55回利付国債(30年) | 40,000,000 | 40,047,600 |  |
| 第56回利付国債(30年) | 30,000,000 | 30,000,000 |  |
| 第45回利付国債(20年) | 30,000,000 | 31,715,700 |  |
| 第47回利付国債(20年) | 50,000,000 | 53,215,000 |  |
| 第48回利付国債(20年) | 30,000,000 | 32,380,500 |  |
| 第50回利付国債(20年) | 30,000,000 | 31,990,500 |  |
| 第51回利付国債(20年) | 10,000,000 | 10,747,800 |  |
| 第52回利付国債(20年) | 20,000,000 | 21,675,200 |  |
| 第53回利付国債(20年) | 10,000,000 | 10,890,700 |  |
| 第55回利付国債(20年) | 10,000,000 | 10,903,700 |  |
| 第57回利付国債(20年) | 30,000,000 | 32,720,400 |  |
| 第58回利付国債(20年) | 20,000,000 | 21,915,600 |  |
| 第59回利付国債(20年) | 10,000,000 | 10,907,700 |  |
| 第63回利付国債(20年) | 20,000,000 | 22,089,800 |  |
| 第64回利付国債(20年) | 10,000,000 | 11,150,800 |  |
| 第65回利付国債(20年) | 40,000,000 | 44,776,800 |  |
| 第69回利付国債(20年) | 30,000,000 | 34,107,300 |  |
| 第70回利付国債(20年) | 20,000,000 | 23,226,200 |  |
| 第72回利付国債(20年) | 20,000,000 | 22,937,000 |  |
| 第76回利付国債(20年) | 30,000,000 | 34,268,700 |  |
| 第78回利付国債(20年) | 20,000,000 | 22,936,400 |  |
| 第81回利付国債(20年) | 40,000,000 | 46,346,400 |  |
| 第84回利付国債(20年) | 40,000,000 | 46,495,200 |  |
| 第85回利付国債(20年) | 40,000,000 | 47,026,400 |  |

|                |            |            |  |
|----------------|------------|------------|--|
| 第88回利付国債(20年)  | 30,000,000 | 35,911,500 |  |
| 第90回利付国債(20年)  | 40,000,000 | 47,723,600 |  |
| 第92回利付国債(20年)  | 50,000,000 | 59,452,500 |  |
| 第94回利付国債(20年)  | 60,000,000 | 71,620,800 |  |
| 第95回利付国債(20年)  | 20,000,000 | 24,335,800 |  |
| 第97回利付国債(20年)  | 40,000,000 | 48,464,800 |  |
| 第99回利付国債(20年)  | 70,000,000 | 84,408,100 |  |
| 第100回利付国債(20年) | 50,000,000 | 60,961,500 |  |
| 第103回利付国債(20年) | 30,000,000 | 37,012,500 |  |
| 第105回利付国債(20年) | 30,000,000 | 36,499,800 |  |
| 第108回利付国債(20年) | 70,000,000 | 83,895,000 |  |
| 第111回利付国債(20年) | 30,000,000 | 37,163,400 |  |
| 第113回利付国債(20年) | 50,000,000 | 61,509,500 |  |
| 第114回利付国債(20年) | 10,000,000 | 12,335,500 |  |
| 第116回利付国債(20年) | 60,000,000 | 74,929,800 |  |
| 第117回利付国債(20年) | 40,000,000 | 49,471,200 |  |
| 第118回利付国債(20年) | 60,000,000 | 73,620,600 |  |
| 第121回利付国債(20年) | 70,000,000 | 85,169,700 |  |
| 第123回利付国債(20年) | 70,000,000 | 87,131,100 |  |
| 第125回利付国債(20年) | 60,000,000 | 75,634,800 |  |
| 第128回利付国債(20年) | 50,000,000 | 61,174,000 |  |
| 第130回利付国債(20年) | 70,000,000 | 84,877,800 |  |
| 第132回利付国債(20年) | 60,000,000 | 72,013,800 |  |
| 第133回利付国債(20年) | 20,000,000 | 24,292,600 |  |
| 第134回利付国債(20年) | 60,000,000 | 72,996,600 |  |
| 第137回利付国債(20年) | 50,000,000 | 60,187,500 |  |
| 第140回利付国債(20年) | 60,000,000 | 72,276,000 |  |
| 第141回利付国債(20年) | 60,000,000 | 72,318,600 |  |
| 第142回利付国債(20年) | 20,000,000 | 24,412,000 |  |
| 第143回利付国債(20年) | 60,000,000 | 71,530,200 |  |
| 第145回利付国債(20年) | 60,000,000 | 72,442,200 |  |
| 第146回利付国債(20年) | 50,000,000 | 60,438,500 |  |
| 第147回利付国債(20年) | 60,000,000 | 71,636,400 |  |
| 第148回利付国債(20年) | 60,000,000 | 70,717,200 |  |
| 第149回利付国債(20年) | 60,000,000 | 70,708,800 |  |
| 第150回利付国債(20年) | 80,000,000 | 93,072,000 |  |
| 第151回利付国債(20年) | 70,000,000 | 79,103,500 |  |
| 第152回利付国債(20年) | 80,000,000 | 90,326,400 |  |
| 第153回利付国債(20年) | 50,000,000 | 57,266,500 |  |
| 第154回利付国債(20年) | 60,000,000 | 67,675,800 |  |
| 第155回利付国債(20年) | 70,000,000 | 76,475,000 |  |
| 第156回利付国債(20年) | 70,000,000 | 69,059,900 |  |

|         |                            |                |                |             |
|---------|----------------------------|----------------|----------------|-------------|
|         | 第157回利付国債(20年)             | 60,000,000     | 56,903,400     |             |
|         | 第158回利付国債(20年)             | 70,000,000     | 69,879,600     |             |
|         | 第159回利付国債(20年)             | 60,000,000     | 60,882,600     |             |
|         | 第160回利付国債(20年)             | 60,000,000     | 61,889,400     |             |
|         | 第161回利付国債(20年)             | 50,000,000     | 50,529,000     |             |
|         | 第162回利付国債(20年)             | 60,000,000     | 60,480,600     |             |
| 国債証券 小計 |                            | 10,660,000,000 | 11,653,361,000 |             |
| 地方債証券   | 第18回東京都公募公債(20年)           | 100,000,000    | 121,940,000    |             |
|         | 第678回東京都公募公債               | 80,000,000     | 82,208,000     |             |
|         | 第164回神奈川県公募公債              | 100,000,000    | 102,270,000    |             |
|         | 第200回神奈川県公募公債              | 35,000,000     | 36,536,500     |             |
|         | 第110回大阪府公募公債(5年)           | 100,000,000    | 100,270,000    |             |
|         | 第412回大阪府公募公債(10年)          | 50,000,000     | 49,510,000     |             |
|         | 平成24年度第3回広島県公募公債           | 66,000,000     | 68,461,800     |             |
|         | 平成24年度第7回広島県公募公債           | 100,000,000    | 103,280,000    |             |
|         | 平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)      | 10,000,000     | 12,840,000     |             |
|         | 第105回共同発行市場公募地方債           | 50,000,000     | 52,080,000     |             |
|         | 第169回共同発行市場公募地方債           | 100,000,000    | 100,260,000    |             |
|         | 第485回名古屋市公募公債(10年)         | 30,000,000     | 31,086,000     |             |
|         | 平成24年度第2回広島市公募公債           | 100,000,000    | 103,260,000    |             |
|         | 地方債証券 小計                   |                | 921,000,000    | 964,002,300 |
| 特殊債券    | 第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 101,630,000    |             |
|         | 第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 122,050,000    |             |
|         | 第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券     | 100,000,000    | 103,350,000    |             |
|         | 第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000    | 103,210,000    |             |
|         | 第34回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 100,000,000    | 103,790,000    |             |
|         | 第49回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 100,000,000    | 104,750,000    |             |
|         | 第58回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 100,000,000    | 103,880,000    |             |
|         | い第766号農林債                  | 50,000,000     | 50,165,000     |             |
|         | い第782号農林債                  | 10,000,000     | 10,055,000     |             |
|         | 第317回信金中金債(5年)             | 100,000,000    | 99,990,000     |             |
|         | 第13回中日本高速道路社債(財投機関債)       | 100,000,000    | 102,870,000    |             |
| 特殊債券 小計 |                            | 960,000,000    | 1,005,740,000  |             |
| 社債券     | 第4回第一三共社債                  | 100,000,000    | 103,760,000    |             |
|         | 第11回ブリヂストン社債               | 100,000,000    | 100,070,000    |             |
|         | 第47回野村ホールディングス社債           | 100,000,000    | 100,910,000    |             |
|         | 第36回東日本旅客鉄道社債              | 100,000,000    | 113,760,000    |             |
| 社債券 小計  |                            | 400,000,000    | 418,500,000    |             |
| 合計      |                            | 12,941,000,000 | 14,041,603,300 |             |

## 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。

### 海外国債マザーファンド

#### 貸借対照表

|                | (単位：円)         |                |
|----------------|----------------|----------------|
|                | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
| <b>資産の部</b>    |                |                |
| <b>流動資産</b>    |                |                |
| 預金             | -              | 3,055,220      |
| コール・ローン        | 275,268,713    | 90,354,968     |
| 国債証券           | 28,955,760,388 | 23,149,077,086 |
| 派生商品評価勘定       | -              | 228,264        |
| 未収入金           | -              | 110,305,223    |
| 未収利息           | 146,333,499    | 91,670,379     |
| 前払費用           | 14,021,910     | 15,794,986     |
| 流動資産合計         | 29,391,384,510 | 23,460,486,126 |
| <b>資産合計</b>    |                |                |
| 29,391,384,510 |                |                |
| <b>負債の部</b>    |                |                |
| <b>流動負債</b>    |                |                |
| 未払解約金          | -              | 14,000,000     |
| 未払利息           | 340            | 143            |
| 流動負債合計         | 340            | 14,000,143     |
| <b>負債合計</b>    |                |                |
| 340            |                |                |
| <b>純資産の部</b>   |                |                |
| <b>元本等</b>     |                |                |
| 元本             | 13,248,288,817 | 10,153,812,287 |
| 剰余金            |                |                |
| 剰余金又は欠損金（ ）    | 16,143,095,353 | 13,292,673,696 |
| 元本等合計          | 29,391,384,170 | 23,446,485,983 |
| <b>純資産合計</b>   |                |                |
| 29,391,384,170 |                |                |
| <b>負債純資産合計</b> |                |                |
| 29,391,384,510 |                |                |

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                    | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15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。</p> <p>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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）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>為替予約取引</p> <p>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>  |

|                           |   |
|---------------------------|---|
| 区分                        | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日                                      |
| 3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br><br>13,248,288,817口                               | 1. 計算日における受益権の総数<br><br>10,153,812,287口                               |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 2.2185円<br>(1万口当たり純資産額) (22,185円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 2.3091円<br>(1万口当たり純資産額) (23,091円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分             | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日   | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|----------------|--|--------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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。<br>また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。  | 同左                             |
| 2.金融商品の内容及びリスク | 当ファンドの投資している金融商品は、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。<br>当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。<br>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                             |

| 区分                         | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日  | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|----------------------------|---|--------------------------------|
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制         | <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。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左                             |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>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又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>  | 同左                             |

#### 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在   |
|--|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> |

| 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
|--|--|
| 国債証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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。 | 国債証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>派生商品評価勘定<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

|  | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
|  | 該当事項はありません。                    | 同左                             |

（その他の注記）

1 元本の移動

| 区分                                 | 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 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 | 16,920,799,395円 | 13,248,288,817円 |
| 期中追加設定元本額                          | 176,668,415円    | 128,274,126円    |
| 期中一部解約元本額                          | 3,849,178,993円  | 3,222,750,656円  |
| 同期末における元本の内訳                       |                 |                 |
| 海外国債ファンド                           | 9,122,508,746円  | 7,433,399,443円  |
| 海外国債ファンド（3ヵ月決算型）                   | 1,331,525,661円  | 1,190,337,420円  |
| 新光7資産バランスファンド                      | 388,337,362円    | 341,575,843円    |
| 海外国債ファンド（1年決算型）                    | 35,504,654円     | 30,036,019円     |
| 海外国債ファンド（変額年金）                     | 2,354,229,004円  | 1,144,939,291円  |
| 世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）     | 3,476,197円      | - 円             |
| グローバル・ナビ                           | 12,707,193円     | 13,524,271円     |
| 合計                                 | 13,248,288,817円 | 10,153,812,287円 |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類   | 平成28年12月15日現在      | 平成29年12月15日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 1,096,304,503      | 61,310,709         |
| 合計   | 1,096,304,503      | 61,310,709         |

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

### 3 デリバティブ取引等関係

#### 取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

| 種類        | 平成28年12月15日現在 |   |       |         | 平成29年12月15日現在 |   |             |         |
|-----------|---------------|---|-------|---------|---------------|---|-------------|---------|
|           | 契約額等(円)       |   | 時価(円) | 評価損益(円) | 契約額等(円)       |   | 時価(円)       | 評価損益(円) |
|           | うち1年超         |   |       |         | うち1年超         |   |             |         |
| 市場取引以外の取引 |               |   |       |         |               |   |             |         |
| 為替予約取引    |               |   |       |         |               |   |             |         |
| 売建        | -             | - | -     | -       | 111,267,429   | - | 111,039,165 | 228,264 |
| 米ドル       | -             | - | -     | -       | 111,267,429   | - | 111,039,165 | 228,264 |
| 合計        | -             | - | -     | -       | 111,267,429   | - | 111,039,165 | 228,264 |

#### 時価の算定方法

##### 為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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。

#### 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

| 通貨  | 種類   | 銘柄                              | 券面総額          | 評価額          | 備考 |
|-----|------|---------------------------------|---------------|--------------|----|
| 米ドル | 国債証券 | US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15   | 10,000,000.00 | 9,816,406.29 |    |
|     |      | US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15 | 10,000,000.00 | 9,892,968.78 |    |
|     |      | US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15   | 10,000,000.00 | 9,794,531.28 |    |
|     |      | US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15  | 10,000,000.00 | 9,960,937.49 |    |
|     |      | US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15 | 10,000,000.00 | 9,485,937.49 |    |
|     |      | US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15 | 10,000,000.00 | 9,466,406.29 |    |
|     |      | US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15   | 10,000,000.00 | 9,350,781.30 |    |
|     |      | US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15   | 3,000,000.00  | 2,918,437.50 |    |

|                                |              |   |               |                                   |  |
|--------------------------------|--------------|---|---------------|-----------------------------------|--|
|                                |              | US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15          | 1,000,000.00  | 992,109.38                        |  |
|                                |              | US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15         | 8,000,000.00  | 8,018,750.00                      |  |
|                                |              | US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15          | 10,000,000.00 | 9,910,156.30                      |  |
|                                |              | US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15           | 3,000,000.00  | 3,172,968.75                      |  |
| 米ドル建小計                         |              |   | 95,000,000.00 | 92,780,390.85<br>(10,428,515,931) |  |
| カナダドル                          | 国債証券         | CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01      | 1,400,000.00  | 1,443,624.00                      |  |
|                                |              | CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01       | 1,400,000.00  | 1,363,824.00                      |  |
|                                |              | CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01       | 1,700,000.00  | 1,573,180.00                      |  |
| カナダドル建小計                       |              |   | 4,500,000.00  | 4,380,628.00<br>(385,144,813)     |  |
| ユーロ                            | 国債証券         | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15  | 3,800,000.00  | 3,944,286.00                      |  |
|                                |              | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15  | 3,800,000.00  | 4,084,316.00                      |  |
|                                |              | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15  | 3,400,000.00  | 3,513,254.00                      |  |
|                                |              | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15  | 1,500,000.00  | 1,478,355.00                      |  |
|                                |              | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15 | 1,000,000.00  | 1,001,060.00                      |  |
|                                |              | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15  | 1,000,000.00  | 1,017,440.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01  | 2,100,000.00  | 2,276,400.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01  | 3,700,000.00  | 4,652,750.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01  | 3,000,000.00  | 3,032,400.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01  | 2,700,000.00  | 2,805,840.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01  | 3,000,000.00  | 3,697,200.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01  | 3,000,000.00  | 3,008,100.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01 | 1,000,000.00  | 1,470,200.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01 | 2,500,000.00  | 2,425,250.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01  | 2,000,000.00  | 2,078,200.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01 | 2,000,000.00  | 2,047,000.00                      |  |
|                                |              | BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01  | 4,000,000.00  | 5,716,400.00                      |  |
|                                |              | FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25         | 3,000,000.00  | 3,344,100.00                      |  |
|                                |              | FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25          | 5,700,000.00  | 5,842,500.00                      |  |
|                                |              | FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25          | 4,500,000.00  | 6,567,750.00                      |  |
| FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25 | 4,400,000.00 | 4,664,880.00                            |               |                                   |  |

|         |      |                                 |               |                                    |  |
|---------|------|---------------------------------|---------------|------------------------------------|--|
|         |      | FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25  | 6,200,000.00  | 7,864,080.00                       |  |
|         |      | FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25  | 3,100,000.00  | 3,145,880.00                       |  |
|         |      | FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25 | 3,300,000.00  | 3,255,120.00                       |  |
|         |      | FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25  | 1,000,000.00  | 1,046,100.00                       |  |
|         |      | FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25 | 2,000,000.00  | 2,427,600.00                       |  |
| ユーロ建小計  |      |                                 | 76,700,000.00 | 86,406,461.00<br>(11,448,856,082)  |  |
| 英ポンド    | 国債証券 | TSY-5.0%-25/03/07               | 700,000.00    | 895,930.00                         |  |
|         |      | TSY-2.0%-25/09/07               | 1,800,000.00  | 1,926,180.00                       |  |
|         |      | TSY-1.5%-26/07/22               | 1,700,000.00  | 1,750,320.00                       |  |
|         |      | TSY-1.25%-27/07/22              | 1,300,000.00  | 1,298,830.00                       |  |
| 英ポンド建小計 |      |                                 | 5,500,000.00  | 5,871,260.00<br>(886,560,260)      |  |
| 合計      |      |                                 |               | 23,149,077,086<br>(23,149,077,086) |  |

## 有価証券明細表注記

- 小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

| 通貨    | 銘柄数     | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-------|---------|--------------|-------------------------|
| 米ドル   | 債券 12銘柄 | 44.5%        | 45.0%                   |
| カナダドル | 債券 3銘柄  | 1.6%         | 1.7%                    |
| ユーロ   | 債券 26銘柄 | 48.8%        | 49.5%                   |
| 英ポンド  | 債券 4銘柄  | 3.8%         | 3.8%                    |

(注1) 組入債券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

(注2) 有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

## 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

「注記表(デリバティブ取引等関係)」に記載しております。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

## 貸借対照表

|              | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
|--------------|----------------|----------------|
| <b>資産の部</b>  |                |                |
| 流動資産         |                |                |
| 預金           | 149,665,668    | 355,237,808    |
| コール・ローン      | 40,249,409     | 4,968,818      |
| 国債証券         | 14,583,156,164 | 13,642,249,404 |
| 派生商品評価勘定     | 200,518        | 18,746,626     |
| 未収利息         | 126,142,184    | 118,183,900    |
| 前払費用         | 5,915,442      | 3,206,916      |
| 差入委託証拠金      | 24,220,872     | 2,014          |
| 流動資産合計       | 14,929,550,257 | 14,142,595,486 |
| 資産合計         | 14,929,550,257 | 14,142,595,486 |
| <b>負債の部</b>  |                |                |
| 流動負債         |                |                |
| 派生商品評価勘定     | 679,442,575    | 31,927,983     |
| 未払金          | 134,852,894    | -              |
| 未払利息         | 49             | 7              |
| 流動負債合計       | 814,295,518    | 31,927,990     |
| 負債合計         | 814,295,518    | 31,927,990     |
| <b>純資産の部</b> |                |                |
| 元本等          |                |                |
| 元本           | 10,558,341,032 | 10,375,372,024 |
| 剰余金          |                |                |
| 剰余金又は欠損金（ ）  | 3,556,913,707  | 3,735,295,472  |
| 元本等合計        | 14,115,254,739 | 14,110,667,496 |
| 純資産合計        | 14,115,254,739 | 14,110,667,496 |
| 負債純資産合計      | 14,929,550,257 | 14,142,595,486 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15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。</p> <p>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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）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</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。</p> <p>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及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>  |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年12月15日現在 | 平成29年12月15日現在 |
|---------------|---------------|
|---------------|---------------|



|   |   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br>10,558,341,032口                                   | 1. 計算日における受益権の総数<br>10,375,372,024口                                   |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.3369円<br>(1万口当たり純資産額) (13,369円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.3600円<br>(1万口当たり純資産額) (13,600円) |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日  | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|-----------------|---|--------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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。<br>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。   | 同左                             |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドの投資している金融商品は、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。<br>当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。<br>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、債券先物取引及び為替予約取引であります。債券先物取引は市場金利の変動によるリスク、為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                             |

|                           |   |    |
|---------------------------|---|----|
| 3.金融商品に係るリスクの管理体制         | <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。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左 |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>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又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>  | 同左 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在                                    |
|---|--|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> |

|  |    |
|--|----|
| 国債証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>派生商品評価勘定<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 同左 |
|--|----|

## （関連当事者との取引に関する注記）

|  |                                |                                |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
|  | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|  | 該当事項はありません。                    | 同左                             |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 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 | 11,872,377,473円 | 10,558,341,032円 |
| 期中追加設定元本額                          | 493,184,132円    | 324,344,990円    |
| 期中一部解約元本額                          | 1,807,220,573円  | 507,313,998円    |
| 同期末における元本の内訳                       |                 |                 |
| 新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）        | 5,869,430,737円  | 5,573,983,541円  |
| 新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）           | 127,616,633円    | 128,160,037円    |
| ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）        | 3,339,513,001円  | 3,442,053,785円  |
| ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）       | 1,208,337,323円  | 1,219,623,621円  |
| グローバル・ナビ                           | 13,443,338円     | 11,551,040円     |
| 合計                                 | 10,558,341,032円 | 10,375,372,024円 |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成28年12月15日現在      | 平成29年12月15日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 287,786,310        | 19,307,191         |
| 合計   | 287,786,310        | 19,307,191         |

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

### 3 デリバティブ取引等関係

#### 取引の時価等に関する事項

(債券関連)

| 種類           | 平成28年12月15日現在 |       |             |         | 平成29年12月15日現在 |       |       |         |
|--------------|---------------|-------|-------------|---------|---------------|-------|-------|---------|
|              | 契約額等(円)       |       | 時価(円)       | 評価損益(円) | 契約額等(円)       |       | 時価(円) | 評価損益(円) |
|              |               | うち1年超 |             |         |               | うち1年超 |       |         |
| 市場取引         |               |       |             |         |               |       |       |         |
| 債券先物取引       |               |       |             |         |               |       |       |         |
| 買建           | 148,903,944   | -     | 148,304,816 | 599,128 | -             | -     | -     | -       |
| US 10YR NOTE | 29,361,989    | -     | 29,054,768  | 307,221 | -             | -     | -     | -       |
| US 5YR NOTE  | 83,241,048    | -     | 82,749,802  | 491,246 | -             | -     | -     | -       |
| LONG GILT FU | 36,300,907    | -     | 36,500,246  | 199,339 | -             | -     | -     | -       |
| 合計           | 148,903,944   | -     | 148,304,816 | 599,128 | -             | -     | -     | -       |

#### 時価の算定方法

##### 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金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

契約額等及び時価の邦貨換算額は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

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。

(通貨関連)

| 種類        | 平成28年12月15日現在  |       |                |             | 平成29年12月15日現在  |       |                |            |
|-----------|----------------|-------|----------------|-------------|----------------|-------|----------------|------------|
|           | 契約額等(円)        |       | 時価(円)          | 評価損益(円)     | 契約額等(円)        |       | 時価(円)          | 評価損益(円)    |
|           |                | うち1年超 |                |             |                | うち1年超 |                |            |
| 市場取引以外の取引 |                |       |                |             |                |       |                |            |
| 為替予約取引    |                |       |                |             |                |       |                |            |
| 買建        | 125,128,169    | -     | 125,120,118    | 8,051       | -              | -     | -              | -          |
| 米ドル       | 67,089,000     | -     | 67,083,300     | 5,700       | -              | -     | -              | -          |
| ユーロ       | 58,039,169     | -     | 58,036,818     | 2,351       | -              | -     | -              | -          |
| 売建        | 14,206,780,528 | -     | 14,885,424,120 | 678,643,592 | 14,039,164,713 | -     | 14,052,346,070 | 13,181,357 |
| 米ドル       | 6,321,096,323  | -     | 6,656,599,880  | 335,503,557 | 6,010,890,192  | -     | 6,028,464,480  | 17,574,288 |

|                |                |   |                |             |                |   |                |            |
|----------------|----------------|---|----------------|-------------|----------------|---|----------------|------------|
| カナダドル          | 300,624,777    | - | 318,851,300    | 18,226,523  | 318,023,237    | - | 321,033,360    | 3,010,123  |
| メキシコペソ         | 116,405,763    | - | 123,717,880    | 7,312,117   | 120,483,071    | - | 117,795,600    | 2,687,471  |
| ユーロ            | 5,705,622,902  | - | 5,927,698,650  | 222,075,748 | 5,844,241,342  | - | 5,829,633,180  | 14,608,162 |
| 英ポンド           | 1,058,223,606  | - | 1,125,164,600  | 66,940,994  | 1,004,954,022  | - | 1,009,704,550  | 4,750,528  |
| スウェーデンク<br>ローナ | 65,216,646     | - | 67,879,900     | 2,663,254   | 69,590,504     | - | 69,170,760     | 419,744    |
| ノルウェークロー<br>ネ  | 38,873,412     | - | 40,606,280     | 1,732,868   | 43,174,069     | - | 43,052,460     | 121,609    |
| デンマーククロー<br>ネ  | 91,107,085     | - | 94,819,200     | 3,712,115   | 94,900,244     | - | 94,589,200     | 311,044    |
| ポーランドズロチ       | 79,762,752     | - | 82,728,840     | 2,966,088   | 94,745,246     | - | 94,146,650     | 598,596    |
| オーストラリアドル      | 297,926,819    | - | 310,384,640    | 12,457,821  | 306,706,005    | - | 311,808,960    | 5,102,955  |
| シンガポールドル       | 55,184,227     | - | 57,499,800     | 2,315,573   | 54,052,790     | - | 54,286,890     | 234,100    |
| 南アフリカランド       | 76,736,216     | - | 79,473,150     | 2,736,934   | 77,403,991     | - | 78,659,980     | 1,255,989  |
| 合計             | 14,331,908,697 | - | 15,010,544,238 | 678,651,643 | 14,039,164,713 | - | 14,052,346,070 | 13,181,357 |

## 時価の算定方法

### 為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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。

## 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

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|----|------|-----|----|
|----|----|----|------|-----|----|

|     |      |                                 |              |              |
|-----|------|---------------------------------|--------------|--------------|
| 米ドル | 国債証券 | US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15  | 2,000,000.00 | 2,022,656.26 |
|     |      | US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15 | 2,700,000.00 | 2,750,203.11 |
|     |      | US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15 | 1,900,000.00 | 1,956,257.80 |
|     |      | US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15 | 1,900,000.00 | 1,955,367.17 |
|     |      | US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15 | 2,000,000.00 | 2,076,250.00 |
|     |      | US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15   | 2,100,000.00 | 2,181,210.93 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15 | 1,600,000.00 | 1,630,749.99 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15 | 1,700,000.00 | 1,734,000.00 |
|     |      | US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15 | 1,550,000.00 | 1,629,195.30 |
|     |      | US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15 | 1,800,000.00 | 1,868,203.11 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15 | 1,600,000.00 | 1,606,125.00 |
|     |      | US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15   | 2,250,000.00 | 2,754,667.95 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15   | 230,000.00   | 229,784.37   |
|     |      | US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15   | 1,500,000.00 | 1,497,187.50 |
|     |      | US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15  | 1,500,000.00 | 1,479,726.56 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31   | 440,000.00   | 437,387.49   |
|     |      | US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15 | 1,250,000.00 | 1,221,191.39 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15   | 1,350,000.00 | 1,339,664.06 |
|     |      | US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15  | 1,000,000.00 | 978,671.88   |
|     |      | US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15   | 1,200,000.00 | 1,220,718.75 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15  | 1,300,000.00 | 1,340,523.44 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15  | 700,000.00   | 721,109.37   |
|     |      | US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15   | 1,000,000.00 | 1,015,078.13 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15 | 1,200,000.00 | 1,208,625.00 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15   | 1,500,000.00 | 1,472,460.92 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15  | 900,000.00   | 896,484.37   |
|     |      | US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15 | 400,000.00   | 379,437.50   |
|     |      | US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15   | 400,000.00   | 510,343.74   |
|     |      | US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15   | 900,000.00   | 841,570.29   |
|     |      | US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15   | 1,100,000.00 | 1,070,093.75 |
|     |      | US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15  | 340,000.00   | 337,317.18   |
|     |      | US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15 | 280,000.00   | 280,656.25   |
|     |      | US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15  | 250,000.00   | 247,753.90   |
|     |      | US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15 | 100,000.00   | 133,406.25   |
|     |      | US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15  | 100,000.00   | 128,031.25   |
|     |      | US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15 | 200,000.00   | 267,109.37   |
|     |      | US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15   | 150,000.00   | 194,765.62   |
|     |      | US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15   | 200,000.00   | 261,937.50   |
|     |      | US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15   | 300,000.00   | 344,906.25   |
|     |      | US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15 | 100,000.00   | 129,492.18   |
|     |      | US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15 | 200,000.00   | 267,671.87   |
|     |      | US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15 | 200,000.00   | 259,562.50   |

|          |      |  |               |                                  |
|----------|------|--|---------------|----------------------------------|
|          |      | US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15        | 200,000.00    | 242,468.75                       |
|          |      | US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15         | 200,000.00    | 255,625.00                       |
|          |      | US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15        | 150,000.00    | 195,386.71                       |
|          |      | US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15         | 300,000.00    | 357,937.50                       |
|          |      | US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15        | 100,000.00    | 108,210.93                       |
|          |      | US TREASURY N/B-3.0%-42/05/15          | 150,000.00    | 158,894.53                       |
|          |      | US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15         | 200,000.00    | 202,500.00                       |
|          |      | US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15        | 800,000.00    | 827,250.00                       |
|          |      | US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15        | 880,000.00    | 1,034,893.74                     |
|          |      | US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15          | 600,000.00    | 634,218.74                       |
|          |      | US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15          | 800,000.00    | 845,500.00                       |
|          |      | US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15          | 400,000.00    | 422,750.00                       |
|          |      | US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15          | 1,000,000.00  | 956,718.75                       |
|          |      | US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15        | 900,000.00    | 928,687.50                       |
|          |      | US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15          | 160,000.00    | 169,225.00                       |
|          |      | US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15         | 120,000.00    | 120,815.62                       |
| 米ドル建小計   |      |  | 50,350,000.00 | 52,338,638.02<br>(5,882,862,913) |
| カナダドル    | 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01     | 470,000.00    | 485,025.90                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01      | 600,000.00    | 627,168.00                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01     | 200,000.00    | 210,630.00                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01     | 550,000.00    | 575,102.00                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01      | 100,000.00    | 98,736.00                        |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01      | 100,000.00    | 104,297.00                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01     | 150,000.00    | 154,674.00                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01      | 150,000.00    | 146,124.00                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01      | 10,000.00     | 9,254.00                         |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01     | 150,000.00    | 208,525.50                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01     | 100,000.00    | 149,019.00                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01      | 130,000.00    | 189,699.90                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01      | 150,000.00    | 200,358.00                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01      | 150,000.00    | 191,515.50                       |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01     | 60,000.00     | 68,025.00                        |
| カナダドル建小計 |      |  | 3,070,000.00  | 3,418,153.80<br>(300,524,082)    |
| メキシコペソ   | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11  | 1,500,000.00  | 1,436,565.00                     |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11  | 1,500,000.00  | 1,524,225.00                     |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10  | 1,700,000.00  | 1,658,265.00                     |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09  | 1,800,000.00  | 1,744,020.00                     |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05 | 1,440,000.00  | 1,649,534.40                     |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03  | 2,700,000.00  | 2,717,685.00                     |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31  | 1,000,000.00  | 1,083,090.00                     |

|           |      |   |               |               |               |
|-----------|------|---|---------------|---------------|---------------|
|           |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20  | 2,600,000.00  | 3,218,826.00  |               |
|           |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18   | 1,900,000.00  | 2,067,257.00  |               |
| メキシコペソ建小計 |      |   | 16,140,000.00 | 17,099,467.40 | (100,715,862) |
| ユーロ       | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28          | 100,000.00    | 112,060.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28          | 20,000.00     | 23,572.00     |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28           | 400,000.00    | 475,680.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22          | 100,000.00    | 113,380.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22           | 100,000.00    | 116,870.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22           | 250,000.00    | 261,175.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22           | 150,000.00    | 158,190.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28           | 350,000.00    | 526,890.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28           | 400,000.00    | 652,960.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28          | 150,000.00    | 239,310.00    |               |
|           |      | BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22          | 70,000.00     | 106,645.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30  | 250,000.00    | 270,025.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31  | 150,000.00    | 163,005.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30  | 330,000.00    | 362,736.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30  | 400,000.00    | 473,680.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31 | 250,000.00    | 308,975.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31  | 200,000.00    | 250,860.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31  | 300,000.00    | 375,540.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30  | 300,000.00    | 358,470.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30  | 300,000.00    | 315,060.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30 | 350,000.00    | 445,340.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30  | 300,000.00    | 415,860.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31 | 10,000.00     | 9,998.00      |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31 | 30,000.00     | 40,593.00     |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31  | 400,000.00    | 579,280.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30 | 310,000.00    | 314,774.00    |               |
|           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30 | 100,000.00    | 148,940.00    |               |



|   |            |            |  |
|---|------------|------------|--|
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30  | 350,000.00 | 500,325.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30  | 100,000.00 | 140,000.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31 | 150,000.00 | 222,690.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31  | 30,000.00  | 31,143.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30 | 50,000.00  | 55,040.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04  | 780,000.00 | 832,525.20 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-19/10/11 | 150,000.00 | 152,790.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04  | 350,000.00 | 383,120.50 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-21/01/04  | 500,000.00 | 548,100.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-21/09/04 | 700,000.00 | 773,150.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04  | 600,000.00 | 653,760.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04 | 550,000.00 | 764,555.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15  | 200,000.00 | 214,562.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15  | 100,000.00 | 103,797.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15  | 300,000.00 | 322,446.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15  | 200,000.00 | 206,662.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15  | 300,000.00 | 295,671.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04  | 100,000.00 | 158,773.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15  | 10,000.00  | 10,174.40  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04 | 300,000.00 | 435,321.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04  | 200,000.00 | 324,824.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04 | 400,000.00 | 651,076.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04  | 30,000.00  | 46,721.10  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04 | 40,000.00  | 66,280.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04 | 200,000.00 | 356,248.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15  | 350,000.00 | 472,164.00 |  |

|   |            |            |  |
|---|------------|------------|--|
| BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-<br>20/02/01  | 800,000.00 | 880,240.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-<br>20/09/01  | 500,000.00 | 555,000.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-<br>21/03/01 | 500,000.00 | 559,100.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-<br>21/08/01 | 300,000.00 | 338,550.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-<br>22/03/01  | 440,000.00 | 524,876.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-<br>22/11/01  | 300,000.00 | 370,560.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-<br>23/05/01  | 500,000.00 | 598,900.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-<br>23/08/01 | 300,000.00 | 365,400.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-<br>24/03/01  | 140,000.00 | 169,316.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-<br>24/09/01 | 450,000.00 | 525,330.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-<br>25/03/01  | 300,000.00 | 377,250.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-<br>25/06/01  | 150,000.00 | 151,620.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-<br>25/12/01  | 300,000.00 | 311,760.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-<br>26/11/01 | 400,000.00 | 588,080.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-<br>27/11/01  | 400,000.00 | 571,640.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-<br>28/09/01 | 140,000.00 | 178,458.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-<br>29/11/01 | 450,000.00 | 602,865.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-<br>31/05/01  | 220,000.00 | 316,954.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-<br>34/08/01  | 490,000.00 | 660,324.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-<br>37/02/01  | 300,000.00 | 363,210.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-<br>39/08/01  | 50,000.00  | 68,050.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-<br>40/09/01  | 150,000.00 | 202,800.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-<br>44/09/01 | 150,000.00 | 199,545.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-<br>46/09/01 | 100,000.00 | 106,000.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-<br>47/03/01  | 300,000.00 | 284,550.00 |  |
| FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15          | 100,000.00 | 109,310.00 |  |
| FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15          | 100,000.00 | 109,050.00 |  |

|                                       |            |            |
|---------------------------------------|------------|------------|
| FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04      | 200,000.00 | 257,440.00 |
| FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04     | 100,000.00 | 123,000.00 |
| FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15     | 30,000.00  | 29,985.00  |
| FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04    | 20,000.00  | 26,880.00  |
| FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25       | 700,000.00 | 747,110.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25       | 700,000.00 | 758,030.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25        | 400,000.00 | 438,800.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25        | 330,000.00 | 358,710.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25       | 10,000.00  | 10,205.00  |
| FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25       | 650,000.00 | 742,820.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25        | 730,000.00 | 834,828.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25       | 600,000.00 | 672,180.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25       | 500,000.00 | 628,350.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25       | 350,000.00 | 390,145.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25        | 250,000.00 | 256,250.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25        | 200,000.00 | 291,900.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25        | 300,000.00 | 318,060.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25        | 300,000.00 | 380,520.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25       | 300,000.00 | 295,920.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25        | 30,000.00  | 31,383.00  |
| FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25       | 200,000.00 | 242,760.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25        | 330,000.00 | 504,966.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25        | 250,000.00 | 299,925.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25        | 130,000.00 | 139,711.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25       | 360,000.00 | 601,524.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25       | 100,000.00 | 158,580.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25        | 150,000.00 | 226,335.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25        | 450,000.00 | 736,470.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25       | 200,000.00 | 277,560.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25        | 70,000.00  | 76,006.00  |
| FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25        | 300,000.00 | 491,640.00 |
| FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25        | 30,000.00  | 50,487.00  |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-4.4%-19/06/18 | 100,000.00 | 107,560.00 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-5.9%-19/10/18 | 50,000.00  | 56,002.50  |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-4.5%-20/04/18 | 30,000.00  | 33,624.00  |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-5.0%-20/10/18 | 100,000.00 | 115,970.00 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-0.8%-22/03/15 | 100,000.00 | 104,430.00 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-3.4%-24/03/18 | 190,000.00 | 228,760.00 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-5.4%-25/03/13 | 100,000.00 | 136,410.00 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-2.4%-30/05/15 | 80,000.00  | 93,416.00  |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-1.7%-37/05/15 | 50,000.00  | 52,545.00  |
| IRELAND GOVERNMENT BOND-2.0%-45/02/18 | 30,000.00  | 32,331.00  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15 | 250,000.00 | 254,875.00 |

|        |      |                                       |               |                                  |  |
|--------|------|---------------------------------------|---------------|----------------------------------|--|
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15  | 100,000.00    | 110,770.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15 | 250,000.00    | 280,187.50                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15 | 200,000.00    | 241,070.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15 | 200,000.00    | 221,520.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15 | 150,000.00    | 151,335.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15  | 100,000.00    | 102,070.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15 | 40,000.00     | 41,244.00                        |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15  | 200,000.00    | 300,800.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15  | 100,000.00    | 124,590.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15  | 100,000.00    | 155,050.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15 | 150,000.00    | 237,375.00                       |  |
|        |      | NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15 | 60,000.00     | 83,766.00                        |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20     | 40,000.00     | 44,028.00                        |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15    | 250,000.00    | 265,575.00                       |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15     | 100,000.00    | 111,450.00                       |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15     | 200,000.00    | 229,820.00                       |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22     | 100,000.00    | 118,060.00                       |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20    | 200,000.00    | 221,620.00                       |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21    | 100,000.00    | 110,860.00                       |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20    | 40,000.00     | 41,284.00                        |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15    | 150,000.00    | 233,610.00                       |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15    | 150,000.00    | 231,225.00                       |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20    | 50,000.00     | 70,880.00                        |  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26     | 50,000.00     | 85,970.00                        |  |
| ユーロ建小計 |      |                                       | 34,870,000.00 | 42,859,087.20<br>(5,678,829,054) |  |
| 英債券    | 国債証券 | TSY-4.5%-19/03/07                     | 200,000.00    | 209,320.00                       |  |
|        |      | TSY-4.75%-20/03/07                    | 300,000.00    | 327,690.00                       |  |
|        |      | TSY-3.75%-20/09/07                    | 350,000.00    | 379,820.00                       |  |
|        |      | TSY-1.5%-21/01/22                     | 10,000.00     | 10,260.00                        |  |
|        |      | TSY-3.75%-21/09/07                    | 170,000.00    | 189,346.00                       |  |
|        |      | TSY-4.0%-22/03/07                     | 200,000.00    | 227,620.00                       |  |
|        |      | TSY-1.75%-22/09/07                    | 100,000.00    | 104,500.00                       |  |
|        |      | TSY-2.25%-23/09/07                    | 150,000.00    | 160,785.00                       |  |
|        |      | TSY-2.75%-24/09/07                    | 100,000.00    | 111,550.00                       |  |
|        |      | TSY-5.0%-25/03/07                     | 100,000.00    | 127,990.00                       |  |
|        |      | TSY-2.0%-25/09/07                     | 250,000.00    | 267,525.00                       |  |
|        |      | TSY-4.25%-27/12/07                    | 190,000.00    | 243,998.00                       |  |
|        |      | TSY-6.0%-28/12/07                     | 150,000.00    | 221,985.00                       |  |
|        |      | TSY-4.25%-32/06/07                    | 250,000.00    | 338,000.00                       |  |
|        |      | TSY-4.5%-34/09/07                     | 150,000.00    | 213,000.00                       |  |
|        |      | TSY-4.25%-36/03/07                    | 60,000.00     | 84,258.00                        |  |

|                |      |                                       |              |                               |  |
|----------------|------|---------------------------------------|--------------|-------------------------------|--|
|                |      | TSY-4.75%-38/12/07                    | 200,000.00   | 306,560.00                    |  |
|                |      | TSY-4.25%-40/12/07                    | 200,000.00   | 294,180.00                    |  |
|                |      | TSY-4.5%-42/12/07                     | 250,000.00   | 387,600.00                    |  |
|                |      | TSY-3.25%-44/01/22                    | 200,000.00   | 260,500.00                    |  |
|                |      | TSY-3.5%-45/01/22                     | 230,000.00   | 314,387.00                    |  |
|                |      | TSY-4.25%-46/12/07                    | 400,000.00   | 623,640.00                    |  |
|                |      | TSY-4.25%-49/12/07                    | 700,000.00   | 1,135,120.00                  |  |
|                |      | TSY-3.75%-52/07/22                    | 10,000.00    | 15,463.00                     |  |
|                |      | TSY-3.5%-68/07/22                     | 10,000.00    | 16,849.00                     |  |
| 英ポンド建小計        |      |                                       | 4,930,000.00 | 6,571,946.00<br>(992,363,846) |  |
| スウェーデン<br>クローナ | 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12     | 600,000.00   | 638,112.00                    |  |
|                |      | SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01      | 1,500,000.00 | 1,744,695.00                  |  |
|                |      | SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01      | 670,000.00   | 780,596.90                    |  |
|                |      | SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12      | 900,000.00   | 1,045,476.00                  |  |
|                |      | SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12      | 80,000.00    | 83,494.40                     |  |
|                |      | SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12     | 130,000.00   | 130,323.70                    |  |
|                |      | SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30      | 500,000.00   | 687,080.00                    |  |
| スウェーデンクローナ建小計  |      |                                       | 4,380,000.00 | 5,109,778.00<br>(68,062,242)  |  |
| ノルウェー<br>クローネ  | 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25   | 600,000.00   | 657,660.00                    |  |
|                |      | NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24    | 600,000.00   | 626,760.00                    |  |
|                |      | NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14    | 890,000.00   | 982,026.00                    |  |
|                |      | NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13   | 10,000.00    | 10,263.00                     |  |
|                |      | NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19    | 90,000.00    | 90,333.00                     |  |
|                |      | NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17   | 180,000.00   | 183,371.40                    |  |
| ノルウェークローネ建小計   |      |                                       | 2,370,000.00 | 2,550,413.40<br>(34,558,101)  |  |
| デンマーク<br>クローネ  | 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15      | 1,300,000.00 | 1,415,505.00                  |  |
|                |      | KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15      | 700,000.00   | 792,911.00                    |  |
|                |      | KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15      | 200,000.00   | 218,810.00                    |  |
|                |      | KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15     | 200,000.00   | 225,662.00                    |  |
|                |      | KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15      | 1,300,000.00 | 2,223,364.00                  |  |
| デンマーククローネ建小計   |      |                                       | 3,700,000.00 | 4,876,252.00<br>(86,797,285)  |  |
| ポーランド<br>ズロチ   | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25 | 10,000.00    | 10,266.00                     |  |
|                |      | POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25  | 350,000.00   | 374,360.00                    |  |
|                |      | POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25 | 200,000.00   | 218,120.00                    |  |
|                |      | POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25  | 140,000.00   | 139,034.00                    |  |
|                |      | POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25 | 300,000.00   | 294,510.00                    |  |
|                |      | POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23 | 400,000.00   | 457,360.00                    |  |
|                |      | POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25  | 300,000.00   | 320,130.00                    |  |

|                                     |            |   |              |              |               |
|-------------------------------------|------------|---|--------------|--------------|---------------|
|                                     |            | POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25   | 350,000.00   | 354,900.00   |               |
|                                     |            | POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25    | 200,000.00   | 190,380.00   |               |
|                                     |            | POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25    | 170,000.00   | 159,817.00   |               |
|                                     |            | POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25   | 100,000.00   | 124,950.00   |               |
| ポーランドズロチ建小計                         |            |   | 2,520,000.00 | 2,643,827.00 | (82,936,852)  |
| オーストラリアドル                           | 国債証券       | AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15     | 400,000.00   | 422,760.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21    | 20,000.00    | 19,868.00    |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15    | 300,000.00   | 336,060.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15    | 200,000.00   | 230,480.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21     | 250,000.00   | 290,800.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21    | 200,000.00   | 204,720.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21    | 250,000.00   | 263,600.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21    | 200,000.00   | 226,920.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21    | 400,000.00   | 474,360.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21    | 60,000.00    | 61,164.00    |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21    | 150,000.00   | 145,725.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21    | 350,000.00   | 370,825.00   |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21     | 50,000.00    | 60,470.00    |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21    | 100,000.00   | 97,173.00    |               |
|                                     |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21    | 50,000.00    | 55,362.50    |               |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21 | 100,000.00 | 95,090.00                               |              |              |               |
| オーストラリアドル建小計                        |            |   | 3,080,000.00 | 3,355,377.50 | (289,334,201) |
| シンガポールドル                            | 国債証券       | SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01      | 10,000.00    | 10,145.20    |               |
|                                     |            | SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01    | 20,000.00    | 20,032.00    |               |
|                                     |            | SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01     | 100,000.00   | 104,425.00   |               |
|                                     |            | SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01     | 200,000.00   | 209,908.00   |               |
|                                     |            | SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01      | 10,000.00    | 10,685.60    |               |
|                                     |            | SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01      | 100,000.00   | 112,599.00   |               |
|                                     |            | SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01    | 100,000.00   | 107,569.00   |               |
|                                     |            | SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01     | 30,000.00    | 32,081.40    |               |
|                                     |            | SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01     | 20,000.00    | 21,447.20    |               |
| シンガポールドル建小計                         |            |   | 590,000.00   | 628,892.40   | (52,537,671)  |
| 南アフリカランド                            | 国債証券       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%-21/03/31 | 1,000,000.00 | 956,280.00   |               |
|                                     |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%-23/02/28 | 10,000.00    | 9,637.30     |               |
|                                     |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21 | 2,800,000.00 | 3,011,288.00 |               |
|                                     |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%-31/02/28  | 760,000.00   | 605,704.80   |               |

|             |   |               |                                    |  |
|-------------|---|---------------|------------------------------------|--|
|             | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%-<br>32/03/31 | 210,000.00    | 183,999.90                         |  |
|             | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%-<br>36/03/31 | 3,600,000.00  | 2,490,588.00                       |  |
|             | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%-<br>41/02/28  | 1,100,000.00  | 746,669.00                         |  |
|             | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-<br>44/01/31 | 500,000.00    | 433,270.00                         |  |
|             | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-<br>48/02/28 | 350,000.00    | 303,824.50                         |  |
| 南アフリカランド建小計 |   | 10,330,000.00 | 8,741,261.50<br>(72,727,295)       |  |
| 合計          |   |               | 13,642,249,404<br>(13,642,249,404) |  |

## 有価証券明細表注記

- 小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

| 通貨         | 銘柄数      | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|----------|--------------|-------------------------|
| 米ドル        | 債券 58銘柄  | 41.7%        | 43.1%                   |
| カナダドル      | 債券 15銘柄  | 2.1%         | 2.2%                    |
| メキシコペソ     | 債券 9銘柄   | 0.7%         | 0.7%                    |
| ユーロ        | 債券 147銘柄 | 40.2%        | 41.6%                   |
| 英ポンド       | 債券 25銘柄  | 7.0%         | 7.3%                    |
| スウェーデンクローナ | 債券 7銘柄   | 0.5%         | 0.5%                    |
| ノルウェークローネ  | 債券 6銘柄   | 0.2%         | 0.3%                    |
| デンマーククローネ  | 債券 5銘柄   | 0.6%         | 0.6%                    |
| ポーランドズロチ   | 債券 11銘柄  | 0.6%         | 0.6%                    |
| オーストラリアドル  | 債券 16銘柄  | 2.1%         | 2.1%                    |
| シンガポールドル   | 債券 9銘柄   | 0.4%         | 0.4%                    |
| 南アフリカランド   | 債券 9銘柄   | 0.5%         | 0.5%                    |

（注1）組入債券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

（注2）有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

## 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

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## グローバル高金利通貨マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

|              | 平成28年12月15日現在 | 平成29年12月15日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 流動資産         |               |               |
| 預金           | 300,287,094   | 28,600,661    |
| コール・ローン      | 30,865,718    | 28,823,996    |
| 特殊債券         | 7,112,157,350 | 6,287,437,171 |
| 派生商品評価勘定     | -             | 930,161       |
| 未収入金         | 193,131,079   | 154,424,369   |
| 未収利息         | 249,649,977   | 214,594,124   |
| 前払費用         | 43,817,581    | 13,421,419    |
| 流動資産合計       | 7,929,908,799 | 6,728,231,901 |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 流動負債         |               |               |
| 派生商品評価勘定     | 2,204,970     | 542,124       |
| 未払金          | 278,072,080   | 86,521,981    |
| 未払利息         | 38            | 45            |
| 流動負債合計       | 280,277,088   | 87,064,150    |
| 負債合計         | 280,277,088   | 87,064,150    |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 元本等          |               |               |
| 元本           | 7,033,144,397 | 5,816,620,140 |
| 剰余金          |               |               |
| 剰余金又は欠損金（ ）  | 616,487,314   | 824,547,611   |
| 元本等合計        | 7,649,631,711 | 6,641,167,751 |
| 純資産合計        | 7,649,631,711 | 6,641,167,751 |
| 負債純資産合計      | 7,929,908,799 | 6,728,231,901 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日   |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 特殊債券<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）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      | 為替予約取引<br>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。  |

(貸借対照表に関する注記)



| 平成28年12月15日現在          |                | 平成29年12月15日現在          |                |
|------------------------|----------------|------------------------|----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 7,033,144,397口 | 1. 計算日における受益権の総数       | 5,816,620,140口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額              | 1.0877円        | 1口当たり純資産額              | 1.1418円        |
| (1万口当たり純資産額)           | (10,877円)      | (1万口当たり純資産額)           | (11,418円)      |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日   | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|-----------------|--|--------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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。<br>また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。  | 同左                             |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドの投資している金融商品は、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。<br>当ファンドが投資している有価証券は、特殊債券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。<br>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                             |

|                           |   |    |
|---------------------------|---|----|
| 3.金融商品に係るリスクの管理体制         | <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。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左 |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>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又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>  | 同左 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在                                    |
|---|--|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> |

|  |    |
|--|----|
| 特殊債券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。                                       | 同左 |
| 派生商品評価勘定<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。                                   |    |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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。 |    |

## （関連当事者との取引に関する注記）

|  |                                |                                |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
|  | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|  | 該当事項はありません。                    | 同左                             |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 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 | 8,122,081,720円 | 7,033,144,397円 |
| 期中追加設定元本額                          | 48,653,195円    | 541,279円       |
| 期中一部解約元本額                          | 1,137,590,518円 | 1,217,065,536円 |
| 同期末における元本の内訳                       |                |                |
| 高金利通貨ファンド                          | 7,008,782,137円 | 5,809,781,406円 |
| 世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）     | 15,571,021円    | - 円            |
| グローバル・ナビ                           | 8,791,239円     | 6,838,734円     |
| 合計                                 | 7,033,144,397円 | 5,816,620,140円 |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成28年12月15日現在      | 平成29年12月15日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 特殊債券 | 22,153,287         | 15,697,302         |
| 合計   | 22,153,287         | 15,697,302         |

（注）「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

## （通貨関連）

| 種類        | 平成28年12月15日現在 |           |             |           | 平成29年12月15日現在 |           |             |         |
|-----------|---------------|-----------|-------------|-----------|---------------|-----------|-------------|---------|
|           | 契約額等（円）       |           | 時価（円）       | 評価損益（円）   | 契約額等（円）       |           | 時価（円）       | 評価損益（円） |
|           |               | うち1年<br>超 |             |           |               | うち1年<br>超 |             |         |
| 市場取引以外の取引 |               |           |             |           |               |           |             |         |
| 為替予約取引    |               |           |             |           |               |           |             |         |
| 買建        | -             | -         | -           | -         | 69,612,546    | -         | 69,070,422  | 542,124 |
| 米ドル       | -             | -         | -           | -         | 40,750,502    | -         | 40,373,249  | 377,253 |
| インドネシアルピア | -             | -         | -           | -         | 28,862,044    | -         | 28,697,173  | 164,871 |
| 売建        | 196,688,839   | -         | 198,893,809 | 2,204,970 | 170,244,997   | -         | 169,314,836 | 930,161 |
| 米ドル       | -             | -         | -           | -         | 69,645,332    | -         | 69,240,326  | 405,006 |
| メキシコペソ    | 35,644,591    | -         | 36,083,374  | 438,783   | -             | -         | -           | -       |
| 英ポンド      | 39,493,308    | -         | 39,989,687  | 496,379   | -             | -         | -           | -       |
| トルコリラ     | 40,836,380    | -         | 41,217,055  | 380,675   | -             | -         | -           | -       |
| ロシアルーブル   | -             | -         | -           | -         | 40,750,502    | -         | 40,370,106  | 380,396 |
| オーストラリアドル | 80,714,560    | -         | 81,603,693  | 889,133   | 59,849,163    | -         | 59,704,404  | 144,759 |
| 合計        | 196,688,839   | -         | 198,893,809 | 2,204,970 | 239,857,543   | -         | 238,385,258 | 388,037 |

## 時価の算定方法

### 為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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。

## 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

| 通貨                | 種 類  | 銘 柄  | 券面総額              | 評価額                             | 備考 |
|-------------------|------|--|-------------------|---------------------------------|----|
| メキシコ<br>ペソ        | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV-4.5%-18/12/18        | 49,620,000.00     | 48,052,008.00                   |    |
|                   |      | EUROPEAN INVESTMENT BANK-4.0%-<br>20/02/25   | 20,500,000.00     | 19,017,850.00                   |    |
|                   |      | INTL BK RECON & DEVELOP-4.0%-18/08/16        | 40,400,000.00     | 39,442,520.00                   |    |
|                   |      | INTL BK RECON & DEVELOP-7.5%-20/03/05        | 19,080,000.00     | 19,087,632.00                   |    |
| メキシコペソ建小計         |      |  | 129,600,000.00    | 125,600,010.00<br>(739,784,058) |    |
| ブラジル<br>レアル       | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV-0.5%-17/12/20        | 1,400,000.00      | 1,399,440.00                    |    |
|                   |      | INTL FINANCE CORP-10.5%-18/04/17             | 4,950,000.00      | 5,016,330.00                    |    |
|                   |      | INTL FINANCE CORP-10.0%-19/06/14             | 17,000,000.00     | 17,771,800.00                   |    |
| ブラジルレアル建小計        |      |  | 23,350,000.00     | 24,187,570.00<br>(814,879,233)  |    |
| 英ポンド              | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK-2.25%-<br>20/03/07  | 350,000.00        | 361,970.00                      |    |
|                   |      | EUROPEAN INVESTMENT BANK-5.375%-<br>21/06/07 | 1,730,000.00      | 1,994,171.00                    |    |
| 英ポンド建小計           |      |  | 2,080,000.00      | 2,356,141.00<br>(355,777,291)   |    |
| トルコリ<br>ラ         | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV-8.0%-18/10/11        | 12,130,000.00     | 11,638,735.00                   |    |
|                   |      | INTL BK RECON & DEVELOP-9.625%-<br>18/07/13  | 16,200,000.00     | 15,833,880.00                   |    |
| トルコリラ建小計          |      |  | 28,330,000.00     | 27,472,615.00<br>(795,332,204)  |    |
| ポーランド<br>ズロチ      | 特殊債券 | INTL BK RECON & DEVELOP-1.5%-20/07/31        | 7,727,000.00      | 7,686,124.17                    |    |
| ポーランドズロチ建小計       |      |  | 7,727,000.00      | 7,686,124.17<br>(241,113,715)   |    |
| ロシア<br>ルーブル       | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV-7.25%-<br>18/02/08   | 250,700,000.00    | 250,341,499.00                  |    |
|                   |      | INTL FINANCE CORP-11.0%-20/01/21             | 232,500,000.00    | 251,588,250.00                  |    |
| ロシアルーブル建小計        |      |  | 483,200,000.00    | 501,929,749.00<br>(958,685,820) |    |
| オースト<br>ラリアド<br>ル | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK-2.8%-<br>21/01/15   | 3,100,000.00      | 3,135,340.00                    |    |
|                   |      | INTL FINANCE CORP-5.75%-20/07/28             | 3,150,000.00      | 3,429,720.00                    |    |
| オーストラリアドル建小計      |      |  | 6,250,000.00      | 6,565,060.00<br>(566,105,123)   |    |
| インドネ<br>シアルピ<br>ア | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV-10.0%-<br>18/11/16   | 17,300,000,000.00 | 17,914,150,000.00               |    |
|                   |      | EUROPEAN INVESTMENT BANK-7.2%-<br>19/07/09   | 17,800,000,000.00 | 18,084,800,000.00               |    |
|                   |      | INTER-AMERICAN DEVEL BK-5.8%-20/09/28        | 10,550,000,000.00 | 10,400,823,000.00               |    |
|                   |      |  | 45,650,000,000.00 | 46,399,773,000.00               |    |

| インドネシアルピア建小計 |      |  |                | (385,118,115)  |                 |
|--------------|------|--|----------------|----------------|-----------------|
| インドルピア       | 特殊債券 | EUROPEAN BK RECON & DEV-5.75%-18/03/19 | 14,400,000.00  | 14,391,360.00  |                 |
|              |      | EUROPEAN BK RECON & DEV-5.15%-20/01/20 | 21,800,000.00  | 21,486,080.00  |                 |
|              |      | EUROPEAN INVESTMENT BANK-6.6%-19/03/04 | 11,000,000.00  | 11,094,600.00  |                 |
|              |      | INTL FINANCE CORP-6.45%-18/10/30       | 255,000,000.00 | 256,275,000.00 |                 |
|              |      | INTL FINANCE CORP-6.45%-20/08/10       | 61,900,000.00  | 62,351,870.00  |                 |
| インドルピア建小計    |      |  | 364,100,000.00 | 365,598,910.00 | (643,454,081)   |
| 南アフリカランド     | 特殊債券 | EUROPEAN INVESTMENT BANK-9.0%-18/12/21 | 41,000,000.00  | 41,479,700.00  |                 |
|              |      | EUROPEAN INVESTMENT BANK-7.5%-19/01/30 | 27,700,000.00  | 27,597,510.00  |                 |
|              |      | EUROPEAN INVESTMENT BANK-9.0%-21/03/31 | 3,480,000.00   | 3,548,556.00   |                 |
|              |      | INTL BK RECON & DEVELOP-0.5%-19/03/28  | 24,200,000.00  | 21,988,120.00  |                 |
| 南アフリカランド建小計  |      |  | 96,380,000.00  | 94,613,886.00  | (787,187,531)   |
| 合計           |      |  |                | 6,287,437,171  | (6,287,437,171) |

## 有価証券明細表注記

- 小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

| 通貨        | 銘柄数    | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-----------|--------|--------------|-------------------------|
| メキシコペソ    | 債券 4銘柄 | 11.1%        | 11.8%                   |
| ブラジルリアル   | 債券 3銘柄 | 12.3%        | 13.0%                   |
| 英ポンド      | 債券 2銘柄 | 5.4%         | 5.7%                    |
| トルコリラ     | 債券 2銘柄 | 12.0%        | 12.6%                   |
| ポーランドズロチ  | 債券 1銘柄 | 3.6%         | 3.8%                    |
| ロシアルーブル   | 債券 2銘柄 | 14.4%        | 15.2%                   |
| オーストラリアドル | 債券 2銘柄 | 8.5%         | 9.0%                    |
| インドネシアルピア | 債券 3銘柄 | 5.8%         | 6.1%                    |
| インドルピア    | 債券 5銘柄 | 9.7%         | 10.2%                   |
| 南アフリカランド  | 債券 4銘柄 | 11.9%        | 12.5%                   |

(注1) 組入債券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

(注2) 有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

## 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

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

#### 新光J-REITマザーファンド

#### 貸借対照表

|              | (単位：円)        |               |
|--------------|---------------|---------------|
|              | 平成28年12月15日現在 | 平成29年12月15日現在 |
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 流動資産         |               |               |
| コール・ローン      | 21,613,824    | 26,790,764    |
| 投資証券         | 2,819,402,500 | 2,276,667,050 |
| 未収入金         | -             | 2,486,333     |
| 未収配当金        | 16,682,388    | 15,524,716    |
| 流動資産合計       | 2,857,698,712 | 2,321,468,863 |
| 資産合計         | 2,857,698,712 | 2,321,468,863 |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 流動負債         |               |               |
| 未払金          | 3,786,016     | 2,823,316     |
| 未払利息         | 26            | 42            |
| 流動負債合計       | 3,786,042     | 2,823,358     |
| 負債合計         | 3,786,042     | 2,823,358     |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 元本等          |               |               |
| 元本           | 1,752,731,946 | 1,458,049,378 |
| 剰余金          |               |               |
| 剰余金又は欠損金（ ）  | 1,101,180,724 | 860,596,127   |
| 元本等合計        | 2,853,912,670 | 2,318,645,505 |
| 純資産合計        | 2,853,912,670 | 2,318,645,505 |
| 負債純資産合計      | 2,857,698,712 | 2,321,468,863 |

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日   |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。 |
| 2. 収益及び費用の計上基準     | 受取配当金<br>原則として、投資証券の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)

| 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br>1,752,731,946口                                    | 1. 計算日における受益権の総数<br>1,458,049,378口                                    |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.6283円<br>(1万口当たり純資産額) (16,283円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.5902円<br>(1万口当たり純資産額) (15,902円) |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分                 | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日  | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|--------------------|---|--------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針    | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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リスク    | 当ファンドの投資している金融商品は、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。<br>当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、価格変動リスク等の市場リスク、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の管理体制 | 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。<br>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。<br>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。<br>市場リスク<br>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。<br>信用リスク<br>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。<br>流動性リスク<br>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。 | 同左                             |



|                           |  |    |
|---------------------------|--|----|
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 | 同左 |
|---------------------------|--|----|

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在   |
|--|---|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>投資証券</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

## （関連当事者との取引に関する注記）

|  | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
|  | 該当事項はありません。                    | 同左                             |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在  |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 1,510,959,483円 | 1,752,731,946円 |
| 期中追加設定元本額                          | 710,666,316円   | 148,508,598円   |
| 期中一部解約元本額                          | 468,893,853円   | 443,191,166円   |
| 同期末における元本の内訳                       |                |                |
| 新光7資産バランスファンド                      | 498,351,904円   | 498,351,904円   |
| 世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）     | 2,905,888円     | - 円            |
| グローバル・ナビ                           | 5,610,008円     | 4,940,213円     |
| 新光J-REITオープン（年2回決算型）               | 1,245,864,146円 | 954,757,261円   |
| 合計                                 | 1,752,731,946円 | 1,458,049,378円 |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成28年12月15日現在      | 平成29年12月15日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 1,081,251          | 44,494,731         |
| 合計   | 1,081,251          | 44,494,731         |

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

### 3 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

### 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

（単位：円）

| 種類            | 銘柄                    | 券面総額       | 評価額        | 備考 |
|---------------|-----------------------|------------|------------|----|
| 投資証券          | 日本アコモデーションファンド投資法人    | 99         | 46,134,000 |    |
|               | MCUBS MidCity投資法人     | 60         | 22,980,000 |    |
|               | 森ヒルズリート投資法人           | 320        | 43,680,000 |    |
|               | 産業ファンド投資法人            | 81         | 39,447,000 |    |
|               | アドバンス・レジデンス投資法人       | 276        | 76,176,000 |    |
|               | ケネディクス・レジデンシャル投資法人    | 68         | 22,066,000 |    |
|               | アクティビア・プロパティーズ投資法人    | 135        | 63,517,500 |    |
|               | GLP投資法人               | 522        | 64,728,000 |    |
|               | コンフォリア・レジデンシャル投資法人    | 109        | 26,574,200 |    |
|               | 日本プロロジスリート投資法人        | 375        | 90,600,000 |    |
|               | 星野リゾート・リート投資法人        | 45         | 24,930,000 |    |
|               | Oneリート投資法人            | 33         | 8,230,200  |    |
|               | イオンリート投資法人            | 283        | 33,224,200 |    |
|               | ヒューリックリート投資法人         | 202        | 32,784,600 |    |
|               | 日本リート投資法人             | 80         | 26,680,000 |    |
|               | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 165        | 18,034,500 |    |
|               | 日本ヘルスケア投資法人           | 14         | 2,280,600  |    |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 187                   | 25,020,600 |            |    |

|                     |        |               |  |
|---------------------|--------|---------------|--|
| ト・セイ・リ・ト投資法人        | 48     | 5,150,400     |  |
| ケネディクス商業リート投資法人     | 108    | 25,034,400    |  |
| ヘルスケア&メディカル投資法人     | 37     | 3,959,000     |  |
| サムティ・レジデンシャル投資法人    | 52     | 4,674,800     |  |
| ジャパン・シニアリビング投資法人    | 16     | 2,608,000     |  |
| 野村不動産マスタ・ファンド投資法人   | 855    | 123,291,000   |  |
| いちごホテルリート投資法人       | 47     | 5,837,400     |  |
| ラサ・ルロジボ・ト投資法人       | 225    | 25,537,500    |  |
| スタ・アジア不動産投資法人       | 62     | 6,869,600     |  |
| マリモ地方創生リート投資法人      | 17     | 1,982,200     |  |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 48     | 17,304,000    |  |
| 大江戸温泉リート投資法人        | 50     | 4,315,000     |  |
| さくら総合リート投資法人        | 72     | 6,688,800     |  |
| 投資法人みらい             | 38     | 6,805,800     |  |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人    | 65     | 9,295,000     |  |
| 三菱地所物流リート投資法人       | 28     | 7,865,200     |  |
| 日本ビルファンド投資法人        | 289    | 161,840,000   |  |
| ジャパンリアルエステイト投資法人    | 282    | 153,408,000   |  |
| 日本リテールファンド投資法人      | 573    | 117,465,000   |  |
| オリックス不動産投資法人        | 575    | 90,217,500    |  |
| 日本プライムリアルティ投資法人     | 188    | 69,466,000    |  |
| プレミア投資法人            | 269    | 28,675,400    |  |
| 東急リアル・エステート投資法人     | 200    | 27,720,000    |  |
| グローバル・ワン不動産投資法人     | 48     | 18,864,000    |  |
| ユナイテッド・アーバン投資法人     | 657    | 107,682,300   |  |
| 森トラスト総合リート投資法人      | 213    | 34,143,900    |  |
| インヴィンシブル投資法人        | 817    | 40,155,550    |  |
| フロンティア不動産投資法人       | 101    | 45,904,500    |  |
| 平和不動産リート投資法人        | 186    | 17,595,600    |  |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人   | 198    | 41,362,200    |  |
| 福岡リート投資法人           | 145    | 24,374,500    |  |
| ケネディクス・オフィス投資法人     | 87     | 55,593,000    |  |
| 積水ハウス・レジデンシャル投資法人   | 226    | 25,447,600    |  |
| いちごオフィスリート投資法人      | 231    | 18,364,500    |  |
| 大和証券オフィス投資法人        | 64     | 36,864,000    |  |
| 阪急リート投資法人           | 122    | 16,018,600    |  |
| スターツプロシード投資法人       | 47     | 7,783,200     |  |
| 大和ハウスリート投資法人        | 306    | 81,946,800    |  |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人    | 860    | 68,370,000    |  |
| 日本賃貸住宅投資法人          | 335    | 27,001,000    |  |
| ジャパンエクセレント投資法人      | 267    | 36,098,400    |  |
| 合計                  | 12,108 | 2,276,667,050 |  |

（注1）券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 新光米国REITマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

|              | 平成28年12月15日現在 | 平成29年12月15日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 流動資産         |               |               |
| 預金           | 11,181,574    | 12,887,061    |
| コール・ローン      | 11,548,392    | 1,586,351     |
| 投資証券         | 858,955,130   | 814,132,207   |
| 未収配当金        | 1,836,099     | 1,794,443     |
| 流動資産合計       | 883,521,195   | 830,400,062   |
| 資産合計         | 883,521,195   | 830,400,062   |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 流動負債         |               |               |
| 未払利息         | 14            | 2             |
| 流動負債合計       | 14            | 2             |
| 負債合計         | 14            | 2             |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 元本等          |               |               |
| 元本           | 565,796,196   | 501,678,356   |
| 剰余金          |               |               |
| 剰余金又は欠損金（ ）  | 317,724,985   | 328,721,704   |
| 元本等合計        | 883,521,181   | 830,400,060   |
| 純資産合計        | 883,521,181   | 830,400,060   |
| 負債純資産合計      | 883,521,195   | 830,400,062   |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分                   | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日   |
|----------------------|--|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法    | 投資証券<br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）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 | 為替予約取引<br>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  |
| 3.収益及び費用の計上基準        | 受取配当金  |

|                            |  |
|----------------------------|--|
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 原則として、投資証券の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。<br>外貨建取引等の処理基準<br>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。 |
|----------------------------|--|

## (貸借対照表に関する注記)

| 平成28年12月15日現在   | 平成29年12月15日現在   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br>565,796,196口                                      | 1. 計算日における受益権の総数<br>501,678,356口                                      |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.5616円<br>(1万口当たり純資産額) (15,616円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.6552円<br>(1万口当たり純資産額) (16,552円) |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日   | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|-----------------|--|--------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、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。<br>また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。  | 同左                             |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドの投資している金融商品は、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。<br>当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。<br>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                             |

|                           |   |    |
|---------------------------|---|----|
| 3.金融商品に係るリスクの管理体制         | <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。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左 |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>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又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>  | 同左 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年12月15日現在  | 平成29年12月15日現在   |
|--|---|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法<br/>投資証券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>同左</p> <p>2.時価の算定方法<br/>同左</p> |

## （関連当事者との取引に関する注記）

|  | 自 平成27年12月16日<br>至 平成28年12月15日 | 自 平成28年12月16日<br>至 平成29年12月15日 |
|--|--------------------------------|--------------------------------|
|  | 該当事項はありません。                    | 同左                             |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成28年12月15日現在 | 平成29年12月15日現在 |
|------------------------------------|---------------|---------------|
| 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 | 628,941,894円  | 565,796,196円  |
| 期中追加設定元本額                          | 24,014,990円   | 763,744円      |
| 期中一部解約元本額                          | 87,160,688円   | 64,881,584円   |
| 同期末における元本の内訳                       |               |               |
| 新光7資産バランスファンド                      | 555,569,117円  | 496,954,036円  |
| 世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）     | 4,063,563円    | - 円           |
| グローバル・ナビ                           | 6,163,516円    | 4,724,320円    |
| 合計                                 | 565,796,196円  | 501,678,356円  |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成28年12月15日現在      | 平成29年12月15日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 28,669,777         | 7,067,095          |
| 合計   | 28,669,777         | 7,067,095          |

（注）「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## 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

| 通貨  | 種類   | 銘柄                                     | 券面総額  | 評価額        | 備考 |
|-----|------|--|-------|------------|----|
| 米ドル | 投資証券 | ACADIA REALTY TRUST                    | 624   | 17,259.84  |    |
|     |      | AGREE REALTY CORPORATION               | 200   | 10,254.00  |    |
|     |      | ALEXANDER'S INC                        | 16    | 6,331.20   |    |
|     |      | ALEXANDRIA REAL ESTATE                 | 653   | 86,124.17  |    |
|     |      | ALTISOURCE RESIDENTIAL CORP            | 347   | 3,733.72   |    |
|     |      | AMERICAN ASSETS TRUST INC              | 300   | 11,628.00  |    |
|     |      | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES            | 940   | 40,382.40  |    |
|     |      | AMERICAN HOMES 4 RENT-A                | 1,687 | 37,130.87  |    |
|     |      | AMERICAN TOWER CORPORATION             | 2,994 | 430,058.16 |    |
|     |      | APARTMENT INVT & MGMT CO-A             | 1,097 | 48,103.45  |    |
|     |      | APPLE HOSPITALITY REIT INC             | 1,475 | 29,101.75  |    |
|     |      | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC          | 300   | 4,674.00   |    |
|     |      | ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC          | 200   | 1,982.00   |    |
|     |      | ASHFORD HOSPITALITY TRUST              | 709   | 4,785.75   |    |
|     |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC              | 969   | 176,716.53 |    |
|     |      | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC   | 200   | 2,036.00   |    |
|     |      | BOSTON PROPERTIES INC                  | 1,084 | 137,353.64 |    |
|     |      | BRANDYWINE REALTY                      | 1,214 | 21,997.68  |    |
|     |      | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC             | 2,146 | 38,778.22  |    |
|     |      | CAMDEN PROPERTY TRUST                  | 641   | 58,914.31  |    |
|     |      | CARETRUST REIT INC                     | 500   | 8,825.00   |    |
|     |      | CATCHMARK TIMBER TRUST INC             | 300   | 3,885.00   |    |
|     |      | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES            | 1,314 | 7,227.00   |    |
|     |      | CEDAR REALTY TRUST INC                 | 700   | 4,235.00   |    |
|     |      | CHATHAM LODGING TRUST                  | 300   | 6,963.00   |    |
|     |      | CHESAPEAKE LODGING TRUST               | 461   | 12,848.07  |    |
|     |      | CLIPPER REALTY INC                     | 111   | 1,131.09   |    |
|     |      | COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A           | 3,805 | 45,964.40  |    |
|     |      | COLUMBIA PROPERTY TRUST INC            | 860   | 19,444.60  |    |
|     |      | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I           | 100   | 2,747.00   |    |
|     |      | CORECIVIC INC                          | 869   | 18,918.13  |    |
|     |      | COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC    | 100   | 3,667.00   |    |
|     |      | CORESITE REALTY CORPORATION            | 238   | 27,984.04  |    |
|     |      | CORPORATE OFFICE PROPERTIES            | 736   | 22,190.40  |    |
|     |      | COUSINS PROPERTIES INC                 | 3,109 | 29,193.51  |    |
|     |      | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION | 2,830 | 313,026.30 |    |
|     |      | CUBESMART                              | 1,265 | 36,988.60  |    |



|                                    |       |            |
|------------------------------------|-------|------------|
| CYRUSONE INC                       | 609   | 36,278.13  |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC           | 648   | 38,465.28  |
| DDR CORPORATION                    | 2,173 | 17,297.08  |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO         | 1,552 | 17,584.16  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC           | 1,419 | 163,568.13 |
| DOUGLAS EMMETT INC                 | 1,020 | 41,830.20  |
| DUKE REALTY CORP                   | 2,500 | 69,525.00  |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 272   | 5,937.76   |
| EASTGROUP PROPERTIES               | 232   | 20,907.84  |
| EDUCATION REALTY TRUST INC         | 514   | 18,606.80  |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC      | 944   | 19,333.12  |
| EPR PROPERTIES                     | 441   | 29,705.76  |
| EQUINIX INC                        | 547   | 251,811.45 |
| EQUITY COMMONWEALTH                | 901   | 27,399.41  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC    | 572   | 52,011.96  |
| EQUITY RESIDENTIAL                 | 2,509 | 164,088.60 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC           | 460   | 114,540.00 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC            | 856   | 74,129.60  |
| FARMLAND PARTNERS INC              | 229   | 2,090.77   |
| FEDERAL REALTY INVESTMENT          | 506   | 66,149.38  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY            | 813   | 26,194.86  |
| FOREST CITY REALTY TRUST- A        | 1,707 | 41,445.96  |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC    | 460   | 12,015.20  |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES         | 800   | 8,504.00   |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC  | 1,383 | 49,829.49  |
| GETTY REALTY CORP                  | 201   | 5,587.80   |
| GGP INC                            | 4,334 | 101,502.28 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION   | 200   | 4,330.00   |
| GLADSTONE LAND CORPORATION         | 54    | 713.34     |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC            | 100   | 835.00     |
| GLOBAL NET LEASE INC               | 436   | 9,304.24   |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST | 661   | 12,327.65  |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST            | 1,081 | 29,922.08  |
| HCP INC                            | 3,303 | 88,553.43  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC        | 865   | 28,510.40  |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC    | 1,393 | 43,336.23  |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST           | 275   | 4,796.00   |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC           | 706   | 36,457.84  |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST       | 1,141 | 34,389.74  |
| HOST HOTELS & RESORTS              | 5,135 | 101,570.30 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC      | 1,098 | 37,694.34  |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC      | 500   | 5,060.00   |

|  |       |            |
|--|-------|------------|
| INFREIT INC                                  | 300   | 6,042.00   |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST                  | 1,000 | 5,770.00   |
| INVITATION HOMES INC                         | 2,100 | 49,896.00  |
| IRON MOUNTAIN INC                            | 1,845 | 70,036.20  |
| JBG SMITH PROPERTIES                         | 605   | 20,775.70  |
| KILROY REALTY CORP                           | 678   | 50,714.40  |
| KIMCO REALTY CORPORATION                     | 2,904 | 53,317.44  |
| KITE REALTY GROUP TRUST                      | 635   | 12,401.55  |
| LAMAR ADVERTISING COMPANY                    | 582   | 45,622.98  |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES                     | 795   | 22,458.75  |
| LEXINGTON REALTY TRUST                       | 1,644 | 16,390.68  |
| LIBERTY PROPERTY TRUST                       | 1,034 | 45,433.96  |
| LIFE STORAGE INC                             | 322   | 29,047.62  |
| LTC PROPERTIES INC                           | 300   | 13,875.00  |
| MACK-CALI REALTY CORP                        | 633   | 13,729.77  |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC                 | 200   | 2,216.00   |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST                     | 2,544 | 35,005.44  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC        | 797   | 81,652.65  |
| MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR-<br>CL A | 500   | 8,915.00   |
| NATIONAL HEALTH INVESTORS INC                | 284   | 22,651.84  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC               | 1,045 | 44,882.75  |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST            | 325   | 8,453.25   |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP                  | 600   | 4,602.00   |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC               | 127   | 3,382.01   |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP                 | 433   | 6,018.70   |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC               | 1,367 | 38,111.96  |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC                   | 100   | 2,650.00   |
| OUTFRONT MEDIA INC                           | 973   | 23,410.38  |
| PARAMOUNT GROUP INC                          | 1,483 | 23,475.89  |
| PARK HOTELS & RESORTS INC                    | 963   | 27,589.95  |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST                      | 481   | 18,220.28  |
| PENN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST            | 500   | 5,545.00   |
| PHYSICIANS REALTY TRUST                      | 1,259 | 23,153.01  |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A           | 1,018 | 20,421.08  |
| POTLATCH CORPORATION                         | 300   | 15,300.00  |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC          | 200   | 4,134.00   |
| PROLOGIS INC                                 | 3,710 | 244,526.10 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA                     | 138   | 17,608.80  |
| PUBLIC STORAGE                               | 1,041 | 219,671.82 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A                    | 352   | 19,588.80  |
| QUALITY CARE PROPERTIES INC                  | 719   | 10,382.36  |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES                  | 600   | 8,646.00   |

|                                      |       |            |
|--------------------------------------|-------|------------|
| RAYONIER INC                         | 957   | 29,896.68  |
| REALTY INCOME CORP                   | 1,921 | 109,439.37 |
| REGENCY CENTERS CORPORATION          | 1,048 | 72,521.60  |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP  | 841   | 16,483.60  |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC     | 1,665 | 21,744.90  |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC        | 500   | 15,355.00  |
| RLJ LODGING TRUST                    | 1,258 | 27,210.54  |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES         | 329   | 22,411.48  |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC           | 1,112 | 21,372.64  |
| SAFETY INCOME AND GROWTH INC         | 73    | 1,305.97   |
| SAUL CENTERS INC                     | 100   | 6,205.00   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP              | 845   | 140,101.00 |
| SELECT INCOME REIT                   | 442   | 11,253.32  |
| SENIOR HOUSING PROPERTIES            | 1,654 | 31,988.36  |
| SIMON PROPERTY GROUP                 | 2,188 | 362,398.44 |
| SL GREEN REALTY CORPORATION          | 697   | 71,881.61  |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC            | 3,583 | 30,312.18  |
| STAG INDUSTRIAL INC                  | 600   | 16,794.00  |
| STORE CAPITAL CORPORATION            | 1,201 | 31,105.90  |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC          | 796   | 11,796.72  |
| SUN COMMUNITIES INC                  | 529   | 50,069.85  |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS             | 1,543 | 25,845.25  |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER         | 657   | 16,937.46  |
| TAUBMAN CENTERS INC                  | 415   | 26,447.95  |
| TERRENO REALTY CORP                  | 364   | 13,384.28  |
| THE GEO GROUP INC                    | 910   | 20,993.70  |
| THE MACERICH COMPANY                 | 962   | 64,040.34  |
| TIER REIT INC                        | 367   | 7,185.86   |
| UDR INC                              | 1,866 | 72,960.60  |
| UMH PROPERTIES INC                   | 200   | 2,966.00   |
| UNITI GROUP INC                      | 1,163 | 20,503.69  |
| UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST | 100   | 7,643.00   |
| URBAN EDGE PROPERTIES                | 700   | 17,682.00  |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES INC        | 229   | 5,200.59   |
| VENTAS INC                           | 2,495 | 158,332.70 |
| VEREIT INC                           | 6,869 | 54,265.10  |
| VORNADO REALTY TRUST                 | 1,210 | 93,750.80  |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC           | 1,423 | 9,861.39   |
| WASHINGTON REAL ESTATE INV           | 577   | 18,660.18  |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS          | 844   | 27,927.96  |
| WELLTOWER INC                        | 2,580 | 171,028.20 |
| WEYERHAEUSER COMPANY                 | 5,251 | 187,198.15 |
| WHITESTONE REIT                      | 283   | 4,109.16   |

|        |                                   |         |                               |  |
|--------|-----------------------------------|---------|-------------------------------|--|
|        | WINTHROP REALTY LIQUIDATING TRUST | 300     | 1,899.00                      |  |
|        | WP CAREY INC                      | 742     | 51,784.18                     |  |
|        | XENIA HOTELS & RESORTS INC        | 835     | 18,461.85                     |  |
| 米ドル建小計 |                                   | 173,604 | 7,243,169.11<br>(814,132,207) |  |
|        | 合計                                |         | 814,132,207<br>(814,132,207)  |  |

(注1) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

- 小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

| 通貨  | 銘柄数        | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-----|------------|----------------|-------------------------|
| 米ドル | 投資証券 167銘柄 | 98.0%          | 100.0%                  |

(注1) 組入投資証券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

(注2) 有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

#### 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。

【中間財務諸表】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、中間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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期中間計算期間(平成29年12月16日から平成30年6月15日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【グローバル・ナビ】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第5期中間計算期間末<br>平成30年 6月15日現在 |
|-----------------|-----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                             |
| 流動資産            |                             |
| 預金              | 7,024                       |
| コール・ローン         | 12,645,541                  |
| 投資信託受益証券        | 12,155,989                  |
| 親投資信託受益証券       | 221,491,789                 |
| 流動資産合計          | 246,300,343                 |
| 資産合計            | 246,300,343                 |
| <b>負債の部</b>     |                             |
| 流動負債            |                             |
| 未払受託者報酬         | 58,053                      |
| 未払委託者報酬         | 1,590,701                   |
| 未払利息            | 28                          |
| その他未払費用         | 4,582                       |
| 流動負債合計          | 1,653,364                   |
| 負債合計            | 1,653,364                   |
| <b>純資産の部</b>    |                             |
| 元本等             |                             |
| 元本              | 208,074,032                 |
| 剰余金             |                             |
| 中間剰余金又は中間欠損金( ) | 36,572,947                  |
| (分配準備積立金)       | 19,087,807                  |
| 元本等合計           | 244,646,979                 |
| 純資産合計           | 244,646,979                 |
| 負債純資産合計         | 246,300,343                 |

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第5期中間計算期間<br>自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日 |
|-------------------------|---|
| 営業収益                    |   |
| 受取配当金                   | 120,137                                     |
| 有価証券売買等損益               | 1,166,755                                   |
| 為替差損益                   | 21,461                                      |
| その他収益                   | 2,057                                       |
| 営業収益合計                  | 1,310,410                                   |
| 営業費用                    |   |
| 支払利息                    | 3,910                                       |
| 受託者報酬                   | 58,053                                      |
| 委託者報酬                   | 1,590,701                                   |
| その他費用                   | 201,637                                     |
| 営業費用合計                  | 1,854,301                                   |
| 営業利益                    | 543,891                                     |
| 経常利益                    | 543,891                                     |
| 中間純利益                   | 543,891                                     |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額      | 76,150                                      |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )         | 25,152,349                                  |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          | 13,529,229                                  |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 13,529,229                                  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          | 1,640,890                                   |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,640,890                                   |
| 分配金                     | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金( )         | 36,572,947                                  |

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                           | 第5期中間計算期間<br>自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日  |
|------------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法           | 投資信託受益証券<br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。<br>親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法        | 為替予約取引<br>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  |
| 3. 収益及び費用の計上基準               | 受取配当金<br>原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。  |
| 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。  |

(中間貸借対照表に関する注記)

|                             | 第5期中間計算期間末<br>平成30年 6月15日現在 |
|-----------------------------|-----------------------------|
| 1. 中間計算期間末日における受益権の総数       | 208,074,032口                |
| 2. 中間計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 |                             |
| 1口当たり純資産額                   | 1.1758円                     |
| (1万口当たり純資産額)                | (11,758円)                   |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分    | 第5期中間計算期間<br>自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日 |
|-------|---|
| その他費用 | 主に、海外カストディアンに対するカストディフィーであります。              |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項



第5期中間計算期間末  
平成30年 6月15日現在

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額

中間貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間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

投資信託受益証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

親投資信託受益証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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

市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。

（その他の注記）

1 元本の移動

| 区分        | 第5期中間計算期間末<br>平成30年 6月15日現在 |
|-----------|-----------------------------|
| 期首元本額     | 131,239,635円                |
| 期中追加設定元本額 | 86,007,033円                 |
| 期中一部解約元本額 | 9,172,636円                  |

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「新光外国株式インデックス マザーファンド」、「新光日本債券インデックスマザーファンド」、「海外国債マザーファンド」、「新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」、「グローバル高金利通貨マザーファンド」、「新光J-REITマザーファンド」及び「新光米国REITマザーファンド」各受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、これら同ファンドの受益証券であります。

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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)

平成30年 6月15日現在

|             |               |
|-------------|---------------|
| 資産の部        |               |
| 流動資産        |               |
| コール・ローン     | 224,034,443   |
| 株式          | 8,532,265,910 |
| 派生商品評価勘定    | 2,310,140     |
| 未収入金        | 58,692        |
| 未収配当金       | 64,258,961    |
| 流動資産合計      | 8,822,928,146 |
| 資産合計        | 8,822,928,146 |
| 負債の部        |               |
| 流動負債        |               |
| 前受金         | 1,490,000     |
| 未払利息        | 507           |
| 流動負債合計      | 1,490,507     |
| 負債合計        | 1,490,507     |
| 純資産の部       |               |
| 元本等         |               |
| 元本          | 3,793,144,975 |
| 剰余金         |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 5,028,292,664 |
| 元本等合計       | 8,821,437,639 |
| 純資産合計       | 8,821,437,639 |
| 負債純資産合計     | 8,822,928,146 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                    | 自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日   |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式<br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）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<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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及び外国金融商品市場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<br>原則として、株式の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)

| 平成30年 6月15日現在                                      |
|--|
| 1. 担保資産<br>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| 株式                     | 164,545,700円   |
| 2. 計算日における受益権の総数       | 3,793,144,975口 |
| 3. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額              | 2.3256円        |
| (1万口当たり純資産額)           | (23,256円)      |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成30年 6月15日現在  |  |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額   |  |
| 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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   |  |
| 株式   |  |
| 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。                           |  |
| 派生商品評価勘定   |  |
| 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。                           |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務  |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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                                 |  |
| 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 |  |
| 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又は計算上の想定元     |  |
| 本であり、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。                  |  |

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成30年 6月15日現在  |
|------------------------------------|----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 4,709,895,506円 |
| 期中追加設定元本額                          | 161,528,009円   |
| 期中一部解約元本額                          | 1,078,278,540円 |
| 同期末における元本の内訳                       |                |
| ニュー トピックス インデックス                   | 267,568,937円   |
| 新光7資産バランスファンド                      | 330,753,274円   |
| ニュー トピックス インデックス(変額年金)             | 121,042,256円   |
| 新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)        | 709,192,462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)        | 711,954,988円   |
| 新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)           | 33,722,659円    |
| ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)        | 1,162,161,062円 |
| ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)       | 410,283,434円   |
| グローバル・ナビ                           | 21,202,693円    |
| 太陽財形株投 太陽一般財形 30                   | 4,777,923円     |
| 太陽財形株投 太陽一般財形 50                   | 17,271,049円    |

|                     |                |
|---------------------|----------------|
| 太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30 | 3,214,238円     |
| 合計                  | 3,793,144,975円 |

## 2 デリバティブ取引等関係

### 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

| 種類       | 平成30年 6月15日現在 |       |             |           |
|----------|---------------|-------|-------------|-----------|
|          | 契約額等（円）       |       | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|          |               | うち1年超 |             |           |
| 市場取引     |               |       |             |           |
| 株価指数先物取引 |               |       |             |           |
| 買建       | 265,739,860   | -     | 268,050,000 | 2,310,140 |
| 東証株価指数先物 | 265,739,860   | -     | 268,050,000 | 2,310,140 |
| 合計       | 265,739,860   | -     | 268,050,000 | 2,310,140 |

### 時価の算定方法

#### 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金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

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。

## 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)

平成30年 6月15日現在

|             |               |
|-------------|---------------|
| <b>資産の部</b> |               |
| 流動資産        |               |
| 預金          | 307,899,570   |
| コール・ローン     | 6,084,730     |
| 株式          | 5,773,895,606 |
| 投資証券        | 125,718,611   |
| 派生商品評価勘定    | 2,562,108     |
| 未収入金        | 18,390        |
| 未収配当金       | 11,220,232    |
| 差入委託証拠金     | 74,570,891    |
| 流動資産合計      | 6,301,970,138 |
| 資産合計        | 6,301,970,138 |
| <b>負債の部</b> |               |
| 流動負債        |               |
| 派生商品評価勘定    | 76,341        |
| 未払解約金       | 69,000        |
| 未払利息        | 13            |

平成30年 6月15日現在

|             |               |
|-------------|---------------|
| 流動負債合計      | 145,354       |
| 負債合計        | 145,354       |
| 純資産の部       |               |
| 元本等         |               |
| 元本          | 2,642,790,160 |
| 剰余金         |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 3,659,034,624 |
| 元本等合計       | 6,301,824,784 |
| 純資産合計       | 6,301,824,784 |
| 負債純資産合計     | 6,301,970,138 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日  |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>株式<br/>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。<br/>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券<br/>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。<br/>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券<br/>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。<br/>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）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<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>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及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引<br/>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>  |
| 3. 収益及び費用の計上基準             | <p>受取配当金<br/>(1) 株式及び投資証券<br/>原則として、株式及び投資証券の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> <p>(2) 投資信託受益証券<br/>原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>  |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準<br/>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>   |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成30年 6月15日現在          |                |
|------------------------|----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 2,642,790,160口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額              | 2.3845円        |
| (1万口当たり純資産額)           | (23,845円)      |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成30年 6月15日現在   |   |
|---|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額  |   |
| 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ<br>ん。   |   |
| 2. 時価の算定方法  |   |
| 株式  | 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。                            |
| 投資証券  | 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。                            |
| 派生商品評価勘定  | 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。                            |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務   | これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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<br>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  |   |
| 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があ<br>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又は計算上の想定元<br>本であり、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。 |   |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成30年 6月15日現在  |
|------------------------------------|----------------|
| 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 | 3,114,466,882円 |
| 期中追加設定元本額                          | 93,393,047円    |
| 期中一部解約元本額                          | 565,069,769円   |
| 同期末における元本の内訳                       |                |
| 新光7資産バランスファンド                      | 316,216,743円   |
| 新光外国株式インデックスVA                     | 529,288,747円   |
| 新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）        | 282,263,814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）        | 236,143,084円   |
| 新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）           | 83,424,322円    |
| ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）        | 770,094,379円   |
| ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）       | 409,611,131円   |

|          |                |
|----------|----------------|
| グローバル・ナビ | 15,747,940円    |
| 合計       | 2,642,790,160円 |

## 2 デリバティブ取引等関係

### 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

| 種類           | 平成30年 6月15日現在 |       |             |           |
|--------------|---------------|-------|-------------|-----------|
|              | 契約額等（円）       |       | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|              |               | うち1年超 |             |           |
| 市場取引         |               |       |             |           |
| 株価指数先物取引     |               |       |             |           |
| 買建           | 412,137,265   | -     | 414,609,793 | 2,472,528 |
| S&P500 EMINI | 277,165,409   | -     | 277,758,100 | 592,691   |
| S&P/TSE 601X | 16,107,999    | -     | 16,255,450  | 147,451   |
| DJ EURO ST50 | 84,039,541    | -     | 85,636,724  | 1,597,183 |
| FTSE 100 IDX | 22,438,173    | -     | 22,650,170  | 211,997   |
| SPI 200      | 12,386,143    | -     | 12,309,349  | 76,794    |
| 合計           | 412,137,265   | -     | 414,609,793 | 2,472,528 |

### 時価の算定方法

#### 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金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

契約額等及び時価の邦貨換算額は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

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。

## 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)

| 平成30年 6月15日現在 |                |
|---------------|----------------|
| 資産の部          |                |
| 流動資産          |                |
| コール・ローン       | 218,653,503    |
| 国債証券          | 10,180,974,500 |
| 地方債証券         | 960,257,300    |
| 特殊債券          | 951,738,000    |
| 社債券           | 517,100,000    |
| 未収利息          | 37,649,007     |
| 前払費用          | 831,402        |
| 流動資産合計        | 12,867,203,712 |

平成30年 6月15日現在

|             |                |
|-------------|----------------|
| 資産合計        | 12,867,203,712 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 未払解約金       | 200            |
| 未払利息        | 495            |
| 流動負債合計      | 695            |
| 負債合計        | 695            |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 10,128,530,834 |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 2,738,672,183  |
| 元本等合計       | 12,867,203,017 |
| 純資産合計       | 12,867,203,017 |
| 負債純資産合計     | 12,867,203,712 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分              | 自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日  |
|-----------------|---|
| 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、社債券<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）に基づいて評価しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成30年 6月15日現在          |                 |
|------------------------|-----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 10,128,530,834口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                 |
| 1口当たり純資産額              | 1.2704円         |
| (1万口当たり純資産額)           | (12,704円)       |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 平成30年 6月15日現在   |  |
|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額  |  |
| 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ<br>ん。 |  |
| 2. 時価の算定方法  |  |



## 国債証券

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

## 地方債証券

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

## 特殊債券

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

## 社債券

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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

市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成30年 6月15日現在   |
|------------------------------------|-----------------|
| 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 | 11,271,523,135円 |
| 期中追加設定元本額                          | 757,627,656円    |
| 期中一部解約元本額                          | 1,900,619,957円  |
| 同期末における元本の内訳                       |                 |
| 新光日本債券インデックスファンド(DC年金)             | 116,448,508円    |
| 新光7資産バランスファンド                      | 578,376,366円    |
| 日本債券ファンド                           | 2,856,067,934円  |
| 新光日本債券インデックスVA                     | 35,381,987円     |
| 新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)        | 1,027,320,639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)        | 1,287,892,080円  |
| 新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)           | 122,349,946円    |
| ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)        | 2,821,466,745円  |
| ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)       | 1,254,303,009円  |
| グローバル・ナビ                           | 28,923,620円     |
| 合計                                 | 10,128,530,834円 |

## 2 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## 海外国債マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

平成30年 6月15日現在

|             |                |
|-------------|----------------|
| 資産の部        |                |
| 流動資産        |                |
| 預金          | 13,822,750     |
| コール・ローン     | 186,938,210    |
| 国債証券        | 20,343,399,464 |
| 未収利息        | 77,814,867     |
| 前払費用        | 40,892,582     |
| 流動資産合計      | 20,662,867,873 |
| 資産合計        | 20,662,867,873 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 未払利息        | 423            |
| 流動負債合計      | 423            |
| 負債合計        | 423            |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 9,407,510,126  |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 11,255,357,324 |
| 元本等合計       | 20,662,867,450 |
| 純資産合計       | 20,662,867,450 |
| 負債純資産合計     | 20,662,867,873 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日   |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 国債証券<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）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      | 為替予約取引<br>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。  |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成30年 6月15日現在          |                |
|------------------------|----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 9,407,510,126口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額              | 2.1964円        |
| (1万口当たり純資産額)           | (21,964円)      |

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成30年 6月15日現在  |  |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額   |  |
| 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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   |  |
| 国債証券   |  |
| 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。                           |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務  |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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                                 |  |
| 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 |  |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成30年 6月15日現在   |
|------------------------------------|-----------------|
| 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 | 10,153,812,287円 |
| 期中追加設定元本額                          | 32,920,983円     |
| 期中一部解約元本額                          | 779,223,144円    |
| 同期末における元本の内訳                       |                 |
| 海外国債ファンド                           | 6,852,994,233円  |
| 海外国債ファンド（3ヵ月決算型）                   | 1,129,671,053円  |
| 新光7資産バランスファンド                      | 341,575,843円    |
| 海外国債ファンド（1年決算型）                    | 29,185,722円     |
| 海外国債ファンド（変額年金）                     | 1,037,368,190円  |
| グローバル・ナビ                           | 16,715,085円     |
| 合計                                 | 9,407,510,126円  |

## 2 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 6月15日現在

## 資産の部

## 流動資産

平成30年 6月15日現在

|             |                |
|-------------|----------------|
| 預金          | 338,426,147    |
| コール・ローン     | 10,136,108     |
| 国債証券        | 10,919,649,787 |
| 派生商品評価勘定    | 7,065,572      |
| 未収利息        | 90,065,471     |
| 前払費用        | 2,264,574      |
| 差入委託証拠金     | 1,983          |
| 流動資産合計      | 11,367,609,642 |
| 資産合計        | 11,367,609,642 |
| 負債の部        |                |
| 流動負債        |                |
| 派生商品評価勘定    | 162,415,885    |
| 未払金         | 1,596,166      |
| 未払利息        | 22             |
| 流動負債合計      | 164,012,073    |
| 負債合計        | 164,012,073    |
| 純資産の部       |                |
| 元本等         |                |
| 元本          | 8,399,761,682  |
| 剰余金         |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 2,803,835,887  |
| 元本等合計       | 11,203,597,569 |
| 純資産合計       | 11,203,597,569 |
| 負債純資産合計     | 11,367,609,642 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15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。</p> <p>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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）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</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。</p> <p>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及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>  |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成30年 6月15日現在    |                |
|------------------|----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数 | 8,399,761,682口 |

|                        |           |
|------------------------|-----------|
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額              | 1.3338円   |
| (1万口当たり純資産額)           | (13,338円) |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成30年 6月15日現在   |  |
|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額  |  |
| 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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  |  |
| 国債証券  |  |
| 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  |  |
| 派生商品評価勘定  |  |
| 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務   |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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  |  |
| 市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。                                      |  |
| 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又は計算上の想定元本であり、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。 |  |

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成30年 6月15日現在   |
|------------------------------------|-----------------|
| 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 | 10,375,372,024円 |
| 期中追加設定元本額                          | 105,968,099円    |
| 期中一部解約元本額                          | 2,081,578,441円  |
| 同期末における元本の内訳                       |                 |
| 新光ワールドバランスファンドVA(適格機関投資家私募)        | 3,670,177,338円  |
| 新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)           | 116,207,978円    |
| ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)        | 3,397,769,527円  |
| ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)       | 1,197,317,792円  |
| グローバル・ナビ                           | 18,289,047円     |
| 合計                                 | 8,399,761,682円  |

## 2 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

| 種類 | 平成30年 6月15日現在 |  |
|----|---------------|--|
|    | 契約額等(円)       |  |
|    |               |  |

|            |                | うち1年超 | 時価（円）          | 評価損益（円）     |
|------------|----------------|-------|----------------|-------------|
| 市場取引以外の取引  |                |       |                |             |
| 為替予約取引     |                |       |                |             |
| 売建         | 11,217,178,304 | -     | 11,372,528,617 | 155,350,313 |
| 米ドル        | 4,929,740,192  | -     | 5,028,516,324  | 98,776,132  |
| カナダドル      | 250,050,750    | -     | 250,260,192    | 209,442     |
| メキシコペソ     | 96,260,096     | -     | 93,211,017     | 3,049,079   |
| ユーロ        | 4,520,370,056  | -     | 4,564,328,930  | 43,958,874  |
| 英ポンド       | 809,892,935    | -     | 823,425,348    | 13,532,413  |
| スウェーデンクローナ | 46,547,896     | -     | 47,776,672     | 1,228,776   |
| ノルウェークローネ  | 37,265,342     | -     | 38,215,478     | 950,136     |
| デンマーククローネ  | 73,877,715     | -     | 74,546,989     | 669,274     |
| ポーランドズロチ   | 73,349,591     | -     | 74,497,020     | 1,147,429   |
| オーストラリアドル  | 246,509,855    | -     | 247,710,393    | 1,200,538   |
| シンガポールドル   | 51,957,119     | -     | 52,699,990     | 742,871     |
| 南アフリカランド   | 81,356,757     | -     | 77,340,264     | 4,016,493   |
| 合計         | 11,217,178,304 | -     | 11,372,528,617 | 155,350,313 |

#### 時価の算定方法

##### 為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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。

#### グローバル高金利通貨マザーファンド

##### 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 6月15日現在

|      |            |
|------|------------|
| 資産の部 |            |
| 流動資産 |            |
| 預金   | 64,563,457 |

平成30年 6月15日現在

|             |               |
|-------------|---------------|
| コール・ローン     | 17,082,415    |
| 特殊債券        | 5,451,421,682 |
| 未収利息        | 138,505,932   |
| 前払費用        | 8,964,836     |
| 流動資産合計      | 5,680,538,322 |
| 資産合計        | 5,680,538,322 |
| 負債の部        |               |
| 流動負債        |               |
| 未払利息        | 38            |
| 流動負債合計      | 38            |
| 負債合計        | 38            |
| 純資産の部       |               |
| 元本等         |               |
| 元本          | 5,284,366,252 |
| 剰余金         |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 396,172,032   |
| 元本等合計       | 5,680,538,284 |
| 純資産合計       | 5,680,538,284 |
| 負債純資産合計     | 5,680,538,322 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日   |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 特殊債券<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）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      | 為替予約取引<br>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。  |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成30年 6月15日現在          |                |
|------------------------|----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 5,284,366,252口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額              | 1.0750円        |
| (1万口当たり純資産額)           | (10,750円)      |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成30年 6月15日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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

特殊債券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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

市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があ  
 ります。

（その他の注記）

1 元本の移動

| 区分                                 | 平成30年 6月15日現在  |
|------------------------------------|----------------|
| 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 | 5,816,620,140円 |
| 期中追加設定元本額                          | 4,874,486円     |
| 期中一部解約元本額                          | 537,128,374円   |
| 同期末における元本の内訳                       |                |
| 高金利通貨ファンド                          | 5,273,127,461円 |
| グローバル・ナビ                           | 11,238,791円    |
| 合計                                 | 5,284,366,252円 |

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

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）

平成30年 6月15日現在

|         |               |
|---------|---------------|
| 資産の部    |               |
| 流動資産    |               |
| コール・ローン | 19,357,048    |
| 投資証券    | 2,323,266,595 |
| 未収入金    | 10,198,845    |
| 未収配当金   | 15,034,413    |
| 流動資産合計  | 2,367,856,901 |
| 資産合計    | 2,367,856,901 |
| 負債の部    |               |
| 流動負債    |               |



平成30年 6月15日現在

|             |               |
|-------------|---------------|
| 未払解約金       | 9,000,000     |
| 未払利息        | 43            |
| 流動負債合計      | 9,000,043     |
| 負債合計        | 9,000,043     |
| 純資産の部       |               |
| 元本等         |               |
| 元本          | 1,399,234,707 |
| 剰余金         |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 959,622,151   |
| 元本等合計       | 2,358,856,858 |
| 純資産合計       | 2,358,856,858 |
| 負債純資産合計     | 2,367,856,901 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                 | 自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日   |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。 |
| 2. 収益及び費用の計上基準     | 受取配当金<br>原則として、投資証券の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)

| 平成30年 6月15日現在          |                |
|------------------------|----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 1,399,234,707口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額              | 1.6858円        |
| (1万口当たり純資産額)           | (16,858円)      |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 平成30年 6月15日現在   |  |
|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                    |  |
| 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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  |  |

## 投資証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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

市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成30年 6月15日現在  |
|------------------------------------|----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 1,458,049,378円 |
| 期中追加設定元本額                          | 111,748,450円   |
| 期中一部解約元本額                          | 170,563,121円   |
| 同期末における元本の内訳                       |                |
| 新光7資産バランスファンド                      | 462,104,698円   |
| グローバル・ナビ                           | 7,291,056円     |
| 新光J-REITオープン（年2回決算型）               | 929,838,953円   |
| 合計                                 | 1,399,234,707円 |

## 2 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

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）

平成30年 6月15日現在

|         |             |
|---------|-------------|
| 資産の部    |             |
| 流動資産    |             |
| 預金      | 7,947,797   |
| コール・ローン | 1,740,422   |
| 投資証券    | 790,375,399 |
| 未収配当金   | 2,105,938   |
| 流動資産合計  | 802,169,556 |
| 資産合計    | 802,169,556 |
| 負債の部    |             |
| 流動負債    |             |
| 未払利息    | 3           |
| 流動負債合計  | 3           |
| 負債合計    | 3           |
| 純資産の部   |             |
| 元本等     |             |

| 平成30年 6月15日現在 |             |
|---------------|-------------|
| 元本            | 504,761,345 |
| 剰余金           |             |
| 剰余金又は欠損金（ ）   | 297,408,208 |
| 元本等合計         | 802,169,553 |
| 純資産合計         | 802,169,553 |
| 負債純資産合計       | 802,169,556 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 自 平成29年12月16日<br>至 平成30年 6月15日   |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 投資証券<br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）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      | 為替予約取引<br>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  |
| 3. 収益及び費用の計上基準             | 受取配当金<br>原則として、投資証券の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。   |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。  |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成30年 6月15日現在          |              |
|------------------------|--------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 504,761,345口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |              |
| 1口当たり純資産額              | 1.5892円      |
| (1万口当たり純資産額)           | (15,892円)    |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 平成30年 6月15日現在   |  |
|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                    |  |
| 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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  |  |

## 投資証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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

市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成30年 6月15日現在 |
|------------------------------------|---------------|
| 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 | 501,678,356円  |
| 期中追加設定元本額                          | 4,107,205円    |
| 期中一部解約元本額                          | 1,024,216円    |
| 同期末における元本の内訳                       |               |
| 新光7資産バランスファンド                      | 496,954,036円  |
| グローバル・ナビ                           | 7,807,309円    |
| 合計                                 | 504,761,345円  |

2 デリバティブ取引等関係  
取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## グローバル・ナビ

(平成30年 6月29日現在)

|                |              |
|----------------|--------------|
| 資産総額           | 241,226,015円 |
| 負債総額           | 143,170円     |
| 純資産総額( - )     | 241,082,845円 |
| 発行済口数          | 207,279,824口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.1631円      |
| (1万口当たり純資産額)   | (11,631円)    |

## (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 8,513,024,633円 |
| 負債総額           | 15,860,179円    |
| 純資産総額( - )     | 8,497,164,454円 |
| 発行済口数          | 3,771,775,242口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 2.2528円        |
| (1万口当たり純資産額)   | (22,528円)      |

## (参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 6,052,384,964円 |
| 負債総額           | 15,009,685円    |
| 純資産総額( - )     | 6,037,375,279円 |
| 発行済口数          | 2,604,261,266口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 2.3183円        |
| (1万口当たり純資産額)   | (23,183円)      |

## (参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

|      |                 |
|------|-----------------|
| 資産総額 | 13,080,989,957円 |
| 負債総額 | 130,976,140円    |

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 純資産総額( - )     | 12,950,013,817円 |
| 発行済口数          | 10,190,017,205口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.2709円         |
| (1万口当たり純資産額)   | (12,709円)       |

## (参考) 海外国債マザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 20,617,304,349円 |
| 負債総額           | 20,000,678円     |
| 純資産総額( - )     | 20,597,303,671円 |
| 発行済口数          | 9,329,169,553口  |
| 1口当たり純資産額( / ) | 2.2078円         |
| (1万口当たり純資産額)   | (22,078円)       |

## (参考) 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

(平成30年 6月29日現在)

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 11,139,249,713円 |
| 負債総額           | 197,537,038円    |
| 純資産総額( - )     | 10,941,712,675円 |
| 発行済口数          | 8,160,440,536口  |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.3408円         |
| (1万口当たり純資産額)   | (13,408円)       |

## (参考) グローバル高金利通貨マザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 5,607,002,917円 |
| 負債総額           | 44円            |
| 純資産総額( - )     | 5,607,002,873円 |
| 発行済口数          | 5,228,622,477口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.0724円        |
| (1万口当たり純資産額)   | (10,724円)      |

## (参考) 新光J-REITマザーファンド

(平成30年 6月29日現在)

|      |                |
|------|----------------|
| 資産総額 | 2,386,809,617円 |
|------|----------------|

|                |                |
|----------------|----------------|
| 負債総額           | 5,000,056円     |
| 純資産総額（ - ）     | 2,381,809,561円 |
| 発行済口数          | 1,391,514,665口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.7117円        |
| （1万口当たり純資産額）   | （17,117円）      |

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成30年 6月29日現在）

|                |              |
|----------------|--------------|
| 資産総額           | 824,592,218円 |
| 負債総額           | 3円           |
| 純資産総額（ - ）     | 824,592,215円 |
| 発行済口数          | 504,630,389口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.6341円      |
| （1万口当たり純資産額）   | （16,341円）    |

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （1）受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

##### （2）受益者等名簿

該当事項はありません。

##### （3）受益者に対する特典

該当事項はありません。

##### （4）受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### a．資本金の額（平成30年 6月29日現在）

|             |          |                                    |
|-------------|----------|------------------------------------|
| 資本金の額       | 20億円     |                                    |
| 会社が発行する株式総数 | 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カ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

###### b．会社の機構（平成30年 6月29日現在）

###### （イ）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。

###### （ロ）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。

平成30年6月29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 | 38    | 1,205,030,866,605  |
| 追加型株式投資信託  | 849   | 12,875,304,912,545 |
| 単位型公社債投資信託 | 50    | 194,834,324,314    |
| 単位型株式投資信託  | 144   | 907,114,136,767    |
| 合計         | 1,081 | 15,182,284,240,231 |

## 3【委託会社等の経理状況】

- 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。
- 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

（単位：千円）

|          | 第32期<br>（平成29年3月31日現在） | 第33期<br>（平成30年3月31日現在） |
|----------|------------------------|------------------------|
| （資産の部）   |                        |                        |
| 流動資産     |                        |                        |
| 現金・預金    | 27,972,477             | 49,071,217             |
| 金銭の信託    | 12,366,219             | 12,083,824             |
| 有価証券     | 297,560                | -                      |
| 未収委託者報酬  | 10,164,041             | 11,769,015             |
| 未収運用受託報酬 | 7,250,239              | 4,574,225              |
| 未収投資助言報酬 | 316,414                | 341,689                |

|             |       |            |   |            |
|-------------|-------|------------|---|------------|
| 未収収益        |       | 52,278     |   | 59,526     |
| 前払費用        |       | 533,411    |   | 569,431    |
| 繰延税金資産      |       | 678,104    |   | 842,996    |
| その他         |       | 445,717    |   | 427,238    |
|             | 流動資産計 | 60,076,462 |   | 79,739,165 |
| 固定資産        |       |            |   |            |
| 有形固定資産      |       | 1,900,343  |   | 1,643,826  |
| 建物          | 1     | 1,243,812  | 1 | 1,156,953  |
| 器具備品        | 1     | 656,235    | 1 | 476,504    |
| 建設仮勘定       |       | 295        |   | 10,368     |
| 無形固定資産      |       | 1,614,084  |   | 1,934,700  |
| 商標権         |       | 5          |   | -          |
| ソフトウェア      |       | 1,511,558  |   | 1,026,319  |
| ソフトウェア仮勘定   |       | 98,483     |   | 904,389    |
| 電話加入権       |       | 3,934      |   | 3,931      |
| 電信電話専用施設利用権 |       | 103        |   | 60         |
| 投資その他の資産    |       | 10,055,336 |   | 7,427,316  |
| 投資有価証券      |       | 3,265,786  |   | 1,721,433  |
| 関係会社株式      |       | 3,306,296  |   | 3,229,196  |
| 長期差入保証金     |       | 1,800,827  |   | 1,518,725  |
| 前払年金費用      |       | 686,322    |   | -          |
| 繰延税金資産      |       | 893,887    |   | 856,537    |
| その他         |       | 102,215    |   | 101,425    |
|             | 固定資産計 | 13,569,764 |   | 11,005,844 |
| 資産合計        |       | 73,646,227 |   | 90,745,010 |

(単位：千円)

|         | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|
| (負債の部)  |                        |                        |
| 流動負債    |                        |                        |
| 預り金     | 1,169,128              | 1,003,550              |
| 未払金     | 4,745,195              | 5,081,728              |
| 未払収益分配金 | 1,027                  | 1,031                  |
| 未払償還金   | 57,332                 | 57,275                 |
| 未払手数料   | 4,062,695              | 4,629,133              |
| その他未払金  | 624,140                | 394,288                |
| 未払費用    | 7,030,589              | 7,711,038              |
| 未払法人税等  | 1,915,556              | 5,153,972              |
| 未払消費税等  | 891,476                | 1,660,259              |
| 賞与引当金   | 1,432,264              | 1,393,911              |

|              |            |            |
|--------------|------------|------------|
| 役員賞与引当金      | 27,495     | 49,986     |
| 本社移転費用引当金    | -          | 156,587    |
| 流動負債計        | 17,211,706 | 22,211,034 |
| 固定負債         |            |            |
| 退職給付引当金      | 1,305,273  | 1,637,133  |
| 時効後支払損引当金    | 216,466    | 199,026    |
| 本社移転費用引当金    | 942,315    | -          |
| 固定負債計        | 2,464,055  | 1,836,160  |
| 負債合計         | 19,675,761 | 24,047,195 |
| (純資産の部)      |            |            |
| 株主資本         |            |            |
| 資本金          | 2,000,000  | 2,000,000  |
| 資本剰余金        | 19,552,957 | 19,552,957 |
| 資本準備金        | 2,428,478  | 2,428,478  |
| その他資本剰余金     | 17,124,479 | 17,124,479 |
| 利益剰余金        | 31,899,643 | 44,349,855 |
| 利益準備金        | 123,293    | 123,293    |
| その他利益剰余金     | 31,776,350 | 44,226,562 |
| 別途積立金        | 24,580,000 | 24,580,000 |
| 研究開発積立金      | 300,000    | 300,000    |
| 運用責任準備積立金    | 200,000    | 200,000    |
| 繰越利益剰余金      | 6,696,350  | 19,146,562 |
| 株主資本計        | 53,452,601 | 65,902,812 |
| 評価・換算差額等     |            |            |
| その他有価証券評価差額金 | 517,864    | 795,002    |
| 評価・換算差額等計    | 517,864    | 795,002    |
| 純資産合計        | 53,970,465 | 66,697,815 |
| 負債・純資産合計     | 73,646,227 | 90,745,010 |

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

|         | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>至 平成29年3月31日) |            | 第33期<br>(自 平成29年4月1日<br>至 平成30年3月31日) |             |
|---------|---------------------------------------|------------|---------------------------------------|-------------|
|         | 営業収益                                  |            |                                       |             |
| 委託者報酬   | 56,355,754                            |            | 84,705,447                            |             |
| 運用受託報酬  | 12,834,241                            |            | 19,124,427                            |             |
| 投資助言報酬  | 1,002,482                             |            | 1,217,672                             |             |
| その他営業収益 | 378,715                               |            | 117,586                               |             |
| 営業収益計   |                                       | 70,571,194 |                                       | 105,165,133 |
| 営業費用    |                                       |            |                                       |             |
| 支払手数料   | 24,957,038                            |            | 37,242,284                            |             |
| 広告宣伝費   | 838,356                               |            | 379,873                               |             |

|            |            |            |            |            |
|------------|------------|------------|------------|------------|
| 公告費        | 991        |            | 1,485      |            |
| 調査費        | 15,105,578 |            | 23,944,438 |            |
| 調査費        | 7,780,474  |            | 10,677,166 |            |
| 委託調査費      | 7,325,104  |            | 13,267,272 |            |
| 委託計算費      | 891,379    |            | 1,073,938  |            |
| 営業雑経費      | 1,102,921  |            | 1,215,963  |            |
| 通信費        | 51,523     |            | 48,704     |            |
| 印刷費        | 926,453    |            | 947,411    |            |
| 協会費        | 37,471     |            | 64,331     |            |
| 諸会費        | 74         |            | 22,412     |            |
| 支払販売手数料    | 87,399     |            | 133,104    |            |
| 営業費用計      |            | 42,896,265 |            | 63,857,984 |
| 一般管理費      |            |            |            |            |
| 給料         | 8,517,089  |            | 11,304,873 |            |
| 役員報酬       | 220,145    |            | 189,022    |            |
| 給料・手当      | 7,485,027  |            | 9,565,921  |            |
| 賞与         | 811,916    |            | 1,549,929  |            |
| 交際費        | 66,813     |            | 58,863     |            |
| 寄付金        | 13,467     |            | 5,150      |            |
| 旅費交通費      | 297,237    |            | 395,605    |            |
| 租税公課       | 430,779    |            | 625,498    |            |
| 不動産賃借料     | 1,961,686  |            | 1,534,255  |            |
| 退職給付費用     | 358,960    |            | 595,876    |            |
| 固定資産減価償却費  | 825,593    |            | 1,226,472  |            |
| 福利厚生費      | 39,792     |            | 49,797     |            |
| 修繕費        | 27,435     |            | 4,620      |            |
| 賞与引当金繰入額   | 1,432,264  |            | 1,393,911  |            |
| 役員賞与引当金繰入額 | 27,495     |            | 49,986     |            |
| 役員退職慰労金    | 63,072     |            | -          |            |
| 機器リース料     | 210        |            | 148        |            |
| 事務委託費      | 1,530,113  |            | 3,037,804  |            |
| 事務用消耗品費    | 127,265    |            | 144,804    |            |
| 器具備品費      | 271,658    |            | 5,253      |            |
| 諸経費        | 129,981    |            | 149,850    |            |
| 一般管理費計     |            | 16,120,918 |            | 20,582,772 |
| 営業利益       |            | 11,554,010 |            | 20,724,376 |

(単位：千円)

|              | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>至 平成29年3月31日) |        | 第33期<br>(自 平成29年4月1日<br>至 平成30年3月31日) |         |
|--------------|---------------------------------------|--------|---------------------------------------|---------|
| 営業外収益        |                                       |        |                                       |         |
| 受取利息         |                                       | 537    |                                       | 1,430   |
| 受取配当金        |                                       | 51,036 |                                       | 74,278  |
| 時効成立分配金・償還金  |                                       | 103    |                                       | 256     |
| 為替差益         |                                       | 7,025  |                                       | 8,530   |
| 投資信託解約益      |                                       | 2      |                                       | 236,398 |
| 投資信託償還益      |                                       | -      |                                       | 93,177  |
| 雑収入          | 1                                     | 18,213 | 1                                     | 10,306  |
| 時効後支払損引当金戻入額 |                                       | -      |                                       | 17,429  |
| 営業外収益計       |                                       | 76,918 |                                       | 441,807 |
| 営業外費用        |                                       |        |                                       |         |
| 投資信託解約損      |                                       | 31,945 |                                       | 4,138   |
| 投資信託償還損      |                                       | 47,201 |                                       | 17,065  |

|                |   |           |            |           |            |
|----------------|---|-----------|------------|-----------|------------|
| 金銭の信託運用損       |   | 552,635   |            | 99,303    |            |
| 時効成立後支払分配金・償還金 |   | 39        |            | -         |            |
| 時効後支払損引当金繰入額   |   | 209,210   |            | -         |            |
| 営業外費用計         |   |           | 841,031    |           | 120,507    |
| 経常利益           |   |           | 10,789,897 |           | 21,045,676 |
| 特別利益           |   |           |            |           |            |
| 固定資産売却益        | 2 | 2,348     |            | 1         |            |
| 投資有価証券売却益      |   | -         |            | 479,323   |            |
| 関係会社株式売却益      | 1 | -         |            | 1,492,680 |            |
| 貸倒引当金戻入益       |   | 8,883     |            | -         |            |
| 訴訟損失引当金戻入益     |   | 21,677    |            | -         |            |
| 本社移転費用引当金戻入額   |   | -         |            | 138,294   |            |
| その他特別利益        |   | 746       |            | 350       |            |
| 特別利益計          |   |           | 33,655     |           | 2,110,649  |
| 特別損失           |   |           |            |           |            |
| 固定資産除却損        | 3 | 23,600    |            | 36,992    |            |
| 固定資産売却損        | 4 | 10,323    |            | 134       |            |
| 投資有価証券評価損      |   | 12,085    |            | -         |            |
| ゴルフ会員権評価損      |   | 4,832     |            | -         |            |
| 訴訟和解金          |   | 30,000    |            | -         |            |
| 本社移転費用         | 5 | 1,511,622 |            | -         |            |
| 退職給付制度終了損      |   | -         |            | 690,899   |            |
| システム移行損失       |   | -         |            | 76,007    |            |
| その他特別損失        |   | -         |            | 50        |            |
| 特別損失計          |   |           | 1,592,463  |           | 804,083    |
| 税引前当期純利益       |   |           | 9,231,089  |           | 22,352,243 |
| 法人税、住民税及び事業税   |   |           | 2,965,061  |           | 6,951,863  |
| 法人税等調整額        |   |           | 177,275    |           | 249,832    |
| 法人税等合計         |   |           | 2,787,786  |           | 6,702,031  |
| 当期純利益          |   |           | 6,443,302  |           | 15,650,211 |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

|                             | 株主資本      |           |              |             |           |            |             |                   |             |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|------------|-------------|-------------------|-------------|
|                             | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益剰余金     |            |             |                   |             |
|                             |           | 資本準備金     | その他<br>資本剰余金 | 資本剰余金<br>合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金   |             |                   |             |
|                             |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金  | 研究開発<br>積立金 | 運用責<br>任準備<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |
| 当期首残高                       | 2,000,000 | 2,428,478 | -            | 2,428,478   | 123,293   | 22,030,000 | 300,000     | 200,000           | 5,347,047   |
| 当期変動額                       |           |           |              |             |           |            |             |                   |             |
| 剰余金の配当                      |           |           |              |             |           |            |             |                   | 2,544,000   |
| 別途積立金の<br>積立                |           |           |              |             |           | 2,550,000  |             |                   | 2,550,000   |
| 当期純利益                       |           |           |              |             |           |            |             |                   | 6,443,302   |
| 合併による<br>増加                 |           |           | 17,124,479   | 17,124,479  |           |            |             |                   |             |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動<br>額(純額) |           |           |              |             |           |            |             |                   |             |

|         |           |           |            |            |         |            |         |         |           |
|---------|-----------|-----------|------------|------------|---------|------------|---------|---------|-----------|
| 当期変動額合計 | -         | -         | 17,124,479 | 17,124,479 | -       | 2,550,000  | -       | -       | 1,349,302 |
| 当期末残高   | 2,000,000 | 2,428,478 | 17,124,479 | 19,552,957 | 123,293 | 24,580,000 | 300,000 | 200,000 | 6,696,350 |

|                             | 株主資本                 |            | 評価・換算差額等             |                | 純資産<br>合計  |
|-----------------------------|----------------------|------------|----------------------|----------------|------------|
|                             | 利益剰余金<br>利益剰余金<br>合計 | 株主資本<br>合計 | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高                       | 28,000,340           | 32,428,818 | 153,956              | 153,956        | 32,582,775 |
| 当期変動額                       |                      |            |                      |                |            |
| 剰余金の配当                      | 2,544,000            | 2,544,000  |                      |                | 2,544,000  |
| 別途積立金の<br>積立                | -                    | -          |                      |                | -          |
| 当期純利益                       | 6,443,302            | 6,443,302  |                      |                | 6,443,302  |
| 合併による<br>増加                 |                      | 17,124,479 |                      |                | 17,124,479 |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動<br>額(純額) |                      | -          | 363,907              | 363,907        | 363,907    |
| 当期変動額合計                     | 3,899,302            | 21,023,782 | 363,907              | 363,907        | 21,387,689 |
| 当期末残高                       | 31,899,643           | 53,452,601 | 517,864              | 517,864        | 53,970,465 |

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

|                             | 株主資本      |           |              |             |           |            |             |                   |             |  |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|------------|-------------|-------------------|-------------|--|
|                             | 資本金       | 資本剰余金     |              |             |           | 利益<br>準備金  | 利益剰余金       |                   |             |  |
|                             |           | 資本準備金     | その他<br>資本剰余金 | 資本剰余金<br>合計 | 別途<br>積立金 |            | 研究開発<br>積立金 | 運用責<br>任準備<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |  |
| 当期首残高                       | 2,000,000 | 2,428,478 | 17,124,479   | 19,552,957  | 123,293   | 24,580,000 | 300,000     | 200,000           | 6,696,350   |  |
| 当期変動額                       |           |           |              |             |           |            |             |                   |             |  |
| 剰余金の配当                      |           |           |              |             |           |            |             |                   | 3,200,000   |  |
| 当期純利益                       |           |           |              |             |           |            |             |                   | 15,650,211  |  |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動<br>額(純額) |           |           |              |             |           |            |             |                   |             |  |
| 当期変動額合計                     | -         | -         | -            | -           | -         | -          | -           | -                 | 12,450,211  |  |
| 当期末残高                       | 2,000,000 | 2,428,478 | 17,124,479   | 19,552,957  | 123,293   | 24,580,000 | 300,000     | 200,000           | 19,146,562  |  |

|       | 株主資本                 |            | 評価・換算差額等             |                | 純資産<br>合計  |
|-------|----------------------|------------|----------------------|----------------|------------|
|       | 利益剰余金<br>利益剰余金<br>合計 | 株主資本<br>合計 | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高 | 31,899,643           | 53,452,601 | 517,864              | 517,864        | 53,970,465 |
| 当期変動額 |                      |            |                      |                |            |

|                             |            |            |         |         |            |
|-----------------------------|------------|------------|---------|---------|------------|
| 剰余金の配当                      | 3,200,000  | 3,200,000  |         |         | 3,200,000  |
| 当期純利益                       | 15,650,211 | 15,650,211 |         |         | 15,650,211 |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動<br>額(純額) |            | -          | 277,137 | 277,137 | 277,137    |
| 当期変動額合計                     | 12,450,211 | 12,450,211 | 277,137 | 277,137 | 12,727,349 |
| 当期末残高                       | 44,349,855 | 65,902,812 | 795,002 | 795,002 | 66,697,815 |

### 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<br/>：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券<br/>時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法<br/>（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）<br/>時価のないもの：移動平均法による原価法</p>                         |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法      | 時価法   |
| 3. 固定資産の減価償却の方法          | <p>(1) 有形固定資産<br/>定率法を採用しております。<br/>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。</p> <p>(2) 無形固定資産<br/>定額法を採用しております。<br/>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p> |
| 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。   |



|              |  |
|--------------|--|
| 5. 引当金の計上基準  | <p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法<br/>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br/>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年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の際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>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p> |
| 6. 消費税等の会計処理 | 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。   |

## 会計上の見積りの変更

|   |
|---|
| 第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）  |
| <p>当社は、当事業年度においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法と比べて、当事業年度末の減価償却費が413,260千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ同額減少しております。</p> |

## 追加情報

|   |
|---|
| 第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）  |
| <p>当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準適用指針第1号 平成28年12月16日）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第2号 平成19年2月7日）を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。</p> <p>本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。</p> |

## 注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

|      | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|------|------------------------|------------------------|
| 建物   | 53,098                 | 140,580                |
| 器具備品 | 734,064                | 847,466                |

## (損益計算書関係)

## 1. 関係会社に対する事項

(千円)

|           | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|-----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 雑収入       | 8,183                               | -                                   |
| 関係会社株式売却益 | -                                   | 1,492,680                           |

## 2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

|       | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|-------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 建物    | 546                                 | -                                   |
| 車両運搬具 | 696                                 | -                                   |
| 器具備品  | 1,104                               | 1                                   |

## 3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

|        | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|--------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 建物     | -                                   | 298                                 |
| 器具備品   | 4,727                               | 8,217                               |
| ソフトウェア | 2,821                               | 28,472                              |
| 電話加入権  | 16,052                              | 3                                   |

## 4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

|      | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 建物   | 543                                 | -                                   |
| 器具備品 | 9,779                               | 134                                 |

## 5. 本社移転費用の内訳

(千円)

|              | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 本社移転費用引当金繰入額 | 942,315                             | -                                   |
| 旧本社不動産賃借料    | 418,583                             | -                                   |
| 賃貸借契約解約損     | 150,723                             | -                                   |

## (株主資本等変動計算書関係)

## 第32期（自平成28年4月1日 至平成29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<br>株式数（株） | 当事業年度<br>増加株式数（株） | 当事業年度<br>減少株式数（株） | 当事業年度末<br>株式数（株） |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式     | 24,000            | 490               | -                 | 24,490           |
| A種種類株式   | -                 | 15,510            | -                 | 15,510           |
| 合計       | 24,000            | 16,000            | -                 | 40,000           |

（注）普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加でありま  
す。

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

| 決議                   | 株式の<br>種類 | 配当金の総額<br>（千円） | 1株当たり配当<br>額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-----------|----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成28年6月29日<br>定時株主総会 | 普通株式      | 2,544,000      | 106,000         | 平成28年3月31日 | 平成28年6月30日 |

## (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<br>種類              | 配当の<br>原資 | 配当金の総<br>額（千円） | 1株当たり配<br>当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|------------------------|-----------|----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成29年6月21日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式<br>A種種類<br>株式 | 利益<br>剰余金 | 3,200,000      | 80,000          | 平成29年3月31日 | 平成29年6月22日 |

## 第33期（自平成29年4月1日 至平成30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<br>株式数（株） | 当事業年度<br>増加株式数（株） | 当事業年度<br>減少株式数（株） | 当事業年度末<br>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<br>種類          | 配当金の総額<br>（千円） | 1株当たり配当<br>額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|--------------------|----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成29年6月21日<br>定時株主総会 | 普通株式<br>A種種類<br>株式 | 3,200,000      | 80,000          | 平成29年3月31日 | 平成29年6月22日 |

## (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

平成30年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

| 決議                   | 株式の種類          | 配当の原資     | 配当金の総額（千円） | 1株当たり配当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|----------------|-----------|------------|-------------|------------|------------|
| 平成30年6月20日<br>定時株主総会 | 普通株式<br>A種種類株式 | 利益<br>剰余金 | 12,520,000 | 313,000     | 平成30年3月31日 | 平成30年6月21日 |

## （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（為替予約取引及び株価指数先物取引）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。

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

## （3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## （4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

|  | 貸借対照表計上額<br>（千円） | 時価<br>（千円） | 差額<br>（千円） |
|--|------------------|------------|------------|
|  |                  |            |            |

|                            |            |            |   |
|----------------------------|------------|------------|---|
| (1) 現金・預金                  | 27,972,477 | 27,972,477 | - |
| (2) 金銭の信託                  | 12,366,219 | 12,366,219 | - |
| (3) 未収委託者報酬                | 10,164,041 | 10,164,041 | - |
| (4) 未収運用受託報酬               | 7,250,239  | 7,250,239  | - |
| (5) 有価証券及び投資有価証券<br>其他有価証券 | 3,225,878  | 3,225,878  | - |
| 資産計                        | 60,978,855 | 60,978,855 | - |
| (1) 未払手数料                  | 4,062,695  | 4,062,695  | - |
| 負債計                        | 4,062,695  | 4,062,695  | - |

## 第33期（平成30年3月31日現在）

|                            | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|----------------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金                  | 49,071,217       | 49,071,217 | -          |
| (2) 金銭の信託                  | 12,083,824       | 12,083,824 | -          |
| (3) 未収委託者報酬                | 11,769,015       | 11,769,015 | -          |
| (4) 未収運用受託報酬               | 4,574,225        | 4,574,225  | -          |
| (5) 有価証券及び投資有価証券<br>其他有価証券 | 1,448,968        | 1,448,968  | -          |
| 資産計                        | 78,947,251       | 78,947,251 | -          |
| (1) 未払手数料                  | 4,629,133        | 4,629,133  | -          |
| 負債計                        | 4,629,133        | 4,629,133  | -          |

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

| 区分     | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式  | 337,468                | 272,464                |
| 関係会社株式 | 3,306,296              | 3,229,196              |

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

|                                   | 1年以内<br>(千円) | 1年超5年以内<br>(千円) | 5年超10年以内<br>(千円) | 10年超<br>(千円) |
|-----------------------------------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| (1) 現金・預金                         | 27,972,477   | -               | -                | -            |
| (2) 金銭の信託                         | 12,366,219   | -               | -                | -            |
| (3) 未収委託者報酬                       | 10,164,041   | -               | -                | -            |
| (4) 未収運用受託報酬                      | 7,250,239    | -               | -                | -            |
| (5) 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券(投資信託) | 297,560      | 320,736         | 888,110          | 12,660       |

第33期(平成30年3月31日現在)

|                                   | 1年以内<br>(千円) | 1年超5年以内<br>(千円) | 5年超10年以内<br>(千円) | 10年超<br>(千円) |
|-----------------------------------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| (1) 現金・預金                         | 49,071,217   | -               | -                | -            |
| (2) 金銭の信託                         | 12,083,824   | -               | -                | -            |
| (3) 未収委託者報酬                       | 11,769,015   | -               | -                | -            |
| (4) 未収運用受託報酬                      | 4,574,225    | -               | -                | -            |
| (5) 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券(投資信託) | -            | 3,995           | -                | -            |

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円、第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

| 区分                       | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額 | 取得原価      | 差額      |
|--------------------------|------------------------|-----------|---------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  |                        |           |         |
| 株式                       | 609,710                | 146,101   | 463,608 |
| 投資信託                     | 2,384,278              | 2,091,387 | 292,891 |
| 小計                       | 2,993,988              | 2,237,489 | 756,499 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの |                        |           |         |
| 株式                       | -                      | -         | -       |
| 投資信託                     | 231,889                | 241,951   | 10,061  |
| 小計                       | 231,889                | 241,951   | 10,061  |
| 合計                       | 3,225,878              | 2,479,440 | 746,438 |

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)については、市場価格がなく、時価を把握すること

が極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

| 区分                       | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額 | 取得原価    | 差額        |
|--------------------------|------------------------|---------|-----------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  |                        |         |           |
| 株式                       | 1,267,157              | 146,101 | 1,121,055 |
| 投資信託                     | 177,815                | 153,000 | 24,815    |
| 小計                       | 1,444,972              | 299,101 | 1,145,870 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの |                        |         |           |
| 株式                       | -                      | -       | -         |
| 投資信託                     | 3,995                  | 4,000   | 4         |
| 小計                       | 3,995                  | 4,000   | 4         |
| 合計                       | 1,448,968              | 303,101 | 1,145,866 |

(注)非上場株式(貸借対照表計上額272,464千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

| 区分   | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|------|-------------|-----------------|-----------------|
| 投資信託 | 717,905     | 2               | 79,146          |

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

| 区分   | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|------|-------------|-----------------|-----------------|
| 株式   | 544,326     | 479,323         | -               |
| 投資信託 | 2,480,288   | 329,576         | 21,204          |

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

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

第33期において、該当事項はありません。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について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。

なお、当社は平成29年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、

退職一時金制度を改定しました。

## 2. 確定給付制度

### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

|                  | 第32期                        | 第33期                        |
|------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                  | (自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | (自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
| 退職給付債務の期首残高      | 1,086,550                   | 2,718,372                   |
| 勤務費用             | 189,127                     | 269,128                     |
| 利息費用             | 10,905                      | 7,523                       |
| 数理計算上の差異の発生額     | 89,303                      | 61,792                      |
| 退職給付の支払額         | 144,062                     | 111,758                     |
| 合併による増加          | 1,486,547                   | -                           |
| 確定拠出制度への移行に伴う減少額 | -                           | 1,316,796                   |
| 退職一時金制度改定に伴う増加額  | -                           | 526,345                     |
| 退職給付債務の期末残高      | 2,718,372                   | 2,154,607                   |

### (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

|                  | 第32期                        | 第33期                        |
|------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                  | (自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | (自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
| 年金資産の期首残高        | -                           | 1,363,437                   |
| 期待運用収益           | 16,033                      | 17,042                      |
| 数理計算上の差異の発生額     | 1,894                       | -                           |
| 事業主からの拠出額        | 37,402                      | 36,672                      |
| 退職給付の支払額         | 28,876                      | -                           |
| 合併による増加          | 1,336,984                   | -                           |
| 確定拠出制度への移行に伴う減少額 | -                           | 1,417,152                   |
| 年金資産の期末残高        | 1,363,437                   | -                           |

### (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

|                     | 第32期           | 第33期           |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | (平成29年3月31日現在) | (平成30年3月31日現在) |
| 積立型制度の退職給付債務        | 1,275,346      | -              |
| 年金資産                | 1,363,437      | -              |
|                     | 88,090         | -              |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 1,443,026      | 2,154,607      |
| 未積立退職給付債務           | 1,354,935      | 2,154,607      |
| 未認識数理計算上の差異         | 430,203        | 204,636        |
| 未認識過去勤務費用           | 4,852          | 312,836        |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 919,879        | 1,637,133      |
| 退職給付引当金             | 1,245,019      | 1,637,133      |
| 前払年金費用              | 325,140        | -              |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 919,879        | 1,637,133      |

### (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)



|                   | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 勤務費用              | 189,127                             | 269,128                             |
| 利息費用              | 10,905                              | 7,523                               |
| 期待運用収益            | 16,033                              | 17,042                              |
| 数理計算上の差異の費用処理額    | 78,229                              | 88,417                              |
| 過去勤務費用の費用処理額      | 4,852                               | 39,611                              |
| 退職一時金制度改定に伴う費用処理額 | -                                   | 70,560                              |
| その他               | 7,498                               | 1,620                               |
| 確定給付制度に係る退職給付費用   | 274,580                             | 456,577                             |
| 制度移行に伴う損失(注)      | -                                   | 690,899                             |

(注) 特別損失に計上しております。

### (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|          | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|----------|------------------------|------------------------|
| 株式       | 31.5%                  | -                      |
| 債券       | 29.0%                  | -                      |
| 共同運用資産   | 24.1%                  | -                      |
| 生命保険一般勘定 | 10.5%                  | -                      |
| 現金及び預金   | 4.6%                   | -                      |
| 合計       | 100.0%                 | -                      |

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

### (6) 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32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 割引率       | 0.02% ~ 1.09%          | 0.09%                  |
| 長期期待運用収益率 | 2.50%                  | -                      |
| 予想昇給率     | 1.00% ~ 8.73%          | 1.00% ~ 4.42%          |

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

### (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

|                  | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>至平成29年3月31日) | 第33期<br>(自平成29年4月1日<br>至平成30年3月31日) |
|------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 退職給付引当金の期首残高     | -                                   | 300,927                             |
| 退職給付費用           | 22,562                              | 53,156                              |
| 退職給付の支払額         | -                                   | -                                   |
| 制度への拠出額          | 36,177                              | 35,640                              |
| 合併による増加          | 287,313                             | -                                   |
| 確定拠出制度への移行に伴う減少額 | -                                   | 391,600                             |
| 退職一時金制度改定に伴う振替額  | -                                   | 108,189                             |
| 退職給付引当金の期末残高     | 300,927                             | -                                   |

## (2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

|                     | (千円)                   |                        |
|---------------------|------------------------|------------------------|
|                     | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
| 積立型制度の退職給付債務        | 789,261                | -                      |
| 年金資産                | 1,150,443              | -                      |
|                     | 361,181                | -                      |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 60,254                 | -                      |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 300,927                | -                      |
| 退職給付引当金             | 60,254                 | -                      |
| 前払年金費用              | 361,181                | -                      |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 300,927                | -                      |

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 22,562千円 当事業年度53,156千円

## 4. 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61,817千円、当事業年度86,141千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

|                 | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) | 第33期<br>(平成30年3月31日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
|                 | (千円)                   | (千円)                   |
| 繰延税金資産          |                        |                        |
| 未払事業税           | 124,081                | 290,493                |
| 未払事業所税          | 11,054                 | 11,683                 |
| 賞与引当金           | 441,996                | 426,815                |
| 未払法定福利費         | 84,152                 | 81,186                 |
| 資産除去債務          | 86,421                 | 90,524                 |
| 減価償却超過額(一括償却資産) | 10,666                 | 11,331                 |
| 減価償却超過額         | 116,920                | 176,791                |
| 繰延資産償却超過額(税法上)  | 32,949                 | 34,977                 |
| 退職給付引当金         | 399,808                | 501,290                |
| 時効後支払損引当金       | 66,282                 | 60,941                 |
| ゴルフ会員権評価損       | 14,295                 | 13,173                 |
| 関係会社株式評価損       | 166,740                | 166,740                |
| 投資有価証券評価損       | 69,683                 | 28,976                 |
| 未払給与            | 12,344                 | 9,186                  |
| 本社移転費用引当金       | 289,865                | 47,947                 |
| その他             | 14,309                 | 29,193                 |
| 繰延税金資産小計        | 1,941,573              | 1,981,254              |
| 評価性引当額          | -                      | -                      |
| 繰延税金資産合計        | 1,941,573              | 1,981,254              |

|              |           |           |
|--------------|-----------|-----------|
| 繰延税金負債       |           |           |
| 前払年金費用       | 210,151   | -         |
| その他有価証券評価差額金 | 159,429   | 281,720   |
| 繰延税金負債合計     | 369,581   | 281,720   |
| 繰延税金資産の純額    | 1,571,992 | 1,699,533 |

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

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

### （企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、平成28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、平成28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

平成28年10月1日

### 3. 企業結合の方法

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

### 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

### 5. 企業結合の主な目的

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

### 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

### 7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しない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」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

|                   |   |
|-------------------|---|
| a. 発生したのれん        | 76,224,837千円                              |
| b. 発生原因           | 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。 |
| c. のれんの償却方法及び償却期間 | 20年間の均等償却                                 |

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

|         |               |              |
|---------|---------------|--------------|
| a. 資産の額 | 資産合計          | 40,451,657千円 |
|         | うち現金・預金       | 11,605,537千円 |
|         | うち金銭の信託       | 11,792,364千円 |
| b. 負債の額 | 負債合計          | 9,256,209千円  |
|         | うち未払手数料及び未払費用 | 4,539,592千円  |

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

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

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| a. 無形固定資産に配分された金額      | 53,030,000千円 |
| b. 主要な種類別の内訳           |              |
| 顧客関連資産                 | 53,030,000千円 |
| c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間 |              |
| 顧客関連資産                 | 16.9年        |

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

|      |               |
|------|---------------|
| 流動資産 | - 千円          |
| 固定資産 | 114,270,495千円 |
| 資産合計 | 114,270,495千円 |

|      |               |
|------|---------------|
| 流動負債 | - 千円          |
| 固定負債 | 13,059,836千円  |
| 負債合計 | 13,059,836千円  |
| 純資産  | 101,210,659千円 |

（注）固定資産及び資産合計には、のれんの金額70,507,975千円及び顧客関連資産の金額45,200,838千円が含まれております。

（2）損益計算書項目

|            |             |
|------------|-------------|
| 営業収益       | - 千円        |
| 営業利益       | 9,012,128千円 |
| 経常利益       | 9,012,128千円 |
| 税引前当期純利益   | 9,012,128千円 |
| 当期純利益      | 7,419,617千円 |
| 1株当たり当期純利益 | 185,490円43銭 |

（注）営業利益には、のれんの償却額3,811,241千円及び顧客関連資産の償却額5,233,360千円が含まれております。

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

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32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

該当はありません。

第33期（自平成29年4月1日 至平成30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32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

該当はありません。

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

| 属性                              | 会社等の名称                       | 住所              | 資本金<br>又は<br>出資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容       |                     | 取引の内容                              | 取引金額<br>(千円)         | 科目               | 期末残高<br>(千円) |
|---------------------------------|------------------------------|-----------------|------------------|-------------------|--------------------------------|------------|---------------------|------------------------------------|----------------------|------------------|--------------|
|                                 |                              |                 |                  |                   |                                | 役員の<br>兼任等 | 事業上<br>の関係          |                                    |                      |                  |              |
| 親<br>会<br>社<br>の<br>子<br>会<br>社 | 株式会社<br>みずほ銀<br>行            | 東京都<br>千代田<br>区 | 14,040<br>億円     | 銀行業               | -                              | -          | 当社設定<br>投資信託<br>の販売 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料               | 4,530,351            | 未払<br>手数料        | 767,732      |
|                                 | 資産管理<br>サービス<br>信託銀行<br>株式会社 | 東京都<br>中央区      | 500<br>億円        | 資産管<br>理等         | -                              | -          | 当社信託<br>財産の運<br>用   | 信託元本の<br>払戻（純<br>額）<br>信託報酬の<br>支払 | 100,000<br><br>7,080 | 金銭の<br>信託        | 12,366,219   |
|                                 | みずほ証<br>券株式会<br>社            | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,251<br>億円      | 証券業               | -                              | -          | 当社設定<br>投資信託<br>の販売 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料               | 5,061,766            | 未払<br>手数料        | 1,166,212    |
|                                 | みずほ信<br>託銀行株<br>式会社          | 東京都<br>中央区      | 2,473<br>億円      | 信託銀<br>行業         | -                              | -          | 投資一任<br>契約の締<br>結   | 運用受託報<br>酬の受取                      | 2,520,431            | 未収運<br>用受託<br>報酬 | 2,722,066    |

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

| 属性                              | 会社等の名称            | 住所              | 資本金<br>又は<br>出資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容       |                     | 取引の内容                | 取引金額<br>(千円) | 科目        | 期末残高<br>(千円) |
|---------------------------------|-------------------|-----------------|------------------|-------------------|--------------------------------|------------|---------------------|----------------------|--------------|-----------|--------------|
|                                 |                   |                 |                  |                   |                                | 役員の<br>兼任等 | 事業上<br>の関係          |                      |              |           |              |
| 親<br>会<br>社<br>の<br>子<br>会<br>社 | 株式会社<br>みずほ銀<br>行 | 東京都<br>千代田<br>区 | 14,040<br>億円     | 銀行業               | -                              | -          | 当社設定<br>投資信託<br>の販売 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料 | 6,470,802    | 未払<br>手数料 | 894,336      |
|                                 | みずほ証<br>券株式会<br>社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,251<br>億円      | 証券業               | -                              | -          | 当社設定<br>投資信託<br>の販売 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料 | 9,079,083    | 未払<br>手数料 | 1,549,208    |

## 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) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(注3) 運用受託報酬は、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4) 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32期<br>(自 平成28年4月 1日<br>至 平成29年3月31日) | 第33期<br>(自 平成29年4月 1日<br>至 平成30年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 1株当たり純資産額    | 1,349,261円64銭                          | 1,667,445円37銭                          |
| 1株当たり当期純利益金額 | 201,491円22銭                            | 391,255円29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32期<br>(自 平成28年4月 1日<br>至 平成29年3月31日) | 第33期<br>(自 平成29年4月 1日<br>至 平成30年3月31日) |
|----------------------------|--|--|
| 当期純利益金額                    | 6,443,302千円                            | 15,650,211千円                           |
| 普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額   | -                                      | -                                      |
| 普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額 | 6,443,302千円                            | 15,650,211千円                           |
| 普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数   | 31,978株                                | 40,000株                                |
| (うち普通株式)                   | (24,244株)                              | (24,490株)                              |
| (うちA種種類株式)                 | (7,734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。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品

取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

- （４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- （５）上記（３）（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

- a．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  
平成30年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。
- b．訴訟事件その他の重要事項  
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a．資本金の額

平成30年3月末日現在、342,037百万円

b．事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

販売会社の名称、資本金の額及び事業の内容は以下の「販売会社一覧表」のとおりです。

販売会社一覧表

（資本金の額は平成30年3月末日現在）

| 名称          | 資本金の額<br>(単位：百万円) | 事業の内容                         |
|-------------|-------------------|-------------------------------|
| 大山日ノ丸証券株式会社 | 215               | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| みずほ証券株式会社   | 125,167           | 同上                            |

### 2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

- （１）委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理
- （２）投資信託財産の計算
- （３）その他上記業務に付随する一切の業務

「販売会社」は以下の業務を行います。



- (1) 募集・販売の取り扱い
- (2) 受益者に対する一部解約事務
- (3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い
- (4) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付
- (6) 受益者に対する運用報告書の交付
- (7) 所得税および地方税の源泉徴収
- (8) その他上記業務に付随する一切の業務

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

( 持株比率 5 %以上を記載します。 )

#### <再信託受託会社の概要>

- 名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- 業務の概要 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- 再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託事務の一部（投資信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

### 第3【その他】

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

- (2) 目論見書は別称として「投資信託説明書」と称して使用場合があります。
- (3) 目論見書は電子媒体などとして使用される他、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (4) 本書の記載内容について、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に記載された運用実績のデータは、随時更新される場合があります。
- (6) 請求目論見書にファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

|                    |       |      |   |
|--------------------|-------|------|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 湯原 尚 | 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 山野 浩 | 印 |

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株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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。

#### 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。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

#### 監査意見

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株式会社の平成30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すべ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。

#### 利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年2月9日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

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」に掲げられているグローバル・ナビの平成28年12月16日から平成29年12月15日までの計算期間の財務諸表、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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

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、グローバル・ナビの平成29年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

## 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

- ( ) 1 . 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成30年8月10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

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

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」に掲げられているグローバル・ナビの平成29年12月16日から平成30年6月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 中間監査意見

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、グローバル・ナビの平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年12月16日から平成30年6月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 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

- ( ) 1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。  
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。