

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成24年7月19日提出

【発行者名】 新光投信株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 桜嶋 文雄

【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋一丁目17番10号

【事務連絡者氏名】 大澤 団
連絡場所：東京都中央区日本橋一丁目17番10号

【電話番号】 03 - 3277 - 1818

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係る新光7資産バランスファンド
ファンドの名称】

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 3兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出しましたので、平成24年1月20日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項のうち、「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」および「第三部 委託会社等の情報」に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するとともに、併せて原届出書添付書類の訂正を行うものです。

【訂正の内容】

- (1) 原届出書の下記事項のうち以下に記載した箇所を、＜訂正前＞の内容から＜訂正後＞の内容に訂正します。
_____部分は、訂正部分を示します。
- (2) 原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」について、該当箇所を更新します。
- (3) 原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」にかかる記載を更新します。
- (4) 原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」の内容を更新します。

第一部 【証券情報】

（9）【払込期日】

< 訂正前 >

当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經由して、住友信託銀行株式会社（以下「受託者」といいます。）の指定する当ファンドの口座に払い込まれます。

ただし、関係当局の認可などを前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

< 訂正後 >

当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經由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託者」といいます。）の指定する当ファンドの口座に払い込まれます。

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】

b. ファンドの特色

< 訂正前 >

(略)

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

(略)

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

(略)

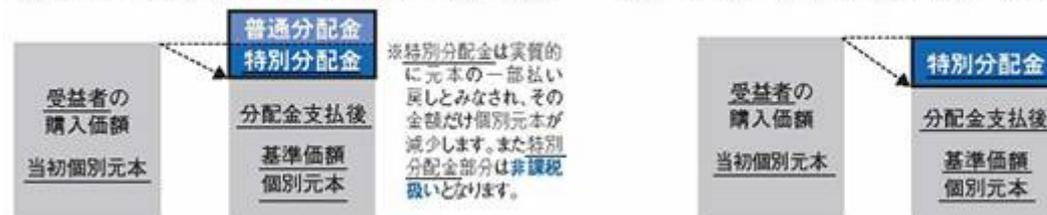
収益分配金に関する留意事項

(略)

受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。

分配金の一部が元本の一部払い戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払い戻しに相当する場合



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

特別分配金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の受益者の個別元本は、特別分配金の額だけ減少します。

< 訂正後 >

(略)

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

(略)

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

(略)

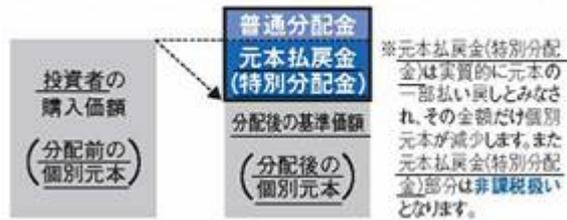
収益分配金に関する留意事項

(略)

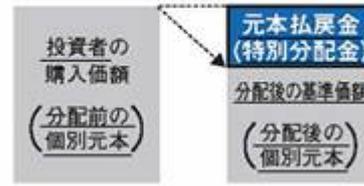
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の

値上がりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払い戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払い戻しに相当する場合



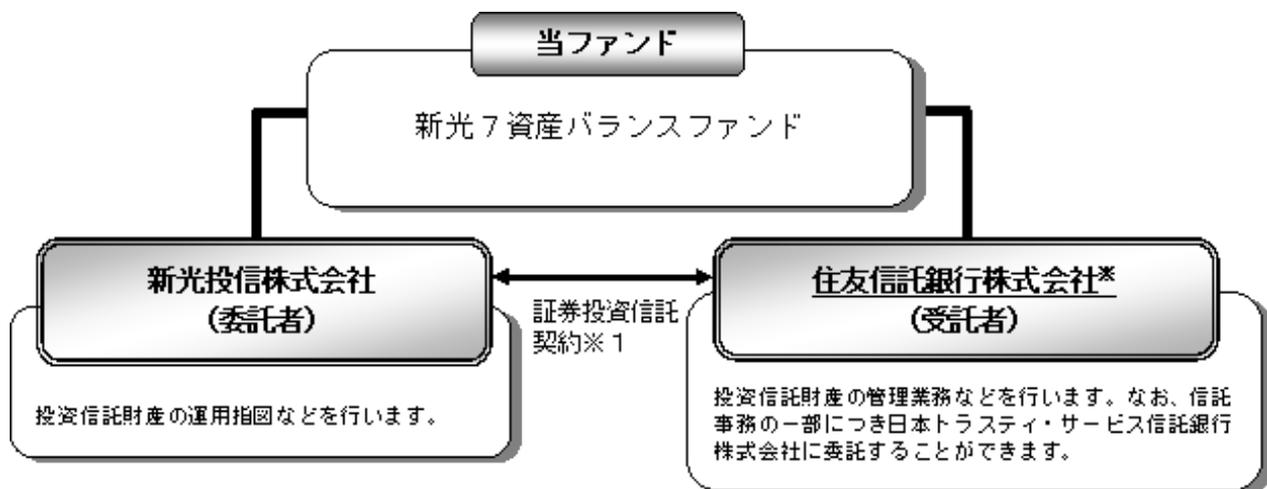
普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

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

(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み

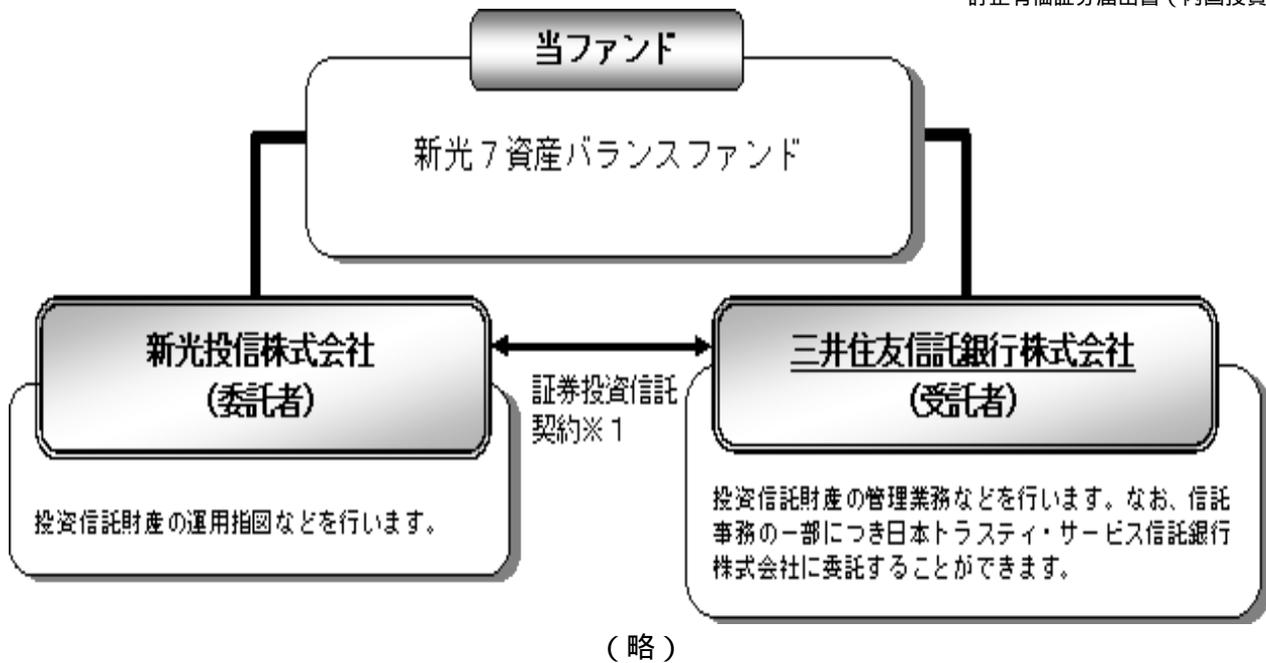
<訂正前>



※ただし、関係当局の認可などを前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

(略)

<訂正後>



b. 委託会社の概況

< 訂正前 >

(イ) 資本金の額（平成23年11月末現在）

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成23年11月末現在)

株主名	住所	持株数	持株比率
(略)			

< 訂正後 >

(イ) 資本金の額（平成24年5月末現在）

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成24年5月末現在)

株主名	住所	持株数	持株比率
(略)			

2【投資方針】

(2)【投資対象】

< 訂正前 >

b. 運用の指図範囲

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

ただし、関係当局の認可などを前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社

および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

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

(略)

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

1. ニュー トピックス インデックス マザーファンドの概要

(略)	
形態	国内籍親投資信託
(略)	
受託会社	住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

東証株価指数について

(略)

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

(略)

2. 新光日本債券インデックスマザーファンドの概要

(略)	
形態	国内籍親投資信託
(略)	
受託会社	住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

(略)

3. 新光J-REITマザーファンドの概要

(略)	
形態	国内籍親投資信託
(略)	
受託会社	住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

東証REIT指数(配当込み)について

(略)

新光J-REITマザーファンドは、東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、新光J-REITマザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

(略)

4. 新光外国株式インデックスマザーファンドの概要

(略)	
形態	国内籍親投資信託
(略)	
受託会社	住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

(略)

5. 海外国債マザーファンドの概要

(略)	
形態	国内籍親投資信託

(略)	
受託会社	住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

(略)

6. フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの概要

(略)

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

フランクリン テンプレトン インベストメント マネジメント リミテッド (FTIML社) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンプレトン インベストメンツ (設立：1947年、運用総資産：約52.5兆円) の一員です。FTIML社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2011年11月末現在、1米ドル = 77.63円で換算。

7. 新光米国REITマザーファンドの概要

(略)	
形態	国内籍親投資信託
(略)	
受託会社	住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

(略)

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成24年1月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

<訂正後>

b. 運用の指図範囲

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

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

(略)

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

1. ニュー トピックス インデックス マザーファンドの概要

(略)	
形態	親投資信託
(略)	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

東証株価指数について

(略)

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

(略)

2. 新光日本債券インデックスマザーファンドの概要

(略)	
形態	親投資信託
(略)	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)
(略)	

3. 新光J-REITマザーファンドの概要

(略)	
形態	親投資信託
(略)	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

東証REIT指数（配当込み）について

(略)

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

(略)

4. 新光外国株式インデックスマザーファンドの概要

(略)	
形態	親投資信託
(略)	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)
(略)	

5. 海外国債マザーファンドの概要

(略)	
形態	親投資信託
(略)	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)
(略)	

6. フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの概要

(略)

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

フランクリン テンブルトン インベストメント マネジメント リミテッド (FTIML社) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンブルトン インベストメンツ (設立：1947年、運用総資産：約53.6兆円) の一員です。FTIML社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2012年5月末現在、1米ドル = 78.415円で換算。

7. 新光米国REITマザーファンドの概要

(略)	
形態	親投資信託
(略)	

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)
------	--

(略)

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成24年7月19日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(3) 【運用体制】

a . 当ファンドの運用体制

< 訂正前 >

(略)

上記は平成24年1月20日現在のものであり、今後変更になることがあります。

(略)

< 訂正後 >

(略)

上記は平成24年7月19日現在のものであり、今後変更になることがあります。

(略)

3 【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

< 訂正前 >

当ファンドは国内外の株式、公社債およびREITなど値動きのある証券に、投資信託証券を通じて投資します。これらの投資対象証券には、主として次のような性質があり、当ファンドの基準価額を変動させる要因となります。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。投資信託は預貯金とは異なります。

a . 資産配分リスク

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

(略)

< 訂正後 >

当ファンドは国内外の株式、公社債およびREITなど値動きのある証券に、投資信託証券を通じて投資します。これらの投資対象証券には、主として次のような性質があり、当ファンドの基準価額を変動させる要因となります。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。なお、投資信託は預貯金とは異なります。

a . 資産配分リスク

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

ります。

（略）

（２）リスク管理体制

<訂正前>

（略）

上記のリスク管理体制は平成24年1月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

<訂正後>

（略）

上記のリスク管理体制は平成24年7月19日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

4【手数料等及び税金】

（５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

a．個人の受益者の場合

（イ）収益分配金の取扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、配当所得として課税され、平成25年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収されます。なお、特別分配金は課税されません。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税のいずれかを選択することもできます。また、特定口座（源泉徴収あり）の利用も可能です。

（ロ）一部解約金・償還金の取扱い

一部解約時および償還時の譲渡益（解約価額または償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した額）については、譲渡所得とみなされ、平成25年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座（源泉徴収あり）においては、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収されます。

上記（イ）および（ロ）の10%（所得税7%および地方税3%）の税率は、平成26年1月1日より、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

（ハ）損益通算について

（略）

b．法人の受益者の場合

平成25年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税対象となる普通分配金および一部解約金・償還金の個別元本超過額については、7%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。なお、特別分配金は課税されません。

また、上記の税率は平成26年1月1日より、15%（所得税のみ）となる予定です。

源泉徴収された所得税は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

なお、益金不算入制度は適用されません。

c．個別元本について

（略）

（ニ）受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該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。（「特別分配金」については、「d．収益分配金の課税について」をご参照ください。）

d．収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」（受益者ごとの元本の一部払い戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、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特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該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。

ただし、課税対象となります分配金は普通分配金のみであり、特別分配金に関しましては非課税扱いとなります。

（略）

<訂正後>

a. 個人の受益者の場合

(イ) 収益分配金の取り扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、配当所得として課税され、以下の(表1)の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金(特別分配金)は課税されません。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税のいずれかを選択することもできます。また、特定口座(源泉徴収あり)の利用も可能です。

(ロ) 一部解約金・償還金の取り扱い

一部解約時および償還時の譲渡益(解約価額または償還価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます。)を控除した額)については、譲渡所得とみなされ、以下の(表1)の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座(源泉徴収あり)の利用も可能です。

(表1)

期 間	税 率
平成24年12月31日まで	10% (所得税7%および地方税3%)
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147% (所得税7.147%および地方税3%)
平成26年1月1日以降	20.315% (所得税15.315%および地方税5%)

平成25年1月1日からは、所得税に復興特別所得税が加算されるため上記の税率となります。

(ハ) 損益通算について

（略）

b. 法人の受益者の場合

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金および一部解約金・償還金の個別元本超過額については以下の(表2)の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金(特別分配金)は課税されません。

源泉徴収された所得税は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

なお、益金不算入制度は適用されません。

(表2)

期 間	税 率
平成24年12月31日まで	7% (所得税のみ)
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	7.147% (所得税のみ)
平成26年1月1日以降	15.315% (所得税のみ)

平成25年1月1日からは、所得税に復興特別所得税が加算されるため上記の税率となります。

c．個別元本について

(略)

(二) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、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」をご参照ください。）

d．収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（受益者ごとの元本の一部払い戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、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、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、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。

ただし、課税対象となります分配金は普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）に関しましては非課税扱いとなります。

(略)

5【運用状況】

<更新後>

(1)【投資状況】

(平成24年5月31日現在)

分類	資産の種類	国・地域	金額	評価方法	投資比率	
有価証券	投資信託受益証券	ケイマン	円		%	
		諸島	1,088,707,500	時価	14.1	
		小計	1,088,707,500	-	14.1	
	親投資 信託	海外国債		円		%
		マザーファンド受益証券	日本	1,114,151,417	時価	14.4
		ニュー トピックス インデックス		円		%
		マザーファンド受益証券	日本	1,024,186,961	時価	13.2
		新光外国株式インデックス		円		%
		マザーファンド受益証券	日本	1,045,843,271	時価	13.5
		新光日本債券インデックス		円		%
		マザーファンド受益証券	日本	1,172,230,360	時価	15.2
		新光J-REIT		円		%
		マザーファンド受益証券	日本	1,093,208,727	時価	14.1
		新光米国REIT		円		%
		マザーファンド受益証券	日本	1,050,110,145	時価	13.6
			円		%	
	小計		6,499,730,881	-	84.0	
その他			円	負債控除後の	%	

資産	コール・ローン等	日本他	145,547,375	取得価額	1.9
-	純資産総額		7,733,985,756	-	100.0

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

(参考)

当ファンドが投資を行う投資信託証券のうち国内の親投資信託証券の投資状況は以下のとおりです。

『ニュー トピックス インデックス マザーファンド』の投資状況

(平成24年5月31日現在)

分類	資産の種類	国・地域	金額	評価方法	投資比率
有価証券	株式	日本	12,080,536,840	時価	95.3
		小計	12,080,536,840	-	95.3
その他資産	コール・ローン等	日本	600,321,010	負債控除後の取得価額	4.7
-	純資産総額		12,680,857,850	-	100.0

『新光日本債券インデックスマザーファンド』の投資状況

(平成24年5月31日現在)

分類	資産の種類		国・地域	金額	評価方法	投資比率	
有価証券	国債証券		日本	12,679,893,100	時価	77.6	
			小計	12,679,893,100	-	77.6	
		地方債証券		日本	1,153,513,400	時価	7.1
				小計	1,153,513,400	-	7.1
		特殊債券		日本	1,476,909,000	時価	9.0
				小計	1,476,909,000	-	9.0
	社債券	普通社債券	日本	937,410,000	時価	5.7	
			小計	937,410,000	-	5.7	
	その他資産	コール・ローン等		日本	94,909,330	負債控除後の取得価額	0.6
	-	純資産総額			16,342,634,830	-	100.0

『新光J - R E I Tマザーファンド』の投資状況

(平成24年5月31日現在)

分類	資産の種類	国・地域	金額	評価方法	投資比率
有価証券	投資証券	日本	円 1,067,551,760	時価	% 97.7
		小計	円 1,067,551,760	-	% 97.7
その他 資産	コール・ローン等	日本	円 25,676,455	負債控除後の 取得価額	% 2.3
-	純資産総額		円 1,093,228,215	-	% 100.0

『新光外国株式インデックスマザーファンド』の投資状況

(平成24年5月31日現在)

分類	資産の種類	国・地域	金額	評価方法	投資比率
有価証券	株 式	アメリカ	円 5,952,312,102	時価	% 53.7
		カナダ	円 569,544,569	時価	% 5.1
		ドイツ	円 379,798,164	時価	% 3.4
		イタリア	円 92,076,699	時価	% 0.8
		フランス	円 380,633,840	時価	% 3.4
		オーストラリア	円 374,977,584	時価	% 3.4
		イギリス	円 1,030,015,745	時価	% 9.3
		スイス	円 443,294,725	時価	% 4.0
		バミューダ諸島	円 50,126,147	時価	% 0.5
		香港	円 114,179,490	時価	% 1.0
		シンガポール	円 81,613,485	時価	% 0.7
		ニュージーランド	円 6,916,123	時価	% 0.1
		オランダ	円 129,619,842	時価	% 1.2
		スペイン	円 111,201,471	時価	% 1.0
		ベルギー	円 50,324,170	時価	% 0.5
		スウェーデン	円 143,669,204	時価	% 1.3
		ノルウェー	円 34,401,209	時価	% 0.3
		オーストリア	円 11,326,002	時価	% 0.1
					円

	ルクセンブルグ	20,908,420	時価	0.2
		円		%
	フィンランド	38,304,155	時価	0.3
		円		%
	デンマーク	56,030,044	時価	0.5
		円		%
	アイルランド	72,942,192	時価	0.7
		円		%
	ギリシャ	3,518,517	時価	0.0
		円		%
	イスラエル	29,691,176	時価	0.3

(平成24年5月31日現在)

分類	資産の種類	国・地域	金額	評価方法	投資比率
有価証券	株式		円		%
		ポルトガル	8,105,462	時価	0.1
			円		%
		ケイマン諸島	12,620,108	時価	0.1
			円		%
		モーリシャス	1,938,499	時価	0.0
			円		%
		リベリア	2,088,696	時価	0.0
			円		%
		パナマ	7,305,466	時価	0.1
			円		%
		キュラソー	44,228,327	時価	0.4
			円		%
	ジャージー	40,087,708	時価	0.4	
		円		%	
	ガーンジー	2,494,000	時価	0.0	
		円		%	
	マン島	3,579,615	時価	0.0	
		円		%	
	小計	10,299,872,956		92.9	
	新株予約権証券		円		%
		アメリカ	560,647	時価	0.0
			円		%
	小計	560,647		0.0	
	投資信託受益証券		円		%
		シンガポール	2,016,406	時価	0.0
			円		%
	小計	2,016,406		0.0	
	投資証券		円		%
		アメリカ	155,886,641	時価	1.4
			円		%
		カナダ	2,950,942	時価	0.0
			円		%
フランス		12,887,216	時価	0.1	
		円		%	
オーストラリア		29,648,904	時価	0.3	
		円		%	
イギリス		13,483,994	時価	0.1	
	円		%		
香港	4,404,868	時価	0.0		
	円		%		
シンガポール	2,972,915	時価	0.0		
	円		%		
オランダ	1,339,330	時価	0.0		
	円		%		

		小 計	223,574,810		2.0
その他 資産	コール・ローン等	日本他	558,751,054	円負債控除後の 取得価額	% 5.0
	純資産総額		11,084,775,873	円	% 100.0

『海外国債マザーファンド』の投資状況

(平成24年5月31日現在)

分 類	資産の種類		国・地域	金 額	評価方法	投資比率
有価証券	公社債券	国債証券	アメリカ	28,644,801,988	円 時価	% 39.6
			カナダ	4,178,571,918	円 時価	% 5.8
			ドイツ	12,730,557,815	円 時価	% 17.6
			イタリア	3,173,854,628	円 時価	% 4.4
			フランス	12,603,253,527	円 時価	% 17.4
			イギリス	7,635,277,470	円 時価	% 10.6
			小 計	68,966,317,346	円	% 95.3
その他 資産	コール・ローン等	日本他	3,379,252,212	円負債控除後の 取得価額	% 4.7	
-	純資産総額		72,345,569,558	円	% 100.0	

『新光米国REITマザーファンド』の投資状況

(平成24年5月31日現在)

分 類	資産の種類		国・地域	金 額	評価方法	投資比率
有価証券	投資証券		アメリカ	1,041,014,044	円 時価	% 99.1
			小 計	1,041,014,044	円	% 99.1
その他 資産	コール・ローン等		日本他	9,063,520	円負債控除後の 取得価額	% 0.9
-	純資産総額			1,050,077,564	円	% 100.0

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(平成24年5月31日現在)

順位	銘柄名	国・地域	種類	数量 (口)	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	新光日本債券インデックス マザーファンド受益証券	日本	親投資信託	1,030,985,365	1.1349	1,170,065,290	1.1370	1,172,230,360	15.15
2	海外国債マザーファンド受 益証券	日本	親投資信託	772,750,324	1.4570	1,125,897,222	1.4418	1,114,151,417	14.40
3	新光J-REITマザー ファンド受益証券	日本	親投資信託	1,516,239,567	0.7096	1,075,923,597	0.7210	1,093,208,727	14.13
4	フランクリン・テンブルト ン・フロンティア・エマー ジング・マーケット・デッ ト・ファンド受益証券	ケイマ ン諸島	投資信託 受益証券	190,500	5,771	1,099,375,500	5,715	1,088,707,500	14.07
5	新光米国REITマザー ファンド受益証券	日本	親投資信託	1,553,417,375	0.6674	1,036,750,756	0.6760	1,050,110,145	13.57
6	新光外国株式インデックス マザーファンド受益証券	日本	親投資信託	1,276,041,083	0.8204	1,046,864,104	0.8196	1,045,843,271	13.52
7	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	日本	親投資信託	1,233,217,292	0.8369	1,032,079,551	0.8305	1,024,186,961	13.24

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する評価金額の比率です。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。以下同じ。

種類別投資比率（平成24年5月31日現在）

種類	投資比率（%）
親投資信託	84.04
投資信託受益証券	14.07
合計	98.11

株式業種別投資比率（平成24年5月31日現在）

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドが投資を行う投資信託証券のうち国内の親投資信託証券の投資資産は以下のとおりです。

『ニュー トピックス インデックス マザーファンド』の投資資産
投資有価証券の主要銘柄

(平成24年5月31日現在)

順位	銘柄名	国・地域	種類	業種	株数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	159,300	2,650.72	422,260,000	3,040	484,272,000	3.81
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	918,200	334.29	306,948,200	340	312,188,000	2.46
3	本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	103,700	2,554.15	264,865,500	2,512	260,494,400	2.05
4	キヤノン	日本	株式	電気機器	76,300	3,352.28	255,779,500	3,150	240,345,000	1.89
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	92,100	2,244.36	206,705,799	2,289	210,816,900	1.66
6	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	55,900	3,908.25	218,471,500	3,380	188,942,000	1.48
7	みずほフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1,560,000	109.24	170,414,789	115	179,400,000	1.41
8	ファナック	日本	株式	電気機器	12,800	11,714.37	149,944,000	13,520	173,056,000	1.36
9	武田薬品工業	日本	株式	医薬品	48,200	3,216.55	155,038,000	3,275	157,855,000	1.24
10	三菱商事	日本	株式	卸売業	88,300	1,609.56	142,124,400	1,535	135,540,500	1.06
11	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	54,900	2,175.12	119,414,500	2,450	134,505,000	1.06
12	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	305	400,121.31	122,037,000	437,000	133,285,000	1.05
13	日立製作所	日本	株式	電気機器	283,000	420.22	118,924,000	449	127,067,000	1.00
14	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	999	140,303.08	140,162,785	125,100	124,974,900	0.98
15	セブン&アイ・ホールディングス	日本	株式	小売業	50,700	2,168.95	109,966,000	2,359	119,601,300	0.94
16	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	156,300	688.53	107,618,300	758	118,475,400	0.93
17	三井物産	日本	株式	卸売業	104,700	1,216.31	127,348,600	1,104	115,588,800	0.91
18	小松製作所	日本	株式	機械	60,000	1,978.20	118,692,000	1,878	112,680,000	0.88
19	三菱地所	日本	株式	不動産業	85,000	1,158.45	98,469,000	1,219	103,615,000	0.81
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	21,400	4,799.60	102,711,500	4,665	99,831,000	0.78
21	信越化学工業	日本	株式	化学	23,100	3,749.84	86,621,500	4,030	93,093,000	0.73
22	KDDI	日本	株式	情報・通信業	188	498,537.23	93,725,000	484,500	91,086,000	0.71
23	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	28,600	3,100.00	88,660,000	3,080	88,088,000	0.69
24	伊藤忠商事	日本	株式	卸売業	96,800	780.04	75,508,200	859	83,151,200	0.65
25	ソニー	日本	株式	電気機器	76,700	1,318.39	101,120,900	1,050	80,535,000	0.63
26	東京海上ホールディングス	日本	株式	保険業	46,000	1,750.45	80,520,800	1,707	78,522,000	0.61
27	東芝	日本	株式	電気機器	259,000	312.50	80,939,000	295	76,405,000	0.60
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	123,000	725.52	89,239,000	617	75,891,000	0.59
29	国際石油開発帝石	日本	株式	鉱業	167	514,502.99	85,922,000	453,000	75,651,000	0.59
30	住友商事	日本	株式	卸売業	71,600	1,056.70	75,659,900	1,053	75,394,800	0.59

種類別投資比率(平成24年5月31日現在)

種類	投資比率(%)
株式	95.26
合計	95.26

株式業種別投資比率(平成24年5月31日現在)

業種	投資比率(%)
水産・農林業	0.09
鉱業	0.67

建設業	2.26
食料品	3.78
繊維製品	0.94
パルプ・紙	0.30
化学	5.69
医薬品	4.84
石油・石炭製品	0.77
ゴム製品	0.75
ガラス・土石製品	0.97
鉄鋼	1.63
非鉄金属	1.07
金属製品	0.64
機械	4.80
電気機器	12.50
輸送用機器	10.19
精密機器	1.37
その他製品	1.40
電気・ガス業	2.86
陸運業	3.97
海運業	0.37
空運業	0.27
倉庫・運輸関連業	0.24
情報・通信業	6.19
卸売業	5.32
小売業	4.31
銀行業	8.92
証券、商品先物取引業	0.98
保険業	2.01
その他金融業	0.77
不動産業	2.33
サービス業	1.89
合計	95.26

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成24年5月31日現在）

種類	国・地域	資産名	買建・ 売建	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物24年6月限	買建	83	657,881,126	595,110,000	4.69

（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および外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

『新光日本債券インデックスマザーファンド』の投資資産
投資有価証券の主要銘柄

（平成24年5月31日現在）

順位	銘柄名	国・地域	種類	額面(円)	帳簿価額		評価額		利率(%)	償還期限	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)			
1	第273回利付国債(10年)	日本	国債証券	400,000,000	104.78	419,128,000	104.58	418,324,000	1.5000	2015.09.20	2.55
2	第270回利付国債(10年)	日本	国債証券	280,000,000	103.83	290,732,100	103.64	290,194,800	1.3000	2015.06.20	1.77
3	第263回利付国債(10年)	日本	国債証券	280,000,000	104.08	291,424,000	103.43	289,618,000	1.6000	2014.09.20	1.77
4	第269回利付国債(10年)	日本	国債証券	280,000,000	103.63	290,177,500	103.34	289,352,000	1.3000	2015.03.20	1.77
5	第290回利付国債(10年)	日本	国債証券	260,000,000	105.73	274,920,000	106.26	276,281,200	1.4000	2018.03.20	1.69
6	第255回利付国債(10年)	日本	国債証券	260,000,000	102.52	266,559,800	101.81	264,708,600	1.5000	2013.09.20	1.61
7	第303回利付国債(10年)	日本	国債証券	240,000,000	105.61	253,485,400	106.56	255,744,000	1.4000	2019.09.20	1.56
8	第256回利付国債(10年)	日本	国債証券	250,000,000	102.49	256,242,000	102.00	255,012,500	1.4000	2013.12.20	1.56
9	第315回利付国債(10年)	日本	国債証券	240,000,000	102.45	245,898,000	104.03	249,674,400	1.2000	2021.06.20	1.52
10	第306回利付国債(10年)	日本	国債証券	230,000,000	105.35	242,307,100	106.47	244,881,000	1.4000	2020.03.20	1.49
11	第308回利付国債(10年)	日本	国債証券	230,000,000	104.31	239,922,200	105.57	242,817,900	1.3000	2020.06.20	1.48
12	第313回利付国債(10年)	日本	国債証券	230,000,000	103.58	238,236,300	105.09	241,727,700	1.3000	2021.03.20	1.47
13	第280回利付国債(10年)	日本	国債証券	220,000,000	107.16	235,756,400	107.05	235,521,000	1.9000	2016.06.20	1.44
14	第101回利付国債(5年)	日本	国債証券	220,000,000	100.42	220,937,400	100.94	222,081,200	0.4000	2016.12.20	1.35
15	第276回利付国債(10年)	日本	国債証券	210,000,000	105.38	221,311,300	105.26	221,048,100	1.6000	2015.12.20	1.35
16	第312回利付国債(10年)	日本	国債証券	190,000,000	102.98	195,663,000	104.45	198,458,800	1.2000	2020.12.20	1.21
17	第260回利付国債(10年)	日本	国債証券	190,000,000	103.76	197,144,000	103.05	195,812,100	1.6000	2014.06.20	1.19
18	第259回利付国債(10年)	日本	国債証券	190,000,000	103.13	195,950,400	102.50	194,757,600	1.5000	2014.03.20	1.19
19	第265回利付国債(10年)	日本	国債証券	180,000,000	103.98	187,165,500	103.55	186,397,200	1.5000	2014.12.20	1.14
20	第310回利付国債(10年)	日本	国債証券	180,000,000	101.52	182,746,800	102.99	185,396,400	1.0000	2020.09.20	1.13
21	第75回利付国債(5年)	日本	国債証券	180,000,000	101.76	183,184,200	101.29	182,329,200	1.1000	2013.09.20	1.11
22	第73回利付国債(5年)	日本	国債証券	180,000,000	101.86	183,364,200	101.25	182,251,800	1.3000	2013.06.20	1.11
23	第285回利付国債(10年)	日本	国債証券	170,000,000	106.96	181,832,400	107.09	182,059,800	1.7000	2017.03.20	1.11
24	第79回利付国債(5年)	日本	国債証券	180,000,000	101.11	182,005,200	100.92	181,665,000	0.7000	2013.12.20	1.11
25	第81回利付国債(5年)	日本	国債証券	170,000,000	101.41	172,407,300	101.25	172,128,400	0.8000	2014.03.20	1.05
26	第319回利付国債(10年)	日本	国債証券	160,000,000	101.23	161,977,200	102.75	164,401,600	1.1000	2021.12.20	1.00
27	第318回利付国債(10年)	日本	国債証券	160,000,000	99.70	159,520,600	102.08	163,332,800	1.0000	2021.09.20	0.99
28	第252回利付国債(10年)	日本	国債証券	160,000,000	101.38	162,212,400	100.93	161,500,800	1.0000	2013.06.20	0.98
29	第282回利付国債(10年)	日本	国債証券	150,000,000	106.56	159,840,000	106.54	159,820,500	1.7000	2016.09.20	0.97
30	第299回利付国債(10年)	日本	国債証券	150,000,000	105.13	157,695,000	105.77	158,664,000	1.3000	2019.03.20	0.97

種類別投資比率(平成24年5月31日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	77.58
特殊債券	9.03
地方債証券	7.05
社債証券	5.73
合計	99.41

株式業種別投資比率(平成24年5月31日現在)

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

『新光』 - R E I Tマザーファンド』の投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(平成24年5月31日現在)

順位	銘柄名	国・地域	種類	数量 (口)	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	193	737,305.42	142,299,946	715,000	137,995,000	12.62
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	173	669,476.56	115,819,444	692,000	119,716,000	10.95
3	日本リテールファンド投資法人	日本	投資証券	593	120,928.86	71,710,813	123,300	73,116,900	6.68
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	664	86,181.42	57,224,462	84,700	56,240,800	5.14
5	森トラスト総合リート投資法人	日本	投資証券	76	676,379.44	51,404,837	669,000	50,844,000	4.65
6	日本プライムリアルティ投資法人	日本	投資証券	226	192,121.07	43,419,361	223,800	50,578,800	4.62
7	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	347	143,094.54	49,653,805	144,600	50,176,200	4.58
8	野村不動産オフィスファンド投資法人	日本	投資証券	96	445,035.12	42,723,371	437,000	41,952,000	3.83
9	フロンティア不動産投資法人	日本	投資証券	61	652,647.55	39,811,500	671,000	40,931,000	3.74
10	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	47	652,000.00	30,644,000	695,000	32,665,000	2.98
11	オリックス不動産投資法人	日本	投資証券	90	333,809.80	30,042,882	350,000	31,500,000	2.88
12	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	61	514,091.40	31,359,575	511,000	31,171,000	2.85
13	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	51	446,768.56	22,785,196	534,000	27,234,000	2.49
14	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	60	317,804.79	19,068,287	418,000	25,080,000	2.29
15	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	125	189,104.22	23,638,027	194,500	24,312,500	2.22
16	森ヒルズリート投資法人	日本	投資証券	73	259,709.87	18,958,820	318,500	23,250,500	2.12
17	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	90	232,894.75	20,960,527	257,200	23,148,000	2.11
18	福岡リート投資法人	日本	投資証券	39	505,994.51	19,733,785	566,000	22,074,000	2.01
19	トップリート投資法人	日本	投資証券	49	400,695.22	19,634,065	440,000	21,560,000	1.97
20	産業ファンド投資法人	日本	投資証券	44	401,586.10	17,669,788	486,500	21,406,000	1.95
21	東急リアル・エステート投資法人	日本	投資証券	53	395,500.00	20,961,500	391,500	20,749,500	1.89
22	野村不動産レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	48	361,653.12	17,359,349	390,000	18,720,000	1.71
23	プレミア投資法人	日本	投資証券	62	272,085.64	16,869,309	289,600	17,955,200	1.64
24	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	31	549,000.00	17,019,000	511,000	15,841,000	1.44
25	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	420	27,997.42	11,758,916	36,500	15,330,000	1.40
26	M I D リート投資法人	日本	投資証券	58	188,012.37	10,904,717	210,200	12,191,600	1.11
27	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	587	15,020.19	8,816,851	20,350	11,945,450	1.09
28	積水ハウス・S I 投資法人	日本	投資証券	36	271,228.09	9,764,211	328,000	11,808,000	1.08
29	阪急リート投資法人	日本	投資証券	27	352,500.00	9,517,500	358,500	9,679,500	0.88
30	平和不動産リート投資法人	日本	投資証券	220	39,526.62	8,695,856	43,300	9,526,000	0.87

種類別投資比率（平成24年5月31日現在）

種 類	投資比率（％）
投資証券	97.65
合 計	97.65

株式業種別投資比率（平成24年5月31日現在）

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

『新光外国株式インデックスマザーファンド』の投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成24年5月31日現在）

順位	銘柄名	国・地域	種類	業 種	株数	帳簿価額		評 価 額		投資比率（％）
						単価 （円）	金額 （円）	単価 （円）	金額 （円）	
1	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,000	31,195.49	187,172,985	45,708.09	274,248,578	2.47
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	30,966	6,107.61	189,128,523	6,297.02	194,993,731	1.75
3	INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	7,600	14,382.38	109,306,094	15,352.30	116,677,537	1.05
4	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	48,900	2,067.70	101,110,725	2,315.51	113,228,575	1.02
5	GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	株式	資本財	68,200	1,250.88	85,310,152	1,502.63	102,479,829	0.92
6	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	38,319	2,281.57	87,427,756	2,670.65	102,336,744	0.92
7	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	12,900	8,229.77	106,164,131	7,704.95	99,393,978	0.89
8	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	21,313	4,112.76	87,655,424	4,502.91	95,970,563	0.86
9	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	家庭用品・パーソナル用品	17,792	4,949.86	88,067,951	4,918.29	87,506,293	0.78
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	17,600	5,013.78	88,242,661	4,909.61	86,409,192	0.77
11	PFIZER INC	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	49,626	1,526.31	75,744,799	1,739.39	86,319,305	0.77
12	WELLS FARGO & COMPANY	アメリカ	株式	銀行	32,388	1,972.21	63,875,963	2,501.76	81,027,132	0.73
13	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1,700	47,426.97	80,625,855	46,423.11	78,919,289	0.71
14	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	食品・飲料・タバコ	13,200	5,290.00	69,828,100	5,923.73	78,193,304	0.70
15	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	アメリカ	株式	食品・飲料・タバコ	11,200	5,494.41	61,537,396	6,698.72	75,025,771	0.67
16	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	イギリス	株式	銀行	115,399	617.87	71,302,341	614.82	70,950,056	0.64
17	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	324,702	214.91	69,782,875	209.84	68,137,426	0.61
18	INTEL CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	32,900	1,881.45	61,899,797	2,062.17	67,845,708	0.61
19	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	各種金融	24,500	2,568.05	62,917,391	2,601.20	63,729,478	0.57
20	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	食品・生活必需品小売り	12,200	4,581.30	55,891,933	5,164.52	63,007,202	0.56
21	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	15,073	4,059.93	61,195,415	4,108.70	61,930,495	0.55
22	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	18,300	2,911.35	53,277,866	3,268.86	59,820,255	0.53
23	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	122,474	549.49	67,298,850	486.36	59,566,960	0.53
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19,731	2,666.70	52,616,791	2,951.60	58,238,177	0.52
25	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	23,517	2,651.00	62,343,757	2,428.15	57,102,975	0.51

26	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	32,602	1,677.79	54,699,355	1,720.52	56,092,715	0.50
27	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,537	11,444.22	51,922,444	12,362.68	56,089,515	0.50
28	PEPSICO INC	アメリカ	株式	食品・飲料・タバコ	10,086	4,915.13	49,574,077	5,383.92	54,302,241	0.48
29	ORACLE CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	26,100	2,493.08	65,069,461	2,065.33	53,905,280	0.48
30	BHP BILLITON LIMITED(AU)	オーストラリア	株式	素材	20,741	2,933.77	60,849,493	2,462.29	51,070,394	0.46

(注) 外貨建株式の単価および金額は、平成24年5月31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。

種別別投資比率(平成24年5月31日現在)

種 類	投資比率(%)
株 式	92.91
投 資 証 券	2.01
投資信託受益証券	0.01
新株予約権証券	0.00
合 計	94.95

株式業種別投資比率(平成24年5月31日現在)

業 種	投資比率(%)
エネルギー	10.84
素材	6.50
資本財	7.10
商業・専門サービス	0.84
運輸	1.77
自動車・自動車部品	1.24
耐久消費財・アパレル	1.26
消費者サービス	1.72
メディア	2.57
小売	2.87
食品・生活必需品小売り	2.26
食品・飲料・タバコ	6.99
家庭用品・パーソナル用品	1.77
ヘルスケア機器・サービス	2.69
医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス	7.64
銀行	6.60
各種金融	4.08
保険	3.70
不動産	0.63
ソフトウェア・サービス	5.89
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.76
電気通信サービス	3.87

公益事業	3.64
半導体・半導体製造装置	1.58
合計	92.91

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成24年5月31日現在）

種類	国・地域	資産名	買建・ 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI先物	買建	70	383,975,198	361,461,492	3.26
株価指数先物取引	カナダ	S&P/TSE 60IX先物	買建	3	32,632,152	29,799,050	0.26
株価指数先物取引	ドイツ	DJ EURO ST50先物	買建	25	57,946,256	51,543,360	0.46
株価指数先物取引	オーストラリア	SPI 200先物	買建	2	16,567,006	15,637,122	0.14
株価指数先物取引	イギリス	LIFFE FTSE先物	買建	9	63,501,962	58,109,096	0.52
株価指数先物取引	スイス	SWISS MKT IX先物	買建	5	24,781,459	23,993,856	0.21
株価指数先物取引	スウェーデン	OMXS30 INDEX先物	買建	3	3,230,925	3,220,752	0.02

（注1）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および外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

（注2）外貨建先物取引については、平成24年5月31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。

『海外国債マザーファンド』の投資資産
投資有価証券の主要銘柄

（平成24年5月31日現在）

順位	銘柄名	国・地域	種類	額面	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	32,300,000	8,355.25	2,698,747,282	8,695.38	2,808,608,053	2.6250	2020.11.15	3.88
2	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	34,300,000	7,916.73	2,715,438,667	8,178.08	2,805,083,155	2.0000	2022.02.15	3.87
3	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	34,200,000	7,895.87	2,700,388,784	8,196.58	2,803,230,999	2.0000	2021.11.15	3.87
4	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	29,200,000	9,038.67	2,639,293,234	9,319.34	2,721,247,928	3.6250	2020.02.15	3.76
5	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	29,900,000	7,937.06	2,373,183,898	8,308.79	2,484,330,078	2.1250	2021.08.15	3.43
6	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	26,400,000	9,016.17	2,380,270,112	9,339.68	2,465,677,830	3.6250	2021.02.15	3.40
7	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	23,800,000	8,957.79	2,131,955,669	9,250.28	2,201,568,358	3.5000	2020.05.15	3.04
8	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	20,000,000	10,295.06	2,059,012,754	10,823.12	2,164,625,880	3.7500	2021.04.25	2.99
9	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	24,800,000	8,376.98	2,077,492,940	8,707.09	2,159,359,714	2.6250	2020.08.15	2.98
10	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	19,100,000	10,156.14	1,939,824,591	10,679.62	2,039,808,948	3.5000	2020.04.25	2.81
11	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	17,400,000	11,101.59	1,931,678,202	11,546.49	2,009,089,886	3.5000	2019.07.04	2.77
12	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	17,900,000	10,679.82	1,911,689,531	11,191.15	2,003,217,067	4.2500	2019.04.25	2.76
13	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	19,600,000	9,356.76	1,833,925,439	9,908.43	1,942,052,280	2.5000	2020.10.25	2.68
14	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	21,500,000	8,654.74	1,860,769,224	9,005.51	1,936,185,052	3.1250	2021.05.15	2.67
15	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	20,200,000	8,887.36	1,795,248,385	9,168.28	1,851,993,442	3.3750	2019.11.15	2.55

16	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	17,800,000	9,693.76	1,725,489,924	10,388.72	1,849,192,231	3.2500	2021.10.25	2.55
17	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	16,000,000	10,988.07	1,758,092,271	11,448.87	1,831,819,776	3.2500	2020.01.04	2.53
18	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	16,700,000	10,385.92	1,734,449,683	10,867.05	1,814,798,752	3.7500	2019.10.25	2.50
19	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	16,000,000	10,744.94	1,719,190,701	11,262.41	1,801,987,104	3.0000	2020.07.04	2.49
20	CANADIAN GOVERNMENT	カナダ	国債証券	20,000,000	8,677.38	1,735,476,712	8,794.75	1,758,950,016	3.7500	2019.06.01	2.43
21	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	13,800,000	10,946.18	1,510,573,832	11,526.96	1,590,721,804	3.2500	2021.07.04	2.19
22	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	17,500,000	8,743.57	1,530,125,302	9,017.84	1,578,122,546	3.1250	2019.05.15	2.18
23	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	14,500,000	9,921.79	1,438,659,618	10,478.53	1,519,386,966	2.0000	2022.01.04	2.10
24	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	13,800,000	10,353.33	1,428,760,462	10,887.55	1,502,483,086	2.5000	2021.01.04	2.07
25	TSY	イギリス	国債証券	10,300,000	13,813.56	1,422,796,779	14,484.68	1,491,922,884	3.7500	2021.09.07	2.06
26	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	15,400,000	9,032.71	1,391,037,483	9,299.61	1,432,140,281	3.6250	2019.08.15	1.97
27	TSY	イギリス	国債証券	9,000,000	14,713.38	1,324,204,799	15,348.25	1,381,342,510	4.7500	2020.03.07	1.90
28	TSY	イギリス	国債証券	9,400,000	13,730.09	1,290,629,189	14,429.73	1,356,395,437	3.7500	2020.09.07	1.87
29	CANADIAN GOVERNMENT	カナダ	国債証券	14,800,000	8,530.65	1,262,536,468	8,747.78	1,294,671,738	3.5000	2020.06.01	1.78
30	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	11,600,000	10,170.96	1,179,832,391	10,678.65	1,238,723,608	2.2500	2020.09.04	1.71

（注）外貨建債券の単価および金額は、平成24年5月31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。

種類別投資比率（平成24年5月31日現在）

種 類	投資比率（％）
国債証券	95.32
合 計	95.32

株式業種別投資比率（平成24年5月31日現在）

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

『新光米国REITマザーファンド』の投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成24年5月31日現在）

順位	銘柄名	国・地域	種類	数量 (口)	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	8,805	9,161.03	80,662,900	11,536.52	101,579,107	9.67
2	AMERICAN TOWER CORPORATION	アメリカ	投資証券	11,700	4,758.08	55,669,615	5,144.79	60,194,099	5.73
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	8,700	4,310.61	37,502,310	4,780.18	41,587,604	3.96

4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	3,800	9,102.63	34,590,004	10,455.32	39,730,222	3.78
5	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	8,455	4,068.32	34,397,696	4,565.52	38,601,488	3.67
6	HCP INC	アメリカ	投資証券	12,000	2,879.00	34,548,019	3,201.78	38,421,412	3.65
7	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	5,435	5,956.09	32,371,362	6,447.76	35,043,597	3.33
8	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	4,300	7,132.00	30,667,601	8,102.71	34,841,680	3.31
9	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	13,500	2,073.22	27,988,583	2,508.86	33,869,701	3.22
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	2,842	9,552.47	27,148,139	10,928.05	31,057,524	2.95
11	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	6,300	3,855.24	24,288,024	4,319.29	27,211,537	2.59
12	HOST HOTELS & RESORTS	アメリカ	投資証券	20,779	995.18	20,678,870	1,196.42	24,860,560	2.36
13	WEYERHAEUSER COMPANY	アメリカ	投資証券	15,800	1,310.86	20,711,606	1,559.45	24,639,455	2.34
14	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	13,850	994.39	13,772,329	1,326.64	18,374,036	1.74
15	THE MACERICH COMPANY	アメリカ	投資証券	3,901	3,515.09	13,712,392	4,497.65	17,545,335	1.67
16	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	3,100	4,666.53	14,466,272	5,525.97	17,130,533	1.63
17	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	11,900	1,193.27	14,199,917	1,406.35	16,735,617	1.59
18	FEDERAL REALTY INVESTMENT	アメリカ	投資証券	1,900	6,570.87	12,484,670	7,702.59	14,634,924	1.39
19	SL GREEN REALTY CORPORATION	アメリカ	投資証券	2,500	4,896.98	12,242,465	5,832.18	14,580,470	1.38
20	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	アメリカ	投資証券	4,800	2,766.93	13,281,288	2,864.00	13,747,232	1.30
21	UDR INC	アメリカ	投資証券	6,558	1,798.58	11,795,132	2,040.08	13,378,857	1.27
22	RAYONIER INC	アメリカ	投資証券	3,600	3,136.28	11,290,610	3,381.72	12,174,199	1.15
23	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	2,300	4,486.60	10,319,184	5,114.80	11,764,051	1.12
24	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,000	10,484.52	10,484,522	11,763.02	11,763,026	1.12
25	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	3,900	2,570.42	10,024,655	3,002.11	11,708,255	1.11
26	TAUBMAN CENTERS INC	アメリカ	投資証券	1,700	4,269.57	7,258,272	5,728.80	9,738,964	0.92
27	ALEXANDRIA REAL ESTATE	アメリカ	投資証券	1,800	5,157.42	9,283,359	5,399.70	9,719,471	0.92
28	LIBERTY PROPERTY	アメリカ	投資証券	3,400	2,282.36	7,760,045	2,716.42	9,235,849	0.87
29	REGENCY CENTERS CORPORATION	アメリカ	投資証券	2,600	2,827.70	7,352,029	3,420.39	8,893,021	0.84
30	DDR CORPORATION	アメリカ	投資証券	8,097	906.00	7,335,894	1,093.83	8,856,751	0.84

(注) 外貨建投資証券の単価および金額は、平成24年5月31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。

種類別投資比率(平成24年5月31日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	99.13
合計	99.13

株式業種別投資比率(平成24年5月31日現在)

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

(単位:円)

期 間		純資産総額 (分配落ち)	純資産総額 (分配付き)	基準価額 (分配落ち)	基準価額 (分配付き)
第1期特定期間	第1期計算期間末	31,398,954,947	31,453,604,999	10,797	10,816
	第2期計算期間末	36,458,477,477	36,522,545,978	11,022	11,041
	第3期計算期間末	39,259,414,859	39,330,106,213	10,754	10,774
	第4期計算期間末	46,505,640,498	46,672,485,568	10,946	10,985
第2期特定期間	第5期計算期間末	56,945,136,672	57,145,564,623	11,105	11,144
	第6期計算期間末	63,247,361,830	63,469,553,127	11,101	11,140
	第7期計算期間末	66,011,879,353	66,247,927,474	10,903	10,942
	第8期計算期間末	63,683,482,806	63,943,903,554	9,782	9,822
	第9期計算期間末	71,218,071,586	71,492,829,632	10,199	10,238
	第10期計算期間末	73,335,259,420	73,622,000,840	10,050	10,090
第3期特定期間	第11期計算期間末	71,959,927,559	72,258,236,214	9,649	9,689
	第12期計算期間末	72,187,419,727	72,484,489,267	9,712	9,752
	第13期計算期間末	66,232,470,325	66,530,784,798	8,881	8,921
	第14期計算期間末	65,487,908,766	65,779,232,282	8,988	9,028
	第15期計算期間末	59,637,828,762	59,918,689,896	8,494	8,534
	第16期計算期間末	60,571,391,084	60,839,591,183	9,027	9,067
第4期特定期間	第17期計算期間末	59,060,866,513	59,320,010,104	9,106	9,145
	第18期計算期間末	55,257,728,657	55,506,608,439	8,878	8,918
	第19期計算期間末	51,215,886,395	51,455,194,433	8,560	8,600
	第20期計算期間末	48,648,466,616	48,877,521,774	8,495	8,535
	第21期計算期間末	42,844,489,177	43,051,785,402	8,267	8,307
	第22期計算期間末	31,463,032,178	31,656,566,896	6,503	6,543
第5期特定期間	第23期計算期間末	25,376,054,081	25,560,489,908	5,503	5,543
	第24期計算期間末	26,270,993,088	26,448,535,021	5,919	5,959
	第25期計算期間末	23,659,525,664	23,827,602,483	5,631	5,671
	第26期計算期間末	21,313,583,838	21,473,639,587	5,327	5,367
	第27期計算期間末	20,870,805,177	21,023,208,589	5,478	5,518
	第28期計算期間末	21,963,360,031	22,110,320,662	5,978	6,018
第6期特定期間	第29期計算期間末	21,446,818,082	21,589,148,403	6,027	6,067
	第30期計算期間末	21,116,218,067	21,252,894,289	6,179	6,219
	第31期計算期間末	20,438,122,570	20,569,965,407	6,200	6,240
	第32期計算期間末	20,608,643,816	20,736,550,829	6,443	6,483
	第33期計算期間末	20,309,868,238	20,433,421,553	6,573	6,613
	第34期計算期間末	19,553,950,956	19,673,764,141	6,526	6,566
第7期特定期間	第35期計算期間末	18,098,090,560	18,213,598,769	6,266	6,306
	第36期計算期間末	17,935,635,932	18,048,225,778	6,370	6,410
	第37期計算期間末	18,149,288,705	18,259,401,088	6,593	6,633
	第38期計算期間末	16,863,825,610	16,969,105,343	6,407	6,447
	第39期計算期間末	16,621,902,346	16,723,356,841	6,553	6,593
	第40期計算期間末	16,678,962,105	16,777,904,047	6,743	6,783

(単位：円)

期 間		純資産総額 (分配落ち)	純資産総額 (分配付き)	基準価額 (分配落ち)	基準価額 (分配付き)
第8期特定期間	第41期計算期間末	15,497,219,338	15,593,929,501	6,410	6,450
	第42期計算期間末	15,022,222,124	15,116,640,982	6,364	6,404
	第43期計算期間末	13,956,811,617	14,048,753,649	6,072	6,112
	第44期計算期間末	13,573,373,582	13,662,827,956	6,069	6,109

	第45期計算期間末	13,565,900,141	13,653,042,771	6,227	6,267
	第46期計算期間末	13,023,510,796	13,108,669,225	6,117	6,157
第9期特定期間	第47期計算期間末	13,036,289,671	13,119,531,493	6,264	6,304
	第48期計算期間末	12,779,543,668	12,860,926,806	6,281	6,321
	第49期計算期間末	12,675,838,357	12,755,909,022	6,332	6,372
	第50期計算期間末	12,718,635,163	12,797,307,998	6,467	6,507
	第51期計算期間末	12,005,093,521	12,082,565,583	6,198	6,238
	第52期計算期間末	12,014,371,674	12,090,851,540	6,284	6,324
第10期特定期間	第53期計算期間末	11,842,345,699	11,917,856,016	6,273	6,313
	第54期計算期間末	11,122,114,306	11,195,635,870	6,051	6,091
	第55期計算期間末	10,935,017,321	11,006,843,044	6,090	6,130
	第56期計算期間末	9,875,625,160	9,946,240,194	5,594	5,634
	第57期計算期間末	9,654,712,263	9,724,341,587	5,546	5,586
	第58期計算期間末	9,331,021,288	9,365,284,964	5,447	5,467
第11期特定期間	第59期計算期間末	8,594,860,745	8,626,850,781	5,373	5,393
	第60期計算期間末	8,296,730,057	8,327,494,691	5,394	5,414
	第61期計算期間末	8,312,761,450	8,342,884,212	5,519	5,539
	第62期計算期間末	8,533,873,764	8,563,159,378	5,828	5,848
	第63期計算期間末	8,695,889,135	8,724,299,608	6,122	6,142
	第64期計算期間末 (平成24年4月20日)	8,395,549,774	8,423,613,455	5,983	6,003
	平成23年5月末日	11,627,986,398	-	6,261	-
	平成23年6月末日	11,197,016,829	-	6,173	-
	平成23年7月末日	10,694,776,962	-	5,988	-
	平成23年8月末日	10,061,646,735	-	5,723	-
	平成23年9月末日	9,488,688,243	-	5,468	-
	平成23年10月末日	9,461,249,331	-	5,655	-
	平成23年11月末日	8,492,201,344	-	5,385	-
	平成23年12月末日	8,340,484,370	-	5,468	-
	平成24年1月末日	8,252,771,813	-	5,552	-
	平成24年2月末日	8,683,905,651	-	5,961	-
	平成24年3月末日	8,614,689,077	-	6,091	-
	平成24年4月末日	8,374,619,454	-	5,995	-
	平成24年5月末日	7,733,985,756	-	5,626	-

(注1) 基準価額は1万口当たりの純資産額です。

(注2) 表中の分配付きの数値は支払外国税を控除している場合があります。

【分配の推移】

特定期間	決算期	1万口当たりの分配金
第1期特定期間	第1期計算期間 (平成19年1月22日)	20円
	第2期計算期間 (平成19年2月20日)	20円
	第3期計算期間 (平成19年3月20日)	20円
	第4期計算期間 (平成19年4月20日)	40円
	第5期計算期間 (平成19年5月21日)	40円

第2期特定期間	第6期計算期間 (平成19年6月20日)	40円
	第7期計算期間 (平成19年7月20日)	40円
	第8期計算期間 (平成19年8月20日)	40円
	第9期計算期間 (平成19年9月20日)	40円
	第10期計算期間 (平成19年10月22日)	40円
第3期特定期間	第11期計算期間 (平成19年11月20日)	40円
	第12期計算期間 (平成19年12月20日)	40円
	第13期計算期間 (平成20年1月21日)	40円
	第14期計算期間 (平成20年2月20日)	40円
	第15期計算期間 (平成20年3月21日)	40円
	第16期計算期間 (平成20年4月21日)	40円
第4期特定期間	第17期計算期間 (平成20年5月20日)	40円
	第18期計算期間 (平成20年6月20日)	40円
	第19期計算期間 (平成20年7月22日)	40円
	第20期計算期間 (平成20年8月20日)	40円
	第21期計算期間 (平成20年9月22日)	40円
	第22期計算期間 (平成20年10月20日)	40円

特定期間	決算期	1万口当たりの分配金
第5期特定期間	第23期計算期間 (平成20年11月20日)	40円
	第24期計算期間 (平成20年12月22日)	40円
	第25期計算期間 (平成21年1月20日)	40円
	第26期計算期間 (平成21年2月20日)	40円
	第27期計算期間 (平成21年3月23日)	40円
	第28期計算期間 (平成21年4月20日)	40円
	第29期計算期間 (平成21年5月20日)	40円
	第30期計算期間 (平成21年6月22日)	40円

第6期特定期間	第31期計算期間 (平成21年7月21日)	40円
	第32期計算期間 (平成21年8月20日)	40円
	第33期計算期間 (平成21年9月24日)	40円
	第34期計算期間 (平成21年10月20日)	40円
第7期特定期間	第35期計算期間 (平成21年11月20日)	40円
	第36期計算期間 (平成21年12月21日)	40円
	第37期計算期間 (平成22年1月20日)	40円
	第38期計算期間 (平成22年2月22日)	40円
	第39期計算期間 (平成22年3月23日)	40円
	第40期計算期間 (平成22年4月20日)	40円
第8期特定期間	第41期計算期間 (平成22年5月20日)	40円
	第42期計算期間 (平成22年6月21日)	40円
	第43期計算期間 (平成22年7月20日)	40円
	第44期計算期間 (平成22年8月20日)	40円
	第45期計算期間 (平成22年9月21日)	40円
	第46期計算期間 (平成22年10月20日)	40円

特定期間	決算期	1万口当たりの分配金
第9期特定期間	第47期計算期間 (平成22年11月22日)	40円
	第48期計算期間 (平成22年12月20日)	40円
	第49期計算期間 (平成23年1月20日)	40円
	第50期計算期間 (平成23年2月21日)	40円
	第51期計算期間 (平成23年3月22日)	40円
	第52期計算期間 (平成23年4月20日)	40円
第10期特定期間	第53期計算期間 (平成23年5月20日)	40円
	第54期計算期間 (平成23年6月20日)	40円
	第55期計算期間 (平成23年7月20日)	40円
	第56期計算期間 (平成23年8月22日)	40円

	第57期計算期間 (平成23年9月20日)	40円
	第58期計算期間 (平成23年10月20日)	20円
第11期特定期間	第59期計算期間 (平成23年11月21日)	20円
	第60期計算期間 (平成23年12月20日)	20円
	第61期計算期間 (平成24年1月20日)	20円
	第62期計算期間 (平成24年2月20日)	20円
	第63期計算期間 (平成24年3月21日)	20円
	第64期計算期間 (平成24年4月20日)	20円

【収益率の推移】

特定期間	決算期	収益率
第1期特定期間	第1期計算期間 (平成19年1月22日)	8.2%
	第2期計算期間 (平成19年2月20日)	2.3%
	第3期計算期間 (平成19年3月20日)	2.3%
	第4期計算期間 (平成19年4月20日)	2.1%
第2期特定期間	第5期計算期間 (平成19年5月21日)	1.8%
	第6期計算期間 (平成19年6月20日)	0.3%
	第7期計算期間 (平成19年7月20日)	1.4%
	第8期計算期間 (平成19年8月20日)	9.9%
	第9期計算期間 (平成19年9月20日)	4.7%
	第10期計算期間 (平成19年10月22日)	1.1%
第3期特定期間	第11期計算期間 (平成19年11月20日)	3.6%
	第12期計算期間 (平成19年12月20日)	1.1%
	第13期計算期間 (平成20年1月21日)	8.1%
	第14期計算期間 (平成20年2月20日)	1.7%
	第15期計算期間 (平成20年3月21日)	5.1%
	第16期計算期間 (平成20年4月21日)	6.7%

第4期特定期間	第17期計算期間 (平成20年5月20日)	1.3%
	第18期計算期間 (平成20年6月20日)	2.1%
	第19期計算期間 (平成20年7月22日)	3.1%
	第20期計算期間 (平成20年8月20日)	0.3%
	第21期計算期間 (平成20年9月22日)	2.2%
	第22期計算期間 (平成20年10月20日)	20.9%

特定期間	決算期	収益率
第5期特定期間	第23期計算期間 (平成20年11月20日)	14.8%
	第24期計算期間 (平成20年12月22日)	8.3%
	第25期計算期間 (平成21年1月20日)	4.2%
	第26期計算期間 (平成21年2月20日)	4.7%
	第27期計算期間 (平成21年3月23日)	3.6%
	第28期計算期間 (平成21年4月20日)	9.9%
第6期特定期間	第29期計算期間 (平成21年5月20日)	1.5%
	第30期計算期間 (平成21年6月22日)	3.2%
	第31期計算期間 (平成21年7月21日)	1.0%
	第32期計算期間 (平成21年8月20日)	4.6%
	第33期計算期間 (平成21年9月24日)	2.6%
	第34期計算期間 (平成21年10月20日)	0.1%
第7期特定期間	第35期計算期間 (平成21年11月20日)	3.4%
	第36期計算期間 (平成21年12月21日)	2.3%
	第37期計算期間 (平成22年1月20日)	4.1%
	第38期計算期間 (平成22年2月22日)	2.2%
	第39期計算期間 (平成22年3月23日)	2.9%
	第40期計算期間 (平成22年4月20日)	3.5%
	第41期計算期間 (平成22年5月20日)	4.3%
	第42期計算期間 (平成22年6月21日)	0.1%

第8期特定期間	第43期計算期間 (平成22年7月20日)	4.0%
	第44期計算期間 (平成22年8月20日)	0.6%
	第45期計算期間 (平成22年9月21日)	3.3%
	第46期計算期間 (平成22年10月20日)	1.1%

特定期間	決算期	収益率
第9期特定期間	第47期計算期間 (平成22年11月22日)	3.1%
	第48期計算期間 (平成22年12月20日)	0.9%
	第49期計算期間 (平成23年1月20日)	1.4%
	第50期計算期間 (平成23年2月21日)	2.8%
	第51期計算期間 (平成23年3月22日)	3.5%
	第52期計算期間 (平成23年4月20日)	2.0%
第10期特定期間	第53期計算期間 (平成23年5月20日)	0.5%
	第54期計算期間 (平成23年6月20日)	2.9%
	第55期計算期間 (平成23年7月20日)	1.3%
	第56期計算期間 (平成23年8月22日)	7.5%
	第57期計算期間 (平成23年9月20日)	0.1%
	第58期計算期間 (平成23年10月20日)	1.4%
第11期特定期間	第59期計算期間 (平成23年11月21日)	1.0%
	第60期計算期間 (平成23年12月20日)	0.8%
	第61期計算期間 (平成24年1月20日)	2.7%
	第62期計算期間 (平成24年2月20日)	6.0%
	第63期計算期間 (平成24年3月21日)	5.4%
	第64期計算期間 (平成24年4月20日)	1.9%

(注1) 収益率とは、各計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を基準とした、各計算期間末の基準価額（分配付き）の上昇（または下落）率をいいます。なお、第1期計算期間の収益率は、1万口当たりの当初元本を基準に算出しています。

(注2) 収益率は小数第2位を四捨五入しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

特定期間	計算期間	設定口数	解約口数
第1期特定期間	第1期計算期間	29,127,812,000□	46,550,000□
	第2期計算期間	4,064,130,486□	66,080,000□
	第3期計算期間	3,689,597,279□	263,233,663□
	第4期計算期間	6,358,819,780□	378,400,000□
第2期特定期間	第5期計算期間	9,269,829,054□	476,460,000□
	第6期計算期間	6,384,553,821□	688,003,187□
	第7期計算期間	4,163,523,649□	597,021,722□
	第8期計算期間	5,001,898,220□	439,121,134□
	第9期計算期間	5,666,297,435□	941,729,104□
	第10期計算期間	3,909,477,753□	771,647,859□
第3期特定期間	第11期計算期間	2,677,910,132□	1,066,470,211□
	第12期計算期間	1,914,581,223□	2,168,049,067□
	第13期計算期間	2,008,886,564□	1,755,933,055□
	第14期計算期間	699,668,119□	2,417,664,794□
	第15期計算期間	284,997,988□	2,929,990,216□
	第16期計算期間	256,345,950□	3,375,209,669□
第4期特定期間	第17期計算期間	191,379,568□	2,425,402,684□
	第18期計算期間	302,720,741□	2,923,993,165□
	第19期計算期間	158,931,559□	2,569,806,744□
	第20期計算期間	123,339,261□	2,686,566,494□
	第21期計算期間	170,941,702□	5,612,165,475□
	第22期計算期間	47,933,051□	3,490,344,106□
第5期特定期間	第23期計算期間	35,982,850□	2,310,759,055□
	第24期計算期間	24,615,235□	1,747,654,724□
	第25期計算期間	35,597,327□	2,401,959,778□
	第26期計算期間	22,172,521□	2,027,789,954□
	第27期計算期間	31,155,517□	1,944,239,792□
	第28期計算期間	26,820,693□	1,385,793,758□
第6期特定期間	第29期計算期間	58,079,355□	1,213,699,895□
	第30期計算期間	55,997,164□	1,468,348,371□
	第31期計算期間	64,547,543□	1,271,173,862□
	第32期計算期間	56,044,330□	1,036,709,184□
	第33期計算期間	17,661,973□	1,105,264,521□
	第34期計算期間	9,807,960□	945,330,291□

特定期間	計算期間	設定口数	解約口数
	第35期計算期間	16,684,154□	1,097,560,550□
	第36期計算期間	11,358,526□	739,344,963□
	第37期計算期間	9,223,463□	635,757,120□

第7期特定期間	第38期計算期間	9,782,730□	1,217,945,078□
	第39期計算期間	9,222,907□	965,532,467□
	第40期計算期間	9,198,291□	637,336,534□
第8期特定期間	第41期計算期間	10,024,802□	567,969,484□
	第42期計算期間	10,430,453□	583,256,830□
	第43期計算期間	10,006,260□	629,212,816□
	第44期計算期間	10,182,484□	632,096,979□
	第45期計算期間	7,690,526□	585,626,420□
	第46期計算期間	16,473,104□	512,523,342□
第9期特定期間	第47期計算期間	8,269,116□	487,420,976□
	第48期計算期間	8,828,792□	473,499,743□
	第49期計算期間	46,507,351□	374,625,503□
	第50期計算期間	15,294,434□	364,751,950□
	第51期計算期間	7,069,586□	307,262,836□
	第52期計算期間	7,324,872□	255,374,005□
第10期特定期間	第53期計算期間	7,699,282□	250,086,367□
	第54期計算期間	7,345,087□	504,533,372□
	第55期計算期間	13,415,043□	437,375,357□
	第56期計算期間	9,900,742□	312,572,862□
	第57期計算期間	8,291,489□	254,719,090□
	第58期計算期間	8,619,025□	284,111,718□
第11期特定期間	第59期計算期間	5,555,467□	1,142,375,874□
	第60期計算期間	4,774,303□	617,474,867□
	第61期計算期間	3,813,801□	324,749,983□
	第62期計算期間	3,499,496□	422,073,371□
	第63期計算期間	3,273,577□	440,844,418□
	第64期計算期間	3,212,426□	176,608,380□

(注) 第1期計算期間の設定口数には、当初申込期間の販売口数を含みます。

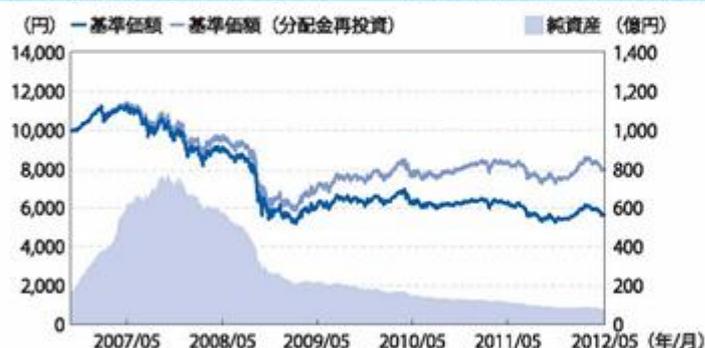
< 参考情報 >

運用実績

新光7資産バランスファンド 愛称：七重奏

2012年5月31日現在

<基準価額・純資産の推移> (2006年10月31日～2012年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。換金時の費用・税金などは考慮していません。
 ※基準価額(分配金再投資)は、取引日の分配金を当ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のもの
 あり、実際の基準価額とは異なります。
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

<分配の推移>

2012年5月	20円
2012年4月	20円
2012年3月	20円
2012年2月	20円
2012年1月	20円
直近1年累計	320円
設定来累計	2,380円

※分配は1万口当たり・税引前の金額です。
 ※分配の推移は、将来の分配の水準を示唆・保証するものではありません。分配が行われない場合
 もあります。

<主要な資産の状況>

組入状況

ファンド名	純資産比率
新光日本債券インデックスマザーファンド	15.15%
海外国債マザーファンド	14.40%
新光J-REITマザーファンド	14.13%
フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	14.07%
新光米国REITマザーファンド	13.57%
新光外国株式インデックスマザーファンド	13.52%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	13.24%
合計	98.11%

国内株式の組入上位5銘柄 (ニュー トピックス インデックス マザーファンド)

銘柄名	業種	純資産比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.81%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.46%
本田技研工業	輸送用機器	2.05%
キヤノン	電気機器	1.89%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.66%

※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、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

国内債券の組入上位5銘柄 (新光日本債券インデックスマザーファンド)

銘柄名	償還日	利率	純資産比率
第273回利付国債(10年)	2015/09/20	1.500%	2.55%
第270回利付国債(10年)	2015/06/20	1.300%	1.77%
第263回利付国債(10年)	2014/09/20	1.600%	1.77%
第269回利付国債(10年)	2015/03/20	1.300%	1.77%
第290回利付国債(10年)	2018/03/20	1.400%	1.69%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

国内REITの組入上位5銘柄 (新光J-REITマザーファンド)

銘柄名	純資産比率
日本ビルファンド投資法人	12.62%
ジャパリアルエステイト投資法人	10.95%
日本リテールファンド投資法人	6.68%
ユナイテッド・アーバン投資法人	5.14%
森トラスト総合リート投資法人	4.65%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

・当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・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。
 ・最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認ください。

15

運用実績

2012年5月31日現在

外国株式等の組入上位5銘柄（新光外国株式インデックスマザーファンド）

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	2.47%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.75%
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.05%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.02%
GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	資本財	0.92%

※世界産業分類基準(GICS)にしたがって記載しています。
 ※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

外国債券の組入上位5銘柄（海外国債マザーファンド）

銘柄名	償還日	利率	通貨	純資産比率
US TREASURY N/B	2020/11/15	2.625%	米ドル	3.88%
US TREASURY N/B	2022/02/15	2.000%	米ドル	3.87%
US TREASURY N/B	2021/11/15	2.000%	米ドル	3.87%
US TREASURY N/B	2020/02/15	3.625%	米ドル	3.76%
US TREASURY N/B	2021/08/15	2.125%	米ドル	3.43%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの状況（現地5月14日現在）

①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	55.9%
ユーロ	12.1%
ブラジルレアル	3.9%
メキシコペソ	3.5%
トルコリラ	3.3%

②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
ナイジェリア	7.4%
ロシア	6.6%
ヨルダン	4.6%
トリニダード・トバゴ	4.3%
グルジア	4.2%

※フランクリン・テンブルトン・インベストメント・マネジメント・リミテッドからの情報を基に作成しております。
 ※比率はフランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

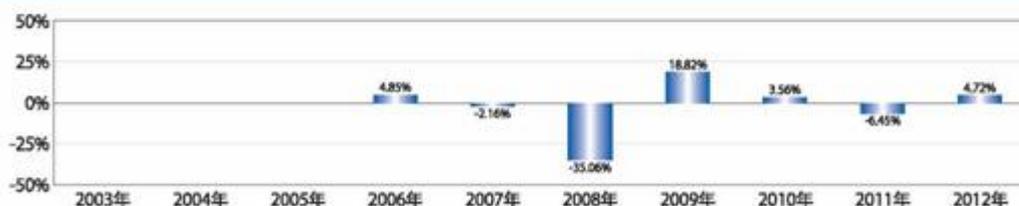
米国REITの組入上位5銘柄（新光米国REITマザーファンド）

銘柄名	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	9.67%
AMERICAN TOWER CORPORATION	5.73%
EQUITY RESIDENTIAL	3.96%
PUBLIC STORAGE	3.78%
VENTAS INC	3.67%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

<年間収益率の推移>

暦年ベース



※根拠の分配金を単純に合算して計算しています。
 ※当ファンドにはベンチマークがありません。
 ※2006年については、設定時から12月末までの収益率を記載しています。
 ※2012年については、年初から5月末までの収益率を記載しています。

・当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・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。
 ・最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認ください。

16

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」にかかる記載を更新します。

<更新後>

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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期特定期間（平成23年10月21日から平成24年4月20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】

新光7資産バランスファンド 財務諸表

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期特定期間末 (平成23年10月20日現在)	第11特定期間末 (平成24年4月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	131,028,064	100,201,082
投資信託受益証券	1,349,245,000	1,167,574,500
親投資信託受益証券	7,826,981,442	7,128,610,030
未収入金	100,000,000	50,000,000
未収利息	211	136
流動資産合計	9,407,254,717	8,446,385,748
資産合計	9,407,254,717	8,446,385,748
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	34,263,676	28,063,681
未払解約金	34,242,717	15,769,664
未払受託者報酬	648,808	588,116
未払委託者報酬	7,055,773	6,395,776
その他未払費用	22,455	18,737
流動負債合計	76,233,429	50,835,974
負債合計	76,233,429	50,835,974
純資産の部		
元本等		
元本	17,131,838,426	14,031,840,603
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	7,800,817,138	5,636,290,829
(分配準備積立金)	144,545,780	139,542,865
元本等合計	9,331,021,288	8,395,549,774
純資産合計	9,331,021,288	8,395,549,774
負債純資産合計	9,407,254,717	8,446,385,748

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期特定期間 自平成23年 4月21日 至平成23年10月20日	第11期特定期間 自平成23年10月21日 至平成24年 4月20日
営業収益		
受取配当金	117,720,000	108,450,000
受取利息	37,120	31,952
有価証券売買等損益	1,167,974,864	912,920,088
営業収益合計	1,050,217,744	1,021,402,040
営業費用		
受託者報酬	4,515,165	3,606,644
委託者報酬	49,102,385	39,222,246
その他費用	219,564	178,834
営業費用合計	53,837,114	43,007,724
営業利益	1,104,054,858	978,394,316
経常利益	1,104,054,858	978,394,316
当期純利益	1,104,054,858	978,394,316
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	8,903,429	24,345,122
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,105,594,850	7,800,817,138
剰余金増加額又は欠損金減少額	817,593,453	1,399,773,363
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	817,593,453	1,399,773,363
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,298,674	10,659,048
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,298,674	10,659,048
分配金	395,365,638	178,637,200
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,800,817,138	5,636,290,829

(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11期特定期間 自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額 に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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。

(追加情報)

第10期特定期間 自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	第11期特定期間 自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
当特定期間の期首以後に行われる会計上の変更及び 誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に 関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4 日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計 基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平 成21年12月4日）を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

第10期特定期間末 [平成23年10月20日現在]	第11期特定期間末 [平成24年 4月20日現在]
1. 特定期間末における受益権の総数 17,131,838,426口	1. 特定期間末における受益権の総数 14,031,840,603口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定 する額 元本の欠損 7,800,817,138円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定 する額 元本の欠損 5,636,290,829円
3. 特定期間末における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.5447円 (1万口当たり純資産額) (5,447円)	3. 特定期間末における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.5983円 (1万口当たり純資産額) (5,983円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第10期特定期間 自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	第11期特定期間 自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
分配金の計算過程	(1) 第53期計算期間（平成23年4月21日 から平成23年5月20日まで） 計算期間末における費用控除後の 配当等収益（35,325,472円）、費用 控除後、繰越欠損金補填後の有価証 券売買等損益（0円）、信託約款に定 める収益調整金（88,175,049円）及 び分配準備積立金（267,007,927 円）より分配対象収益は 390,508,448円（1万口当たり206.85 円）であり、うち75,510,317円（1万 口当たり40円）を分配して おります。	(1) 第59期計算期間（平成23年10月21日 から平成23年11月21日まで） 計算期間末における費用控除後の 配当等収益（26,958,562円）、費用 控除後、繰越欠損金補填後の有価証 券売買等損益（0円）、信託約款に定 める収益調整金（3,268,661円）及 び分配準備積立金（135,793,632 円）より分配対象収益は 166,020,855円（1万口当たり103.78 円）であり、うち31,990,036円（1万 口当たり20円）を分配して おります。

<p>(2) 第54期計算期間（平成23年5月21日から平成23年6月20日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,839,978円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（67,569,677円）及び分配準備積立金（239,996,052円）より分配対象収益は336,405,707円（1万口当たり183.02円）であり、うち73,521,564円（1万口当たり40円）を分配しております。</p> <p>(3) 第55期計算期間（平成23年6月21日から平成23年7月20日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（41,853,133円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（48,220,944円）及び分配準備積立金（209,133,684円）より分配対象収益は299,207,761円（1万口当たり166.62円）であり、うち71,825,723円（1万口当たり40円）を分配しております。</p>	<p>(2) 第60期計算期間（平成23年11月22日から平成23年12月20日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,807,107円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（3,184,283円）及び分配準備積立金（126,414,538円）より分配対象収益は158,405,928円（1万口当たり102.97円）であり、うち30,764,634円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(3) 第61期計算期間（平成23年12月21日から平成24年1月20日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（35,941,508円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（3,151,700円）及び分配準備積立金（122,138,344円）より分配対象収益は161,231,552円（1万口当たり107.03円）であり、うち30,122,762円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>
---	--

区 分	第10期特定期間 自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	第11期特定期間 自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
分配金の計算過程	<p>(4) 第56期計算期間（平成23年7月21日から平成23年8月22日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,601,041円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（29,867,999円）及び分配準備積立金（194,181,668円）より分配対象収益は252,650,708円（1万口当たり143.10円）であり、うち70,615,034円（1万口当たり40円）を分配しております。</p> <p>(5) 第57期計算期間（平成23年8月23日から平成23年9月20日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（30,264,834円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（12,127,622円）及び分配準備積立金（167,630,653円）より分配対象収益は210,023,109円（1万口当たり120.64円）であり、うち69,629,324円（1万口当たり40円）を分配しております。</p> <p>(6) 第58期計算期間（平成23年9月21日から平成23年10月20日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（43,663,556円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（3,448,632円）及び分配準備積立金（135,145,900円）より分配対象収益は182,258,088円（1万口当たり106.37円）であり、うち34,263,676円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>	<p>(4) 第62期計算期間（平成24年1月21日から平成24年2月20日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（31,366,157円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（3,094,725円）及び分配準備積立金（124,727,374円）より分配対象収益は159,188,256円（1万口当たり108.70円）であり、うち29,285,614円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(5) 第63期計算期間（平成24年2月21日から平成24年3月21日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（34,646,633円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（3,031,805円）及び分配準備積立金（123,271,009円）より分配対象収益は160,949,447円（1万口当たり113.29円）であり、うち28,410,473円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(6) 第64期計算期間（平成24年3月22日から平成24年4月20日まで） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（39,420,695円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（3,028,892円）及び分配準備積立金（128,185,851円）より分配対象収益は170,635,438円（1万口当たり121.59円）であり、うち28,063,681円（1万口当たり20円）を分配しております。</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10期特定期間 自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	第11期特定期間 自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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。 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。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	コンプライアンス部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。 また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。 市場リスク 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。 信用リスク 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。 流動性リスク 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

第10期特定期間末 [平成23年10月20日現在]	第11期特定期間末 [平成24年 4月20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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 投資信託受益証券及び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。	2. 時価の算定方法 投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	第10期特定期間 自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	第11期特定期間 自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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10期特定期間末 [平成23年10月20日現在]	第11期特定期間末 [平成24年 4月20日現在]
期首元本額	19,119,966,524円	17,131,838,426円
期中追加設定元本額	55,270,668円	24,129,070円
期中一部解約元本額	2,043,398,766円	3,124,126,893円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	第10期特定期間末 [平成23年10月20日現在]	第11期特定期間末 [平成24年 4月20日現在]
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	51,186,000	41,338,500
親投資信託受益証券	100,836,535	135,355,874
合 計	152,022,535	176,694,374

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

種 類	第10期特定期間末 [平成23年10月20日現在]	第11期特定期間末 [平成24年 4月20日現在]
	該当事項はありません。	同左

(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

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
投資信託 受益証券	フランクリン・templton・フロンティア・ エマージング・マーケット・デット・ファンド	190,500	1,167,574,500	
投資信託受益証券小計		190,500	1,167,574,500	
親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	806,195,141	1,205,503,594	
	ニュー トピックス インデックス マザーファン ド	1,233,217,292	1,155,031,315	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	1,276,041,083	1,164,259,884	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	1,030,985,365	1,162,951,491	
	新光J - R E I Tマザーファンド	1,658,164,064	1,254,732,747	
	新光米国R E I Tマザーファンド	1,665,446,503	1,186,130,999	
親投資信託受益証券小計		7,670,049,448	7,128,610,030	
有 価 証 券 合 計		-	8,296,184,530	

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。

(参考情報)

当ファンドは、「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」、「海外国債マザーファンド」、「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」、「新光J - 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「投資信託受益証券」は、すべて「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」の受益証券であり、「親投資信託受益証券」は、「海外国債マザーファンド」、「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」、「新光J - 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」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。

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

「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」は、ケイマン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの2011年11月30日に終了した半年間に対する財務書類は、国際財務報告基準に従い作成されておりますが、独立監査人の監査を受けておりません。

同ファンドの財政状態計算書、包括利益計算書、持分変動計算書、キャッシュ・フロー計算書及び財務書類に対する注記は、同ファンドの受託会社であるB N Y ファンド・マネジメント（ケイマン）リミテッドから入手し

た財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋したものであります。

(1) 財政状態計算書（無監査）

2011年11月30日現在

	注記	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
資産			
流動資産			
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	4	40,356,313,119	46,374,823,350
償還可能受益証券の保有者に対する債権		519,650,916	-
ブローカーに対する債権		-	243,210,587
現金および現金同等物	6	5,631,234,979	439,549,887
資産合計		46,507,199,014	47,057,583,824
資本			
当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および 剰余金	8	46,015,102,572	46,542,655,146
負債			
流動負債			
償還可能受益証券の保有者に対する債務		261,142,440	-
ブローカーに対する債務		188,615,421	464,623,410
未払費用	7	42,338,581	50,305,268
負債合計		492,096,442	514,928,678
資本および負債合計		46,507,199,014	47,057,583,824

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

(2) 包括利益計算書（無監査）

2011年11月30日に終了した半年間

	注記	2011年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2010年11月30日に 終了した半年間 (日本円)
収益			
保管受託銀行に預けた預金からの受取利息		82,512	23
為替差損純額		(60,950,410)	(44,041,792)
純損益を通じて公正価値で測定する金融 資産に係る公正価値のその他の純変動額		(4,234,580,623)	829,293,108
純（損失）／収益合計		(4,295,448,521)	785,251,339
費用			
運用報酬	10	88,326,280	122,054,056
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	10	23,048,823	28,202,699
保管受託銀行報酬	10	6,542,966	9,557,681
当座借越利息		-	1,356
その他の営業費用		2,385,128	2,351,702
営業費用合計		120,303,197	162,167,494
税引前（損失）／利益		(4,415,751,718)	623,083,845
源泉税		-	-
当期（損失）／利益		(4,415,751,718)	623,083,845
その他の包括利益			
包括（損失）／利益合計		(4,415,751,718)	623,083,845

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

(3) 持分変動計算書（無監査）

2011年11月30日に終了した半年間

注記	2011年11月30日に 終了した半年間 合計		2010年11月30日に 終了した半年間 合計	
	受益証券 口数	(日本円)	受益証券 口数	(日本円)
半年間の期首残高	6,567,000	46,542,655,146	9,465,500	70,448,088,226
半年間の包括利益合計	-	(4,415,751,718)	-	623,083,845
半年間の分配金	9	(3,681,794,970)	-	(3,557,820,000)
受益証券の発行	1,454,406	8,960,395,063	-	-
受益証券の償還	(212,985)	(1,390,400,949)	(1,932,500)	(14,155,238,000)
半年間の期末残高	7,808,421	46,015,102,572	7,533,000	53,358,114,071

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

(4) キャッシュ・フロー計算書（無監査）

2011年11月30日に終了した半年間

注記	2011年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2010年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	
営業活動によるキャッシュ・フロー			
包括利益合計	(4,415,751,718)	623,083,845	
- 受取利息	(82,512)	(23)	
- 支払利息	-	1,356	
運転資本変動前営業キャッシュ・フロー	(4,415,834,230)	623,085,178	
営業資産および負債の変動			
- プローカーに対する債権の減少	243,210,587	1,436,351,776	
- プローカーに対する債務の減少	(276,007,989)	(1,274,898,162)	
- 未払費用の減少	(7,966,687)	(21,866,595)	
- 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産の減少	6,018,510,231	16,245,953,378	
営業によるキャッシュ	1,561,911,912	17,008,625,575	
利息の受取額	82,512	23	
営業活動による正味キャッシュ収入	1,561,994,424	17,008,625,598	
財務活動によるキャッシュ・フロー			
償還可能受益証券の保有者に対する支払分配金	(3,681,794,970)	(3,557,820,000)	
受益証券の発行による収入	8,440,744,147	-	
受益証券の償還による支払	(1,129,258,509)	(15,272,438,000)	
利息の支払額	-	(1,356)	
財務活動による正味キャッシュ支出	3,629,690,668	(18,830,259,356)	
現金および現金同等物の純増加 / (減少) 額	5,191,685,092	(1,821,633,758)	
現金および現金同等物の半年間の期首残高	439,549,887	1,902,845,675	
現金および現金同等物の半年間の期末残高	6	5,631,234,979	81,211,917

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

（５）財務書類に対する注記（無監査）

2011年11月30日に終了した半年間

本注記は、添付の財務書類の不可分の一部であり、財務書類と併せて読むのが望ましい。

1 一般的情報

フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド（以下「当ファンド」という。）は、ケイマン諸島で設立され、籍を置いている。当ファンドの登記上の事務所の住所は、ケイマン諸島、PO Box 31371, Regatta Office Park, Windward #1, 1st Floor, Grand Cayman KY1 - 1206である。当ファンドは、2006年3月8日に設定され、2006年4月3日に営業を開始した。

当ファンドは、償還可能受益証券の保有者のために、新興国が発行する上場および非上場のソブリン債および準ソブリン債に投資することで、高利回りおよび長期的な資本の増価を達成することを目標としている。

当ファンドの投資活動は、英国法に基づき設立された会社であるフランクリン テンプレトン インベストメント マネジメント リミテッド（以下「投資顧問会社」という。）により管理されている。BNY ファンド マネジメント（ケイマン）リミテッド（以下「受託会社」という。）が当ファンドの受託会社を務め、受託業務および管理事務代行業務を提供している。ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店が当ファンドの副管理事務代行会社に任命されている。ザ バンク オブ ニューヨーク メロン コーポレーションは受託会社の持株会社であり、当ファンドの保管受託銀行である。

本財務書類全体にわたり、資本金および剰余金と表記されているものはすべて、別途記載がない限り、当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金を指している。

当ファンドの受益証券は公開市場で取引されておらず、また、当ファンドは、公開市場における証券のいずれかのクラスの発行を目的とした、規制機関への財務書類の提出を行っていない。

BNY ファンド マネジメント（ケイマン）リミテッドが、当ファンドの受託会社および管理事務代行会社を務めている。受託会社は、副管理事務代行会社であるザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店に当ファンドの管理事務代行を委託している。

2 重要な会計方針の要約

本財務書類の作成に際して適用された主要な会計方針は以下のとおりである。これらの方針は、別途記載がない限り、表示されたすべての期間において首尾一貫して適用されている。

2.1 表示の基礎

本財務書類は、国際財務報告基準（以下「IFRS」という。）に準拠して作成されている。本財務書類は取得原価主義に基づき作成されているが、純損益を通じて公正価値で測定する保有金融資産および金融負債（デリバティブ金融商品を含む。）の再評価によって修正される。

IFRSに準拠したこれらの財務書類の作成には、当ファンドの会計方針を適用する過程で経営者に判断を行うことを要求されている。IFRSはまた、一定の重要な会計上の見積りおよび仮定の使用を要求している。

(a) 既存の基準に対する以下の修正は、2011年1月1日に発効している。

IAS第24号（改訂）「関連当事者についての開示」は、2009年11月に公表された。これは、2003年に公表されたIAS第24号「関連当事者についての開示」を置き換えるものである。IAS第24号（改訂）は、2011年1月1日以後開始する期間から強制適用になっている。早期適用は、全体または一部について認められている。改訂後の基準は、関連当事者の定義を明確かつ平易にしている。当ファンドは、2011年6月1日から当該改訂基準を適用した。当該改訂基準の採用は、追加開示をもたらさず、当ファンドの財政状態および包括利益に影響を及ぼさなかった。

(b)以下の基準は、公表済であるが、未発効であり、当ファンドは早期適用していない。

IFRS第9号「金融商品」は、2009年11月に公表された。この基準は、IAS第39号「金融商品：認識および測定」を置き換える過程の第1段階である。IFRS第9号は、金融資産の分類および測定に関する新しい要求を導入しており、当ファンドの金融資産の会計処理に影響を及ぼす可能性がある。当該基準は、2015年1月1日まで適用されないが、早期適用は可能である。当ファンドが投資を純損益を通じて公正価値で測定されているものとして分類し続けられると思われることから、この基準の適用は、当ファンドの財政状態および業績に重要な影響を及ぼさないと見込まれる。

IFRS第13号「公正価値測定」は、2011年5月に公表された。この基準は、公正価値の明確な定義、ならびにIFRS全体での使用のための公正価値測定および開示要求の単一の典拠を提供することによって、整合性を高め、かつ、複雑性を低減させることを意図している。当該基準は、2013年1月1日まで適用されないが、早期適用は可能である。この基準の適用は、当ファンドの財政状態および業績に重要な影響を及ぼさないと見込まれている。

2.2 外貨換算

(a) 機能通貨および表示通貨

当ファンドは、日本円をファンドの機能通貨としている。これは、日本が、当ファンドが資金を調達しエクスポージャーを有する主たる経済環境であるためである。本財務書類は、当ファンドの機能通貨および表示通貨である日本円で表示されている。

(b) 取引および残高

外貨建取引は、取引日現在の実勢為替レートを使用して日本円に換算される。外貨建取引の決済から、および外貨建金融資産・負債の期末換算レートによる換算から生じた為替差損益は、包括利益計算書に認識される。

2.3 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産

(a) 分類

当ファンドは、負債証券、ワラントおよびクレジット・リンク債に対する投資を、純損益を通じて公正価値で測定する金融資産として分類している。これらの金融資産は、主として短期間に売却を行う目的で取得しており、売買目的で保有している。当ファンドはデリバティブをヘッジ関係におけるヘッジとして指定していないため、デリバティブもまた、売買目的保有として分類されている。

(b) 認識 / 認識の中止

通常の方法による投資の購入および売却は、当ファンドが投資を購入または売却することを確約した日である取引日に認識される。投資からのキャッシュ・フローを受け取る権利が消滅したか、または当ファンドが所有に係るリスクおよび経済価値をほとんどすべて移転している場合、投資は認識の中止が行われる。

(c) 測定

純損益を通じて公正価値で測定する金融資産は、当初、公正価値で認識される。取引費用は、包括利益計算書に費用計上される。当初認識後、純損益を通じて公正価値で測定する金融資産はすべて、公正価値で測定される。

「純損益を通じて公正価値で測定する金融資産」の公正価値の変動により生じた利益および損失は、発生した年度の包括利益計算書に表示される。純損益を通じて公正価値で測定する金融資産からの受取利息は、包括利益計算書の「純損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る公正価値のその他の純変動額」に認識される。

(d) 公正価値の見積り

活発な市場で取引される金融商品の公正価値は、財政状態計算書日現在の取引市場価格に基づく。当ファンド

が保有する金融資産に使用される市場相場価格は、経過利息を考慮した期末の買呼値である。

活発な市場で取引されない金融商品の公正価値は、評価技法を使用して決定される。当ファンドは、様々な方法を使用し、各財政状態計算書日現在の市況に基づく仮定を行っている。使用される評価技法は、類似する最近の独立第三者間取引、割引キャッシュ・フロー分析、オプション価格算定モデルおよび市場参加者が一般に使用しているその他の評価技法の使用が含まれている。

2.4 金融商品の相殺

認識された金額を相殺する法的に強制力のある権利があり、かつ、純額で決済するかまたは資産の実現と負債の決済を同時に実行する意図がある場合には、金融資産と金融負債とを相殺し、純額を財政状態計算書に報告する。

2.5 ブローカーに対する債権および債務

ブローカーに対する債権および債務は、それぞれ、契約済であるが財政状態計算書日時点で決済も受渡もされていない、売却有価証券に関する債権および購入有価証券に関する未払金を表している。

これらの金額は、当初、公正価値で認識され、事後に、実効金利法を使用して償却原価（ブローカーに対する債権金額は減損引当金控除後）で測定される。ブローカーに対する債権金額の減損引当金は、当ファンドが関連するブローカーから債権を全額回収できない客観的証拠がある場合に設定される。ブローカーの重大な財政的困難、ブローカーが破産または財政的再編成に陥る可能性および支払不履行は、ブローカーに対する債権金額が減損している兆候とみなされる。金融資産または類似する金融資産のグループが、減損損失の結果として評価減された場合には、減損損失を測定する目的で将来キャッシュ・フローを割り引くのに使用した金利を用いて受取利息が認識される。

実効金利法は、金融資産または金融負債の償却原価を計算し、関係する期間に受取利息または支払利息を配分する方法である。実効金利は、金融商品の予想残存期間（場合によっては、より短い期間）を通じての、将来の現金支払額または受取額の見積額を、金融資産または金融負債の正味帳簿価額まで正確に割り引く利率である。実効金利を計算する際には、当ファンドは金融商品のすべての契約条件を考慮してキャッシュ・フローを見積るが、将来の貸倒損失を考慮しない。その計算には、実効金利の不可分の一部である契約当事者間で授受されるすべての手数料およびポイント、取引費用、ならびにその他のすべてのプレミアムまたはディスカウントが含まれる。

2.6 現金および現金同等物

現金および現金同等物は銀行預金で構成されている。

2.7 未払費用

未払費用は、当初、公正価値で認識され、事後に、実効金利法を使用して償却原価で表示される。

2.8 当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金

当ファンドの受益証券は、保有者の選択により償還可能であり、資本として分類されている。受益証券は、常時、当ファンドの資本金および剰余金の比例的な取り分に相当する現金と引き換えに、当ファンドに対する償還請求が可能である。

受益証券は、保有者の選択により、発行時または償還時の当ファンドの受益証券1口当たり資本金および剰余金に基づく価格で発行または償還される。当ファンドの受益証券1口当たり純資産額は、当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金を、流通済受益証券の合計口数で除することにより算定される。当ファンドの規則の条項に従い、投資ポジションは、募集および償還に関する受益証券1口当たり純資産額を決定する目的で、市場価格の仲値に基づき評価される。

2.9 受取利息

受取利息は、実効金利法を使用して時間比例基準で認識される。

2.10 償還可能受益証券の保有者に対する未払分配金

償還可能受益証券の保有者に対して提示された分配金は、受託会社によって承認された時点で持分変動計算書に認識される。これらの受益証券に係る分配金は、持分変動計算書に認識される。

2.11 課税

当ファンドはケイマン諸島に籍を置いている。

ケイマン諸島の現行法の下では、当ファンドは、収益、不動産、譲渡、売却およびその他に係るケイマン諸島の税金について支払義務はない。当ファンドは、一部の国々により投資収益に係る源泉税を課される可能性がある。このような収益は、包括利益計算書に源泉税込みの総額で計上される。

3 金融リスク管理

3.1 金融商品を利用する際の戦略

当ファンドは、投資取引に従事しており、その活動により様々な金融リスクにさらされている。当ファンドの金融リスク管理方針の実施に関する全責任は投資顧問会社にあるが、投資顧問会社は、特に金融市場が予測不可能であることに焦点を当て、当ファンドの財務業績に対する潜在的な悪影響を最小限にするよう努めている。

3.2 市場価格リスク

市場価格リスクは、主に、当ファンドが保有する純損益を通じて公正価値で測定する金融資産の将来価格の不確実性から生じる。これは、市場でポジションを保有することで、価格の変動により当ファンドが被る可能性のある潜在的損失を表している。当ファンドの活動の特性の直接的な結果、リターンを最大化を目指すために、市場リスクのエクスポージャーが取られることになる。しかし、トップダウンによるリスク管理により、国ごとに最大エクスポージャーを設定し（従って安全）、それによって該当リスクを制限することで、該当リスクが各有価証券および各市場に分散されるようにしている。その目的は、当ファンドが目論見書に規定されている投資方針を確実に遵守することによって達成される。投資方針の1つは、投資顧問会社が単一の発行体または単一の国/地域の有価証券に対して当ファンドの純資産額の20%を超えて投資することを禁じている。また、新興市場における国々は3つのリスクベースのカテゴリーに分類されており、カテゴリー1は最もリスクが低いとみなされ、カテゴリー3は最もリスクが高い。投資顧問会社の方針において、当ファンドの純資産額合計に基づき、カテゴリー1の国々への投資は単一の国/地域当たり最大16%、カテゴリー2は単一の国/地域当たり最大8%およびカテゴリー3は単一の国/地域当たり最大4%に制限されている。さらに、国債への投資は地域ベースで制限されている。この地域には、ラテンアメリカ、東欧、中東/アフリカおよび極東/アジアが含まれている。各地域に関する最大/最小エクスポージャーは10%から40%の範囲である。

当ファンドが保有する金融資産の市場価格は、当ファンドが主に新興市場のソブリンおよび準ソブリンが発行した上場および非上場債券に投資するため、金利変動のボラティリティの影響を大きく受ける。

市場リスク・エクスポージャーの監視に使用されている業界標準ツールの1つが、VaR（バリュー・アット・リスク）である。VaRは、異なる市場と相場（例えば金利と外国為替レート）の相関関係を考慮に入れて、過去のボラティリティおよび相関性の統計的分析に基づき、ポートフォリオの損失の確率を見積る。以下に示すVaRは、純資産額（NAV）に対する割合として表されたものであり、信頼水準99%、保有期間1ヶ月を基礎として、現金および未決済の売買を含む、ポートフォリオのポジションを考慮に入れている。VaRの見積りは、VaRモデルにより作成された多数のモンテカルロ・シミュレーションから導出されている。

投資顧問会社は、VaRがリスクに対する有益な指針であるものの、限界があることを認識している。将来の事象の見積りの代用として過去のデータを使用することで、すべての潜在的な事象が、特に将来における極端な事象が網羅されないことがある。例えば、当該モデルが、市場ストレス期間における市場流動性の著しい低下を完全に

予測できないことがあり、結果として、そのようなときに売買されたポートフォリオのポジションが、VaRの見積りに反映されていない重要な費用を負担することもあり得る。

VaRを使用して、信頼水準99%、保有期間1ヶ月として算定された、当ファンドの市場リスクは、2011年11月30日現在、10.188%または4,688,018,650円(2011年5月31日現在、8.458%または3,936,577,772円)である。

デリバティブ金融商品は、当ファンドの為替エクスポージャーをヘッジする目的で適宜利用される場合があり、一方、クレジット・リンク債は、基礎となる商品に対するエクスポージャーを創出するために許容制限内で利用される場合がある。目論見書に規定されているとおり、投資顧問会社はクレジット・リンク債に対して当ファンドの純資産額の20%を超える投資は行わない。

当ファンドは、原油ワラントまたは原油価格連動型債務支払証書(以下「OIPO」という。)にも投資を行っている。これらのOIPOは相対的に流動性が低いため、有価証券の価格が毎日定期的に変動しないことから、リスクの見積りおよび感応性分析は困難になる。かかる統計情報の不足を考慮した場合、これらの資産に対する当ファンドのリスク・エクスポージャーの定量化に最適な方法は、レビュー半年間における月次総利回りの最大値、最小値および中央値に着目することである。

以下の表は、当半年間の月次総利回りの中央値、最小値および最大値を受けた資本金および剰余金の変動を説明したものである。

	資本金および剰余金の変動			
	2011年11月30日現在		2011年5月31日現在	
	(%)	(日本円)	(%)	(日本円)
<u>ナイジェリア原油ワラント</u>				
月次総利回り中央値	1.74	44,926,727	1.62	54,541,959
月次総利回り最小値	(5.78)	(149,239,358)	(1.62)	(54,541,959)
月次総利回り最大値	4.59	118,513,608	13.85	466,300,079
<u>ベネズエラ原油ワラント</u>				
月次総利回り中央値	1.21	20,442,209	1.95	34,633,150
月次総利回り最小値	(2.09)	(35,309,269)	(3.85)	(68,378,270)
月次総利回り最大値	6.95	117,415,991	6.95	123,436,097

3.3 金利リスク

当ファンドは、その利付金融資産および負債によって、財政状態およびキャッシュ・フローに関する市場金利の実勢水準の変動の影響および関連するリスクにさらされている。金利リスクは、当ファンドのリスクの重要な構成要素を表している。投資顧問会社は、当ファンドと同様に、総体的に個々の保有有価証券の修正デュレーションを監視している。投資顧問会社は、当ファンドの平均修正デュレーションが目論見書に規定されているとおり8年未満になるようにしている。以下の表は、金利リスクに対する当ファンドのエクスポージャーを要約したものである。表には、当ファンドの資産およびトレーディング負債が公正価値で含まれており、契約上の価格改定または満期日のいずれか早い方により分類されている。

	1ヶ月未満 (日本円)	1ヶ月以上 1年未満 (日本円)	1年以上 5年未満 (日本円)	5年以上 (日本円)	無利息 (日本円)	合計 (日本円)
2011年11月30日 現在						
資産						
純損益を通じて 公正価値で測定 する金融資産	5,922,836,665	4,134,256,610	10,666,627,929	15,361,157,376	4,271,434,539	40,356,313,119
償還可能受益証 券の保有者に対 する債権	-	-	-	-	519,650,916	519,650,916
現金および現金 同等物	5,631,234,979	-	-	-	-	5,631,234,979
資産合計	11,554,071,644	4,134,256,610	10,666,627,929	15,361,157,376	4,791,085,455	46,507,199,014

負債						
償還可能受益証券の保有者に対する債務	-	-	-	-	261,142,440	261,142,440
ブローカーに対する債務	-	-	-	-	188,615,421	188,615,421
未払費用	-	-	-	-	42,338,581	42,338,581
負債合計	-	-	-	-	492,096,442	492,096,442
金利感応度ギャップ合計	11,554,071,644	4,134,256,610	10,666,627,929	15,361,157,376	4,298,989,013	46,015,102,572

	1ヶ月未満 (日本円)	1ヶ月以上 1年未満 (日本円)	1年以上 5年未満 (日本円)	5年以上 (日本円)	無利息 (日本円)	合計 (日本円)
2011年5月31日現在						
資産						
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	6,129,545,169	5,576,670,905	13,246,228,219	16,279,532,526	5,142,846,531	46,374,823,350
ブローカーに対する債権	-	-	-	-	243,210,587	243,210,587
現金および現金同等物	439,549,887	-	-	-	-	439,549,887
資産合計	6,569,095,056	5,576,670,905	13,246,228,219	16,279,532,526	5,386,057,118	47,057,583,824
負債						
ブローカーに対する債務	-	-	-	-	464,623,410	464,623,410
未払費用	-	-	-	-	50,305,268	50,305,268
負債合計	-	-	-	-	514,928,678	514,928,678
金利感応度ギャップ合計	6,569,095,056	5,576,670,905	13,246,228,219	16,279,532,526	4,871,128,440	46,542,655,146

3.4 信用リスクおよび相手方リスク

当ファンドは、発行体または相手方が期日に全額を支払うことができなくなるリスクである信用リスクに対するエクスポージャーを引き受けている。当ファンドは、金融インフラが完全には整備されていない国々に投資する場合がある。その結果、当ファンドは、ブローカー、決済機関および取引所との取引に関するリスクを含む様々な信用リスクにさらされる。さらに、新興市場で発行された特定の有価証券の信用度は、評価が困難な場合がある。当ファンドはまた、相手方および保管機関に保有する資産が、これらの当事者が債務不履行となった場合には回収不能となるリスクにさらされている。

投資顧問会社は、承認されたブローカーおよびその他の評価の高い金融機関と取引することで、当ファンドの信用リスクを最小限に抑えている。当ファンドの金融資産もまた、定評のある承認された相手方により保管されている。

投資顧問会社は、各投資の信用格付を取引ベースで監視し、当ファンドが目論見書に規定されているとおりに投資方針を厳守することを確保している。これには、当ファンドが、当ファンドの純資産の10%を超えて、無格付の発行体、またはムーディーズもしくはスタンダード・アンド・プアーズのソブリン債信用格付が、それぞれ Caa1またはCCC+ と同等かそれより低い発行体の有価証券には投資しないこと、および当ファンドの有価証券の平均信用格付けが、最低でも、ムーディーズによる評価ではB1またはスタンダード・アンド・プアーズによる評価ではB+ であることの確保が含まれている。

格付（ムーディーズ/スタンダード・アンド・プアーズ）	2011年11月30日現在 純損益を通じて公正価値 で測定する金融資産の割 合 %	2011年5月31日現在 純損益を通じて公正価値 で測定する金融資産の割 合 %
Aaa / AAA	3.07	3.03
A3 / A-	1.89	-
Baa1 / BBB+	7.24	7.64
Baa2 / BBB	9.80	5.56
Baa3 / BBB-	11.00	17.09
Ba1 / BB+	6.56	4.45
Ba2 / BB	12.52	12.42
Ba3 / BB-	9.67	5.56
B1 / B+	11.69	14.35
B2 / B	15.59	16.28
B3 / B-	6.45	4.88
Caa1 / CCC+	-	2.30
Caa2 / CCC	2.39	2.54
D（スタンダード・アンド・プアーズのみ）	2.13	3.90
	<hr/> 100.00	<hr/> 100.00

投資顧問会社は、当ファンドが目論見書に規定されたとおりに投資方針を厳守することを確保するため、クレジット・リンク債発行体の信用格付を監視している。

2011年11月30日現在

発行体の格付 （ムーディーズ/スタンダード・アンド・プアーズ）	基礎となる企業の格付	純資産に対する割合 （%）
Aa3 / AA-	Baa2 / BBB	4.02
Aa3 / AA-	Ba3 / BB-	2.29
合計		<hr/> 6.30

2011年5月31日現在

発行体の格付 （ムーディーズ/スタンダード・アンド・プアーズ）	基礎となる企業の格付	
Aa2 / AA	Baa3 / BBB-	4.50
Aa3 / AA-	B2 / B+	2.99
合計		<hr/> 7.49

当半年間の信用補完考慮前の信用リスクに対する最大エクスポージャーは、金融資産の帳簿価額であり、以下のとおりである。

	2011年11月30日現在 （日本円）	2011年5月31日現在 （日本円）
債券	33,183,927,929	37,746,213,278
デリバティブ資産	7,172,385,190	8,628,610,072
償還可能受益証券の保有者に対する債権	519,650,916	-
その他の資産	-	243,210,587
現金および現金同等物	5,631,234,979	439,549,887
合計	<hr/> 46,507,199,014	<hr/> 47,057,583,824

以下に開示した利息および/または元本の支払が不履行となっている投資を除いて、当該資産のいずれも、減損しておらず、期日を経過しておらず減損もしていない。

	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
Astana Finance 7.785% 08/06/2010	318,783,207	717,888,563
Ivory Coast Republic 2.50% 31/12/2032	-	432,018,259
Sphynx Capital Markets 10.25% due 30/01/2010	540,337,738	660,560,281
	<u>859,120,945</u>	<u>1,810,467,103</u>

上記の投資は、不履行となっている支払を2011年11月30日現在の公正価値の考慮に入れている。

3.5 流動性リスク

当ファンドは日々、現金による受益証券の償還を行っている。そのため、当ファンドは、資産の大部分を活発な市場で取引され容易に処分可能な投資対象に投資している。当ファンドは、限られた割合の資産のみを活発に取引されていない投資対象に投資している。

受託会社は、投資顧問会社の助言による場合も含めて、当ファンドの利益のために合理的に決定する場合には、受益証券保有者の受益証券の償還請求の権利を一時停止すること、および/または償還金の支払を延期することが可能である。受益証券の償還を一時停止する場合、受益証券の償還は、一時停止終了後の最初の取引日に繰り延べられる。

また、受託会社は、取引日に償還される受益証券の合計口数を、取引日における発行済の受益証券の10%以上に制限することが可能である。

当ファンドは、借入金額が直前の評価日における純資産額の10%を超えない範囲で借入を行うことができる。当半年間中に借入は行われなかった。

当ファンドは適宜、店頭で取引されるデリバティブ商品（主にクレジット・リンク債）に投資する可能性がある。かかる商品は組織化されている市場で取引されておらず流動性が低い場合がある。その結果、当ファンドは、流動性のニーズを満たすため、または、特定の発行体の信用度の低下のような特別な事象に対応するために、これらの商品に対する投資を速やかに公正価値に近似する金額で換金することができない場合がある。

当ファンドの方針に従い、投資顧問会社は、日次ベースで当ファンドの流動性ポジションを監視している。

以下の表は、当ファンドの金融負債を、財政状態計算書日から契約上の満期日までの残存期間に基づき関連する満期でグルーピングして分析したものである。表中の金額は、契約上の割引前キャッシュ・フローである。

	1ヶ月未満 (日本円)	1ヶ月以上3ヶ月未満 (日本円)
2011年11月30日現在		
償還可能受益証券の保有者に対する債務	261,142,440	-
ブローカーに対する債務	188,615,421	-
未払費用	-	42,338,581
2011年5月31日現在		
ブローカーに対する債務	464,623,410	-
未払費用	-	50,305,268

3.6 為替リスク

当ファンドは、機能通貨である日本円以外の通貨建の資産を保有している。当ファンドは、為替レートの変動によりその他の通貨建の有価証券の価値が変動するため、為替リスクにさらされている。当ファンドは適宜、一定量の為替リスクを削減するため、為替変動をヘッジする為替予約、オプションまたは先物を利用する場合がある。

以下の表は、当ファンドの為替に対するエクスポージャーの要約である。

	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
資産		
ブラジル・レアル	1,847,966,967	2,093,439,086
ドイツ・マルク	1,193,126,697	1,494,537,461
ドミニカ・ペソ	915,025,905	990,947,893
ユーロ	4,844,684,312	6,233,040,661
ガーナ・セディ	1,183,410,355	1,385,738,573
日本円	5,885,980,865	-
メキシコ・ヌエボ・ペソ	1,583,586,678	1,968,329,194
ナイジェリア・ナイラ	115,617,996	-
セルビア・ディナール	502,766,296	576,356,760
ロシア・ルーブル	888,256,295	1,044,599,436
新トルコ・リラ	1,454,131,257	1,780,139,569
南アフリカ・ランド	762,101,513	1,339
ウガンダ・シリング	464,324,357	-
ウクライナ・フリヴニャ	-	104,173,851
ウルグアイ・ペソ	1,217,966,146	1,516,840,000
米ドル	22,408,812,779	26,462,163,264
ザンビア・クワチャ	1,239,440,596	1,407,276,737
資産合計	46,507,199,014	47,057,583,824
負債		
日本円	290,844,145	32,290,097
シンガポール・ドル	2,110,259	4,662,624
ウガンダ・シリング	145,833,776	-
米ドル	53,308,262	477,975,957
負債合計	492,096,442	514,928,678

当ファンドは、クレジット・リンク債の基礎となる為替に対してエクスポージャーを有している。以下の表は、エクスポージャーの要約である。

	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
クレジット・リンク債		
ブラジル・レアル	1,847,966,967	2,093,439,086
ユーロ	1,052,983,684	1,288,150,604
ウクライナ・フリヴニャ	-	104,173,851
クレジット・リンク債合計	2,900,950,651	3,485,763,541

3.7 自己資本リスク管理

当ファンドの自己資本は、当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金である。当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金の金額は、当ファンドが受益証券保有者の判断による購入申込および償還請求を日々受けるため、日次ベースで著しく変動する可能性がある。当ファンドの自己資本管理の目的は、受益証券保有者にリターンを、その他の証券の保有者に利益を提供するために、継続企業として存続する当ファンドの能力を保全すること、ならびに、当ファンドの投資活動の進展を支えるために、強固な自己資本基盤を維持することである。

自己資本構成を維持または調整するために、当ファンドは以下を実施する方針である。

- ・ 過剰売買に関しては、日々の購入申込および償還請求の水準を監視する。
- ・ 当ファンドの規約文書に従って、受益証券を償還する。これには、取引日現在、受益証券の償還合計口数を発行済受益証券の10%以上に制限する能力が含まれる。受益証券の償還がそのように制限された場合、受益証券は、受益証券保有者の間で比例償還され、償還されなかった受益証券は、同様の制限を条件として、次の取引日に償還が繰り越される。

3.8 公正価値の見積り

IFRS第7号は、当ファンドに、測定を行う際に使用されるインプットの重要性を反映した公正価値ヒエラルキーを用いて公正価値測定を分類することを要求している。公正価値ヒエラルキーには、以下のレベルがある。

- ・同一の資産または負債についての活発な市場における（未調整の）相場価格（レベル1）
- ・当該資産または負債について直接的に（すなわち価格として）または間接的に（すなわち価格から算出して）観察可能な、レベル1に含まれる相場価格以外のインプット（レベル2）
- ・当該資産または負債についての、観察可能な市場データに基づかないインプット（すなわち観察不能なインプット）（レベル3）

活発であるとみなされないが、観察可能なインプットによって裏付けられる市場相場価格、ディーラーの値付け、または代替的な価格決定の情報源に基づき評価される、市場で取引される金融商品は、レベル2に分類される。レベル2の投資は、活発な市場で取引されないポジションを含み、および/または譲渡制限が課されることから、評価額は流動性および/または譲渡不能性を反映して調整される場合があり、当該調整は通常、入手可能な市場の情報に基づいている。

当ファンドは、容易に入手可能な、定期的に頒布または更新される、信頼できかつ検証可能な、独占的でない市場データで、かつ、関連する市場に積極的に関わっている独立した情報源によって供給される市場データを、観察可能なデータとみなしている。

レベル3に分類されている投資は、取引が稀であるため、重要な観察不能のインプットを有する。当ファンドは、当初の取引価格、同一または類似の証券の最近の取引、ならびにその他の流動性リスク、信用リスクおよび市場リスクの要素を考慮している。当ファンドは、必要な場合には当該モデルを修正する。

レベル3のポジションに重要性がないことから、個別の感応度分析は実施されていない。代わりに、感応度分析は、その他の投資と共に注記3.2で実施されている。

以下の表は、半年間での公正価値で測定した当ファンドの金融資産および負債を（種類別に）公正価値ヒエラルキーの範囲内で分析したものである。

2011年11月30日現在

資産	レベル1 (日本円)	レベル2 (日本円)	レベル3 (日本円)	残高合計 (日本円)
売買目的金融資産：				
- 債券	-	32,101,219,280	1,082,708,649	33,183,927,929
- デリバティブ資産	-	7,172,385,190	-	7,172,385,190
資産合計	-	39,273,604,470	1,082,708,649	40,356,313,119

2011年5月31日現在

資産				
売買目的金融資産：				
- 債券	-	37,169,856,518	576,356,760	37,746,213,278
- デリバティブ資産	-	8,524,436,221	104,173,851	8,628,610,072
資産合計	-	45,694,292,739	680,530,611	46,374,823,350

以下の表は、2011年11月30日に終了した半年間に係るレベル3の商品の変動を示したものである。

	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
期首残高	680,530,611	109,774,332
購入	536,455,218	512,603,943
売却/償還	276,452,836	-

レベル3への振替	-	-
レベル3からの振替	-	-
包括利益計算書に認識された利益および損失合計	142,175,656	58,152,336
期末残高	1,082,708,649	680,530,611
半年間の期末保有資産に係る、包括利益計算書に含まれている半年間の利益または損失合計	142,175,656	58,152,336

4 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産

売買目的保有	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
原油ワラント	4,271,434,539	5,142,846,531
クレジット・リンク債	2,900,950,651	3,485,763,541
債券	33,183,927,929	37,746,213,278
売買目的保有合計	40,356,313,119	46,374,823,350

以下の表は保有する金融資産の要約である。

	2011年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2011年5月31日現在 公正価値 (日本円)
債券		
アルゼンチン		
Province Del Neuquen 8.656% due 18/10/2014 Series REGS	721,370,714	899,272,088
Province Del Neuquen 7.875% due 26/04/2021 REGS	232,648,581	251,913,005
アルゼンチン合計	954,019,295	1,151,185,093
アゼルバイジャン		
Intl Bank of Azerbaijan (Rebrika Finance) 8.5% due 22/10/2013 Series REGS	697,449,019	777,225,302
アゼルバイジャン合計	697,449,019	777,225,302
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina FRN due 11/12/2021	1,193,126,697	1,494,537,461
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	1,193,126,697	1,494,537,461
クロアチア		
Republic of Croatia 6.75% due 05/11/2019	422,714,584	527,095,696
クロアチア合計	422,714,584	527,095,696
ドミニカ共和国		
Dominican Republic 10.5% due 09/08/2013 Series REGS	915,025,905	990,947,893
Ege Haina Finance Company 9.5% due 26/04/2017 Series REG	376,902,358	521,716,389
ドミニカ共和国合計	1,291,928,263	1,512,664,282
エクアドル		
Republic of Ecuador 9.375% 15/12/2015 Series REGS	966,019,229	1,179,100,776
エクアドル合計	966,019,229	1,179,100,776
エジプト		
Arab Republic of Egypt 6.875% due 30/04/2040 Series REGS	387,536,790	465,073,429
エジプト合計	387,536,790	465,073,429

	2011年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2011年5月31日現在 公正価値 (日本円)
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	1,390,995,968	1,478,943,186
エルサルバドル合計	1,390,995,968	1,478,943,186
エストニア		
Eesti Energia AS,4.5% due 11/18/2020	455,131,757	530,591,310
エストニア合計	455,131,757	530,591,310
フィジー		
Fiji Republic of 6.875% due 13/09/2011	-	734,443,527
フィジー合計	-	734,443,527
グルジア		
Georgian Railway LLC 9.875% 22/07/2015	836,845,536	984,597,887
Republic of Georgia 6.875% 12/04/2021 REGS	962,416,970	1,016,652,402
グルジア合計	1,799,262,506	2,001,250,289
ガーナ		
Ghana Govt 13.67% due 15/06/2012	1,183,410,355	1,385,738,573
ガーナ合計	1,183,410,355	1,385,738,573
グレナダ		
Government of Grenada FRN due 15/09/2025 Series REGS	559,840,125	1,005,257,959
グレナダ合計	559,840,125	1,005,257,959
ハンガリー		
Hungarian Development Bank 5.875% 31/05/2016	730,247,402	965,098,218
ハンガリー合計	730,247,402	965,098,218
インド		
NTPC Ltd 5.625% 14/07/2021	351,885,643	-
Indian Oil Corp Ltd 5.625% 02/08/2021 REGS	425,596,350	-
インド合計	777,481,993	-
インドネシア		
Republic of Indonesia 11.625% 04/03/2019	-	546,761,646
インドネシア合計	-	546,761,646
イラク		
Republic of Iraq 5.8% due 15/01/2028	776,376,935	-
イラク合計	776,376,935	-
コートジボワール		
Sphynx Capital Markets 10.25% due 30/01/2010(Note 3.4)	540,337,738	660,560,281
Ivory Coast 2.50% due 31/12/2032 Series REGS(Note 3.4)	-	432,018,259
コートジボワール合計	540,337,738	1,092,578,540
ヨルダン		
Dev Inv Jordan Arm Force 6.14% due 16/12/2019	2,034,324,079	2,457,828,223
ヨルダン合計	2,034,324,079	2,457,828,223
カザフスタン		
Astana Finance 7.875% 08/06/2010(Note 3.4)	318,783,207	717,888,563

2011年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2011年5月31日現在 公正価値 (日本円)
--------------------------------	-------------------------------

Kazmunaigaz Finance SUB 11.75% due 23/01/2015 Series REGS カザフスタン合計	956,019,057 1,274,802,264	1,059,078,724 1,776,967,287
リトアニア Republic of Lithuania 6.125% 09/03/2021 REGS S リトアニア合計	688,381,988 688,381,988	- -
マケドニア FYR Macedonia 9.875% due 08/01/2013 マケドニア合計	772,364,261 772,364,261	953,510,625 953,510,625
メキシコ Mexican Bondes Desarroll FRN 15/01/2015 Series LD メキシコ合計	1,578,164,743 1,578,164,743	1,968,329,194 1,968,329,194
モンテネグロ Republic of Montenegro 7.875% due 14/09/2015 モンテネグロ合計	496,162,510 496,162,510	636,361,226 636,361,226
ナイジェリア Nigeria Treasury Bill 04/10/2012 ナイジェリア合計	115,617,996 115,617,996	- -
ロシア RSHB CAPTL (Russ AG BK) FRN 21/09/2016 Russian Federation 7.85% 10/03/2018 REGS Gaz Capital SA 9.25% due 23/04/2019 SER REGS RSHB Capital (Russ Agric BK) 6.00% 03/06/2021 REG S ロシア合計	- 888,256,295 854,685,198 562,714,843 2,305,656,336	554,827,679 1,044,599,436 1,554,121,155 467,178,839 3,620,727,109
セルビア Serbia Treasury Bill 06/09/2012 STRP Coupon セルビア合計	502,766,296 502,766,296	576,356,760 576,356,760
	2011年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2011年5月31日現在 公正価値 (日本円)
南アフリカ Republic of South Africa 8.00% 21/12/2018 南アフリカ合計	762,095,314 762,095,314	- -
国際機関 European Investment Bank 11.25% due 02/12/2011 series REGS African Development Bank 12.5% due 22/12/2011 Series EMTN 国際機関合計	422,593,085 816,847,511 1,239,440,596	467,860,379 939,416,358 1,407,276,737
トリニダード・トバゴ Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 Series REGS トリニダード・トバゴ合計	1,867,068,568 1,867,068,568	2,022,300,565 2,022,300,565
チュニジア Banque Cent de Tunisie 4.50% 22/06/2020 REG S チュニジア合計	416,127,235 416,127,235	480,879,834 480,879,834
トルコ Turkey Government Bond FRN 26/02/2014 Export Credit Bank of Turkey 5.375% 04/11/2016 REGS Turkey Government Bond FRN 04/01/2017	1,023,637,314 287,331,774 430,493,943	1,249,113,500 - 521,577,652

トルコ合計	1,741,463,031	1,770,691,152
ウクライナ		
Credit Susse (CITY KYIV) 8.25% 26/11/2012	649,787,742	741,059,057
City of Kyiv (CSFB) 8.00% 06/11/2015	240,400,437	321,196,971
State Savings Bank of Ukraine 8.25% due 10/03/2016	691,135,374	648,343,251
ウクライナ合計	1,581,323,553	1,710,599,279
ウルグアイ		
Republica Orient Uruguay 3.7% 26/06/2037	1,217,966,146	1,516,840,000
ウルグアイ合計	1,217,966,146	1,516,840,000
ウガンダ		
Uganda Treasury Bills 04/10/2012	162,575,427	-
Uganda Treasury Bills 19/04/2012	124,058,615	-
Uganda Treasury Bills 15/11/2012	31,856,539	-
Uganda Treasury Bills 29/11/2012	145,833,776	-
ウガンダ合計	464,324,357	-
債券合計	33,183,927,929	37,746,213,278
	2011年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2011年5月31日現在 公正価値 (日本円)
クレジット・リンク債		
アンゴラ		
Deutsche Bank AG FRN due 21/06/2016	1,052,983,684	1,288,150,604
アンゴラ合計	1,052,983,684	1,288,150,604
ブラジル		
HSBC Bank USA 0% 17/05/2013	1,847,966,967	2,093,439,086
ブラジル合計	1,847,966,967	2,093,439,086
ウクライナ		
ING Bank NV 9.45% due 28/09/2011	-	104,173,851
ウクライナ合計	-	104,173,851
クレジット・リンク債合計	2,900,950,651	3,485,763,541
原油ワラント		
ナイジェリア		
Central Bank of Nigeria Expires 15/11/2020	2,581,995,813	3,366,787,577
ナイジェリア合計	2,581,995,813	3,366,787,577
ベネズエラ		
Republic of Venezuela - Oil Expires 15/04/2020 Series USD	1,689,438,726	1,776,058,954
ベネズエラ合計	1,689,438,726	1,776,058,954
原油ワラント合計	4,271,434,539	5,142,846,531
投資ポートフォリオ	40,356,313,119	46,374,823,350

5 デリバティブ金融商品

当ファンドは、以下のデリバティブ金融商品を保有している。

(a) クレジット・リンク債

当ファンドは、クレジット・リンク債を購入することができる。クレジット・リンク債は、当ファンドが基礎となる参照資産を直接購入していた場合に受けるであろう経済的影響を再現するよう意図されている。クレジット・リンク債のリスクには、基礎となる参照資産の潜在的な債務不履行、クレジット・リンク債に関連する基礎となる参照資産の通貨価値の変動、当ファンドがクレジット・リンク債を通常の事業の過程で処分できない潜在的な可能性、および相手方が契約に基づく債務を履行できない可能性が含まれている。

投資家は、満期前に参照資産に信用事由が発生しなかった場合には、満期時に債券の額面価額を受け取る。参照資産が債務不履行になった場合は、発行体が債券を早期償還するか（債券の保有者へ債務不履行となった参照資産を譲渡）、または、投資家が債券の満期時に返還して受け取る正味金額が減額される。クレジット・リンク債の満期は、通常、参照資産の満期と同じである。

クレジット・リンク債は当初、取引日現在の公正価値で認識され、事後に、公正価値で再測定される。クレジット・リンク債は店頭で取引されるため、公正価値はディーラーの気配値から得られる。

(b) 原油ワラント

これらの原油ワラントまたは原油価格連動型債務支払証書（以下「OIP0」という。）は、1990年代前半のブレイディ・ボンドによるソブリン債務再編の一環として発行され、最初は債券に付属していたが、後に分離され別々に取引された。OIP0は、いくつかの測定基準（当該期間の平均原油価格を含む。）が満たされておりかつ生産レベルが規定された参照レートを上回る場合には、半年ごとに支払われる予定になっている。かかる半年ごとの支払については上限金額が定められており、OIP0に基づく最終支払の期日は2020年の予定である。

OIP0は、当初、取引日現在の公正価値で認識され、事後に、公正価値で再測定される。公正価値はディーラーの気配値から得られる。

6 現金および現金同等物

キャッシュ・フロー計算書目的上、現金および現金同等物は、当初満期が90日未満の以下の残高で構成されている。

	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
現金および現金同等物	5,631,234,979	439,549,887

現金および現金同等物は、保管受託銀行に保管されている金銭である。

7 未払費用

	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
未払運用報酬	29,701,705	32,290,097
未払受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	7,678,865	8,239,045
未払保管受託銀行報酬	2,847,752	4,489,265
その他の未払費用	2,110,259	5,286,861
	42,338,581	50,305,268

未払費用の帳簿価額は、財政状態計算書日現在の公正価値に近似していた。

8 受益証券

すべての受益証券は、分配金を受け取る権利があり、償還日に当ファンドの受益証券1口当たり純資産額に基づく比例的な取り分の支払を受ける権利がある。関連する変動は、持分変動計算書に示されている。注記1に概説

された目的および注記3のリスク管理方針に従い、当ファンドは受け取った申込金額を適切な投資対象に投資するよう努める一方で、償還に見合う十分な流動性を維持する。このような流動性は、短期借入金または必要な場合には上場有価証券の処分によって高められる。

募集および償還の目的で当ファンドの純資産額を算定するため、投資は、関連する取引日の営業終了時点の市場価格の仲値に基づき評価される。財政状態計算書日現在の、市場価格の買呼値を使用した当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金の調整は、以下の表において説明されている。

	2011年11月30日現在 (日本円)	2011年5月31日現在 (日本円)
財政状態計算書による資本金および剰余金（買呼値）	46,015,102,572	46,542,655,146
買呼値から仲値への調整	478,592,310	553,557,861
資本金および剰余金（仲値）	46,493,694,882	47,096,213,007

9 分配金

当半年間に支払われた分配金は、以下で構成されている。

	権利付最終日	分配金額 日本円
2011年11月30日		
受益証券1口当たり分配金90円	2011年6月3日	589,770,000円
受益証券1口当たり分配金90円	2011年7月5日	587,970,000円
受益証券1口当たり分配金90円	2011年8月3日	605,970,000円
受益証券1口当たり分配金90円	2011年9月6日	605,970,000円
受益証券1口当たり分配金90円	2011年10月3日	605,970,000円
受益証券1口当たり分配金90円	2011年11月4日	686,144,970円
		3,681,794,970円
2010年11月30日		
受益証券1口当たり分配金70円	2010年6月3日	662,585,000円
受益証券1口当たり分配金70円	2010年7月6日	626,605,000円
受益証券1口当たり分配金70円	2010年8月3日	598,605,000円
受益証券1口当たり分配金70円	2010年9月3日	576,905,000円
受益証券1口当たり分配金70円	2010年10月4日	558,810,000円
受益証券1口当たり分配金70円	2010年11月4日	534,310,000円
		3,557,820,000円

10 関連当事者との取引

当事者は、ある当事者が他方の当事者を支配する能力を有しているか、または他方の当事者の財務または営業の決定に重要な影響力を行使できる場合に、関連があるとみなされる。

本財務書類中に別途開示された以外に、当半年間に以下の関連当事者との取引が行われた。

(a) 運用報酬

投資顧問会社は、当ファンドの純資産額の年率0.40%の運用報酬を受け取る権利を有する。当該報酬は、各取引日の当ファンドの純資産額に基づき日々発生し、後払いされる。

(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬

受託会社報酬および管理事務代行会社報酬は、当ファンドの純資産額のうち、最初の100百万米ドルに相当する日本円に対しては0.135%、100百万米ドル超300百万米ドル以下に相当する日本円に対しては0.12%、300百万米

ドル超500百万米ドル以下に相当する日本円に対しては0.085%、500百万米ドル超に相当する日本円に対しては0.05%で課される。

当該報酬の最低額は、年額48,000米ドルに相当する日本円とする。当該年間報酬は、日々発生し、後払いされる。

(c) 保管受託銀行報酬

当ファンドは、保管受託サービスを提供するザ バンク オブ ニューヨーク メロン（保管受託銀行）のサービスを契約している。保管受託銀行報酬は、保護預け手数料、取引手数料、送金手数料およびその他の手数料で構成されている。保護預け手数料は、保管受託契約の条件に従って市場ごとのベースス・ポイントに基づき課される。送金手数料およびその他の手数料は、1取引当たり6.50米ドルから20米ドルの範囲で取引ごとに課される。

「海外国債マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,020,477,536	2,684,766,144
国債証券	83,352,037,731	73,595,147,087
未収利息	940,749,397	833,359,283
前払費用	178,978,141	114,797,976
流動資産合計	86,492,242,805	77,228,070,490
資産合計	86,492,242,805	77,228,070,490
負債の部		
流動負債		
未払解約金	50,000,000	-
流動負債合計	50,000,000	-
負債合計	50,000,000	-
純資産の部		
元本等		
元本	62,295,833,001	51,647,186,694
剰余金		
剰余金又は欠損金()	24,146,409,804	25,580,883,796
元本等合計	86,442,242,805	77,228,070,490
純資産合計	86,442,242,805	77,228,070,490
負債純資産合計	86,492,242,805	77,228,070,490

(2) 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23年10月21日 至平成24年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（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 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 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。

（追加情報）

自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
当期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。	

（貸借対照表に関する注記）

[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 62,295,833,001口	1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 51,647,186,694口
2. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3876円 (1万口当たり純資産額) (13,876円)	2. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.4953円 (1万口当たり純資産額) (14,953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23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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。 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。 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。 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。為替予約取引に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	コンプライアンス部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。 また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。 市場リスク 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。 信用リスク 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。 流動性リスク 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。 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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	2. 時価の算定方法 国債証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	73,040,682,249円	62,295,833,001円
同期中における追加設定元本額	228,504,716円	128,408,657円
同期中における一部解約元本額	10,973,353,964円	10,777,054,964円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	45,734,117,144円	36,281,146,791円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	4,201,540,772円	3,473,562,376円
新光7資産バランスファンド	947,117,203円	806,195,141円
海外国債ファンド（1年決算型）	305,769,326円	298,430,671円
海外国債ファンド（変額年金）	11,107,288,556円	10,787,851,715円
合 計	62,295,833,001円	51,647,186,694円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	1,724,313,733	954,763,218
合 計	1,724,313,733	954,763,218

（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

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
	該当事項はありません。	同左

(3) 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		米ドル	米ドル	
		US TREASURY N/B 3.125% 2019/5/15	18,800,000.00	21,047,187.49	
		US TREASURY N/B 8.125% 2019/8/15	3,700,000.00	5,449,117.17	
		US TREASURY N/B 3.625% 2019/8/15	15,900,000.00	18,359,531.25	
		US TREASURY N/B 3.375% 2019/11/15	20,700,000.00	23,528,461.01	
		US TREASURY N/B 3.625% 2020/2/15	29,900,000.00	34,541,507.94	
		US TREASURY N/B 3.5% 2020/5/15	24,400,000.00	27,970,406.36	
		US TREASURY N/B 8.75% 2020/8/15	2,700,000.00	4,215,585.94	
		US TREASURY N/B 2.625% 2020/8/15	26,300,000.00	28,305,375.00	
		US TREASURY N/B 2.625% 2020/11/15	33,600,000.00	36,096,375.15	
		US TREASURY N/B 3.625% 2021/2/15	29,900,000.00	34,539,171.86	
		US TREASURY N/B 3.125% 2021/5/15	24,200,000.00	26,903,593.74	
		US TREASURY N/B 2.125% 2021/8/15	33,600,000.00	34,356,000.00	
		US TREASURY N/B 8% 2021/11/15	5,400,000.00	8,350,593.75	
US TREASURY N/B 2% 2021/11/15	35,100,000.00	35,363,250.00			
US TREASURY N/B 2% 2022/2/15	24,000,000.00	24,091,875.12			
米ドル建小計			米ドル 328,200,000.00	米ドル 363,118,031.78 (29,652,218,475円)	
カナダドル	国債証券		カナダドル	カナダドル	
		CANADIAN GOVERNMENT 3.75% 2019/6/1	23,500,000.00	26,521,865.00	
		CANADIAN GOVERNMENT 3.5% 2020/6/1	17,500,000.00	19,569,200.00	
		CANADIAN GOVERNMENT 3.25% 2021/6/1	15,300,000.00	16,842,240.00	
カナダドル建小計			カナダドル 56,300,000.00	カナダドル 62,933,305.00 (5,168,083,006円)	

通貨	種類	銘 柄	券面総額	評 価 額	備考
ユーロ	国債証券		ユーロ	ユーロ	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.5% 2019/7/4	17,400,000.00	20,210,100.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25% 2020/1/4	16,000,000.00	18,305,600.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3% 2020/7/4	16,000,000.00	18,016,000.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25% 2020/9/4	11,600,000.00	12,365,600.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5% 2021/1/4	13,800,000.00	14,967,480.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25% 2021/7/4	13,800,000.00	15,810,660.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25% 2021/9/4	11,600,000.00	12,257,720.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2% 2022/1/4	14,500,000.00	15,006,050.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25% 2019/9/1	4,600,000.00	4,363,560.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.5% 2020/2/1	4,200,000.00	4,020,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES 4.25% 2020/3/1	4,300,000.00	4,047,160.00			

		BUONI POLIENNALI DEL TES 4% 2020/9/1	4,800,000.00	4,407,840.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75% 2021/3/1	4,600,000.00	4,113,780.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75% 2021/8/1	5,400,000.00	4,775,760.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75% 2021/9/1	4,800,000.00	4,579,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5% 2022/3/1	3,300,000.00	3,173,280.00	
		FRANCE (GOVT OF) 4.25% 2019/4/25	17,900,000.00	19,883,320.00	
		FRANCE (GOVT OF) 8.5% 2019/10/25	5,600,000.00	7,852,320.00	
		FRANCE (GOVT OF) 3.75% 2019/10/25	16,700,000.00	17,970,870.00	
		FRANCE (GOVT OF) 3.5% 2020/4/25	19,100,000.00	20,106,570.00	
		FRANCE (GOVT OF) 2.5% 2020/10/25	19,600,000.00	19,080,600.00	
		FRANCE (GOVT OF) 3.75% 2021/4/25	20,000,000.00	21,260,000.00	
		FRANCE (GOVT OF) 3.25% 2021/10/25	17,800,000.00	18,193,380.00	
ユ ー ロ 建 小 計			ユ ー ロ 267,400,000.00	ユ ー ロ 284,767,510.00 (30,589,725,924円)	
英ポンド	国債証券	TSY 3.75% 2019/9/7	英ポンド 9,300,000.00	英ポンド 10,672,680.00	
		TSY 3.75% 2020/9/7	10,000,000.00	11,446,100.00	
		TSY 3.75% 2021/9/7	11,200,000.00	12,805,520.00	
		TSY 4% 2022/3/7	6,800,000.00	7,909,828.00	
		TSY 4.75% 2020/3/7	9,500,000.00	11,599,500.00	
		TSY 8% 2021/6/7	5,400,000.00	7,995,780.00	
英 ポ ン ド 建 小 計			英ポンド 52,200,000.00	英ポンド 62,429,408.00 (8,185,119,682円)	
合 計			-	円 73,595,147,087 (73,595,147,087)	

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。
- 合計金額欄の記載は、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	組入債券時価比率	有価証券の合計額に対する比率
米 ド ル	債券 15銘柄	38.4%	40.3%
カ ナ ダ ド ル	債券 3銘柄	6.7%	7.0%
ユ ー ロ	債券 23銘柄	39.6%	41.6%
英 ポ ン ド	債券 6銘柄	10.6%	11.1%

（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。

「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

	[平成23年10月20日現在]	[平成24年4月20日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	540,374,293	379,107,296
株式	13,004,878,560	13,200,584,650
派生商品評価勘定	1,793,355	207,731
未収配当金	131,851,230	153,912,616
未収利息	874	515
前払金	-	16,340,000
流動資産合計	13,678,898,312	13,750,152,808
資産合計	13,678,898,312	13,750,152,808
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,577,888	19,857,342
前受金	6,706,000	-
未払解約金	50,000,000	1,400,000
流動負債合計	59,283,888	21,257,342
負債合計	59,283,888	21,257,342
純資産の部		
元本等		
元本	16,012,694,805	14,658,360,151
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,393,080,381	929,464,685
元本等合計	13,619,614,424	13,728,895,466
純資産合計	13,619,614,424	13,728,895,466
負債純資産合計	13,678,898,312	13,750,152,808

(2) 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23年10月21日 至平成24年4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所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 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。

(追加情報)

自平成23年4月21日 至平成23年10月20日	自平成23年10月21日 至平成24年4月20日
-----------------------------	-----------------------------

<p>当期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>	
---	--

（貸借対照表に関する注記）

[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
<p>1. 差入委託証拠金代用有価証券 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 100,940,100円</p>	<p>1. 差入委託証拠金代用有価証券 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 111,267,900円</p>
<p>2. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 16,012,694,805口</p>	<p>2. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 14,658,360,151口</p>
<p>3. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 2,393,080,381円</p>	<p>3. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 929,464,685円</p>
<p>4. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.8506円 (1万口当たり純資産額) (8,506円)</p>	<p>4. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9366円 (1万口当たり純資産額) (9,366円)</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	自平成23年 4月21日 至平成23年10月20日	自平成23年10月21日 至平成24年 4月20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、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。株価指数先物取引に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>コンプライアンス部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 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 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 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。 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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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（先物取引） 「（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。	2. 時価の算定方法 株式 同左 派生商品評価勘定（先物取引） 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	15,671,512,358円	16,012,694,805円
同期中における追加設定元本額	979,938,878円	94,193,616円
同期中における一部解約元本額	638,756,431円	1,448,528,270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	650,560,624円	622,687,688円
新光7資産バランスファンド	1,519,537,392円	1,233,217,292円
ニュー トピックス インデックス（変額年金）	1,566,669,456円	1,499,235,234円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	3,490,356,399円	3,225,236,212円
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	4,174,590,012円	3,751,333,971円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	487,767,741円	456,584,466円
ワールドバランスファンド30V A（適格機関投資家私募）	3,044,390,913円	2,870,178,980円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,078,822,268円	999,886,308円
合 計	16,012,694,805円	14,658,360,151円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	3,029,079,251	1,244,420,020
合 計	3,029,079,251	1,244,420,020

（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23年10月20日現在]				[平成24年 4月20日現在]			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引 株価指数先 物取引								
買建	611,274,533	-	610,490,000	784,533	539,009,611	-	519,360,000	19,649,611
TOPIX先物	611,274,533	-	610,490,000	784,533	539,009,611	-	519,360,000	19,649,611
合 計	611,274,533	-	610,490,000	784,533	539,009,611	-	519,360,000	19,649,611

（注）1.時価の算定方法

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。

2.先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおります。

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。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘 柄	株 式 数	評 価 額		備 考
		単価（円）	金 額（円）	
極洋	4,000	189	756,000	
日本水産	15,400	262	4,034,800	
マルハニチロホールディングス	26,000	139	3,614,000	
サカタのタネ	2,000	1,118	2,236,000	
ホクト	1,400	1,705	2,387,000	
日鉄鉱業	5,000	355	1,775,000	
三井松島産業	9,000	164	1,476,000	
国際石油開発帝石	162	520,000	84,240,000	
日本海洋掘削	600	2,470	1,482,000	
石油資源開発	1,900	3,735	7,096,500	
ショーボンドホールディングス	1,200	2,060	2,472,000	
ミライト・ホールディングス	3,800	574	2,181,200	
間組	6,700	212	1,420,400	
東急建設	8,810	194	1,709,140	

コムシスホールディングス	6,500	821	5,336,500
ミサワホーム	1,900	1,079	2,050,100
高松コンストラクショングループ	700	1,353	947,100
東建コーポレーション	500	3,105	1,552,500
大成建設	67,000	204	13,668,000
大林組	40,000	350	14,000,000
清水建設	41,000	308	12,628,000
飛鳥建設	12,700	92	1,168,400
長谷工コーポレーション	83,500	59	4,926,500
松井建設	4,000	326	1,304,000
鹿島建設	63,000	229	14,427,000
不動テトラ	9,700	145	1,406,500
鉄建建設	12,000	123	1,476,000
安藤建設	5,000	115	575,000
太平工業	4,000	430	1,720,000
西松建設	17,000	179	3,043,000
三井住友建設	10,400	69	717,600
前田建設工業	8,000	346	2,768,000
奥村組	13,000	301	3,913,000
東鉄工業	2,000	898	1,796,000
戸田建設	14,000	256	3,584,000
熊谷組	16,000	84	1,344,000
矢作建設工業	1,700	416	707,200
大東建託	5,100	7,370	37,587,000
N I P P O	3,000	838	2,514,000
東亜道路工業	4,000	236	944,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
前田道路	4,000	983	3,932,000	
日本道路	6,000	320	1,920,000	
東亜建設工業	12,000	149	1,788,000	
若築建設	13,000	101	1,313,000	
東洋建設	21,000	80	1,680,000	
五洋建設	17,000	239	4,063,000	
福田組	1,000	275	275,000	
住友林業	9,200	714	6,568,800	
日本基礎技術	800	310	248,000	
日成ビルド工業	7,000	184	1,288,000	
エス・バイ・エル	7,000	178	1,246,000	
パナホーム	5,000	533	2,665,000	
大和ハウス工業	33,000	1,039	34,287,000	
ライト工業	3,500	433	1,515,500	
積水ハウス	38,000	747	28,386,000	
西部電気工業	2,000	346	692,000	
中電工	1,900	811	1,540,900	
関電工	6,000	375	2,250,000	
きんでん	9,000	590	5,310,000	
東京エネシス	1,000	460	460,000	
トーエネック	1,000	457	457,000	
日本電設工業	2,000	765	1,530,000	

協和エクシオ	4,400	737	3,242,800
九電工	4,000	481	1,924,000
三機工業	4,000	433	1,732,000
日揮	12,000	2,382	28,584,000
中外炉工業	6,000	274	1,644,000
太平電業	2,000	668	1,336,000
高砂熱学工業	3,800	640	2,432,000
大気社	2,000	1,644	3,288,000
ダイダン	3,000	499	1,497,000
日比谷総合設備	1,600	879	1,406,400
東芝プラントシステム	2,000	893	1,786,000
東洋エンジニアリング	7,000	372	2,604,000
千代田化工建設	11,000	976	10,736,000
新興プラントテック	2,700	669	1,806,300
日本製粉	8,000	364	2,912,000
日清製粉グループ本社	12,000	965	11,580,000
昭和産業	3,000	252	756,000
協同飼料	6,000	90	540,000
日本甜菜製糖	13,000	172	2,236,000
三井製糖	8,000	264	2,112,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
森永製菓	13,000	184	2,392,000	
中村屋	7,000	403	2,821,000	
江崎グリコ	5,000	963	4,815,000	
不二家	12,000	196	2,352,000	
山崎製パン	10,000	1,190	11,900,000	
モロゾフ	10,000	274	2,740,000	
カルビー	700	4,730	3,311,000	
森永乳業	11,000	296	3,256,000	
ヤクルト本社	7,200	2,753	19,821,600	
明治ホールディングス	4,000	3,530	14,120,000	
雪印メグミルク	2,900	1,437	4,167,300	
プリマハム	7,000	162	1,134,000	
日本ハム	10,000	987	9,870,000	
伊藤ハム	7,000	305	2,135,000	
丸大食品	6,000	311	1,866,000	
米久	600	705	423,000	
サッポロホールディングス	22,000	280	6,160,000	
アサヒグループホールディングス	25,000	1,792	44,800,000	
キリンホールディングス	54,000	1,013	54,702,000	
宝ホールディングス	11,000	543	5,973,000	
オエノンホールディングス	13,000	192	2,496,000	
コカ・コーラウエスト	4,500	1,433	6,448,500	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	1,500	1,065	1,597,500	
ダイドードリンコ	600	3,195	1,917,000	
伊藤園	3,700	1,457	5,390,900	
キーコーヒー	1,200	1,487	1,784,400	
日清オイリオグループ	5,000	329	1,645,000	
不二製油	3,200	1,104	3,532,800	

キッコーマン	11,000	928	10,208,000
味の素	35,000	1,035	36,225,000
キューピー	6,800	1,227	8,343,600
ハウス食品	4,700	1,358	6,382,600
カゴメ	5,200	1,591	8,273,200
焼津水産化学工業	3,500	781	2,733,500
アリアケジャパン	1,200	1,608	1,929,600
ニチレイ	15,000	365	5,475,000
東洋水産	6,000	2,087	12,522,000
日清食品ホールディングス	5,200	3,010	15,652,000
フジッコ	1,000	996	996,000
ロック・フィールド	2,300	1,603	3,686,900
日本たばこ産業	296	456,500	135,124,000
わらべや日洋	300	1,245	373,500

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ミヨシ油脂	4,000	106	424,000	
片倉工業	3,100	709	2,197,900	
ゲンゼ	9,000	222	1,998,000	
東洋紡績	53,000	109	5,777,000	
ユニチカ	28,000	49	1,372,000	
富士紡ホールディングス	10,000	177	1,770,000	
日清紡ホールディングス	8,000	712	5,696,000	
倉敷紡績	13,000	152	1,976,000	
シキボウ	13,000	99	1,287,000	
日本毛織	4,000	608	2,432,000	
ダイドーリミテッド	3,000	656	1,968,000	
帝国繊維	3,000	633	1,899,000	
帝人	51,000	266	13,566,000	
東レ	91,000	608	55,328,000	
サカイオーベックス	3,000	140	420,000	
日本フェルト	1,700	407	691,900	
アツギ	25,000	98	2,450,000	
ダイニック	2,000	166	332,000	
セーレン	3,100	573	1,776,300	
小松精練	5,000	407	2,035,000	
ワコールホールディングス	7,000	905	6,335,000	
ホギメディカル	800	3,545	2,836,000	
T S Iホールディングス	5,600	425	2,380,000	
三陽商会	11,000	219	2,409,000	
オンワードホールディングス	8,000	622	4,976,000	
ゴールドウイン	4,000	537	2,148,000	
デサント	3,000	466	1,398,000	
ヤマトインターナショナル	3,700	380	1,406,000	
特種東海製紙	8,000	211	1,688,000	
王子製紙	55,000	373	20,515,000	
三菱製紙	21,000	74	1,554,000	
北越紀州製紙	7,500	523	3,922,500	
中越パルプ工業	3,000	163	489,000	
大王製紙	5,000	463	2,315,000	

日本製紙グループ本社	6,000	1,661	9,966,000
レンゴー	10,000	587	5,870,000
クラレ	19,800	1,144	22,651,200
旭化成	73,000	497	36,281,000
昭和電工	78,000	183	14,274,000
住友化学	86,000	336	28,896,000
住友精化	5,000	350	1,750,000
日産化学工業	9,500	729	6,925,500

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ラサ工業	11,000	121	1,331,000	
クレハ	8,000	382	3,056,000	
テイカ	3,000	278	834,000	
石原産業	21,000	78	1,638,000	
日本曹達	7,000	346	2,422,000	
東ソー	33,000	216	7,128,000	
トクヤマ	19,000	249	4,731,000	
セントラル硝子	12,000	331	3,972,000	
東亜合成	16,000	352	5,632,000	
ダイソー	9,000	244	2,196,000	
関東電化工業	4,000	259	1,036,000	
電気化学工業	26,000	315	8,190,000	
信越化学工業	22,400	4,565	102,256,000	
堺化学工業	6,000	287	1,722,000	
エア・ウォーター	10,000	1,011	10,110,000	
大陽日酸	16,000	554	8,864,000	
日本化学工業	9,000	134	1,206,000	
日本パーカライジング	3,000	1,215	3,645,000	
四国化成工業	1,000	481	481,000	
戸田工業	2,000	541	1,082,000	
ステラ ケミファ	800	1,886	1,508,800	
日本触媒	9,000	905	8,145,000	
大日精化工業	4,000	382	1,528,000	
カネカ	16,000	475	7,600,000	
三菱瓦斯化学	21,000	523	10,983,000	
三井化学	53,000	242	12,826,000	
J S R	11,400	1,659	18,912,600	
東京応化工業	2,200	1,777	3,909,400	
三菱ケミカルホールディングス	78,000	418	32,604,000	
日本合成化学工業	4,000	469	1,876,000	
ダイセル	16,000	526	8,416,000	
住友ベークライト	11,000	427	4,697,000	
積水化学工業	26,000	727	18,902,000	
日本ゼオン	12,000	710	8,520,000	
アイカ工業	3,300	1,191	3,930,300	
宇部興産	52,000	211	10,972,000	
積水樹脂	2,000	794	1,588,000	
タキロン	3,000	281	843,000	
旭有機材工業	8,000	212	1,696,000	
日立化成工業	5,400	1,464	7,905,600	

大倉工業	6,000	241	1,446,000	
積水化成品工業	1,000	286	286,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本カーリット	1,500	399	598,500	
日本化薬	9,000	803	7,227,000	
日本精化	800	556	444,800	
ADEKA	5,400	748	4,039,200	
日油	10,000	402	4,020,000	
花王	33,100	2,138	70,767,800	
第一工業製薬	4,000	240	960,000	
三洋化成工業	4,000	522	2,088,000	
大日本塗料	14,000	87	1,218,000	
日本ペイント	12,000	609	7,308,000	
関西ペイント	14,000	847	11,858,000	
中国塗料	4,000	480	1,920,000	
藤倉化成	3,900	465	1,813,500	
太陽ホールディングス	1,000	2,100	2,100,000	
DIC	48,000	163	7,824,000	
サカタインクス	4,000	397	1,588,000	
東洋インキSCホールディングス	11,000	322	3,542,000	
富士フイルムホールディングス	26,600	1,720	45,752,000	
資生堂	20,700	1,433	29,663,100	
ライオン	14,000	461	6,454,000	
高砂香料工業	4,000	387	1,548,000	
マンダム	1,200	2,031	2,437,200	
ミルボン	700	2,379	1,665,300	
ファンケル	3,100	1,044	3,236,400	
コーセー	2,000	1,809	3,618,000	
ドクターシーラボ	8	380,000	3,040,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	2,478	3,221,400	
コニシ	1,700	1,051	1,786,700	
長谷川香料	1,600	1,134	1,814,400	
小林製薬	1,700	4,000	6,800,000	
荒川化学工業	1,700	712	1,210,400	
日本高純度化学	7	202,700	1,418,900	
荏原ユージライト	200	2,273	454,600	
アース製薬	900	2,901	2,610,900	
大成ラミック	1,000	2,448	2,448,000	
クミアイ化学工業	5,000	317	1,585,000	
日本農薬	5,000	372	1,860,000	
アキレス	20,000	108	2,160,000	
有沢製作所	3,900	297	1,158,300	
日東電工	10,300	3,490	35,947,000	
レック	300	1,247	374,100	
藤森工業	1,500	1,389	2,083,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

前澤化成工業	1,900	949	1,803,100	
JSP	1,300	1,124	1,461,200	
エフピコ	600	5,090	3,054,000	
天馬	400	926	370,400	
信越ポリマー	4,600	399	1,835,400	
東リ	9,000	169	1,521,000	
ニフコ	2,800	2,103	5,888,400	
日本バルカー工業	9,000	228	2,052,000	
ユニ・チャーム	6,900	4,345	29,980,500	
協和発酵キリン	17,000	846	14,382,000	
武田薬品工業	46,700	3,435	160,414,500	(注)
アステラス製薬	27,700	3,240	89,748,000	
大日本住友製薬	8,800	786	6,916,800	
塩野義製薬	19,500	1,056	20,592,000	
田辺三菱製薬	12,500	1,127	14,087,500	
あすか製薬	2,000	479	958,000	
日本新薬	3,000	998	2,994,000	
中外製薬	14,500	1,423	20,633,500	
科研製薬	5,000	1,000	5,000,000	
エーザイ	15,400	3,115	47,971,000	
ロート製薬	5,000	988	4,940,000	
小野薬品工業	6,100	4,485	27,358,500	
久光製薬	3,900	3,560	13,884,000	
持田製薬	4,000	945	3,780,000	
参天製薬	4,200	3,350	14,070,000	
扶桑薬品工業	4,000	223	892,000	
日本ケミファ	2,000	436	872,000	
ツムラ	3,400	2,171	7,381,400	
日医工	2,100	1,672	3,511,200	
キッセイ薬品工業	2,300	1,483	3,410,900	
生化学工業	2,400	878	2,107,200	
栄研化学	1,600	1,140	1,824,000	
鳥居薬品	1,500	1,516	2,274,000	
東和薬品	600	3,770	2,262,000	
沢井製薬	800	8,500	6,800,000	
ゼリア新薬工業	2,000	1,430	2,860,000	
第一三共	42,000	1,363	57,246,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,000	1,515	4,545,000	
大幸薬品	700	787	550,900	
大塚ホールディングス	24,800	2,391	59,296,800	
大正製薬ホールディングス	3,000	6,580	19,740,000	
日本コークス工業	14,500	117	1,696,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
昭和シェル石油	11,200	498	5,577,600	
コスモ石油	34,000	217	7,378,000	
二チレキ	4,000	400	1,600,000	
東燃ゼネラル石油	19,000	748	14,212,000	
ユシロ化学工業	900	849	764,100	
AOCホールディングス	3,100	456	1,413,600	

出光興産	1,500	7,580	11,370,000
JXホールディングス	138,500	477	66,064,500
横浜ゴム	15,000	606	9,090,000
東洋ゴム工業	9,000	216	1,944,000
ブリヂストン	39,100	1,880	73,508,000
住友ゴム工業	9,700	1,141	11,067,700
オカモト	6,000	325	1,950,000
ニッタ	1,200	1,488	1,785,600
東海ゴム工業	2,300	967	2,224,100
三ツ星ベルト	3,000	435	1,305,000
バンドー化学	6,000	299	1,794,000
日東紡績	9,000	300	2,700,000
旭硝子	61,000	619	37,759,000
日本板硝子	53,000	107	5,671,000
日本山村硝子	10,000	199	1,990,000
日本電気硝子	24,000	639	15,336,000
住友大阪セメント	25,000	241	6,025,000
太平洋セメント	73,000	193	14,089,000
日本コンクリート工業	1,000	265	265,000
東海カーボン	11,000	400	4,400,000
日本カーボン	10,000	214	2,140,000
東洋炭素	600	2,847	1,708,200
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	233	1,398,000
TOTO	19,000	585	11,115,000
日本碍子	16,000	989	15,824,000
日本特殊陶業	11,000	1,165	12,815,000
MARUWA	500	3,555	1,777,500
黒崎播磨	4,000	245	980,000
フジインコーポレーテッド	1,700	995	1,691,500
ニチアス	6,000	422	2,532,000
ニチハ	1,900	998	1,896,200
新日本製鐵	327,000	202	66,054,000
住友金属工業	231,000	147	33,957,000
神戸製鋼所	173,000	117	20,241,000
日新製鋼	44,000	115	5,060,000
中山製鋼所	3,000	72	216,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
合同製鐵	7,000	193	1,351,000	
ジェイエフイーホールディングス	29,500	1,557	45,931,500	
東京製鐵	6,300	695	4,378,500	
共英製鋼	1,300	1,539	2,000,700	
大和工業	2,800	2,308	6,462,400	
東京鐵鋼	3,000	276	828,000	
大阪製鐵	800	1,607	1,285,600	
淀川製鋼所	9,000	328	2,952,000	
東洋鋼鈑	5,000	300	1,500,000	
丸一鋼管	3,800	1,783	6,775,400	
大同特殊鋼	21,000	497	10,437,000	
日本金属工業	17,000	65	1,105,000	

日本冶金工業	12,500	131	1,637,500
山陽特殊製鋼	6,000	401	2,406,000
愛知製鋼	7,000	379	2,653,000
日立金属	8,000	1,039	8,312,000
大平洋金属	9,000	403	3,627,000
日本電工	4,000	351	1,404,000
栗本鐵工所	8,000	198	1,584,000
三菱製鋼	8,000	270	2,160,000
新家工業	4,000	126	504,000
日本軽金属	28,000	115	3,220,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	248	248,000
三井金属鉱業	34,000	203	6,902,000
東邦亜鉛	7,000	333	2,331,000
三菱マテリアル	78,000	240	18,720,000
住友金属鉱山	32,000	1,059	33,888,000
DOWAホールディングス	15,000	519	7,785,000
古河機械金属	21,000	74	1,554,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	2,554	3,064,800
東邦チタニウム	2,000	1,127	2,254,000
住友軽金属工業	30,000	84	2,520,000
古河スカイ	7,000	258	1,806,000
古河電気工業	39,000	223	8,697,000
住友電気工業	44,000	1,107	48,708,000
フジクラ	19,000	245	4,655,000
昭和電線ホールディングス	22,000	74	1,628,000
タツタ電線	4,000	445	1,780,000
日立電線	10,000	197	1,970,000
リョービ	7,000	291	2,037,000
アサヒホールディングス	1,700	1,623	2,759,100
宮地エンジニアリンググループ	3,000	156	468,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
三協・立山ホールディングス	17,000	158	2,686,000	
トーカロ	1,100	1,536	1,689,600	
SUMCO	7,600	871	6,619,600	
東洋製罐	8,800	1,080	9,504,000	
横河ブリッジホールディングス	3,000	556	1,668,000	
駒井ハルテック	3,000	250	750,000	
三和ホールディングス	12,000	313	3,756,000	
文化シャッター	6,000	299	1,794,000	
住生活グループ	16,200	1,547	25,061,400	
ノーリツ	2,400	1,415	3,396,000	
長府製作所	1,200	1,905	2,286,000	
リンナイ	2,000	5,750	11,500,000	
岡部	4,200	527	2,213,400	
東プレ	2,400	800	1,920,000	
高周波熱錬	2,700	714	1,927,800	
東京製綱	9,000	154	1,386,000	
パイオラックス	900	1,986	1,787,400	
日本発條	9,000	864	7,776,000	

三益半導体工業	500	747	373,500
日本製鋼所	19,000	506	9,614,000
三浦工業	1,900	2,094	3,978,600
タクマ	4,000	365	1,460,000
ツガミ	3,000	847	2,541,000
オークマ	7,000	663	4,641,000
東芝機械	7,000	430	3,010,000
アマダ	18,000	562	10,116,000
アイダエンジニアリング	3,200	468	1,497,600
牧野フライス製作所	6,000	630	3,780,000
オーエスジー	5,500	1,321	7,265,500
旭ダイヤモンド工業	3,100	880	2,728,000
森精機製作所	6,600	832	5,491,200
ディスコ	1,300	4,795	6,233,500
日東工器	1,000	1,794	1,794,000
大阪機工	7,000	111	777,000
津田駒工業	3,000	170	510,000
島精機製作所	1,600	1,439	2,302,400
日阪製作所	2,000	863	1,726,000
やまびこ	200	1,322	264,400
ナブテスコ	5,200	1,794	9,328,800
三井海洋開発	1,000	1,687	1,687,000
S M C	3,700	13,590	50,283,000
ホソカワミクロン	3,000	476	1,428,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ユニオンツール	800	1,453	1,162,400	
オイレス工業	1,400	1,626	2,276,400	
サトーホールディングス	1,300	1,182	1,536,600	
小松製作所	58,200	2,394	139,330,800	
住友重機械工業	32,000	419	13,408,000	
日立建機	6,400	1,813	11,603,200	
日工	3,000	303	909,000	
巴工業	200	1,796	359,200	
井関農機	13,000	199	2,587,000	
北川鉄工所	10,000	157	1,570,000	
クボタ	57,000	778	44,346,000	
三菱化工機	4,000	155	620,000	
月島機械	3,000	697	2,091,000	
帝国電機製作所	900	1,636	1,472,400	
新東工業	2,700	882	2,381,400	
小森コーポレーション	3,500	707	2,474,500	
住友精密工業	2,000	454	908,000	
酒井重工業	1,000	292	292,000	
荏原製作所	20,000	296	5,920,000	
西島製作所	1,400	1,039	1,454,600	
ダイキン工業	15,200	2,109	32,056,800	
オルガノ	3,000	513	1,539,000	
トーヨーカネツ	10,000	186	1,860,000	
栗田工業	6,900	1,961	13,530,900	

椿本チエイン	6,000	494	2,964,000
アネスト岩田	5,000	370	1,850,000
ダイフク	5,500	443	2,436,500
加藤製作所	5,000	409	2,045,000
タダノ	6,000	607	3,642,000
フジテック	3,000	502	1,506,000
シーケーディ	3,300	642	2,118,600
平和	2,600	1,714	4,456,400
理想科学工業	1,200	1,195	1,434,000
SANKYO	3,600	3,855	13,878,000
日本金銭機械	2,100	746	1,566,600
マースエンジニアリング	1,100	1,834	2,017,400
ダイコク電機	200	1,173	234,600
アマノ	3,600	713	2,566,800
JUKI	9,000	162	1,458,000
サンデン	6,000	252	1,512,000
蛇の目マシン工業	22,000	70	1,540,000
マックス	2,000	1,000	2,000,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
グローリー	3,600	1,753	6,310,800	
セガサミーホールディングス	12,800	1,706	21,836,800	
日本ピストンリング	8,000	182	1,456,000	
リケン	4,000	343	1,372,000	
TPR	1,300	1,344	1,747,200	
ホシザキ電機	2,400	1,960	4,704,000	
大豊工業	700	1,094	765,800	
日本精工	27,000	558	15,066,000	
NTN	28,000	315	8,820,000	
ジェイテクト	11,400	874	9,963,600	
不二越	12,000	406	4,872,000	
日本トムソン	4,000	454	1,816,000	
THK	7,900	1,651	13,042,900	
ユーシン精機	900	1,762	1,585,800	
イーグル工業	2,000	771	1,542,000	
日本ピラー工業	2,000	679	1,358,000	
キッツ	4,900	328	1,607,200	
日立工機	3,200	699	2,236,800	
マキタ	7,800	3,195	24,921,000	
日立造船	47,000	107	5,029,000	
三菱重工業	200,000	390	78,000,000	
IHI	81,000	194	15,714,000	
イビデン	7,800	1,892	14,757,600	
コニカミノルタホールディングス	31,500	660	20,790,000	
ブラザー工業	15,400	1,103	16,986,200	
ミネベア	18,000	368	6,624,000	
日立製作所	268,000	536	143,648,000	
東芝	251,000	330	82,830,000	
三菱電機	119,000	717	85,323,000	
富士電機	36,000	208	7,488,000	

東洋電機製造	2,000	305	610,000
安川電機	14,000	731	10,234,000
シンフォニアテクノロジー	12,000	166	1,992,000
明電舎	12,000	266	3,192,000
オリジン電気	2,000	339	678,000
デンヨー	1,700	1,044	1,774,800
東芝テック	7,000	344	2,408,000
マブチモーター	1,600	3,490	5,584,000
日本電産	6,400	7,440	47,616,000
高岳製作所	7,000	228	1,596,000
ダイヘン	7,000	272	1,904,000
JVCケンウッド	7,200	333	2,397,600

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日新電機	4,000	454	1,816,000	
大崎電気工業	2,000	846	1,692,000	
オムロン	13,300	1,611	21,426,300	
日東工業	1,800	1,136	2,044,800	
I D E C	2,500	786	1,965,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	23,000	415	9,545,000	
サクサホールディングス	5,000	171	855,000	
メルコホールディングス	800	1,787	1,429,600	
日本電気	164,000	152	24,928,000	
富士通	115,000	390	44,850,000	
沖電気工業	46,000	132	6,072,000	
電気興業	4,000	385	1,540,000	
サンケン電気	6,000	382	2,292,000	
アイホン	1,000	1,544	1,544,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,100	480	1,488,000	
セイコーエプソン	8,100	1,115	9,031,500	
ワコム	23	179,300	4,123,900	
アルバック	2,400	759	1,821,600	
アクセル	1,000	1,858	1,858,000	
ナナオ	1,000	1,627	1,627,000	
日本信号	3,600	506	1,821,600	
京三製作所	5,000	351	1,755,000	
日本無線	1,000	191	191,000	
パナソニック	136,100	638	86,831,800	(注)
シャープ	58,000	494	28,652,000	
アンリツ	6,000	1,037	6,222,000	
富士通ゼネラル	3,000	599	1,797,000	
日立国際電気	3,000	746	2,238,000	
ソニー	74,300	1,363	101,270,900	(注)
T D K	6,200	4,285	26,567,000	
帝国通信工業	3,000	141	423,000	
ミツミ電機	4,200	657	2,759,400	
タムラ製作所	6,000	212	1,272,000	
アルプス電気	9,400	734	6,899,600	
池上通信機	4,000	63	252,000	
パイオニア	16,900	409	6,912,100	

日本電波工業	1,200	1,129	1,354,800
フォスター電機	1,300	1,113	1,446,900
クラリオン	7,000	224	1,568,000
S M K	6,000	261	1,566,000
東光	5,000	271	1,355,000
ホシデン	3,200	562	1,798,400

銘 柄	株 式 数	評 価 額		備 考
		単価(円)	金 額(円)	
ヒロセ電機	2,100	8,370	17,577,000	
日本航空電子工業	3,000	691	2,073,000	
ユニデン	5,000	302	1,510,000	
アルパイン	2,300	1,020	2,346,000	
アイコム	1,000	2,011	2,011,000	
船井電機	1,100	1,506	1,656,600	
横河電機	12,900	763	9,842,700	
新電元工業	4,000	336	1,344,000	
アズビル	3,100	1,745	5,409,500	
日本光電工業	2,400	2,304	5,529,600	
チノー	2,000	213	426,000	
共和電業	2,000	264	528,000	
堀場製作所	2,200	2,790	6,138,000	
アドバンテスト	8,900	1,156	10,288,400	
小野測器	1,000	304	304,000	
エスベック	2,500	759	1,897,500	
キーエンス	2,900	18,650	54,085,000	
日置電機	900	1,480	1,332,000	
シスメックス	4,200	3,115	13,083,000	
メガチップス	1,000	1,731	1,731,000	
O B A R A G R O U P	1,300	1,011	1,314,300	
コーセル	1,700	1,129	1,919,300	
オブテックス	1,500	1,078	1,617,000	
スタンレー電気	8,000	1,230	9,840,000	
岩崎電気	9,000	169	1,521,000	
ウシオ電機	7,200	1,062	7,646,400	
日本セラミック	300	1,321	396,300	
日本デジタル研究所	600	889	533,400	
日本電子	8,000	237	1,896,000	
カシオ計算機	11,400	574	6,543,600	
ファナック	12,400	14,670	181,908,000	
日本シイエムケイ	3,800	419	1,592,200	
エンプラス	900	2,072	1,864,800	
ローム	5,900	3,640	21,476,000	
浜松ホトニクス	4,600	3,185	14,651,000	
三井ハイテック	1,300	508	660,400	
新光電気工業	4,000	798	3,192,000	
京セラ	9,900	7,300	72,270,000	
太陽誘電	5,300	863	4,573,900	
村田製作所	12,500	4,780	59,750,000	
ユーシン	2,300	610	1,403,000	
双葉電子工業	2,000	1,230	2,460,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
北陸電気工業	8,000	112	896,000	
ニチコン	3,800	996	3,784,800	
日本ケミコン	7,000	310	2,170,000	
K O A	2,400	849	2,037,600	
小糸製作所	6,000	1,238	7,428,000	
ミツバ	2,000	814	1,628,000	
スター精密	1,900	853	1,620,700	
大日本スクリーン製造	11,000	726	7,986,000	
キャノン電子	1,100	1,975	2,172,500	
キャノン	74,000	3,760	278,240,000	(注)
リコー	36,000	734	26,424,000	
日本電産サンキョー	3,000	492	1,476,000	
M U T O Hホールディングス	1,000	281	281,000	
東京エレクトロン	10,000	4,430	44,300,000	
トヨタ紡織	4,200	946	3,973,200	
鬼怒川ゴム工業	3,000	588	1,764,000	
ユニプレス	1,900	2,541	4,827,900	
豊田自動織機	10,800	2,303	24,872,400	
モリタホールディングス	3,000	540	1,620,000	
三櫻工業	2,700	638	1,722,600	
デンソー	29,400	2,569	75,528,600	
東海理化電機製作所	2,800	1,307	3,659,600	
三井造船	46,000	123	5,658,000	
佐世保重工業	12,000	124	1,488,000	
川崎重工業	87,000	247	21,489,000	
日本車輛製造	4,000	307	1,228,000	
日産自動車	151,600	844	127,950,400	
いすゞ自動車	75,000	471	35,325,000	
トヨタ自動車	154,500	3,295	509,077,500	(注)
日野自動車	17,000	562	9,554,000	
三菱自動車工業	266,000	90	23,940,000	
エフテック	200	1,624	324,800	
武蔵精密工業	1,200	1,794	2,152,800	
日産車体	3,000	810	2,430,000	
新明和工業	5,000	395	1,975,000	
極東開発工業	2,100	778	1,633,800	
日信工業	2,200	1,248	2,745,600	
トピー工業	9,000	255	2,295,000	
ティラド	4,000	322	1,288,000	
曙ブレーキ工業	6,000	403	2,418,000	
タチエス	1,600	1,565	2,504,000	
N O K	5,800	1,709	9,912,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
フタバ産業	3,400	420	1,428,000	
カヤバ工業	8,000	472	3,776,000	

シロキ工業	1,000	259	259,000	
大同メタル工業	2,000	975	1,950,000	
プレス工業	5,000	485	2,425,000	
カルソニックカンセイ	7,000	461	3,227,000	
太平洋工業	4,000	499	1,996,000	
ケーヒン	2,500	1,329	3,322,500	
河西工業	1,000	404	404,000	
アイシン精機	9,800	2,800	27,440,000	
マツダ	160,000	130	20,800,000	
ダイハツ工業	11,000	1,435	15,785,000	
今仙電機製作所	1,300	1,094	1,422,200	
本田技研工業	100,500	2,866	288,033,000	(注)
スズキ	24,900	1,899	47,285,100	
富士重工業	38,000	618	23,484,000	
ヤマハ発動機	19,400	1,038	20,137,200	
ショーワ	2,500	617	1,542,500	
T B K	1,000	496	496,000	
エクセディ	1,600	2,244	3,590,400	
豊田合成	3,400	1,542	5,242,800	
愛三工業	1,800	747	1,344,600	
ヨロズ	900	1,644	1,479,600	
エフ・シー・シー	1,900	1,741	3,307,900	
シマノ	4,500	4,865	21,892,500	
タカタ	2,200	1,989	4,375,800	
テイ・エス テック	2,500	1,580	3,950,000	
テルモ	8,400	3,575	30,030,000	
クリエートメディック	1,700	817	1,388,900	
日機装	4,000	856	3,424,000	
島津製作所	14,000	704	9,856,000	
長野計器	900	742	667,800	
東京計器	8,000	174	1,392,000	
東京精密	2,100	1,557	3,269,700	
ニコン	20,800	2,350	48,880,000	
トプコン	2,700	563	1,520,100	
オリンパス	14,000	1,286	18,004,000	
タムロン	1,000	2,451	2,451,000	
HOYA	29,000	1,808	52,432,000	
日本電産コパル	300	1,028	308,400	
シチズンホールディングス	14,300	519	7,421,700	
リズム時計工業	2,000	134	268,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
セイコーホールディングス	9,000	203	1,827,000	
ニプロ	5,800	545	3,161,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,000	2,364	2,364,000	
永大産業	1,000	353	353,000	
バンダイナムコホールディングス	12,300	1,189	14,624,700	
フランスベッドホールディングス	12,000	159	1,908,000	
パイロットコーポレーション	10	155,400	1,554,000	
トッパン・フォームズ	2,600	736	1,913,600	

フジシールインターナショナル	1,300	1,514	1,968,200
タカラトミー	3,900	589	2,297,100
ウッドワン	3,000	340	1,020,000
大建工業	8,000	268	2,144,000
凸版印刷	36,000	548	19,728,000
大日本印刷	36,000	722	25,992,000
共同印刷	5,000	211	1,055,000
日本写真印刷	2,000	926	1,852,000
光村印刷	6,000	269	1,614,000
宝印刷	2,400	648	1,555,200
アシックス	11,100	860	9,546,000
ツツミ	200	2,247	449,400
ローランド	1,200	778	933,600
ヤマハ	8,800	786	6,916,800
河合楽器製作所	9,000	198	1,782,000
クリナップ	1,100	608	668,800
ビジョン	1,000	3,165	3,165,000
リンテック	2,300	1,502	3,454,600
イトーキ	1,900	457	868,300
任天堂	6,800	11,380	77,384,000
三菱鉛筆	700	1,373	961,100
タカスタンダード	5,000	608	3,040,000
コクヨ	6,200	587	3,639,400
グローブライド	3,000	100	300,000
岡村製作所	4,000	588	2,352,000
美津濃	6,000	445	2,670,000
アデランス	1,700	844	1,434,800
東京電力	95,100	202	19,210,200
中部電力	39,300	1,399	54,980,700
関西電力	48,600	1,259	61,187,400
中国電力	16,500	1,433	23,644,500
北陸電力	11,700	1,415	16,555,500
東北電力	29,800	877	26,134,600
四国電力	11,000	2,229	24,519,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
九州電力	26,300	1,132	29,771,600	
北海道電力	11,100	1,206	13,386,600	
沖縄電力	700	3,345	2,341,500	
電源開発	7,400	2,259	16,716,600	
東京瓦斯	144,000	391	56,304,000	
大阪瓦斯	116,000	324	37,584,000	
東邦瓦斯	30,000	497	14,910,000	
北海道瓦斯	4,000	254	1,016,000	
西部瓦斯	13,000	212	2,756,000	
静岡瓦斯	3,000	562	1,686,000	
東武鉄道	68,000	408	27,744,000	
相鉄ホールディングス	19,000	247	4,693,000	
東京急行電鉄	70,000	376	26,320,000	
京浜急行電鉄	31,000	685	21,235,000	

小田急電鉄	38,000	742	28,196,000	
京王電鉄	33,000	567	18,711,000	
京成電鉄	19,000	612	11,628,000	
富士急行	3,000	496	1,488,000	
新京成電鉄	2,000	349	698,000	
東日本旅客鉄道	20,700	5,020	103,914,000	
西日本旅客鉄道	10,400	3,290	34,216,000	
東海旅客鉄道	103	654,000	67,362,000	
西日本鉄道	15,000	376	5,640,000	
ハマキョウレックス	100	2,842	284,200	
近畿日本鉄道	108,000	294	31,752,000	
阪急阪神ホールディングス	80,000	375	30,000,000	
南海電気鉄道	25,000	339	8,475,000	
京阪電気鉄道	27,000	370	9,990,000	
名古屋鉄道	42,000	218	9,156,000	
日本通運	47,000	302	14,194,000	
ヤマトホールディングス	24,200	1,204	29,136,800	
山九	14,000	312	4,368,000	
丸全昭和運輸	3,000	254	762,000	
センコー	5,000	331	1,655,000	
日本梱包運輸倉庫	3,600	1,008	3,628,800	
日本石油輸送	8,000	203	1,624,000	
福山通運	7,000	432	3,024,000	
セイノーホールディングス	9,000	565	5,085,000	
神奈川中央交通	2,000	442	884,000	
日立物流	2,500	1,469	3,672,500	
日本郵船	94,000	241	22,654,000	
商船三井	62,000	325	20,150,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
川崎汽船	37,000	173	6,401,000	
N Sユニテッド海運	2,000	129	258,000	
飯野海運	5,800	397	2,302,600	
第一中央汽船	11,000	109	1,199,000	
全日本空輸	159,000	225	35,775,000	
日新	10,000	195	1,950,000	
三菱倉庫	8,000	887	7,096,000	
三井倉庫	6,000	348	2,088,000	
住友倉庫	9,000	385	3,465,000	
澁澤倉庫	3,000	235	705,000	
東陽倉庫	10,000	180	1,800,000	
安田倉庫	1,400	499	698,600	
東洋埠頭	12,000	144	1,728,000	
上組	13,000	648	8,424,000	
郵船ロジスティクス	800	1,114	891,200	
近鉄エクスプレス	1,100	2,752	3,027,200	
NEC ネットエスアイ	1,800	1,233	2,219,400	
システナ	27	61,100	1,649,700	
新日鉄ソリューションズ	300	1,478	443,400	
コア	700	664	464,800	

ITホールディングス	3,600	1,098	3,952,800
グリー	6,000	2,186	13,116,000
コーエーテクモホールディングス	2,300	689	1,584,700
三菱総合研究所	200	1,670	334,000
ネクソン	6,000	1,556	9,336,000
ドワンゴ	10	121,500	1,215,000
マクロミル	2,200	791	1,740,200
ティーガイア	2	142,000	284,000
GMOペイメントゲートウェイ	4	313,500	1,254,000
ザップラス	9	102,000	918,000
インターネットイニシアティブ	7	313,000	2,191,000
ソネットエンタテインメント	7	337,000	2,359,000
SRAホールディングス	1,600	902	1,443,200
フェイス	59	9,750	575,250
野村総合研究所	6,700	1,939	12,991,300
フジ・メディア・ホールディングス	122	135,900	16,579,800
オービック	370	15,940	5,897,800
ヤフー	861	25,080	21,593,880
トレンドマイクロ	5,200	2,340	12,168,000
日本オラクル	2,400	3,135	7,524,000
オービックビジネスコンサルタント	200	3,770	754,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,400	3,565	4,991,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アイティフォー	2,500	298	745,000	
大塚商会	900	6,340	5,706,000	
サイボウズ	10	27,200	272,000	
ウェザーニューズ	200	2,502	500,400	
C I J	4,200	347	1,457,400	
WOWOW	3	181,400	544,200	
ネットワンシステムズ	5,300	1,039	5,506,700	
アルゴグラフィックス	600	1,110	666,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,200	930	2,046,000	
日本ユニシス	2,800	606	1,696,800	
兼松エレクトロニクス	1,500	902	1,353,000	
東京放送ホールディングス	7,000	1,126	7,882,000	
日本テレビ放送網	1,030	12,740	13,122,200	
テレビ朝日	30	120,700	3,621,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	89	35,000	3,115,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	1,700	531	902,700	
イー・アクセス	90	16,380	1,474,200	
NECモバイルリング	400	2,814	1,125,600	
日本電信電話	54,100	3,685	199,358,500	(注)
KDDI	182	521,000	94,822,000	
光通信	1,100	2,692	2,961,200	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	969	136,600	132,365,400	(注)
GMOインターネット	5,000	432	2,160,000	
ゼンリン	2,800	807	2,259,600	
昭文社	800	592	473,600	
角川グループホールディングス	1,100	2,410	2,651,000	

アイネット	1,900	488	927,200
松竹	8,000	751	6,008,000
東宝	8,400	1,435	12,054,000
東映	5,000	418	2,090,000
エヌ・ティ・ティ・データ	73	272,800	19,914,400
D T S	2,200	1,036	2,279,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,800	1,621	6,159,800
カプコン	2,300	1,863	4,284,900
ジャステック	1,900	497	944,300
S C S K	2,400	1,227	2,944,800
アイネス	2,500	632	1,580,000
T K C	1,000	1,682	1,682,000
富士ソフト	1,500	1,437	2,155,500
N S D	2,300	684	1,573,200
コナミ	5,300	2,331	12,354,300
J B C Cホールディングス	3,400	534	1,815,600

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ソフトバンク	53,300	2,299	122,536,700	
高千穂交易	1,400	867	1,213,800	
エレマテック	900	1,157	1,041,300	
双日	78,700	140	11,018,000	
アルフレッサホールディングス	3,100	3,725	11,547,500	
横浜冷凍	2,700	623	1,682,100	
アルコニックス	500	1,714	857,000	
あいホールディングス	900	470	423,000	
ダイワボウホールディングス	11,000	174	1,914,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	709	1,559,800	
U K Cホールディングス	900	1,138	1,024,200	
T O K A Iホールディングス	5,700	381	2,171,700	
シップヘルスケアホールディングス	1,500	1,878	2,817,000	
エコートレーディング	600	708	424,800	
ナガイレーベン	1,600	1,229	1,966,400	
三菱食品	1,100	2,106	2,316,600	
松田産業	900	1,297	1,167,300	
メディパルホールディングス	12,700	1,000	12,700,000	
S P K	300	1,450	435,000	
アズワン	1,100	1,715	1,886,500	
尾家産業	1,200	827	992,400	
シモジマ	1,000	1,054	1,054,000	
ドウシシャ	900	2,370	2,133,000	
黒田電気	2,400	845	2,028,000	
ガリバーインターナショナル	540	2,923	1,578,420	
進和	2,100	953	2,001,300	
シークス	200	1,283	256,600	
マクニカ	1,000	1,950	1,950,000	
伊藤忠商事	93,800	931	87,327,800	
丸紅	103,000	574	59,122,000	
長瀬産業	6,700	982	6,579,400	
豊田通商	13,100	1,587	20,789,700	

兼松	25,000	99	2,475,000	
三井物産	101,500	1,290	130,935,000	
日本紙パルプ商事	6,000	282	1,692,000	
日立ハイテクノロジーズ	3,600	1,933	6,958,800	
カメイ	2,000	1,145	2,290,000	
スターゼン	6,000	249	1,494,000	
山善	4,500	711	3,199,500	
住友商事	69,400	1,164	80,781,600	
内田洋行	1,000	274	274,000	
三菱商事	85,600	1,788	153,052,800	(注)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
第一実業	5,000	405	2,025,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,900	1,006	3,923,400	
西華産業	4,000	231	924,000	
菱洋エレクトロ	2,300	901	2,072,300	
東京産業	3,500	301	1,053,500	
ユアサ商事	12,000	138	1,656,000	
阪和興業	12,000	344	4,128,000	
菱電商事	3,000	467	1,401,000	
フルサト工業	400	850	340,000	
岩谷産業	13,000	273	3,549,000	
すてきナイスグループ	8,000	246	1,968,000	
昭光通商	8,000	132	1,056,000	
三愛石油	5,000	386	1,930,000	
稲畑産業	3,100	547	1,695,700	
JFE商事	7,900	399	3,152,100	
東邦ホールディングス	3,800	1,465	5,567,000	
サンゲツ	2,100	2,110	4,431,000	
ミツウロコグループホールディングス	3,800	519	1,972,200	
シナネン	1,000	346	346,000	
伊藤忠エネクス	2,000	459	918,000	
サンリオ	3,000	3,455	10,365,000	
リョーサン	1,900	1,527	2,901,300	
新光商事	1,400	678	949,200	
三信電気	2,800	609	1,705,200	
東陽テクニカ	1,700	887	1,507,900	
モスフードサービス	1,500	1,573	2,359,500	
加賀電子	600	845	507,000	
Paltac	1,000	1,165	1,165,000	
ヤマタネ	10,000	116	1,160,000	
トラスコ中山	1,500	1,675	2,512,500	
オートバックスセブン	1,400	3,805	5,327,000	
加藤産業	1,700	1,630	2,771,000	
イエローハット	1,100	1,453	1,598,300	
富士エレクトロニクス	900	1,196	1,076,400	
日伝	400	2,138	855,200	
杉本商事	1,900	774	1,470,600	
因幡電機産業	1,400	2,414	3,379,600	
住金物産	11,000	207	2,277,000	

ミスミグループ本社	4,300	1,901	8,174,300	
スズケン	4,500	2,428	10,926,000	
ローソン	3,700	5,240	19,388,000	
キリン堂	1,500	597	895,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
カワチ薬品	800	1,906	1,524,800	
エービーシー・マート	1,700	2,917	4,958,900	
ハードオフコーポレーション	600	627	376,200	
アスクル	1,400	1,605	2,247,000	
ゲオホールディングス	18	97,000	1,746,000	
ポイント	990	2,932	2,902,680	
キャンドウ	22	107,600	2,367,200	
パル	550	3,635	1,999,250	
エディオン	4,700	523	2,458,100	
ハニーズ	1,030	1,508	1,553,240	
アルペン	900	1,584	1,425,600	
ビックカメラ	45	40,200	1,809,000	
D C Mホールディングス	6,100	624	3,806,400	
M o n o t a R O	700	1,332	932,400	
J . フロント リテイリング	28,000	428	11,984,000	
ドトール・日レスホールディングス	1,900	1,111	2,110,900	
マツモトキヨシホールディングス	2,200	1,781	3,918,200	
スタートトゥデイ	2,100	1,288	2,704,800	
ココカラファイン	1,200	2,538	3,045,600	
三越伊勢丹ホールディングス	23,400	886	20,732,400	
クリエイトSDホールディングス	200	2,200	440,000	
あさひ	600	1,563	937,800	
コスモス薬品	500	4,500	2,250,000	
セブン&アイ・ホールディングス	49,200	2,399	118,030,800	
ツルハホールディングス	1,000	4,795	4,795,000	
サンマルクホールディングス	200	3,170	634,000	
トリドール	1,300	1,064	1,383,200	
総合メディカル	100	2,776	277,600	
カッパ・クリエイト	850	1,728	1,468,800	
ライトオン	400	764	305,600	
良品計画	1,200	4,350	5,220,000	
三城ホールディングス	700	527	368,900	
コナカ	2,000	894	1,788,000	
ハウス オブ ローゼ	400	1,265	506,000	
コジマ	600	391	234,600	
コーナン商事	1,300	1,201	1,561,300	
エコス	1,800	501	901,800	
ワタミ	1,400	1,719	2,406,600	
マルシェ	600	728	436,800	
ドン・キホーテ	3,100	2,962	9,182,200	
メガネトップ	1,700	1,047	1,779,900	
西松屋チェーン	2,600	686	1,783,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ゼンショーホールディングス	4,500	995	4,477,500	
幸楽苑	2,200	1,243	2,734,600	
サイゼリヤ	1,700	1,260	2,142,000	
ポプラ	900	505	454,500	
ユニテッドアローズ	1,300	1,819	2,364,700	
ハイデイ日高	1,800	1,277	2,298,600	
京都きもの友禅	2,300	971	2,233,300	
コロナイド	4,000	593	2,372,000	
スギホールディングス	2,100	2,624	5,510,400	
スクロール	1,200	313	375,600	
ファミリーマート	3,600	3,465	12,474,000	
木曽路	1,300	1,585	2,060,500	
千趣会	3,100	578	1,791,800	
ケーヨー	2,400	501	1,202,400	
上新電機	3,000	782	2,346,000	
日本瓦斯	1,100	1,292	1,421,200	
ベスト電器	6,500	189	1,228,500	
ロイヤルホールディングス	2,000	943	1,886,000	
島忠	2,700	1,803	4,868,100	
チヨダ	1,500	1,887	2,830,500	
カスミ	5,700	571	3,254,700	
リンガーハット	2,500	1,074	2,685,000	
AOKIホールディングス	1,000	1,668	1,668,000	
オークワ	2,000	1,120	2,240,000	
コメリ	1,600	2,298	3,676,800	
青山商事	3,200	1,775	5,680,000	
しまむら	1,400	9,240	12,936,000	
高島屋	16,000	621	9,936,000	
松屋	2,400	713	1,711,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,000	714	4,284,000	
ニッセンホールディングス	4,100	466	1,910,600	
パルコ	2,100	802	1,684,200	
丸井グループ	15,300	642	9,822,600	
原信ナルスホールディングス	1,700	1,363	2,317,100	
ダイエー	7,250	270	1,957,500	
イズミヤ	4,000	430	1,720,000	
イオン	41,400	1,059	43,842,600	
ユニー	8,800	961	8,456,800	
イズミ	3,500	1,757	6,149,500	
東武ストア	3,000	276	828,000	
平和堂	2,200	1,127	2,479,400	
フジ	1,300	1,808	2,350,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ヤオコー	500	2,886	1,443,000	
ゼビオ	1,400	2,208	3,091,200	
ケーズホールディングス	2,900	2,539	7,363,100	
アインファーマシーズ	600	4,375	2,625,000	

元気寿司	1,000	995	995,000	
ヤマダ電機	5,720	5,250	30,030,000	
アーランドサカモト	1,400	1,273	1,782,200	
ニトリホールディングス	2,350	7,310	17,178,500	
吉野家ホールディングス	32	105,800	3,385,600	
サガミチェーン	4,000	640	2,560,000	
ブレナス	1,300	1,552	2,017,600	
ミニストップ	900	1,519	1,367,100	
アークス	1,600	1,639	2,622,400	
パロー	2,300	1,420	3,266,000	
ベルク	400	1,195	478,000	
ファーストリテイリング	2,700	18,590	50,193,000	
サンドラッグ	2,200	2,490	5,478,000	
新生銀行	92,000	106	9,752,000	
あおぞら銀行	37,000	212	7,844,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	890,000	396	352,440,000	
りそなホールディングス	102,300	352	36,009,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	230,000	244	56,120,000	
三井住友フィナンシャルグループ	89,300	2,647	236,377,100	
第四銀行	15,000	269	4,035,000	
北越銀行	12,000	160	1,920,000	
西日本シティ銀行	41,000	215	8,815,000	
札幌北洋ホールディングス	17,700	289	5,115,300	
千葉銀行	46,000	491	22,586,000	
横浜銀行	76,000	391	29,716,000	
常陽銀行	45,000	357	16,065,000	
群馬銀行	27,000	410	11,070,000	
武蔵野銀行	1,900	2,653	5,040,700	
千葉興業銀行	2,600	442	1,149,200	
筑波銀行	7,600	271	2,059,600	
東京都民銀行	2,200	936	2,059,200	
七十七銀行	18,000	331	5,958,000	
青森銀行	9,000	242	2,178,000	
秋田銀行	8,000	263	2,104,000	
山形銀行	7,000	373	2,611,000	
岩手銀行	800	3,590	2,872,000	
東邦銀行	10,000	261	2,610,000	
東北銀行	14,000	132	1,848,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ふくおかフィナンシャルグループ	48,000	343	16,464,000	
静岡銀行	35,000	832	29,120,000	
十六銀行	15,000	263	3,945,000	
スルガ銀行	11,000	813	8,943,000	
八十二銀行	22,000	448	9,856,000	
山梨中央銀行	7,000	337	2,359,000	
大垣共立銀行	16,000	280	4,480,000	
福井銀行	10,000	254	2,540,000	
北國銀行	14,000	291	4,074,000	
清水銀行	700	2,940	2,058,000	

滋賀銀行	11,000	456	5,016,000
南都銀行	11,000	362	3,982,000
百五銀行	11,000	349	3,839,000
京都銀行	21,000	690	14,490,000
ほくほくフィナンシャルグループ	82,000	144	11,808,000
広島銀行	35,000	337	11,795,000
山陰合同銀行	7,000	603	4,221,000
中国銀行	10,000	1,043	10,430,000
伊予銀行	13,000	674	8,762,000
百十四銀行	13,000	354	4,602,000
四国銀行	8,000	297	2,376,000
阿波銀行	10,000	485	4,850,000
鹿児島銀行	8,000	494	3,952,000
大分銀行	8,000	235	1,880,000
宮崎銀行	8,000	215	1,720,000
肥後銀行	9,000	462	4,158,000
佐賀銀行	7,000	213	1,491,000
十八銀行	8,000	237	1,896,000
沖縄銀行	900	3,385	3,046,500
琉球銀行	2,500	1,074	2,685,000
八千代銀行	1,000	1,866	1,866,000
セブン銀行	33,000	192	6,336,000
みずほフィナンシャルグループ	1,510,800	129	194,893,200
紀陽ホールディングス	47,000	118	5,546,000
山口フィナンシャルグループ	12,000	696	8,352,000
名古屋銀行	11,000	265	2,915,000
愛知銀行	400	4,590	1,836,000
第三銀行	9,000	166	1,494,000
大光銀行	8,000	227	1,816,000
愛媛銀行	7,000	229	1,603,000
トマト銀行	3,000	151	453,000
みなと銀行	11,000	152	1,672,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
京葉銀行	10,000	379	3,790,000	
関西アーバン銀行	16,000	119	1,904,000	
栃木銀行	6,000	285	1,710,000	
北日本銀行	200	2,051	410,200	
東和銀行	6,000	89	534,000	
福島銀行	26,000	64	1,664,000	
大東銀行	17,000	69	1,173,000	
トモニホールディングス	9,000	379	3,411,000	
フィデアホールディングス	6,800	201	1,366,800	
池田泉州ホールディングス	48,500	110	5,335,000	
SBIホールディングス	1,246	6,780	8,447,880	
日本アジア投資	17,000	70	1,190,000	
ジャフコ	1,400	1,889	2,644,600	
大和証券グループ本社	116,000	309	35,844,000	
野村ホールディングス	254,500	345	87,802,500	
岡三証券グループ	10,000	330	3,300,000	

丸三証券	5,700	324	1,846,800
東洋証券	7,000	202	1,414,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,000	297	3,861,000
水戸証券	1,000	206	206,000
いちよし証券	3,700	503	1,861,100
松井証券	7,000	516	3,612,000
マネックスグループ	95	16,960	1,611,200
カブドットコム証券	2,500	276	690,000
極東証券	3,300	709	2,339,700
NK S Jホールディングス	24,600	1,658	40,786,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	35,100	1,525	53,527,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,300	1,351	15,266,300
第一生命保険	629	104,700	65,856,300
東京海上ホールディングス	44,600	2,057	91,742,200
T & Dホールディングス	42,900	904	38,781,600
クレディセゾン	9,600	1,681	16,137,600
芙蓉総合リース	1,100	2,652	2,917,200
興銀リース	1,600	2,218	3,548,800
東京センチュリーリース	3,200	1,596	5,107,200
日本証券金融	4,900	420	2,058,000
アイフル	10,700	176	1,883,200
リコリース	800	1,805	1,444,000
イオンクレジットサービス	5,200	1,381	7,181,200
アコム	2,360	1,694	3,997,840
ジャックス	7,000	276	1,932,000
オリエントコーポレーション	17,000	99	1,683,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日立キャピタル	2,300	1,174	2,700,200	
オリックス	6,120	7,670	46,940,400	
三菱UFJリース	2,980	3,395	10,117,100	
日本駐車場開発	377	4,390	1,655,030	
昭栄	3,800	314	1,193,200	
野村不動産ホールディングス	5,600	1,398	7,828,800	
ヒューリック	3,800	948	3,602,400	
パーク24	6,100	1,139	6,947,900	
三井不動産	52,000	1,504	78,208,000	
三菱地所	82,000	1,412	115,784,000	
平和不動産	11,000	203	2,233,000	
東京建物	22,000	302	6,644,000	
ダイビル	3,500	608	2,128,000	
東急不動産	24,000	385	9,240,000	
住友不動産	28,000	1,849	51,772,000	
東宝不動産	700	479	335,300	
大京	18,000	214	3,852,000	
テーオーシー	4,600	461	2,120,600	
東京楽天地	6,000	304	1,824,000	
レオパレス21	9,100	249	2,265,900	
フジ住宅	900	447	402,300	

住友不動産販売	420	3,875	1,627,500
ゴールドクレスト	1,060	1,394	1,477,640
リロ・ホールディング	300	2,416	724,800
東急リバブル	1,900	865	1,643,500
飯田産業	500	705	352,500
アーネストワン	1,900	933	1,772,700
タカラレーベン	1,000	746	746,000
イオンモール	5,400	1,771	9,563,400
フージャースコーポレーション	30	67,900	2,037,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	73	63,000	4,599,000
日本空港ビルデング	3,700	1,079	3,992,300
日本工営	8,000	281	2,248,000
日本M&Aセンター	1,100	2,345	2,579,500
アコーディア・ゴルフ	51	56,000	2,856,000
テンプホールディングス	700	798	558,600
スタジオアリス	1,100	1,404	1,544,400
総合警備保障	4,500	958	4,311,000
カカクコム	1,900	2,437	4,630,300
エムスリー	10	344,000	3,440,000
ディー・エヌ・エー	5,600	2,539	14,218,400
博報堂D Yホールディングス	1,580	5,030	7,947,400

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ぐるなび	1,200	913	1,095,600	
PGMホールディングス	11	62,900	691,900	
イーピーエス	11	194,200	2,136,200	
ケネディクス	136	15,000	2,040,000	
電通	11,300	2,499	28,238,700	
みらかホールディングス	3,200	3,150	10,080,000	
アルプス技研	2,200	617	1,357,400	
オリエンタルランド	3,400	8,950	30,430,000	
ダスキン	3,700	1,576	5,831,200	
明光ネットワークジャパン	2,800	771	2,158,800	
ファルコSDホールディングス	700	897	627,900	
ラウンドワン	3,900	524	2,043,600	
リゾートトラスト	1,900	1,341	2,547,900	
ビー・エム・エル	800	2,060	1,648,000	
もしもしホットライン	2,100	804	1,688,400	
ユー・エス・エス	1,620	8,210	13,300,200	
テー・オー・ダブリュー	3,800	522	1,983,600	
エイチ・アイ・エス	1,300	2,615	3,399,500	
共立メンテナンス	1,100	1,793	1,972,300	
イチネンホールディングス	2,000	427	854,000	
燦ホールディングス	1,000	1,578	1,578,000	
スバル興業	2,000	257	514,000	
東京テアトル	13,000	114	1,482,000	
よみうりランド	2,000	264	528,000	
東京都競馬	19,000	120	2,280,000	
カナモト	2,000	968	1,936,000	
東京ドーム	10,000	266	2,660,000	

トランス・コスモス	1,600	1,203	1,924,800
藤田観光	4,000	306	1,224,000
白洋舎	2,000	213	426,000
セコム	12,100	3,895	47,129,500
セントラル警備保障	800	783	626,400
メイテック	1,900	1,647	3,129,300
アサツー ディ・ケイ	2,100	2,311	4,853,100
応用地質	2,000	933	1,866,000
船井総合研究所	2,000	572	1,144,000
ベネッセホールディングス	3,900	3,960	15,444,000
イオンディライト	1,400	1,839	2,574,600
ナック	600	1,709	1,025,400
ニチイ学館	2,400	1,110	2,664,000
ダイセキ	2,000	1,369	2,738,000
合 計	18,273,179		13,200,584,650

(注) 上記のうち、以下の株式を先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に差入れております。

武田薬品工業	2,600株
パナソニック	7,500株
ソニー	3,700株
キヤノン	4,100株
トヨタ自動車	9,000株
本田技研工業	6,000株
日本電信電話	3,200株
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	67株
三菱商事	5,200株

(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。

[次へ](#)

「新光外国株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	575,641,783	362,241,608
コール・ローン	28,971,536	7,855,032
株式	11,480,037,621	11,558,306,455
投資信託受益証券	1,668,079	2,157,865
投資証券	203,063,523	238,332,282
派生商品評価勘定	35,207,900	203,316
未収入金	6,614,455	850,074
未収配当金	8,552,471	7,327,715
未収利息	46	10
差入委託証拠金	144,782,335	177,054,516
流動資産合計	12,484,539,749	12,354,328,873
資産合計	12,484,539,749	12,354,328,873
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	670,296	13,980,815
未払解約金	130,000,000	15,000,000
流動負債合計	130,670,296	28,980,815
負債合計	130,670,296	28,980,815
純資産の部		
元本等		
元本	15,930,800,276	13,508,832,506
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,576,930,823	1,183,484,448
元本等合計	12,353,869,453	12,325,348,058
純資産合計	12,353,869,453	12,325,348,058
負債純資産合計	12,484,539,749	12,354,328,873

(2) 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23年10月21日 至平成24年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所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	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所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。 (2) 為替予約取引 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 (1) 株式及び投資証券 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。

	(2) 投資信託受益証券 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 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。

(追加情報)

自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
当期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 15,930,800,276口	1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 13,508,832,506口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 3,576,930,823円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,183,484,448円
3. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7755円 (1万口当たり純資産額) (7,755円)	3. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9124円 (1万口当たり純資産額) (9,124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23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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。 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。 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。 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。株価指数先物取引には株価の変動によるリスク、為替予約取引に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>コンプライアンス部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 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 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 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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 株式、投資信託受益証券及び投資証券 「（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（先物取引、為替予約取引） 「（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。	2. 時価の算定方法 株式、投資信託受益証券及び投資証券 同左 派生商品評価勘定（先物取引、為替予約取引） 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	自平成23年 4月21日 至平成23年10月20日	自平成23年10月21日 至平成24年 4月20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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	14,679,676,917円	15,930,800,276円
同期中における追加設定元本額	2,101,346,053円	440,035,447円
同期中における一部解約元本額	850,222,694円	2,862,003,217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	1,664,339,884円	1,276,041,083円
新光外国株式インデックスV A	6,350,087,236円	5,361,845,113円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	1,536,531,352円	1,327,902,964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）	1,486,619,995円	1,300,018,743円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	1,425,011,322円	1,219,751,386円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	2,247,273,335円	1,988,156,587円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,220,937,152円	1,035,116,630円
合 計	15,930,800,276円	13,508,832,506円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	723,715,025	939,171,377
投資信託受益証券	876,176	214,358
投 資 証 券	7,050,787	21,776,107
合 計	731,641,988	961,161,842

（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

（1）株式関連

種 類	[平成23年10月20日現在]				[平成24年 4月20日現在]			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	619,992,648	-	654,681,212	34,688,564	534,523,530	-	520,740,756	13,782,774
S&P500 EMINI先物	358,806,176	-	380,280,502	21,474,326	343,502,178	-	336,235,050	7,267,128
S&P/TSE 60IX先物	40,037,844	-	40,658,496	620,652	34,974,579	-	34,086,369	888,210
DJ EURO ST50先物	93,214,878	-	100,680,338	7,465,460	52,195,378	-	47,758,932	4,436,446
LIFFE FTSE先物	62,867,519	-	65,693,250	2,825,731	61,127,808	-	59,791,404	1,336,404
SWISS MKT IX先物	23,518,637	-	24,266,342	747,705	21,956,466	-	21,925,369	31,097
OMXS30 INDEX先物	9,923,415	-	9,868,662	54,753	2,490,167	-	2,485,048	5,119
SPI 200先物	31,624,179	-	33,233,622	1,609,443	18,276,954	-	18,458,584	181,630
合 計	619,992,648	-	654,681,212	34,688,564	534,523,530	-	520,740,756	13,782,774

（注）1.時価の算定方法

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。

（2）通貨関連

種 類	[平成23年10月20日現在]				[平成24年 4月20日現在]			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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 買建 カナダドル	-	-	-	-	2,219,400	-	2,216,970	2,430
売建 米ドル	112,496,880	-	112,760,070	263,190	19,521,340	-	19,587,280	65,940
カナダドル	60,508,410	-	60,642,540	134,130	9,687,790	-	9,716,350	28,560
ユーロ	5,669,250	-	5,658,000	11,250	-	-	-	-
英ポンド	14,146,380	-	14,175,860	29,480	1,602,450	-	1,611,150	8,700
スイスフラン	18,088,500	-	18,186,000	97,500	2,218,330	-	2,228,700	10,370
スウェーデンクローナ	3,670,050	-	3,661,450	8,600	1,154,920	-	1,161,680	6,760
デンマーククローネ	1,223,240	-	1,229,600	6,360	1,988,250	-	1,999,800	11,550
オーストラリアドル	495,950	-	497,000	1,050	-	-	-	-
香港ドル	7,235,800	-	7,246,840	11,040	2,869,600	-	2,869,600	-
シンガポールドル	611,320	-	612,560	1,240	-	-	-	-
合計	847,980	-	850,220	2,240	-	-	-	-
	112,496,880	-	112,760,070	263,190	21,740,740	-	21,804,250	68,370

(注) 時価の算定方法

(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。

(3) 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	株		米ドル	米ドル	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	1,500	16.82	25,230.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	3,200	72.29	231,328.00	
	APACHE CORP	2,500	92.11	230,275.00	
	ARCH COAL INC	1,500	9.94	14,910.00	
	BAKER HUGHES INC	2,800	41.02	114,856.00	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,300	30.98	40,274.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORPORATION	1,600	49.76	79,616.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	4,300	18.00	77,400.00		

CHEVRON CORP	12,900	102.51	1,322,379.00	
CIMAREX ENERGY CO	600	65.01	39,006.00	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	1,300	26.87	34,931.00	
CONCHO RESOURCES INC	600	99.63	59,778.00	
CONOCOPHILLIPS	8,100	72.89	590,409.00	
CONSOL ENERGY INC	1,700	34.44	58,548.00	
CONTINENTAL RESOURCES INC	300	85.55	25,665.00	
DENBURY RESOURCES INC	2,700	18.00	48,600.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	2,600	65.91	171,366.00	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC	500	68.52	34,260.00	
EL PASO CORP	5,000	29.60	148,000.00	
ENERGEN CORPORATION	500	46.78	23,390.00	
EOG RESOURCES INC	1,700	103.96	176,732.00	
EQT CORPORATION	900	46.99	42,291.00	
EXXON MOBIL CORP	30,966	85.28	2,640,780.48	
FMC TECHNOLOGIES INC	1,600	47.35	75,760.00	
HALLIBURTON CO	5,900	33.98	200,482.00	
HELMERICH & PAYNE INC	700	52.33	36,631.00	
HESS CORPORATION	2,100	55.25	116,025.00	
HOLLYFRONTIER CORPORATION	1,600	30.21	48,336.00	
KINDER MORGAN INC	700	36.73	25,711.00	
MARATHON OIL CORP	4,500	29.41	132,345.00	
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	2,350	39.74	93,389.00	
MURPHY OIL CORPORATION	1,200	54.00	64,800.00	
NABORS INDUSTRIES LTD	2,100	15.84	33,264.00	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	2,704	78.14	211,290.56	
NEWFIELD EXPLORATION CO	900	32.67	29,403.00	
NOBLE CORPORATION	1,700	37.88	64,396.00	
NOBLE ENERGY INC	1,100	93.73	103,103.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	5,200	88.22	458,744.00	
PEABODY ENERGY CORP	1,700	30.46	51,782.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	株 700	米ドル 105.89	米ドル 74,123.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	900	41.32	37,188.00	
	QEP RESOURCES INC	1,300	29.42	38,246.00	
	RANGE RESOURCES CORP	1,000	58.58	58,580.00	
	ROWAN COMPANIES INC	900	33.53	30,177.00	
	SCHLUMBERGER LIMITED	8,732	69.80	609,493.60	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	2,200	28.24	62,128.00	
	SPECTRA ENERGY CORPORATION	4,234	30.38	128,628.92	
	SUNOCO INC	800	38.45	30,760.00	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	1,100	25.19	27,709.00	
	ULTRA PETROLEUM CORP	1,100	18.78	20,658.00	
	VALERO ENERGY CORP	3,600	23.90	86,040.00	
	WEATHERFORD INTERNATIONAL LIMITED	4,900	13.83	67,767.00	
	WHITING PETROLEUM CORPORATION	800	54.23	43,384.00	
WILLIAMS COS INC	3,800	32.18	122,284.00		

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,400	89.26	124,964.00	
AIRGAS INC	500	90.15	45,075.00	
ALCOA INC	6,900	9.76	67,344.00	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	700	40.87	28,609.00	
BALL CORPORATION	1,100	43.30	47,630.00	
CELANESE CORP-SERIES A	1,100	48.12	52,932.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	400	185.80	74,320.00	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	1,000	68.35	68,350.00	
CROWN HOLDINGS INC	1,100	37.33	41,063.00	
DOW CHEMICAL	7,600	34.96	265,696.00	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	6,000	52.61	315,660.00	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,000	52.75	52,750.00	
ECOLAB INC	1,900	62.26	118,294.00	
FMC CORPORATION	500	106.69	53,345.00	
FREEMONT-MCMORAN COPPER & GOLD INC	6,138	38.03	233,428.14	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	500	59.23	29,615.00	
INTERNATIONAL PAPER CO	2,900	32.96	95,584.00	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	2,000	44.09	88,180.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	300	81.89	24,567.00	
MEADWESTVACO CORPORATION	1,100	31.43	34,573.00	
MONSANTO CO	3,500	76.79	268,765.00	
NEWMONT MINING CORP	3,200	47.81	152,992.00	
NUCOR CORP	2,000	40.09	80,180.00	
OWENS-ILLINOIS INC	1,200	23.90	28,680.00	
PPG INDUSTRIES INC	1,000	101.00	101,000.00	
PRAXAIR INC	1,900	113.82	216,258.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	ROCK-TENN COMPANY-CL A	500	62.79	31,395.00	
	SEALED AIR CORPORATION	1,100	19.12	21,032.00	
	SIGMA-ALDRICH	800	71.59	57,272.00	
	THE MOSAIC COMPANY	2,100	50.84	106,764.00	
	THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	600	116.73	70,038.00	
	UNITED STATES STEEL CORP	1,100	28.59	31,449.00	
	VULCAN MATERIALS CO	800	41.02	32,816.00	
	WALTER ENERGY INC	500	65.84	32,920.00	
	3M CO	4,300	86.80	373,240.00	
	AGCO CORPORATION	700	44.76	31,332.00	
	AMETEK INC	1,050	48.81	51,250.50	
	BOEING CO	4,600	73.10	336,260.00	
	CATERPILLAR INC	4,200	107.36	450,912.00	
	COOPER INDUSTRIES PLC	1,100	61.46	67,606.00	
	CUMMINS INC	1,200	114.80	137,760.00	
	DANAHER CORP	3,800	53.00	201,400.00	
	DEERE & CO	2,700	80.39	217,053.00	
	DOVER CORP	1,300	59.88	77,844.00	
EATON CORP	2,100	46.93	98,553.00		

EMERSON ELECTRIC CO	4,800	50.08	240,384.00	
FASTENAL CO	1,800	47.50	85,500.00	
FLOWSERVE CORPORATION	400	111.13	44,452.00	
FLUOR CORP	1,200	57.93	69,516.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,000	68.93	137,860.00	
GENERAL ELECTRIC CO(US)	68,200	19.14	1,305,348.00	
GOODRICH CORPORATION	800	125.21	100,168.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,700	58.00	272,600.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	2,800	55.41	155,148.00	
INGERSOLL-RAND PLC	2,122	40.13	85,155.86	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	800	43.18	34,544.00	
JOY GLOBAL INC	700	75.33	52,731.00	
KBR INC	1,100	34.08	37,488.00	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	600	69.47	41,682.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	1,800	90.34	162,612.00	
MASCO CORP	2,400	11.97	28,728.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,700	61.02	103,734.00	
PACCAR INC	2,200	42.51	93,522.00	
PALL CORPORATION	700	58.70	41,090.00	
PARKER HANNIFIN CORP	950	81.58	77,501.00	
PENTAIR INC	700	44.24	30,968.00	
PRECISION CASTPARTS CORP	900	172.08	154,872.00	
QUANTA SERVICES INC	1,400	20.78	29,092.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	RAYTHEON COMPANY	2,200	52.53	115,566.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	900	78.15	70,335.00	
	ROCKWELL COLLINS INC.	1,000	55.85	55,850.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	600	96.95	58,170.00	
	SPX CORP	300	75.30	22,590.00	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	1,037	72.91	75,607.67	
	TEXTRON INC	1,900	26.35	50,065.00	
	TYCO INTERNATIONAL LIMITED	2,950	54.99	162,220.50	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	5,600	80.40	450,240.00	
	URS CORPORATION	500	39.85	19,925.00	
	WW GRAINGER INC	400	213.26	85,304.00	
	XYLEM INC	1,300	27.10	35,230.00	
	AVERY DENNISON CORPORATION	800	30.89	24,712.00	
	CINTAS CORPORATION	900	39.22	35,298.00	
	DUN & BRADSTREET CORP	300	78.49	23,547.00	
	EQUIFAX INC	900	43.91	39,519.00	
	IHS INC-CLASS A	300	99.37	29,811.00	
	IRON MOUNTAIN INCORPORATED	900	29.55	26,595.00	
	MANPOWER GROUP	500	43.77	21,885.00	
	NIELSEN HOLDINGS NV	600	28.71	17,226.00	
	PITNEY BOWES INC	1,600	16.93	27,088.00	
	REPUBLIC SERVICES INC	2,130	30.82	65,646.60	
ROBERT HALF INTL INC	1,000	28.85	28,850.00		
STERICYCLE INC	500	87.28	43,640.00		

VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	1,000	47.62	47,620.00	
WASTE MANAGEMENT INC	2,800	35.74	100,072.00	
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	1,200	66.14	79,368.00	
CSX CORP	6,800	21.56	146,608.00	
DELTA AIR LINES INC	1,400	10.82	15,148.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	1,500	45.74	68,610.00	
FEDEX CORP	1,900	89.39	169,841.00	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,800	14.51	26,118.00	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	700	55.38	38,766.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	800	71.37	57,096.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,400	68.70	164,880.00	
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	1,600	8.23	13,168.00	
UNION PACIFIC CORP	3,100	105.70	327,670.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	600	23.34	14,004.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	4,700	79.86	375,342.00	
AUTOLIV INC	600	64.54	38,724.00	
BORGWARNER INC	700	81.45	57,015.00	
FORD MOTOR CO	22,900	11.66	267,014.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	GENERAL MOTORS CO	5,100	24.01	122,451.00	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	1,600	11.17	17,872.00	
	HARLEY-DAVIDSON INC	1,500	49.57	74,355.00	
	JOHNSON CONTROLS INC	4,400	32.35	142,340.00	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORPORATION	800	43.70	34,960.00	
	COACH INC	1,900	74.83	142,177.00	
	DR HORTON INC	1,900	14.62	27,778.00	
	FOSSIL INC	300	129.92	38,976.00	
	GARMIN LIMITED	800	44.81	35,848.00	
	HASBRO INC	800	35.78	28,624.00	
	LEGGETT & PLATT INC	1,000	22.88	22,880.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	600	72.96	43,776.00	
	MATTEL INC	2,400	31.76	76,224.00	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	400	62.74	25,096.00	
	NEWELL RUBBERMAID INC	2,000	17.36	34,720.00	
	NIKE INC -CL B	2,300	109.61	252,103.00	
	RALPH LAUREN CORPORATION	400	169.35	67,740.00	
	TOLL BROTHERS INC	1,000	23.37	23,370.00	
	VF CORP	600	149.14	89,484.00	
	WHIRLPOOL CORP	500	64.49	32,245.00	
	APOLLO GROUP INC-CL A	900	35.23	31,707.00	
	CARNIVAL CORP(US)	2,900	32.60	94,540.00	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	200	430.78	86,156.00	
	DARDEN RESTAURANTS INC	900	49.71	44,739.00	
	H&R BLOCK INC	2,100	16.88	35,448.00	
INTL GAME TECHNOLOGY	2,000	16.14	32,280.00		
LAS VEGAS SANDS CORP	2,400	58.36	140,064.00		
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	1,726	39.45	68,090.70		

MCDONALD'S CORP	6,600	95.28	628,848.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	2,300	13.77	31,671.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,100	28.87	31,757.00	
STARBUCKS CORP	4,800	58.81	282,288.00	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	1,400	58.02	81,228.00	
WYNN RESORTS LTD	500	129.55	64,775.00	
YUM! BRANDS INC	3,100	71.41	221,371.00	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	1,400	13.69	19,166.00	
CBS CORP-CLASS B	3,850	33.28	128,128.00	
COMCAST CORP-CL A	13,500	29.47	397,845.00	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	4,200	29.15	122,430.00	
DIRECTV	4,600	47.95	220,570.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	900	47.80	43,020.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	850	51.89	44,106.50	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	DISH NETWORK CORPORATION-A	1,400	31.44	44,016.00	
	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	3,400	10.86	36,924.00	
	LIBERTY GLOBAL INC-A	900	49.25	44,325.00	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	800	47.38	37,904.00	
	LIBERTY MEDIA CORPORATION-LIBERTY CAPI-A	700	84.54	59,178.00	
	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	1,900	49.27	93,613.00	
	NEWS CORP-CL A	11,100	18.89	209,679.00	
	NEWS CORP-CLASS B	3,100	19.25	59,675.00	
	OMNICOM GROUP	1,800	49.39	88,902.00	
	SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	700	48.68	34,076.00	
	SIRIUS XM RADIO INC	25,400	2.23	56,642.00	
	THE WALT DISNEY CO.	11,000	42.08	462,880.00	
	TIME WARNER CABLE INC	2,101	81.43	171,084.43	
	TIME WARNER INC	6,533	36.31	237,213.23	
	VIACOM INC-CLASS B	3,150	47.26	148,869.00	
	VIRGIN MEDIA INC	2,100	23.66	49,686.00	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	700	48.24	33,768.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	500	90.87	45,435.00	
	AMAZON.COM INC	2,300	191.10	439,530.00	
	AUTOZONE INC	200	380.00	76,000.00	
	BED BATH & BEYOND INC	1,600	68.17	109,072.00	
	BEST BUY CO INC	2,000	22.00	44,000.00	
	CARMAX INC	1,600	31.26	50,016.00	
	DOLLAR GENERAL CORPORATION	1,000	46.64	46,640.00	
	DOLLAR TREE INC	850	98.45	83,682.50	
	EXPEDIA INC	700	31.55	22,085.00	
	FAMILY DOLLAR STORES	600	67.49	40,494.00	
	GAMESTOP CORP-CLASS A	1,000	22.29	22,290.00	
	GAP INC/THE	2,200	27.50	60,500.00	
	GENUINE PARTS CO	1,000	63.45	63,450.00	
	HOME DEPOT INC	10,000	51.56	515,600.00	
J.C. PENNEY CO INC	1,200	34.24	41,088.00		

KOHL'S CORP	1,600	50.53	80,848.00
LIBERTY INTERACTIVE-A	3,625	18.45	66,881.25
LIMITED BRANDS INC	1,700	49.04	83,368.00
LOWE'S COS INC	8,100	32.00	259,200.00
MACY'S INC	2,700	39.65	107,055.00
NETFLIX INC	300	107.09	32,127.00
NORDSTROM INC	1,100	55.56	61,116.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	800	95.99	76,792.00
PETSMART INC	700	56.97	39,879.00
PRICELINE COM INC	300	717.18	215,154.00

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	ROSS STORES INC	1,600	59.92	95,872.00	
	SEARS HOLDINGS CORP	300	55.66	16,698.00	
	STAPLES INC	4,500	15.66	70,470.00	
	TARGET CORP	4,100	56.79	232,839.00	
	TIFFANY & CO	900	66.15	59,535.00	
	TJX COMPANIES INC	4,900	41.09	201,341.00	
	URBAN OUTFITTERS INC	900	29.06	26,154.00	
	COSTCO WHOLESALE CORP	2,800	87.09	243,852.00	
	CVS CAREMARK CORPORATION	8,372	43.33	362,758.76	
	KROGER CO	3,700	23.21	85,877.00	
	SAFEWAY INC	2,500	21.99	54,975.00	
	SYSCO CORP	4,000	29.55	118,200.00	
	WAL-MART STORES INC	12,200	61.75	753,350.00	
	WALGREEN CO	5,700	35.63	203,091.00	
	WHOLE FOODS MARKET INC	1,000	83.96	83,960.00	
	ALTRIA GROUP INC	13,300	31.78	422,674.00	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	4,300	30.66	131,838.00	
	BEAM INC	900	56.53	50,877.00	
	BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	500	84.29	42,145.00	
	BUNGE LIMITED	1,000	66.73	66,730.00	
	CAMPBELL SOUP COMPANY	1,400	33.81	47,334.00	
	COCA-COLA CO/THE	13,200	73.82	974,424.00	
	COCA-COLA ENTERPRISES INC	2,100	28.60	60,060.00	
	CONAGRA FOODS INC	2,700	26.07	70,389.00	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,400	21.10	29,540.00	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	1,439	40.50	58,279.50	
	GENERAL MILLS INC	4,200	39.02	163,884.00	
	GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS INC	800	43.42	34,736.00	
	HERSHEY CO/THE	1,200	62.90	75,480.00	
	HJ HEINZ CO	2,200	53.01	116,622.00	
	HORMEL FOODS CORPORATION	900	28.34	25,506.00	
	KELLOGG COMPANY	1,700	53.80	91,460.00	
KRAFT FOODS INC-A	10,844	38.20	414,240.80		
LORILLARD INC	900	136.25	122,625.00		
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	800	54.94	43,952.00		
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	1,300	82.95	107,835.00		
MOLSON COORS BREWING CO-B	1,100	41.26	45,386.00		

MONSTER BEVERAGE CORPORATION	1,000	63.16	63,160.00	
PEPSICO INC	10,086	66.15	667,188.90	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	11,200	86.75	971,600.00	
RALCORP HOLDINGS INC	400	73.26	29,304.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	2,400	41.64	99,936.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	SARA LEE CORP	3,600	21.68	78,048.00	
	THE JM SMUCKER COMPANY	700	79.25	55,475.00	
	TYSON FOODS INC-CL A	2,200	17.97	39,534.00	
	AVON PRODUCTS INC	3,000	22.19	66,570.00	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	1,000	50.62	50,620.00	
	CLOROX COMPANY	1,000	70.00	70,000.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	3,100	98.18	304,358.00	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	400	71.30	28,520.00	
	ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	1,600	62.78	100,448.00	
	HERBALIFE LIMITED	900	70.91	63,819.00	
	KIMBERLY-CLARK CORP	2,500	75.27	188,175.00	
	PROCTER & GAMBLE CO	17,792	66.57	1,184,413.44	
	AETNA INC	2,300	49.07	112,861.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	1,700	37.48	63,716.00	
	BARD (C.R.) INC	600	98.30	58,980.00	
	BAXTER INTERNATIONAL INC.	3,600	54.18	195,048.00	
	BECTON DICKINSON & CO	1,400	76.20	106,680.00	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	9,603	5.85	56,177.55	
	CARDINAL HEALTH INC	2,200	41.17	90,574.00	
	CAREFUSION CORPORATION	1,550	25.61	39,695.50	
	CERNER CORPORATION	900	74.07	66,663.00	
	CIGNA CORP	1,800	48.01	86,418.00	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	1,100	33.50	36,850.00	
	COVIDIEN PLC	3,050	54.20	165,310.00	
	DAVITA INC	600	87.20	52,320.00	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	900	39.73	35,757.00	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	700	72.93	51,051.00	
	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	5,025	58.57	294,314.25	
	HCA HOLDINGS INC	1,100	27.60	30,360.00	
	HENRY SCHEIN INC	600	74.14	44,484.00	
	HOLOGIC INC	2,000	20.67	41,350.00	
	HUMANA INC	1,100	89.75	98,725.00	
	INTUITIVE SURGICAL INC	300	579.22	173,766.00	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	600	88.83	53,298.00		
MCKESSON CORP	1,600	90.57	144,912.00		
MEDTRONIC INC	6,800	37.92	257,856.00		
OMNICARE INC	800	34.98	27,984.00		
PATTERSON COMPANIES INC	800	32.84	26,272.00		
QUEST DIAGNOSTICS	1,000	58.82	58,820.00		
ST JUDE MEDICAL INC	2,200	38.33	84,326.00		
STRYKER CORP	2,000	54.36	108,720.00		

UNITEDHEALTH GROUP INC	6,900	58.71	405,099.00	
------------------------	-------	-------	------------	--

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	800	66.25	53,000.00	
	WELLPOINT INC	2,200	70.62	155,364.00	
	ZIMMER HOLDINGS INC	1,300	63.06	81,978.00	
	ABBOTT LABORATORIES	10,100	59.51	601,051.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,200	41.92	92,224.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,200	90.97	109,164.00	
	ALLERGAN INC	2,000	95.20	190,400.00	
	AMGEN INC	5,100	67.13	342,363.00	
	BIOGEN IDEC INC	1,500	125.95	188,925.00	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	10,900	33.93	369,837.00	
	CELGENE CORP	2,900	78.62	227,998.00	
	COVANCE INC	500	45.96	22,980.00	
	ELI LILLY & CO	6,700	39.75	266,325.00	
	FOREST LABORATORIES INC	1,700	33.86	57,562.00	
	GILEAD SCIENCES INC	4,900	52.27	256,123.00	
	HOSPIRA INC	1,200	34.39	41,268.00	
	ILLUMINA INC	900	44.06	39,654.00	
	JOHNSON & JOHNSON	17,600	63.03	1,109,328.00	
	LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	1,231	46.31	57,007.61	
	MERCK & CO. INC.	19,731	38.36	756,881.16	
	MYLAN INC	3,100	22.09	68,479.00	
	PERRIGO COMPANY	500	105.81	52,905.00	
	PFIZER INC	49,626	22.32	1,107,652.32	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	2,400	54.37	130,488.00	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,300	36.66	47,658.00	
	WARNER CHILCOTT PLC	900	15.92	14,328.00	
	WATERS CORP	600	88.04	52,824.00	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	800	68.11	54,488.00	
	BB&T CORPORATION	4,500	31.10	139,950.00	
	CIT GROUP INC	1,200	39.99	47,988.00	
	COMERICA INC	1,500	31.64	47,460.00	
	FIFTH THIRD BANCORP	5,900	13.72	80,948.00	
	HUDSON CITY BANCORP INC	3,200	6.65	21,280.00	
KEYCORP	7,000	7.91	55,370.00		
M & T BANK CORP	700	86.95	60,865.00		
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	3,200	13.04	41,728.00		
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	2,600	12.43	32,318.00		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	3,400	64.60	219,640.00		
REGIONS FINANCIAL CORP	9,317	6.12	57,020.04		
SUNTRUST BANKS INC	3,800	22.74	86,412.00		
US BANCORP	12,300	31.22	384,006.00		
WELLS FARGO & COMPANY	32,388	33.12	1,072,690.56		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	

米ドル		株	米ドル	米ドル	
	AMERICAN EXPRESS CO	6,800	57.57	391,476.00	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,540	53.56	82,482.40	
	BANK OF AMERICA CORP	65,498	8.77	574,417.46	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	7,807	22.76	177,687.32	
	BLACKROCK INC	700	190.60	133,420.00	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	3,200	53.93	172,576.00	
	CITIGROUP INC	18,920	34.85	659,362.00	
	CME GROUP INC	351	277.46	97,388.46	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,500	32.77	114,695.00	
	EATON VANCE CORPORATION	900	26.46	23,814.00	
	FRANKLIN RESOURCES INC	1,000	122.36	122,360.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,000	113.60	340,800.00	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	500	129.51	64,755.00	
	INVESCO LTD	3,080	24.29	74,813.20	
	JPMORGAN CHASE & CO	24,500	43.22	1,058,890.00	
	LEGG MASON INC	1,000	25.72	25,720.00	
	LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,400	24.32	34,048.00	
	MOODY'S CORP	1,300	41.22	53,586.00	
	MORGAN STANLEY	9,300	18.07	168,051.00	
	NASDAQ OMX GROUP INC	800	24.70	19,760.00	
	NORTHERN TRUST CORP	1,400	46.51	65,114.00	
	NYSE EURONEXT	1,800	26.74	48,132.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	1,100	19.95	21,945.00	
	SLM CORPORATION	3,500	14.91	52,185.00	
	STATE STREET CORP	3,162	45.03	142,384.86	
	T ROWE PRICE GROUP INC	1,600	61.76	98,816.00	
	TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	1,600	18.30	29,280.00	
	THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	7,400	13.98	103,452.00	
	ACE LIMITED	2,200	74.84	164,648.00	
	AFLAC INC	3,000	42.29	126,870.00	
	ALLEGHANY CORPORATION	100	337.54	33,754.00	
	ALLSTATE CORP	3,300	32.81	108,273.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,475	32.27	112,138.25	
	AON PLC	1,900	49.71	94,449.00	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	900	38.54	34,686.00	
	ASSURANT INC	600	39.08	23,448.00	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	800	34.29	27,432.00	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	5,900	79.28	467,752.00	
	CHUBB CORP	1,800	72.19	129,942.00	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,100	34.36	37,796.00	
	EVEREST RE GROUP LTD	300	94.17	28,251.00	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-A	1,500	18.73	28,095.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	3,400	6.04	20,536.00	
	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	2,900	20.07	58,203.00	
	LINCOLN NATIONAL CORP	2,100	23.90	50,190.00	

LOEWS CORPORATION	2,000	39.55	79,100.00	
MARSH & MCLENNAN COS	3,500	32.89	115,115.00	
METLIFE INC	6,800	35.38	240,584.00	
PARTNERRE LTD	400	67.41	26,964.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,000	28.26	56,520.00	
PROGRESSIVE CORP	3,800	22.38	85,044.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,000	60.17	180,510.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	300	75.09	22,527.00	
TORCHMARK CORPORATION	650	48.63	31,609.50	
TRAVELERS COS INC/THE	2,800	61.70	172,760.00	
UNUM GROUP	2,100	23.55	49,455.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	1,100	35.67	39,237.00	
WR BERKLEY CORP	900	37.82	34,038.00	
XL GROUP PLC	2,200	21.37	47,014.00	
CBRE GROUP INC	2,200	18.46	40,612.00	
ACCENTURE PLC	4,100	63.05	258,505.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	3,700	12.25	45,325.00	
ADOBE SYSTEMS INC	3,200	32.90	105,280.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,200	37.86	45,432.00	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	300	127.44	38,232.00	
AUTODESK INC	1,500	40.58	60,870.00	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	3,300	54.62	180,246.00	
BMC SOFTWARE INC	1,100	40.62	44,682.00	
CA INC	2,500	26.53	66,325.00	
CITRIX SYSTEMS INC	1,200	78.20	93,840.00	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	2,000	71.90	143,800.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	1,000	27.56	27,560.00	
EBAY INC	7,500	40.60	304,500.00	
ELECTRONIC ARTS INC	2,500	14.75	36,875.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,480	33.10	48,988.00	
FISERV INC	1,000	68.73	68,730.00	
GOOGLE INC-CL A	1,700	600.00	1,020,000.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	7,600	199.51	1,516,276.00	
INTUIT INC	1,800	60.90	109,620.00	
MASTERCARD INC.-CLASS A	700	436.82	305,774.00	
MICROSOFT CORP	48,900	31.03	1,517,367.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	1,700	22.88	38,896.00	
ORACLE CORP	26,100	28.98	756,378.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	PAYCHEX INC	2,100	30.77	64,617.00	
	RED HAT INC	1,200	60.13	72,156.00	
	SAIC INC	2,100	12.05	25,305.00	
	SALESFORCE COM INC	800	159.57	127,656.00	
	SYMANTEC CORP	4,800	18.09	86,832.00	
	SYNOPSYS INC	1,100	29.59	32,549.00	
	TERADATA CORPORATION	1,100	68.96	75,856.00	

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,400	23.29	32,606.00	
VERISIGN INC	1,100	41.95	46,145.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	3,400	121.19	412,046.00	
VMWARE INC-CLASS A	600	113.75	68,250.00	
WESTERN UNION COMPANY	4,000	18.05	72,200.00	
YAHOO! INC	7,600	15.39	116,964.00	
AMPHENOL CORPORATION-CL A	1,200	57.63	69,156.00	
APPLE INC	6,000	587.95	3,527,700.00	
ARROW ELECTRONICS INC	700	41.03	28,721.00	
AVNET INC	1,000	35.29	35,290.00	
CISCO SYSTEMS INC	34,700	19.92	691,224.00	
CORNING INC	10,100	13.53	136,653.00	
DELL INC	10,400	16.16	168,064.00	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	300	37.74	11,322.00	
EMC CORP/MASSACHUSETTS	13,200	28.10	370,920.00	
F5 NETWORKS INC	500	133.98	66,990.00	
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	5,600	6.80	38,080.00	
FLIR SYSTEMS INC	1,100	23.42	25,762.00	
HARRIS CORPORATION	700	44.21	30,947.00	
HEWLETT-PACKARD COMPANY	12,800	24.71	316,288.00	
JUNIPER NETWORKS INC	3,400	20.93	71,162.00	
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	1,775	38.89	69,029.75	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,871	48.91	91,510.61	
NETAPP INC	2,400	39.67	95,208.00	
QUALCOMM INC	10,900	62.67	683,103.00	
SANDISK CORP	1,700	40.47	68,799.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	2,700	28.81	77,787.00	
TE CONNECTIVITY LIMITED	2,650	35.03	92,829.50	
WESTERN DIGITAL CORP	1,600	42.05	67,280.00	
XEROX CORP	9,041	7.91	71,514.31	
AT&T INC	38,319	30.74	1,177,926.06	
CENTURYLINK INC	4,026	38.07	153,269.82	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	1,800	54.79	98,622.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	7,432	4.13	30,694.16	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	1,200	23.25	27,900.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	1,700	8.14	13,838.00	
	NII HOLDINGS INC	1,100	19.42	21,362.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	700	51.86	36,302.00	
	SPRINT NEXTEL CORP	21,100	2.40	50,640.00	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	18,300	38.15	698,145.00	
	WINDSTREAM CORPORATION	3,600	11.28	40,608.00	
	AES CORP	4,600	12.12	55,752.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	800	43.47	34,776.00	
	AMEREN CORPORATION	1,800	31.29	56,322.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	3,100	37.89	117,459.00	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,200	33.32	39,984.00	
CALPINE CORPORATION	2,100	17.92	37,632.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	2,900	19.33	56,057.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	1,900	57.90	110,010.00	
DOMINION RESOURCES INC/VA	3,700	50.54	186,998.00	
DTE ENERGY COMPANY	1,200	54.72	65,664.00	
DUKE ENERGY CORPORATION	8,568	20.87	178,814.16	
EDISON INTERNATIONAL	2,100	42.52	89,292.00	
ENTERGY CORP	1,200	65.37	78,444.00	
EXELON CORP	5,502	37.61	206,930.22	
FIRSTENERGY CORP	2,667	45.42	121,135.14	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	600	52.44	31,464.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	1,400	21.79	30,506.00	
NEXTERA ENERGY INC	2,600	62.72	163,072.00	
NISOURCE INC	1,900	24.07	45,733.00	
NORTHEAST UTILITIES	2,118	35.92	76,078.56	
NRG ENERGY INC	1,800	15.06	27,108.00	
ONEOK INC	600	80.94	48,564.00	
P G & E CORPORATION	2,600	42.79	111,254.00	
PEPCO HOLDINGS INC	1,700	18.44	31,348.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	800	47.06	37,648.00	
PPL CORPORATION	3,700	26.90	99,530.00	
PROGRESS ENERGY INC	2,000	51.93	103,860.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	3,300	30.08	99,264.00	
SCANA CORPORATION	800	44.86	35,888.00	
SEMPRA ENERGY	1,600	63.51	101,616.00	
SOUTHERN CO	5,600	45.50	254,800.00	
WISCONSIN ENERGY CORPORATION	1,600	35.43	56,688.00	
XCEL ENERGY INC	3,100	26.31	81,561.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	4,100	7.97	32,677.00	
ALTERA CORPORATION	2,100	38.50	80,850.00	
ANALOG DEVICES INC	1,900	38.28	72,732.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル		株	米ドル	米ドル	
	APPLIED MATERIALS INC	8,500	11.86	100,810.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LIMITED	1,400	35.71	49,994.00	
	BROADCOM CORP-CL A	3,100	35.73	110,763.00	
	CREE INC	700	30.12	21,084.00	
	FIRST SOLAR INC	400	21.40	8,560.00	
	INTEL CORP	32,900	27.69	911,001.00	
	KLA-TENCOR CORPORATION	1,200	53.37	64,044.00	
	LAM RESEARCH CORP	800	41.44	33,152.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	1,600	32.93	52,688.00	
	LSI CORPORATION	3,600	8.07	29,052.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	3,300	15.42	50,886.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	1,900	27.74	52,706.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,300	35.76	46,488.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	6,200	7.01	43,462.00		

	NVIDIA CORP	3,900	13.67	53,313.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	7,400	32.68	241,832.00	
	XILINX INC	1,700	35.03	59,551.00	
	株			米ドル	
	米ドル建小計	1,966,134	-	82,117,736.57 (6,705,734,368円)	
カナダドル	株		カナダドル	カナダドル	
	ARC RESOURCES LIMITED	2,000	18.50	37,000.00	
	ATHABASCA OIL SANDS CORPORATION	2,000	10.56	21,120.00	
	BAYTEX ENERGY CORPORATION	900	51.10	45,990.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	1,000	17.16	17,160.00	
	CAMECO CORP (CA)	2,500	21.07	52,675.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	7,100	32.15	228,265.00	
	CANADIAN OIL SANDS LIMITED	3,100	20.64	63,984.00	
	CENOVUS ENERGY INC	5,100	34.55	176,205.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,800	42.42	76,356.00	
	ENBRIDGE INC	4,800	39.22	188,256.00	
	ENCANA CORP	4,700	18.00	84,600.00	
	ENERPLUS CORP	1,200	18.00	21,600.00	
	HUSKY ENERGY INC	2,200	24.44	53,768.00	
	IMPERIAL OIL LTD	1,900	44.71	84,949.00	
	MEG ENERGY CORPORATION	800	37.86	30,288.00	
	NEXEN INC	3,400	19.01	64,634.00	
	NIKO RESOURCES LTD	300	37.50	11,250.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	1,700	28.49	48,433.00	
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	1,300	28.98	37,674.00	
	PENGROWTH ENERGY CORPORATION	2,500	8.54	21,350.00	
	PENN WEST PETROLEUM LIMITED	3,200	16.67	53,344.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
カナダドル	株		カナダドル	カナダドル	
	PRECISION DRILLING CORPORATION	1,700	9.07	15,419.00	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORPORATION	1,300	9.66	12,558.00	
	SUNCOR ENERGY INC	10,248	31.42	321,992.16	
	TALISMAN ENERGY INC	7,000	12.81	89,670.00	
	TOURMALINE OIL CORPORATION	800	19.29	15,432.00	
	TRANSCANADA CORPORATION	4,500	42.91	193,095.00	
	VERMILION ENERGY INC	700	45.38	31,766.00	
	AGNICO-EAGLE MINES	1,200	33.60	40,320.00	
	AGRIUM INC	1,000	85.45	85,450.00	
	BARRICK GOLD CORP	6,500	40.75	264,875.00	
	CENTERRA GOLD INC	1,300	12.38	16,094.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	4,200	14.19	59,598.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	3,400	21.52	73,168.00	
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	800	41.65	33,320.00	
	GOLDCORP INC	5,207	41.18	214,424.26	
	IAMGOLD CORPORATIO	2,500	12.66	31,650.00	
	INMET MINING CORPORATION	400	55.91	22,364.00	
	IVANHOE MINES LIMITED	1,800	12.96	23,328.00	

KINROSS GOLD CORP	7,256	9.12	66,174.72	
NEW GOLD INC	3,100	9.76	30,256.00	
OSISKO MINING CORPORATION	2,600	9.62	25,012.00	
PAN AMERICAN SILVER CORPORATION	700	19.21	13,447.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	5,500	43.15	237,325.00	
SILVER WHEATON CORPORATION	2,300	29.40	67,620.00	
SINO-FOREST CORPORATION	1,700	0.00	0.00	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	3,845	37.08	142,572.60	
YAMANA GOLD INC	4,800	14.24	68,352.00	
BOMBARDIER INC 'B'	10,300	4.13	42,539.00	
CAE INC	1,700	10.57	17,969.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	1,200	27.00	32,400.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	1,000	38.55	38,550.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS INCORPORATED	600	20.91	12,546.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,900	79.56	230,724.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,100	76.03	83,633.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,400	45.53	63,742.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	800	26.76	21,408.00	
TIM HORTONS INC(CA)	1,000	54.00	54,000.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	2,700	20.01	54,027.00	
THOMSON REUTERS CORP(CA)	2,500	28.27	70,675.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	500	68.71	34,355.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	800	38.75	31,000.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
カナダドル		株	カナダドル	カナダドル	
	EMPIRE COMPANY LIMITED A	200	58.73	11,746.00	
	GEORGE WESTON LIMITED	400	61.64	24,656.00	
	LOBLAW COMPANIES LTD	900	32.46	29,214.00	
	METRO INC	700	53.15	37,205.00	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	1,400	43.55	60,970.00	
	SAPUTO INC	1,000	44.83	44,830.00	
	VITERRA INC	2,500	15.94	39,850.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	1,800	54.86	98,748.00	
	BANK OF MONTREAL	4,100	59.39	243,499.00	
	BANK OF NOVA SCOTIA	7,000	55.05	385,350.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,600	75.04	195,104.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	1,000	78.05	78,050.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	9,300	57.22	532,146.00	
	TORONTO-DOMINION BANK(CA)	5,838	83.93	489,983.34	
	CI FINANCIAL CORPORATION	1,200	23.80	28,560.00	
	IGM FINANCIAL INC	700	46.42	32,494.00	
	ONEX CORPORATION	600	37.17	22,302.00	
	TMX GROUP INC	500	44.64	22,320.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	100	396.57	39,657.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	2,000	24.69	49,380.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES	700	31.09	21,763.00	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	800	61.85	49,480.00	

MANULIFE FINANCIAL CORP	11,600	13.47	156,252.00	
POWER CORP OF CANADA	2,500	26.87	67,175.00	
POWER FINANCIAL CORP	1,700	29.61	50,337.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	3,800	24.80	94,240.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	3,575	32.14	114,900.50	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	1,850	17.61	32,578.50	
CGI GROUP INC -CL A	1,700	21.31	36,227.00	
OPEN TEXT CORPORATION	400	59.07	23,628.00	
RESEARCH IN MOTION	3,000	13.42	40,260.00	
BCE INC	1,800	39.89	71,802.00	
BELL ALIANT INC	500	27.35	13,675.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	2,700	39.67	107,109.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	1,000	58.17	58,170.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	700	66.39	46,473.00	
FORTIS INC	1,200	33.06	39,672.00	
TRANSALTA CORP	1,600	16.61	26,576.00	
カナダドル建小計	株 253,319	-	カナダドル 7,918,134.08 (650,237,170円)	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	978	20.98	20,518.44	
	ENI SPA	15,521	16.24	252,061.04	
	FUGRO NV-CVA	463	52.99	24,534.37	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,700	10.92	18,572.50	
	NESTE OIL OYJ	1,100	8.94	9,839.50	
	OMV AG	1,040	24.02	24,980.80	
	REPSOL YPF SA	5,125	14.66	75,158.12	
	SAIPEM	1,808	37.37	67,564.96	
	SBM OFFSHORE NV	1,132	13.39	15,163.14	
	TECHNIP S.A.	641	87.66	56,190.06	
	TENARIS SA	3,188	13.53	43,133.64	
	TOTAL SA	13,709	36.33	498,116.51	
	ACERINOX SA	691	9.02	6,236.96	
	AIR LIQUIDE SA	1,833	96.78	177,397.74	
	AKZO NOBEL	1,516	42.36	64,217.76	
	ARCELORMITTAL	5,545	12.83	71,170.07	
	ARKEMA	376	67.73	25,466.48	
	BASF SE	5,932	65.01	385,639.32	
	CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	1,369	5.50	7,530.86	
	CRH PLC(IE)	4,910	14.85	72,913.50	
	HEIDELBERGCEMENT AG	955	42.91	40,979.05	
	IMERYS SA	247	43.45	10,732.15	
	K+S AG	1,113	37.18	41,381.34	
	KONINKLIJKE DSM NV	1,041	42.31	44,044.71	
	LAFARGE SA	1,354	29.43	39,854.99	
	LANXESS AG	537	61.08	32,799.96	
	LINDE AG	1,103	128.95	142,231.85	
	SALZGITTER AG	292	39.41	11,507.72	

SOLVAY SA	411	89.78	36,899.58	
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	4,279	5.28	22,614.51	
THYSSENKRUPP AG	2,492	18.34	45,715.74	
UMICORE	790	43.53	34,392.65	
UPM-KYMMENE OYJ	3,825	9.16	35,056.12	
VOESTALPINE AG	762	23.60	17,983.20	
WACKER CHEMIE AG	106	58.58	6,209.48	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	982	15.78	15,500.87	
ALSTOM	1,399	26.29	36,779.71	
BEKAERT NV	298	20.30	6,050.89	
BOSKALIS WESTMINSTER NV	485	27.02	13,104.70	
BOUYGUES SA	1,432	20.43	29,255.76	
BRENNTAG AG	317	92.04	29,176.68	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	2,594	30.40	78,857.60	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユ - 口		株	ユ - 口	ユ - 口	
	EIFFAGE SA	275	24.36	6,699.00	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE & SPACE CO	2,800	30.85	86,380.00	
	FERROVIAL SA	2,972	8.09	24,058.34	
	FIAT INDUSTRIAL SPA	5,194	8.34	43,317.96	
	FINMECCANICA SPA	2,733	3.32	9,073.56	
	FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS SA	387	13.01	5,034.87	
	GEA GROUP AG	1,327	25.78	34,216.69	
	HOCHTIEF AG	294	43.60	12,818.40	
	KONE OYJ-B	1,115	42.31	47,175.65	
	KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRONICS NV	6,516	14.08	91,777.86	
	LEGRAND SA	1,445	25.69	37,129.27	
	MAN SE	431	102.30	44,091.30	
	METSO OYJ	959	32.45	31,119.55	
	PRYSMIAN SPA	1,555	12.58	19,561.90	
	SAFRAN SA	1,126	25.59	28,819.97	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	3,162	47.41	149,926.23	
	SIEMENS AG-REG	5,314	69.86	371,236.04	
	THALES SA	621	26.54	16,484.44	
	VALLOUREC SA	793	42.65	33,825.41	
	VINCI SA	2,919	34.13	99,640.06	
	WARTSILA OYJ-B SHARES	1,200	28.02	33,624.00	
	WENDEL	223	55.99	12,485.77	
	ZARDOYA OTIS SA	1,200	9.33	11,196.00	
	BUREAU VERITAS SA	415	67.24	27,904.60	
	EDENRED	1,214	23.50	28,535.07	
	RANDSTAD HOLDING NV	766	25.89	19,831.74	
SOCIETE BIC SA	232	74.68	17,325.76		
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	2,806	11.23	31,511.38		
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	206	63.48	13,076.88		
ATLANTIA SPA	2,070	11.26	23,308.20		

DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,587	9.82	15,598.62	
DEUTSCHE POST AG-REG	5,779	14.05	81,223.84	
FRAPORT AG	319	48.59	15,501.80	
GROUPE EUROTUNNEL SA	4,145	6.49	26,909.34	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	6,734	2.07	13,999.98	
KONINKLIJKE VOPAK NV	544	47.76	25,984.16	
TNT EXPRESS NV	2,609	9.22	24,068.02	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,138	68.32	146,068.16	
BMW-PFD	443	45.04	19,952.72	
CONTINENTAL AG	543	69.10	37,521.30	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	5,854	40.85	239,135.90	
FIAT SPA	5,737	3.83	21,984.18	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユ - 口		株	ユ - 口	ユ - 口	
	MICHELIN (CGDE)-B	1,163	52.15	60,650.45	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	744	35.29	26,255.76	
	PEUGEOT SA	1,490	9.23	13,757.17	
	PIRELLI & C SPA	2,020	8.75	17,685.10	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	1,061	41.87	44,424.07	
	RENAULT SA	1,306	35.79	46,748.27	
	VOLKSWAGEN AG	199	115.50	22,984.50	
	VOLKSWAGEN AG-PFD	934	127.00	118,618.00	
	ADIDAS AG	1,351	59.51	80,398.01	
	CHRISTIAN DIOR SA	370	111.50	41,255.00	
	LUXOTTICA GROUP SPA	754	26.66	20,101.64	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	1,640	123.10	201,884.00	
	ACCOR SA	1,018	26.03	26,498.54	
	AUTOGRILL SPA	864	7.50	6,480.00	
	OPAP SA	1,797	6.84	12,291.48	
	SODEXO	609	60.79	37,021.11	
	AXEL SPRINGER AG	342	35.63	12,185.46	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	687	26.96	18,524.95	
	JC DECAUX SA	563	22.05	12,414.15	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	651	47.75	31,085.25	
	LAGARDERE S.C.A.	949	21.67	20,564.83	
	MEDIASET SPA	5,077	1.71	8,727.36	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	587	19.04	11,176.48	
	PUBLICIS GROUPE	937	38.47	36,051.07	
	REED ELSEVIER NV(NL)	4,767	9.11	43,465.50	
	SANOMA OYJ	683	7.95	5,429.85	
	SES	1,936	19.05	36,890.48	
	SOCIETE TELEVISION FRANCAISE 1	1,021	7.57	7,738.15	
	WOLTERS KLUWER NV-CVA	2,029	13.27	26,924.83	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	1,409	68.81	96,953.29	
PPR	491	120.05	58,944.55		
CARREFOUR SA	3,943	15.40	60,741.91		
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	416	72.28	30,068.48		
COLRUYT SA	523	29.91	15,645.54		
DELHAIZE GROUP	726	36.52	26,513.52		

DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	4,046	3.45	13,995.11	
JERONIMO MARTINS SGPS SA	1,496	15.49	23,173.04	
KESKO OYJ-B SHS	575	23.07	13,265.25	
KONINKLIJKE AHOLD NV	7,504	9.87	74,064.48	
METRO AG	965	25.01	24,139.47	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	5,185	55.50	287,767.50	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユ - 口		株	ユ - 口	ユ - 口	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING COMPANY SA	1,475	14.63	21,579.25	
	DANONE	3,772	54.36	205,045.92	
	HEINEKEN HOLDING NV	778	36.29	28,233.62	
	HEINEKEN NV	1,770	42.97	76,065.75	
	KERRY GROUP PLC-A	948	34.01	32,246.22	
	PERNOD-RICARD SA	1,282	78.70	100,893.40	
	SUEDZUCKER AG	576	23.70	13,651.20	
	UNILEVER NV-CVA	10,521	25.52	268,495.92	
	BEIERSDORF AG	722	51.61	37,262.42	
	HENKEL AG & CO KGAA	877	45.70	40,078.90	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,151	55.73	64,145.23	
	L'OREAL	1,553	91.74	142,472.22	
	CELESIO AG	801	12.64	10,124.64	
	ESSILOR INTERNATIONAL SA	1,299	65.26	84,772.74	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	1,355	53.62	72,655.10	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	734	74.51	54,690.34	
	BAYER AG	5,341	52.40	279,868.40	
	ELAN CORPORATION PLC	3,448	10.47	36,100.56	
	GRIFOLS SA	1,100	16.57	18,232.50	
	MERCK KGAA	448	83.69	37,493.12	
	ORION OYJ-CLASS B	777	14.63	11,367.51	
	QIAGEN NV	1,572	11.98	18,840.42	
	SANOFI	7,358	55.78	410,429.24	
	UCB SA	681	34.21	23,300.41	
	BANCA CARIGE SPA	6,320	0.79	5,040.20	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	31,043	0.25	7,760.75	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	30,084	4.94	148,855.63	
	BANCO DE SABADELL SA	13,404	1.77	23,845.71	
	BANCO ESPIRITO SANTO SA-RIGHTS	4,566	0.33	1,506.78	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	4,566	0.60	2,739.60	
	BANCO POPOLARE SPA	11,306	1.08	12,312.23	
	BANCO POPULAR ESPANOL SA	7,349	2.33	17,123.17	
	BANCO SANTANDER SA	55,441	4.63	257,079.91	
BANKIA SA	5,886	2.54	14,956.32		
BANKINTER SA	1,447	3.10	4,488.59		
BNP PARIBAS	6,240	28.55	178,183.20		
CAIXABANK	5,828	2.54	14,838.08		
COMMERZBANK AG	23,484	1.60	37,574.40		

CREDIT AGRICOLE SA	6,660	3.65	24,348.96	
ERSTE GROUP BANK AG	1,311	15.75	20,654.80	
INTESA SANPAOLO	65,074	1.14	74,379.58	
INTESA SANPAOLO-RSP	9,145	1.00	9,145.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユ - 口		株	ユ - 口	ユ - 口	
	KBC GROEP NV	1,117	13.76	15,375.50	
	NATIONAL BANK OF GREECE	6,849	1.76	12,054.24	
	NATIXIS SA	5,891	2.30	13,590.53	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	315	22.85	7,197.75	
	SOCIETE GENERALE	4,260	16.72	71,227.20	
	UNICREDIT SPA	26,141	2.98	77,952.46	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	5,745	2.55	14,695.71	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	6,003	33.90	203,501.70	
	DEUTSCHE BOERSE AG	1,332	47.00	62,610.66	
	EURAZEO	258	37.89	9,775.62	
	EXOR SPA	612	17.23	10,544.76	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	593	52.93	31,387.49	
	ING GROEP NV-CVA	24,737	5.39	133,332.43	
	MEDIOBANCA SPA	3,553	3.70	13,153.20	
	POHJOLA BANK PLC	1,171	7.66	8,969.86	
	AEGON NV	11,723	3.58	42,073.84	
	AGEAS	15,487	1.40	21,759.23	
	ALLIANZ SE-REG	2,935	83.40	244,779.00	
	ASSICURAZIONI GENERALI	7,541	10.17	76,691.97	
	AXA	11,240	10.32	115,996.80	
	CNP ASSURANCES	1,009	10.26	10,352.34	
	DELTA LLOYD NV	611	12.00	7,332.00	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG-REG	410	44.37	18,191.70	
	MAPFRE SA	5,115	2.18	11,150.70	
	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	1,158	113.40	131,317.20	
	SAMPO OYJ-A SHS	2,713	19.80	53,717.40	
	SCOR SE	1,291	19.63	25,348.78	
	VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG	334	29.90	9,986.60	
	IMMOFINANZ AG	6,384	2.65	16,930.36	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	2,104	15.02	31,602.08	
	ATOS	382	45.57	17,407.74	
	CAP GEMINI SA	1,105	28.31	31,282.55	
	DASSAULT SYSTEMES SA	444	69.95	31,057.80	
	INDRA SISTEMAS SA	856	7.46	6,392.60	
	IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00	
	SAP AG	5,943	49.31	293,049.33	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,068	13.84	14,781.12	
	ALCATEL-LUCENT	15,748	1.44	22,803.10	
	NEOPOST SA	219	43.30	9,482.70	
	NOKIA OYJ	24,187	2.91	70,577.66	
	BELGACOM SA	1,141	23.16	26,425.56	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	株 18,141	ユーロ 8.49	ユーロ 154,053.37	
	ELISA OYJ	998	16.06	16,027.88	
	FRANCE TELECOM SA	11,975	9.91	118,756.07	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,665	3.02	5,028.30	
	ILIAD SA	141	98.11	13,833.51	
	KONINKLIJKE KPN NV	9,543	6.67	63,680.43	
	MOBISTAR SA	286	33.20	9,495.20	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	4,567	3.80	17,354.60	
	TELECOM ITALIA SPA	60,656	0.80	48,646.11	
	TELECOM ITALIA-RSP	43,169	0.66	28,685.80	
	TELEFONICA SA	26,529	10.76	285,584.68	
	TELEKOM AUSTRIA AG	2,612	8.24	21,525.49	
	VIVENDI	8,054	12.41	99,990.41	
	A2A SPA	9,311	0.45	4,196.46	
	ACCIONA SA	173	44.84	7,758.18	
	E.ON AG	11,631	16.78	195,168.18	
	EDP RENOVAVEIS SA	1,896	3.38	6,408.48	
	ELECTRICITE DE FRANCE	1,633	15.31	25,001.23	
	ENAGAS SA	1,241	13.57	16,840.37	
	ENEL GREEN POWER SPA	11,501	1.23	14,226.73	
	ENEL SPA	42,512	2.40	102,368.89	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	12,887	2.08	26,908.05	
	FORTUM OYJ	2,869	16.38	46,994.22	
	GAS NATURAL SDG SA	2,333	10.31	24,053.23	
	GDF SUEZ	7,999	18.54	148,341.45	
	IBERDROLA SA	24,695	3.48	86,012.68	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	812	31.72	25,756.64	
	RWE AG	3,161	35.72	112,910.92	
	RWE AG-NON VTG PFD	362	32.99	11,942.38	
	SNAM SPA	10,379	3.42	35,496.18	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	2,100	10.32	21,672.00		
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	8,169	2.78	22,726.15		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,494	10.58	26,386.52		
VERBUND AG	511	20.45	10,452.50		
ASML HOLDING NV	2,786	38.38	106,940.61		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	7,019	7.67	53,856.78		
STMICROELECTRONICS NV	4,418	5.07	22,403.67		
ユーロ建小計	株 1,168,367	-	ユーロ 13,546,394.11 (1,455,153,655円)		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
英ポンド	AMEC PLC	株 2,296	英ポンド 11.17	英ポンド 25,646.32	

BG GROUP PLC	21,919	14.12	309,605.87	
BP PLC	122,474	4.40	538,946.83	
ESSAR ENERGY PLC	2,498	1.40	3,507.19	
PETROFAC LIMITED	1,907	17.53	33,429.71	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	23,517	21.22	499,148.32	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	17,194	21.83	375,345.02	
TULLOW OIL PLC	5,842	15.02	87,746.84	
ANGLO AMERICAN PLC	8,547	23.07	197,179.29	
ANTOFAGASTA PLC	2,679	11.70	31,344.30	
BHP BILLITON PLC(UK)	13,641	19.40	264,635.40	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	1,750	5.59	9,791.25	
FRESNILLO PLC	1,218	16.26	19,804.68	
GLENORE INTERNATIONAL PLC	9,455	4.15	39,323.34	
JOHNSON MATTHEY PLC	1,450	23.64	34,278.00	
KAZAKHMYS PLC	1,484	8.68	12,888.54	
LONMIN PLC	1,122	10.09	11,320.98	
RANDGOLD RESOURCES LIMITED	592	54.45	32,234.40	
REXAM PLC	6,281	4.31	27,089.95	
RIO TINTO PLC(UK)	8,859	35.12	311,172.37	
VEDANTA RESOURCES PLC	812	12.00	9,744.00	
XSTRATA PLC	13,403	11.40	152,794.20	
BAE SYSTEMS PLC	20,938	2.91	61,013.33	
BALFOUR BEATTY PLC	4,693	2.71	12,718.03	
BUNZL PLC	2,243	10.29	23,080.47	
COBHAM PLC	7,843	2.39	18,783.98	
INVENSYS PLC	6,116	1.90	11,669.32	
MEGGITT PLC	5,891	4.07	23,994.04	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	12,092	8.44	102,056.48	
SMITHS GROUP PLC	2,953	10.45	30,858.85	
THE WEIR GROUP PLC	1,616	17.52	28,312.32	
WOLSELEY PLC	1,933	24.11	46,604.63	
AGGREKO PLC	1,924	22.88	44,021.12	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	2,437	8.39	20,458.61	
CAPITA PLC	4,247	7.44	31,597.68	
EXPERIAN PLC	6,862	9.96	68,379.83	
G4S PLC	10,761	2.87	30,980.91	
INTERTEK GROUP PLC	1,106	26.05	28,811.30	
SERCO GROUP PLC	3,698	5.63	20,838.23	
GKN PLC	11,231	2.06	23,236.93	
BURBERRY GROUP PLC	3,020	14.89	44,967.80	
CARNIVAL PLC(UK)	1,243	19.95	24,797.85	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
英ポンド		株	英ポンド	英ポンド	
	COMPASS GROUP PLC	12,269	6.57	80,668.67	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,068	14.74	30,482.32	
	TUI TRAVEL PLC	3,418	1.92	6,583.06	
	WHITBREAD PLC	1,203	18.35	22,075.05	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	7,353	6.65	48,934.21	

ITV PLC	23,862	0.88	21,022.42	
PEARSON PLC	5,268	11.13	58,632.84	
REED ELSEVIER PLC(UK)	7,858	5.27	41,411.66	
WPP PLC	8,149	8.55	69,714.69	
KINGFISHER PLC	15,269	3.05	46,677.33	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	10,977	3.55	39,034.21	
NEXT PLC	1,238	30.13	37,300.94	
SAINSBURY (J) PLC	9,097	3.11	28,309.86	
TESCO PLC	51,782	3.20	165,728.29	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	14,010	2.94	41,217.42	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2,470	12.26	30,282.20	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	12,720	32.24	410,092.80	
DIAGEO PLC	16,136	15.89	256,401.04	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	6,510	25.45	165,679.50	
SABMILLER PLC	6,161	26.02	160,340.02	
TATE & LYLE PLC	3,543	6.85	24,269.55	
UNILEVER PLC	8,289	20.69	171,499.41	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	4,000	36.60	146,400.00	
SMITH & NEPHEW PLC	5,770	6.08	35,081.60	
ASTRAZENECA PLC	8,415	28.23	237,597.52	
GLAXOSMITHKLINE PLC	32,602	14.54	474,033.08	
SHIRE PLC	3,633	19.95	72,478.35	
BARCLAYS PLC	74,832	2.12	158,868.33	
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	115,399	5.54	640,002.85	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	266,321	0.29	78,005.42	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	127,930	0.23	30,498.51	
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	15,380	15.22	234,083.60	
3I GROUP PLC	6,593	1.91	12,638.78	
ICAP PLC	4,308	3.76	16,219.62	
INVESTEC PLC	3,511	3.55	12,478.09	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	1,294	10.76	13,923.44	
MAN GROUP PLC	13,910	0.93	12,991.94	
SCHRODERS PLC	763	14.46	11,032.98	
ADMIRAL GROUP PLC	1,441	12.09	17,421.69	
AVIVA PLC	18,762	2.99	56,210.95	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	37,924	1.18	44,977.86	
OLD MUTUAL PLC	35,915	1.48	53,477.43	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
英ポンド		株	英ポンド	英ポンド	
	PRUDENTIAL PLC	16,455	7.55	124,317.52	
	RESOLUTION LIMITED	10,394	2.25	23,386.50	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	23,760	1.03	24,662.88	
	STANDARD LIFE PLC	16,956	2.28	38,744.46	
	SAGE GROUP PLC (THE)	9,134	2.84	26,004.49	
	BT GROUP PLC	50,210	2.16	108,604.23	
	INMARSAT PLC	2,955	4.21	12,461.23	
	VODAFONE GROUP PLC	324,702	1.72	559,623.89	
	CENTRICA PLC	33,409	3.17	106,040.16	
	INTERNATIONAL POWER PLC	10,315	4.17	43,044.49	

	NATIONAL GRID PLC	22,990	6.48	148,975.20	
	SEVERN TRENT PLC	1,601	16.59	26,560.59	
	SSE PLC	6,060	13.31	80,658.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,883	6.05	29,542.15	
	ARM HOLDINGS PLC	8,727	6.07	53,016.52	
	英ポンド建小計	株 1,932,691	-	英ポンド 9,444,580.95 (1,238,279,008円)	
スイスフラン		株	スイスフラン	スイスフラン	
	TRANSOCEAN LIMITED(CHF)	2,311	45.55	105,266.05	
	GIVAUDAN-REG	56	887.50	49,700.00	
	HOLCIM LTD-REG	1,584	54.80	86,803.20	
	SIKA AG-BR	14	1,899.00	26,586.00	
	SYNGENTA AG(CH)	611	320.00	195,520.00	
	ABB LIMITED-REG	14,158	18.55	262,630.90	
	GEBERIT AG-REG	264	187.00	49,368.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	185	112.30	20,775.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	365	114.80	41,902.00	
	SULZER AG-REG	163	129.80	21,157.40	
	ADECCO SA-REG	881	44.87	39,530.47	
	SGS SA-REG	35	1,768.00	61,880.00	
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	349	113.00	39,437.00	
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	3,371	55.90	188,438.90	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	326	71.20	23,211.20	
	THE SWATCH GROUP AG-B	211	412.30	86,995.30	
	ARYZTA AG	634	45.70	28,973.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	14	864.50	12,103.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	1	34,690.00	34,690.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	7	2,930.00	20,510.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	21,313	57.20	1,219,103.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	317	100.90	31,985.30	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
スイスフラン		株	スイスフラン	スイスフラン	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	68	144.80	9,846.40	
	SYNTHES INC	422	156.80	66,169.60	
	ACTELION LTD-REG	800	32.95	26,360.00	
	LONZA GROUP AG-REG	386	42.46	16,389.56	
	NOVARTIS AG-REG SHS	15,073	50.95	767,969.35	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4,537	164.40	745,882.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	7,369	23.96	176,561.24	
	GAM HOLDING LIMITED	1,404	12.65	17,760.60	
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	1,404	35.35	49,631.40	
	PARGESA HOLDING SA-BR	235	59.75	14,041.25	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	101	173.90	17,563.90	
	UBS AG-REGISTERED	23,505	11.43	268,662.15	
	BALOISE HOLDING AG-REG	323	69.55	22,464.65	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	207	96.90	20,058.30	
	SWISS RE LIMITED	2,230	56.00	124,880.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	952	221.70	211,058.40	

	SWISSCOM AG-REG	151	337.00	50,887.00	
	スイスフラン建小計	株 106,337	-	スイスフラン 5,252,754.22 (469,386,117円)	
スウェーデン クローナ		株	スウェーデン クローナ	スウェーデンクローナ	
	LUNDIN PETROLEUM AB	1,687	137.70	232,299.90	
	BOLIDEN AB	1,847	105.00	193,935.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	448	176.20	78,937.60	
	SSAB AB-A SHARES	1,063	61.15	65,002.45	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	3,896	106.20	413,755.20	
	ALFA LAVAL AB	2,280	141.40	322,392.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,029	205.20	416,350.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	4,337	163.90	710,834.30	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,840	145.90	414,356.00	
	SANDVIK AB	6,487	95.45	619,184.15	
	SCANIA AB-B SHS	2,401	133.50	320,533.50	
	SKANSKA AB-B SHS	2,906	109.70	318,788.20	
	SKF AB-B SHARES	2,530	165.50	418,715.00	
	VOLVO AB-B SHS	8,988	88.80	798,134.40	
	SECURITAS AB-B SHS	2,279	62.50	142,437.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,746	138.00	240,948.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	3,554	39.68	141,022.72	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	413	341.90	141,204.70	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	6,604	232.70	1,536,750.80	
	SWEDISH MATCH AB	1,560	272.20	424,632.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
スウェーデン クローナ		株	スウェーデン クローナ	スウェーデンクローナ	
	GETINGE AB-B SHS	1,457	179.70	261,822.90	
	NORDEA BANK AB	16,990	56.80	965,032.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	9,581	45.42	435,169.02	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,164	207.90	657,795.60	
	SWEDBANK AB-A SHARES	5,299	103.70	549,506.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	903	95.55	86,281.65	
	INVESTOR AB-B SHS	2,942	134.00	394,228.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB	1,580	140.00	221,200.00	
	RATOS AB-B SHS	1,301	79.60	103,559.60	
	ERICSSON LM-B SHS	19,450	64.95	1,263,277.50	
	HEXAGON AB-B SHS	1,676	136.60	228,941.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	554	694.00	384,476.00	
	TELE2 AB-B SHS	2,293	124.20	284,790.60	
	TELIASONERA AB	13,983	41.97	586,866.51	
	スウェーデンクローナ建小計	株 141,068	-	スウェーデンクローナ 14,373,161.50 (174,346,448円)	
ノルウェー クローネ		株	ノルウェー クローネ	ノルウェークローネ	
	AKER SOLUTIONS ASA	1,347	95.95	129,244.65	
	SEADRILL LIMITED	2,121	220.00	466,620.00	

	STATOIL ASA	7,208	153.20	1,104,265.60	
	SUBSEA 7 SA	2,070	147.00	304,290.00	
	NORSK HYDRO ASA	5,880	29.29	172,225.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,208	276.50	334,012.00	
	ORKLA ASA	5,350	44.66	238,931.00	
	DNB ASA	6,312	69.80	440,577.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,359	70.60	95,945.40	
	TELENOR ASA	5,059	100.30	507,417.70	
ノルウェークローネ建小計		株 37,914	-	ノルウェークローネ 3,793,529.15 (53,906,049円)	
デンマーク クローネ		株	デンマーク クローネ	デンマーククローネ	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,650	160.00	264,000.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,412	51.45	72,647.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	4	40,240.00	160,960.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	9	42,200.00	379,800.00	
	DSV A/S	1,227	126.30	154,970.10	
	CARLSBERG AS-B	722	489.10	353,130.20	
COLOPLAST A/S	155	995.00	154,225.00		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
デンマーク クローネ		株	デンマーク クローネ	デンマーククローネ	
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	200	549.50	109,900.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	2,747	855.00	2,348,685.00	
	DANSKE BANK A/S	4,212	91.35	384,766.20	
	TRYG A/S	237	316.80	75,081.60	
TDC A/S	2,522	38.52	97,147.44		
デンマーククローネ建小計		株 15,097	-	デンマーククローネ 4,555,312.94 (65,778,718円)	
オーストラリ アドル		株	オーストラリ アドル	オーストラリアドル	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	1,146	13.60	15,585.60	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	7,445	13.52	100,656.40	
	SANTOS LTD	6,449	14.04	90,543.96	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	4,163	35.04	145,871.52	
	WORLEYPARSONS LIMITED	1,435	28.76	41,270.60	
	ALUMINA LIMITED	16,916	1.21	20,468.36	
	AMCOR LTD	7,894	7.51	59,283.94	
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	20,741	35.50	736,305.50	
	BORAL LIMITED	5,014	3.81	19,103.34	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	8,044	6.02	48,424.88	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	2,844	17.54	49,883.76	
	INCITEC PIVOT LIMITED	11,291	3.27	36,921.57	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	2,814	7.40	20,823.60	
	LYNAS CORPORATION LIMITED	11,482	1.14	13,146.89	
	NEWCREST MINING LIMITED	4,944	28.16	139,223.04	
ORICA LTD	2,351	27.06	63,618.06		
OZ MINERALS LIMITED	2,510	9.66	24,246.60		
RIO TINTO LIMITED(AU)	2,814	66.60	187,412.40		

SIMS METAL MANAGEMENT LTD	1,236	15.07	18,626.52	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	939	20.43	19,183.77	
BRAMBLES LTD	9,561	7.21	68,934.81	
CAMPBELL BROTHERS LIMITED	512	67.29	34,452.48	
ASCIANO LIMITED	6,299	4.79	30,172.21	
QANTAS AIRWAYS LTD	9,459	1.65	15,607.35	
QR NATIONAL LIMITED	11,031	3.64	40,152.84	
SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	2,994	2.90	8,682.60	
TOLL HOLDINGS LIMITED	4,560	5.71	26,037.60	
TRANSURBAN GROUP	8,759	5.71	50,013.89	
CROWN LTD	3,055	8.98	27,433.90	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	4,748	4.50	21,366.00	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	4,748	2.77	13,151.96	
TATTS GROUP LTD	11,100	2.46	27,306.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリアドル		株	オーストラリアドル	オーストラリアドル	
	FAIRFAX MEDIA LIMITED	19,023	0.72	13,696.56	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	4,511	2.00	9,022.00	
	METCASH LTD	5,329	3.99	21,262.71	
	WESFARMERS LIMITED	6,497	29.35	190,686.95	
	WOOLWORTHS LIMITED	7,913	25.85	204,551.05	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	3,931	12.60	49,530.60	
	COCHLEAR LIMITED	424	62.50	26,500.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	1,007	19.86	19,999.02	
	SONIC HEALTHCARE LTD	2,492	12.66	31,548.72	
	CSL LIMITED	3,380	36.89	124,688.20	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	17,017	23.30	396,496.10	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	2,800	7.43	20,804.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	10,180	50.78	516,940.40	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	14,236	25.24	359,316.64	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	19,574	22.02	431,019.48	
	ASX LTD	1,302	32.37	42,145.74	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	2,251	29.27	65,886.77	
	AMP LIMITED	18,437	4.33	79,832.21	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	14,412	3.49	50,297.88	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	7,205	13.54	97,555.70	
	SUNCORP GROUP LIMITED	8,309	8.14	67,635.26	
	LEND LEASE GROUP	3,807	7.22	27,486.54	
	COMPUTERSHARE LIMITED	3,082	8.43	25,981.26	
TELSTRA CORPORATION	28,127	3.39	95,350.53		
AGL ENERGY LIMITED	3,177	14.83	47,114.91		
APA GROUP	3,711	5.07	18,814.77		
SP AUSNET	11,580	1.06	12,332.70		
	オーストラリアドル建小計	株 423,012	-	オーストラリアドル 5,260,408.65 (444,188,906円)	
ニュージーランドドル		株	ニュージーランドドル	ニュージーランドドル	
	FLETCHER BUILDING LIMITED	4,401	6.28	27,638.28	

AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	7,823	2.53	19,792.19	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	4,744	3.82	18,122.08	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND(NZ)	15,899	2.53	40,224.47	
CONTACT ENERGY LIMITED	2,496	4.91	12,255.36	
ニュージーランドドル建小計	株 35,363	-	ニュージーランドドル 118,032.38 (7,851,513円)	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
香港ドル		株	香港ドル	香港ドル	
	HOPEWELL HOLDINGS LIMITED	6,000	20.80	124,800.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	13,000	75.10	976,300.00	
	NWS HOLDINGS LIMITED	10,500	11.84	124,320.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	10,000	13.44	134,400.00	
	MTR CORPORATION	9,500	27.35	259,825.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LIMITED	2,000	57.00	114,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	6,000	26.85	161,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	8,000	23.55	188,400.00	
	SANDS CHINA LIMITED	15,600	32.70	510,120.00	
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	8,000	16.74	133,920.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	12,000	17.34	208,080.00	
	WYNN MACAU LIMITED	10,400	23.65	245,960.00	
	LI & FUNG LIMITED	38,000	16.92	642,960.00	
	LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	5,000	19.02	95,100.00	
	BANK OF EAST ASIA	11,300	29.40	332,220.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	24,000	23.00	552,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	5,300	105.10	557,030.00	
	WING HANG BANK LIMITED	1,500	79.75	119,625.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	16,000	8.90	142,400.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	6,600	129.90	857,340.00	
	AIA GROUP LIMITED	54,400	28.00	1,523,200.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	9,000	101.80	916,200.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	6,000	50.00	300,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	15,000	29.40	441,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	7,000	45.30	317,100.00	
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	5,000	32.50	162,500.00	
	KERRY PROPERTIES LIMITED	5,500	35.40	194,700.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	27,000	9.34	252,180.00	
	SINO LAND CO	22,000	13.64	300,080.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	9,000	93.85	844,650.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	5,000	88.80	444,000.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	10,000	44.65	446,500.00	
	WHEELOCK AND COMPANY LTD	6,000	25.35	152,100.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	14,000	4.48	62,720.00	
	HKT TRUST AND HKT LIMITED #1	695	5.97	4,149.15	

PCCW LIMITED	32,000	2.84	90,880.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	4,000	45.90	183,600.00	
CLP HOLDINGS LTD	12,000	66.75	801,000.00	
HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	30,724	20.40	626,769.60	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
香港ドル		株	香港ドル	香港ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	9,000	57.90	521,100.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	1,700	109.20	185,640.00	
香港ドル建小計		株 503,719	-	香港ドル 15,249,968.75 (160,429,671円)	
シンガポールドル		株	シンガポールドル	シンガポールドル	
	COSCO CORP SINGAPORE LIMITED	9,000	1.08	9,765.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	6,000	6.75	40,500.00	
	KEPPEL CORPORATION LIMITED	8,900	11.55	102,795.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	29,636	1.27	37,637.72	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	6,000	5.36	32,160.00	
	SEMBCORP MARINE LIMITED	5,000	5.33	26,650.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	12,000	3.29	39,480.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	14,000	1.24	17,430.00	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	14,000	1.52	21,280.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LIMITED	8,000	1.27	10,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,000	10.73	32,190.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	39,000	1.71	66,885.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	11,000	3.97	43,670.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	1,000	47.45	47,450.00	
	OLAM INTERNATIONAL LIMITED	10,000	2.35	23,500.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	48,000	0.76	36,480.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	13,000	4.89	63,570.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	11,000	13.65	150,150.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	16,000	8.95	143,200.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	8,000	18.55	148,400.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	6,000	6.86	41,160.00	
	CAPITALAND LTD	16,000	2.94	47,040.00	
CAPITAMALLS ASIA LIMITED	12,000	1.58	19,020.00		
CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	10.54	31,620.00		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	13,000	2.08	27,040.00		
KEPPEL LAND LIMITED	6,000	3.40	20,400.00		
UOL GROUP LIMITED	4,000	4.70	18,800.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	51,000	3.14	160,140.00		
STARHUB LIMITED	5,000	3.20	16,000.00		
シンガポールドル建小計		株 388,536	-	シンガポールドル 1,474,612.72 (96,306,956円)	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イスラエル シュケル		株	イスラエル シュケル	イスラエルシュケル	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	3,074	43.02	132,243.48	
	THE ISRAEL CORPORATION LIMITED	19	2,451.00	46,569.00	
	DELEK GROUP LIMITED	31	725.00	22,475.00	
	ELBIT SYSTEMS LIMITED	199	139.00	27,661.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	5,911	170.20	1,006,052.20	
	BANK HAPOALIM BM	8,119	13.80	112,042.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	7,960	11.53	91,778.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	4,512	4.92	22,221.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	987	33.60	33,163.20	
	NICE SYSTEMS LIMITED	506	142.80	72,256.80	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	14,168	6.20	87,912.44	
	CELLCOM ISRAEL LIMITED	405	45.10	18,265.50	
PARTNER COMMUNICATIONS COMPANY LIMITED	696	27.25	18,966.00		
イスラエルシュケル建小計	株 46,587	-	イスラエルシュケル 1,691,607.22 (36,707,876円)		
合計	株 7,018,144	-	円 11,558,306,455 (11,558,306,455)		

(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	35,000	米ドル 26,425.00	
米ドル建小計			35,000	米ドル 26,425.00 (2,157,865円)	
米ドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	2,500	米ドル 159,625.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	6,300	100,233.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	618	88,052.64	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,000	103,340.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	800	59,688.00	
		DUKE REALTY CORP	1,800	25,848.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,900	117,021.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	400	38,748.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	2,868	48,698.64	
		HCP INC	2,600	101,582.00	
		HEALTH CARE REIT INC	1,300	70,135.00	
		HOST HOTELS & RESORTS	4,628	76,824.80	
		KIMCO REALTY CORP	2,600	48,282.00	
		LIBERTY PROPERTY	800	28,984.00	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	1,000	41,030.00	
		PROLOGIS INC	3,040	104,454.40	

		PUBLIC STORAGE	900	124,002.00	
		RAYONIER INC	900	39,357.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	600	25,890.00	
		SIMON PROPERTY GROUP	1,889	279,685.34	
		THE MACERICH COMPANY	900	52,650.00	
		VENTAS INC	1,900	106,172.00	
		VORNADO REALTY TRUST	1,137	94,291.41	
		WEYERHAEUSER COMPANY	3,498	72,583.50	
米ドル建小計			45,878	米ドル 2,007,177.73 (163,906,133円)	
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	600	カナダドル 14,520.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	900	23,913.00	
カナダドル建小計			1,500	カナダドル 38,433.00 (3,156,117円)	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	投資証券	CORIO NV	399	ユーロ 14,481.70	
		FONCIERE DES REGIONS	198	11,262.24	
		GECINA SA	159	10,950.33	
		ICADE	200	12,640.00	
		KLEPIERRE	738	18,195.39	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	594	83,843.10	
ユーロ建小計			2,288	ユーロ 151,372.76 (16,260,461円)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	6,299	英ポンド 30,443.06	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	3,843	12,493.59	
		HAMMERSON PLC	4,772	19,660.64	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	5,230	37,629.85	
		SEGRO PLC	5,141	11,670.07	
英ポンド建小計			25,285	英ポンド 111,897.21 (14,670,843円)	
オーストラリアドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	12,602	オーストラリアドル 23,628.75	
		DEXUS PROPERTY GROUP	30,700	28,858.00	
		GOODMAN GROUP	10,466	37,677.60	
		GPT GROUP	11,902	37,848.36	
		MIRVAC GROUP	22,111	26,975.42	
		STOCKLAND	16,520	50,386.00	
		WESTFIELD GROUP	14,167	127,786.34	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	18,739	50,595.30	

オーストラリアドル建小計		137,207	オーストラリアドル 383,755.77 (32,404,337円)
香港ドル	投資証券 THE LINK REIT	14,500	香港ドル 440,800.00
香港ドル建小計		14,500	香港ドル 440,800.00 (4,637,216円)

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,000	22,660.00	シンガポールドル 50,485.00 (3,297,175円)
		CAPITAMALL TRUST	15,000	27,825.00	
		シンガポールドル建小計	26,000	50,485.00 (3,297,175円)	
合計			-	円 240,490,147 (240,490,147)	

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

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。
- 合計金額欄の記載は、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 時価比率	組入投資信託受 益証券時価比率	組入投資証券時 価比率	有価証券の合計 額に対する比率
米ドル	株式 558銘柄	54.4%	-	-	56.8%
	投資信託 受益証券 1銘柄	-	0.0%	-	0.0%
	投資証券 24銘柄	-	-	1.3%	1.4%
カナダドル	株式 100銘柄	5.3%	-	-	5.5%
	投資証券 2銘柄	-	-	0.0%	0.0%
ユーロ	株式 245銘柄	11.8%	-	-	12.3%
	投資証券 6銘柄	-	-	0.1%	0.1%
英ポンド	株式 99銘柄	10.0%	-	-	10.5%
	投資証券 5銘柄	-	-	0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.8%	-	-	4.0%
スウェーデン クローナ	株式 34銘柄	1.4%	-	-	1.5%
ノルウェー クローネ	株式 10銘柄	0.4%	-	-	0.5%
デンマーク クローネ	株式 12銘柄	0.5%	-	-	0.6%
オーストラリ アドル	株式 59銘柄	3.6%	-	-	3.8%
	投資証券 8銘柄	-	-	0.3%	0.3%

ニュージーランドドル	株式	5銘柄	0.1%	-	-	0.1%
香港ドル	株式	41銘柄	1.3%	-	-	1.4%
	投資証券	1銘柄	-	-	0.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	29銘柄	0.8%	-	-	0.8%
	投資証券	2銘柄	-	-	0.0%	0.0%
イスラエルシケル	株式	13銘柄	0.3%	-	-	0.3%

（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」の状況

（1）貸借対照表

	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,304,479	32,635,490
国債証券	12,394,849,500	12,854,817,900
地方債証券	1,248,514,000	1,148,886,900
特殊債券	1,618,460,500	1,473,138,000
社債券	988,120,000	932,170,000
未収入金	21,522,300	10,650,600
未収利息	46,912,097	45,109,529
前払費用	1,197,005	2,027,871
流動資産合計	16,333,879,881	16,499,436,290
資産合計	16,333,879,881	16,499,436,290
負債の部		
流動負債		
未払解約金	21,200,000	24,900,000
流動負債合計	21,200,000	24,900,000
負債合計	21,200,000	24,900,000
純資産の部		
元本等		
元本	14,626,692,082	14,605,107,257
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,685,987,799	1,869,429,033
元本等合計	16,312,679,881	16,474,536,290
純資産合計	16,312,679,881	16,474,536,290
負債純資産合計	16,333,879,881	16,499,436,290

(2) 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23年10月21日 至 平成24年 4月20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、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（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。

(追加情報)

自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
当期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 14,626,692,082口	1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 14,605,107,257口
2. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1153円 (1万口当たり純資産額) (11,153円)	2. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1280円 (1万口当たり純資産額) (11,280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23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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。 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。	同左

3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 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 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 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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「（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。	2. 時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	16,386,284,723円	14,626,692,082円
同期中における追加設定元本額	91,589,306円	511,196,075円
同期中における一部解約元本額	1,851,181,947円	532,780,900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）	129,706,850円	121,726,634円
新光7資産バランスファンド	1,174,346,428円	1,030,985,365円
日本債券ファンド	133,576,116円	200,986,732円
新光日本債券インデックスVA	2,455,577,422円	2,644,207,878円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,117,380,646円	2,170,682,880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）	3,268,523,825円	3,143,218,165円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	795,648,637円	768,747,236円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	3,178,536,760円	3,160,228,737円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,373,395,398円	1,364,323,630円
合 計	14,626,692,082円	14,605,107,257円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	41,131,200	13,779,700
地方債証券	1,297,900	778,600
特殊債券	4,707,300	1,327,100
社 債 券	78,400,000	11,290,000
合 計	43,274,000	22,964,000

（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

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
	該当事項はありません。	同左

（3）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

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評 価 額（円）	備 考
国債証券	第73回利付国債（5年）	180,000,000	182,476,800	
	第75回利付国債（5年）	180,000,000	182,512,800	
	第79回利付国債（5年）	180,000,000	181,767,600	
	第81回利付国債（5年）	240,000,000	243,163,200	
	第83回利付国債（5年）	20,000,000	20,339,400	
	第84回利付国債（5年）	40,000,000	40,506,800	
	第87回利付国債（5年）	140,000,000	141,369,200	
	第88回利付国債（5年）	70,000,000	70,717,500	
	第89回利付国債（5年）	30,000,000	30,230,400	
	第95回利付国債（5年）	30,000,000	30,464,400	
	第96回利付国債（5年）	120,000,000	121,393,200	
	第97回利付国債（5年）	140,000,000	141,036,000	
	第99回利付国債（5年）	110,000,000	110,766,700	
	第101回利付国債（5年）	230,000,000	231,478,900	

第103回利付国債（5年）	60,000,000	60,057,600	
第1回利付国債（40年）	30,000,000	32,747,100	
第2回利付国債（40年）	30,000,000	31,075,800	
第3回利付国債（40年）	30,000,000	30,959,700	
第4回利付国債（40年）	40,000,000	41,076,000	
第251回利付国債（10年）	10,000,000	10,092,100	
第252回利付国債（10年）	160,000,000	161,657,600	
第255回利付国債（10年）	270,000,000	275,283,900	
第256回利付国債（10年）	290,000,000	296,226,300	
第259回利付国債（10年）	190,000,000	195,029,300	
第260回利付国債（10年）	190,000,000	196,081,900	
第263回利付国債（10年）	280,000,000	289,937,200	
第265回利付国債（10年）	190,000,000	196,885,600	
第268回利付国債（10年）	10,000,000	10,391,400	
第269回利付国債（10年）	290,000,000	299,677,300	
第270回利付国債（10年）	290,000,000	300,419,700	
第273回利付国債（10年）	410,000,000	428,462,300	
第276回利付国債（10年）	210,000,000	220,785,600	
第277回利付国債（10年）	150,000,000	158,128,500	
第280回利付国債（10年）	230,000,000	245,952,800	
第282回利付国債（10年）	150,000,000	159,580,500	
第283回利付国債（10年）	10,000,000	10,682,300	
第284回利付国債（10年）	140,000,000	149,305,800	
第285回利付国債（10年）	170,000,000	181,758,900	
第286回利付国債（10年）	40,000,000	43,066,800	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第288回利付国債（10年）	150,000,000	160,998,000	
	第289回利付国債（10年）	90,000,000	95,738,400	
	第290回利付国債（10年）	260,000,000	275,225,600	
	第293回利付国債（10年）	100,000,000	108,342,000	
	第296回利付国債（10年）	130,000,000	138,541,000	
	第297回利付国債（10年）	120,000,000	127,160,400	
	第299回利付国債（10年）	160,000,000	168,481,600	
	第301回利付国債（10年）	100,000,000	106,685,000	
	第303回利付国債（10年）	240,000,000	254,152,800	
	第305回利付国債（10年）	40,000,000	42,018,400	
	第306回利付国債（10年）	240,000,000	253,622,400	
	第308回利付国債（10年）	250,000,000	261,972,500	
	第310回利付国債（10年）	200,000,000	204,356,000	
	第312回利付国債（10年）	190,000,000	196,788,700	
	第313回利付国債（10年）	230,000,000	239,754,300	
	第315回利付国債（10年）	240,000,000	247,658,400	
	第317回利付国債（10年）	30,000,000	30,612,900	
	第318回利付国債（10年）	160,000,000	161,808,000	
	第319回利付国債（10年）	160,000,000	162,841,600	
	第320回利付国債（10年）	10,000,000	10,084,300	
	第321回利付国債（10年）	50,000,000	50,317,000	
	第5回利付国債（30年）	20,000,000	21,611,200	
	第7回利付国債（30年）	20,000,000	21,877,400	
第10回利付国債（30年）	30,000,000	26,508,600		

第11回利付国債（30年）	20,000,000	19,754,000	
第13回利付国債（30年）	30,000,000	31,177,500	
第15回利付国債（30年）	30,000,000	33,889,500	
第17回利付国債（30年）	40,000,000	44,398,000	
第19回利付国債（30年）	30,000,000	32,745,600	
第21回利付国債（30年）	30,000,000	32,705,400	
第23回利付国債（30年）	30,000,000	33,848,400	
第24回利付国債（30年）	30,000,000	33,876,600	
第26回利付国債（30年）	50,000,000	55,396,000	
第27回利付国債（30年）	50,000,000	56,495,500	
第28回利付国債（30年）	50,000,000	56,482,000	
第29回利付国債（30年）	40,000,000	44,374,800	
第30回利付国債（30年）	50,000,000	54,432,500	
第31回利付国債（30年）	50,000,000	53,327,500	
第32回利付国債（30年）	70,000,000	76,146,700	
第33回利付国債（30年）	60,000,000	61,276,200	
第34回利付国債（30年）	70,000,000	74,543,700	
第35回利付国債（30年）	70,000,000	71,387,400	
第36回利付国債（30年）	20,000,000	20,361,800	
第45回利付国債（20年）	30,000,000	34,022,100	
第47回利付国債（20年）	60,000,000	67,173,000	

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評 価 額（円）	備 考
国債証券	第48回利付国債（20年）	60,000,000	68,703,600	
	第50回利付国債（20年）	30,000,000	32,811,900	
	第51回利付国債（20年）	10,000,000	11,023,700	
	第52回利付国債（20年）	30,000,000	33,324,600	
	第53回利付国債（20年）	30,000,000	33,301,200	
	第55回利付国債（20年）	30,000,000	33,015,600	
	第57回利付国債（20年）	30,000,000	32,714,700	
	第58回利付国債（20年）	30,000,000	32,714,100	
	第59回利付国債（20年）	40,000,000	42,778,400	
	第61回利付国債（20年）	40,000,000	39,843,200	
	第63回利付国債（20年）	40,000,000	43,102,800	
	第64回利付国債（20年）	40,000,000	43,462,800	
	第65回利付国債（20年）	70,000,000	75,980,800	
	第69回利付国債（20年）	40,000,000	44,256,000	
	第70回利付国債（20年）	40,000,000	45,574,400	
	第72回利付国債（20年）	40,000,000	44,149,200	
	第76回利付国債（20年）	40,000,000	43,079,600	
	第78回利付国債（20年）	40,000,000	42,985,200	
	第81回利付国債（20年）	60,000,000	65,091,600	
	第84回利付国債（20年）	60,000,000	64,983,000	
	第85回利付国債（20年）	80,000,000	87,432,000	
	第88回利付国債（20年）	60,000,000	67,011,600	
	第90回利付国債（20年）	70,000,000	77,221,900	
	第92回利付国債（20年）	60,000,000	65,305,200	
	第94回利付国債（20年）	50,000,000	54,348,500	
	第95回利付国債（20年）	70,000,000	77,826,700	
第97回利付国債（20年）	70,000,000	76,755,700		
第99回利付国債（20年）	60,000,000	64,893,000		

第100回利付国債（20年）	70,000,000	76,585,600	
第103回利付国債（20年）	70,000,000	77,432,600	
第105回利付国債（20年）	80,000,000	86,092,800	
第108回利付国債（20年）	60,000,000	62,737,800	
第111回利付国債（20年）	70,000,000	76,113,800	
第113回利付国債（20年）	80,000,000	85,678,400	
第114回利付国債（20年）	10,000,000	10,695,600	
第116回利付国債（20年）	120,000,000	130,018,800	
第118回利付国債（20年）	100,000,000	105,109,000	
第121回利付国債（20年）	110,000,000	113,721,300	
第123回利付国債（20年）	90,000,000	95,844,600	
第125回利付国債（20年）	110,000,000	118,802,200	
第128回利付国債（20年）	100,000,000	103,038,000	
第130回利付国債（20年）	50,000,000	50,655,500	
第132回利付国債（20年）	70,000,000	69,640,900	
第134回利付国債（20年）	40,000,000	40,444,400	
国債証券小計	12,260,000,000	12,854,817,900	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	第18回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,910,000	
	第613回東京都公募公債	50,000,000	51,670,000	
	第654回東京都公募公債	100,000,000	106,480,000	
	第678回東京都公募公債	80,000,000	84,160,000	
	平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	32,133,000	
	第126回神奈川県公募公債	60,000,000	61,614,000	
	第164回神奈川県公募公債	100,000,000	106,350,000	
	第277回大阪府公募公債（10年）	30,000,000	31,017,000	
	第302回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	42,764,000	
	平成17年度第8回兵庫県公募公債	10,000,000	10,384,000	
	平成18年度第2回静岡県公募公債	10,000,000	10,714,000	
	平成21年度第4回愛知県公募公債（5年）	50,000,000	50,765,000	
	平成15年度第5回埼玉県公募公債	50,000,000	51,090,000	
	第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,950,000	
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,480,000	
	第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	50,475,000	
	平成18年度第3回大阪市公募公債	39,000,000	41,893,800	
	第12回す号名古屋市公募公債	30,000,000	31,668,000	
	平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	32,181,000	
	平成15年度第4回札幌市公募公債	20,000,000	20,412,000	
平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,776,100		
地方債証券小計		1,092,000,000	1,148,886,900	
特殊債券	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,810,000	
	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	105,020,000	
	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	106,140,000	
	第317回政府保証道路債券	100,000,000	100,430,000	
	第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,510,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	109,069,900	
	第188回政府保証中小企業債券	100,000,000	106,650,000	
	第7回都市基盤整備債券	100,000,000	100,850,000	
	第29回都市再生債券	100,000,000	101,750,000	

第14回政府保証国民生活債券	107,000,000	110,456,100	
第2回成田国際空港社債	100,000,000	104,580,000	
い第736号商工債券	70,000,000	70,210,000	
い第715号農林債券	40,000,000	40,432,000	
第229回信金中金債（5年）	100,000,000	101,970,000	
第13回中日本高速道路社債（財投機関債）	100,000,000	105,260,000	
特殊債券小計	1,418,000,000	1,473,138,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	第30回新日本製鐵社債	100,000,000	114,250,000	
	第8回トヨタ自動車社債	100,000,000	108,860,000	
	第30回住友商事社債	100,000,000	105,070,000	
	第112回三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	101,050,000	
	第46回三井住友銀行社債	100,000,000	101,990,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,470,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	108,420,000	
	第524回東京電力社債	100,000,000	83,090,000	
	第444回東北電力社債	100,000,000	100,970,000	
社債券小計	900,000,000	932,170,000		
有価証券合計	15,670,000,000	16,409,012,800		

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」-REITマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

	[平成23年10月20日現在]	[平成24年4月20日現在]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,351,140	19,676,429
投資証券	1,244,423,710	1,222,103,460
未収配当金	13,727,981	12,992,078
未収利息	29	26
流動資産合計	1,276,502,860	1,254,771,993
資産合計	1,276,502,860	1,254,771,993
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	1,922,950,033	1,658,164,064
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	646,447,173	403,392,071

元本等合計	1,276,502,860	1,254,771,993
純資産合計	1,276,502,860	1,254,771,993
負債純資産合計	1,276,502,860	1,254,771,993

(2) 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23年10月21日 至 平成24年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所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 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。

(追加情報)

自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
当期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 1,922,950,033口	1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 1,658,164,064口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 646,447,173円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 403,392,071円
3. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.6638円 (1万口当たり純資産額) (6,638円)	3. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7567円 (1万口当たり純資産額) (7,567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23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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。 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	コンプライアンス部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。 また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。 市場リスク 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。 信用リスク 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。 流動性リスク 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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	2. 時価の算定方法 投資証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	自平成23年 4月21日 至平成23年10月20日	自平成23年10月21日 至平成24年 4月20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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	2,171,947,705円	1,922,950,033円
同期中における追加設定元本額	- 円	- 円
同期中における一部解約元本額	248,997,672円	264,785,969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	1,922,950,033円	1,658,164,064円
合 計	1,922,950,033円	1,658,164,064円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	94,380,926	121,539,459
合 計	94,380,926	121,539,459

（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

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
	該当事項はありません。	同左

(3) 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

種 類	銘 柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	67	37,118,000	
	M I Dリート投資法人	63	14,086,800	
	森ヒルズリート投資法人	79	25,675,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	52	22,386,000	
	産業ファンド投資法人	47	22,301,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	377	59,189,000	
	日本ビルファンド投資法人	210	160,650,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	186	133,176,000	
	日本リテールファンド投資法人	645	80,883,000	
	オリックス不動産投資法人	98	37,093,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	245	57,011,500	
	プレミアム投資法人	67	21,406,500	
	東急リアル・エステート投資法人	58	24,737,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	33	17,787,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	105	51,870,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	722	67,507,000	
	森トラスト総合リート投資法人	83	59,262,000	
	インヴィンシブル投資法人	279	1,950,210	
	フロンティア不動産投資法人	67	46,029,000	
	平和不動産リート投資法人	239	11,711,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	51	36,873,000	
	福岡リート投資法人	42	24,360,000	
	ケネディクス不動産投資法人	98	29,204,000	
積水ハウス・S I投資法人	39	12,948,000		
いちご不動産投資法人	289	10,765,250		

大和証券オフィス投資法人	136	29,430,400	
阪急リート投資法人	29	11,484,000	
スタートプロシード投資法人	37	4,362,300	
トップリート投資法人	53	25,281,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	55	29,700,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	636	11,734,200	
日本賃貸住宅投資法人	457	17,091,800	
ジャパンエクセレント投資法人	65	27,040,000	
投資証券小計	5,709	1,222,103,460	
有価証券合計	5,709	1,222,103,460	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

「新光米国REITマザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	5,425,214	-
コール・ローン	5,577,519	54,447,592
投資証券	1,330,960,446	1,176,357,680
未収入金	-	49,092,552
未収配当金	1,303,553	1,175,426
未収利息	9	74
流動資産合計	1,343,266,741	1,281,073,324
資産合計	1,343,266,741	1,281,073,324
負債の部		
流動負債		
前受金	-	44,883,223
未払解約金	-	50,000,000
流動負債合計	-	94,883,223
負債合計	-	94,883,223
純資産の部		
元本等		
元本	2,416,957,045	1,665,446,503
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,073,690,304	479,256,402
元本等合計	1,343,266,741	1,186,190,101
純資産合計	1,343,266,741	1,186,190,101
負債純資産合計	1,343,266,741	1,281,073,324

(2) 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23年10月21日 至 平成24年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所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 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 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 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。

(追加情報)

自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20日
当期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 2,416,957,045口	1. 本報告書における開示対象ファンドの期末日における受益権の総数 1,665,446,503口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,073,690,304円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 479,256,402円
3. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.5558円 (1万口当たり純資産額) (5,558円)	3. 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7122円 (1万口当たり純資産額) (7,122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23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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。 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	<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。</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。為替予約取引に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>コンプライアンス部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 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 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 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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	2. 時価の算定方法 投資証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成23年 4月21日 至 平成23年10月20日	自 平成23年10月21日 至 平成24年 4月20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23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	2,566,568,057円	2,416,957,045円

同期中における追加設定元本額	- 円	- 円
同期中における一部解約元本額	149,611,012円	751,510,542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	2,416,957,045円	1,665,446,503円
合 計	2,416,957,045円	1,665,446,503円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20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	50,068,594	178,583,989
合 計	50,068,594	178,583,989

（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

種 類	[平成23年10月20日現在]	[平成24年 4月20日現在]
	該当事項はありません。	同左

(3) 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			米ドル	
		ACADIA REALTY TRUST	1,323	29,370.60	
		AGREE REALTY CORPORATION	300	6,561.00	
		ALEXANDER'S INC	100	37,580.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	1,900	137,959.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,200	27,000.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,300	100,993.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	12,500	798,125.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	3,775	97,848.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,200	19,646.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	1,300	21,502.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,042	433,424.16	
		BIOMED REALTY TRUST INC	4,800	91,920.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,600	475,364.00	
		BRANDYWINE REALTY	4,500	51,570.00	
		BRE PROPERTIES -CL A	2,400	122,016.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,500	164,525.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	1,100	12,320.00	
		CAPLEASE INC	2,100	8,673.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4,684	85,295.64	

CEDAR REALTY TRUST INC	2,100	10,395.00
CHATHAM LODGING TRUST	500	6,100.00
CHESAPEAKE LODGING TRUST	1,000	18,100.00
COLONIAL PROPERTIES TRUST	2,700	59,022.00
COMMONWEALTH REIT	2,675	48,551.25
CORESITE REALTY CORPORATION	700	16,653.00
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2,300	51,060.00
COUSINS PROPERTIES INC	3,362	25,046.90
CUBESMART	4,000	47,280.00
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	7,700	44,506.00
DDR CORPORATION	8,697	124,019.22
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	5,252	54,935.92
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,300	246,213.00
DOUGLAS EMMETT INC	3,300	74,613.00
DUKE REALTY CORP	8,200	117,752.00
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	2,000	47,720.00

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券			米ドル	
		EASTGROUP PROPERTIES	900	44,694.00	
		EDUCATION REALTY TRUST	3,000	32,250.00	
		ENTERTAINMENT PROPERTIES	1,500	69,735.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	1,300	86,398.00	
		EQUITY ONE INC	1,800	35,982.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	9,300	572,787.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,100	169,708.00	
		EXCEL TRUST INC	1,200	13,872.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	3,000	85,500.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	2,000	193,740.00	
		FELCOR LODGING TRUST	4,100	17,302.00	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY	2,700	32,535.00	
		FIRST POTOMAC REALTY	1,600	20,560.00	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES	2,700	27,243.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	14,750	250,455.00	
		GETTY REALTY CORP	800	12,456.00	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	300	5,040.00	
		GLIMCHER REALTY TRUST	4,400	43,472.00	
		GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	1,100	25,707.00	
		HCP INC	12,800	500,096.00	
		HEALTH CARE REIT INC	6,700	361,465.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,500	52,650.00	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,300	30,051.00	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,300	77,073.00	
		HOME PROPERTIES INC	1,500	90,585.00	
		HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	3,900	105,495.00	
		HOST HOTELS & RESORTS	22,279	369,831.40	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	800	12,048.00	
		INLAND REAL ESTATE CORP	2,900	23,722.00	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,700	19,548.00	
		KILROY REALTY CORP	2,200	101,244.00	
		KIMCO REALTY CORP	12,800	237,696.00	

	KITE REALTY GROUP TRUST	2,200	10,780.00	
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	2,700	78,543.00	
	LEXINGTON REALTY TRUST	4,854	42,229.80	
	LIBERTY PROPERTY	3,600	130,428.00	
	LTC PROPERTIES INC	1,000	32,030.00	
	MACK-CALI REALTY CORP	2,800	78,736.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	4,200	36,960.00	
	MID-AMERICA APARTMENT	1,300	86,281.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券			米ドル	
		MISSION WEST PROPERTIES INC	700	6,328.00	
		MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR-CL A	1,300	12,623.00	
		MPG OFFICE TRUST INC	1,700	3,859.00	
		NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	900	42,822.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	3,300	88,902.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3,200	67,552.00	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	500	9,325.00	
		PARKWAY PROPERTIES INC	700	6,881.00	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,600	36,848.00	
		PENN REAL ESTATE INVESTMENT	1,700	25,636.00	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	5,400	91,800.00	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	5,100	209,253.00	
		POST PROPERTIES INC	1,700	78,931.00	
		POTLATCH CORPORATION	1,300	39,676.00	
		PROLOGIS INC	14,500	498,220.00	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	600	39,732.00	
		PUBLIC STORAGE	4,000	551,120.00	
		RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1,300	15,288.00	
		RAYONIER INC	3,800	166,174.00	
		REALTY INCOME CORP	4,200	159,516.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,800	120,820.00	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	1,600	18,960.00	
		RLJ LODGING TRUST	3,300	61,215.00	
		ROUSE PROPERTIES INC	620	8,450.60	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,200	19,128.00	
		SAUL CENTERS INC	500	19,505.00	
		SENIOR HOUSING PROPERTIES	5,100	108,732.00	
		SIMON PROPERTY GROUP	9,405	1,392,504.30	
		SL GREEN REALTY CORP	2,700	204,012.00	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	900	45,099.00	
		STAG INDUSTRIAL INC	500	6,705.00	
		STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	5,800	38,106.00	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,000	7,760.00	
		SUN COMMUNITIES INC	800	33,648.00	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS	3,675	37,264.50	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	2,900	87,493.00	
		TAUBMAN CENTERS INC	1,800	135,018.00	
		TERRENO REALTY CORP	300	4,275.00	
		THE MACERICH COMPANY	4,201	245,758.50	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	UDR INC	7,058	米ドル 184,990.18	
		UMH PROPERTIES INC	500	5,745.00	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	400	15,464.00	
		URSTADT BIDDLE-CL A	700	13,209.00	
		VENTAS INC	9,055	505,993.40	
		VORNADO REALTY TRUST	5,835	483,896.55	
		WASHINGTON REAL ESTATE INV	2,100	60,942.00	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,800	96,482.00	
		WEYERHAEUSER COMPANY	16,900	350,675.00	
		WHITESTONE REIT-B	300	3,906.00	
		WINTHROP REALTY TRUST INC	820	8,724.80	
米ドル建小計			427,362	米ドル 14,405,555.72 (1,176,357,680円)	
合計			-	円 1,176,357,680 (1,176,357,680)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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。
- 合計金額欄の記載は、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	組入投資証券時価比率	有価証券の合計額に対する比率
米ドル	投資証券125銘柄	99.2%	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

「注記表(デリバティブ取引等関係)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（平成24年5月31日現在）

「新光7資産バランスファンド」

資産総額	7,759,281,295	円
負債総額	25,295,539	円
純資産総額（ - ）	7,733,985,756	円
発行済口数	13,747,836,538	口
1万口当たり純資産額（ / ）	5,626	円

（参考）

「海外国債マザーファンド」

資産総額	73,355,887,993	円
負債総額	1,010,318,435	円
純資産総額（ - ）	72,345,569,558	円
発行済口数	50,178,180,634	口
1万口当たり純資産額（ / ）	14,418	円

「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」

資産総額	13,132,299,010	円
負債総額	451,441,160	円
純資産総額（ - ）	12,680,857,850	円
発行済口数	15,269,638,437	口
1万口当たり純資産額（ / ）	8,305	円

「新光外国株式インデックスマザーファンド」

資産総額	11,123,584,686	円
負債総額	38,808,813	円
純資産総額（ - ）	11,084,775,873	円
発行済口数	13,523,876,204	口
1万口当たり純資産額（ / ）	8,196	円

「新光日本債券インデックスマザーファンド」

資産総額	16,423,414,830	円
負債総額	80,780,000	円
純資産総額（ - ）	16,342,634,830	円
発行済口数	14,373,081,969	口
1万口当たり純資産額（ / ）	11,370	円

「新光J - R E I Tマザーファンド」

資産総額	1,096,496,410	円
負債総額	3,268,195	円
純資産総額（ - ）	1,093,228,215	円
発行済口数	1,516,239,567	口
1万口当たり純資産額（ / ）	7,210	円

「新光米国REITマザーファンド」

資産総額	1,050,077,564 円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	1,050,077,564 円
発行済口数	1,553,417,375 口
1万口当たり純資産額（ / ）	6,760 円

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】

< 訂正前 >

a . 資本金の額（平成23年11月末現在）

（略）

< 訂正後 >

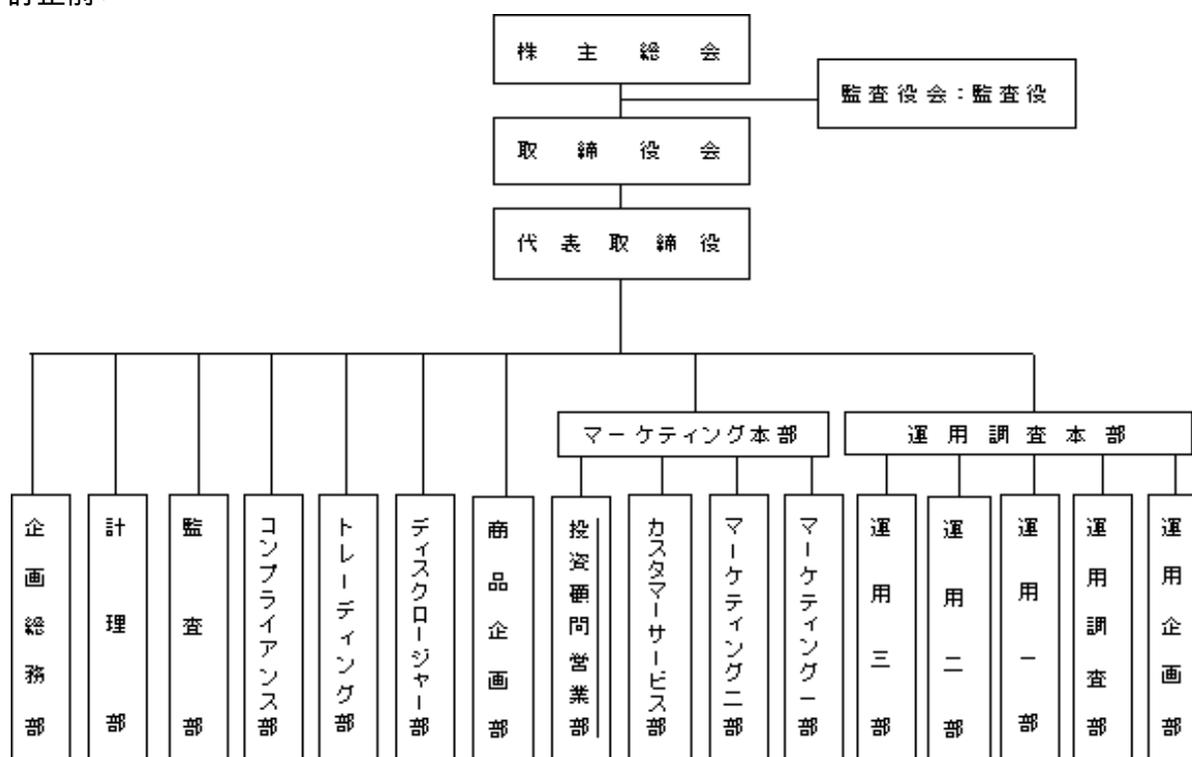
a . 資本金の額（平成24年5月末現在）

（略）

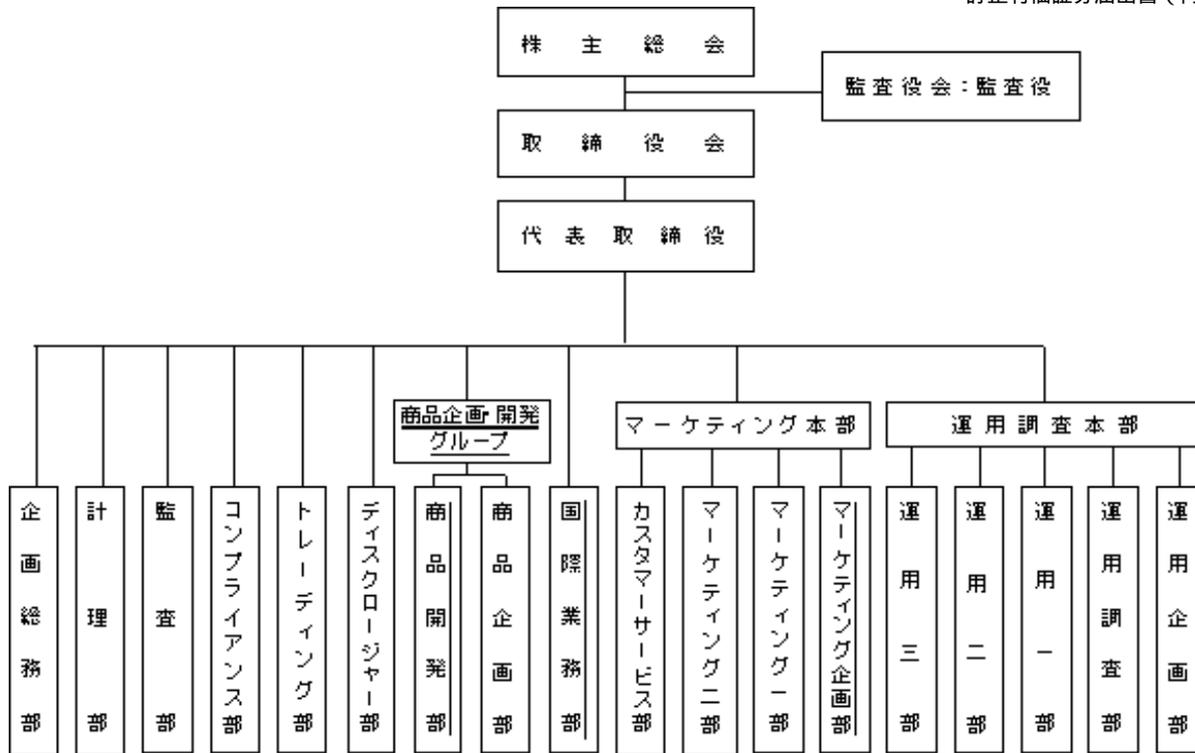
b . 委託会社の機構

（口）組織図

< 訂正前 >



< 訂正後 >



2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

「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者は、証券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）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年11月30日現在、委託者が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は以下のとおりです。

（平成23年11月30日現在）

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	188	2,052,961
株式投資信託（合計）	159	1,639,569
単位型	2	6,208
追加型	157	1,633,361
公社債投資信託（合計）	29	413,391
単位型	2	846
追加型	27	412,545

< 訂正後 >

「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者は、証券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）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成24年5月31日現在、委託者が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は以下のとおりです。

（平成24年5月31日現在）

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	193	2,040,617

株式投資信託(合計)	164	1,628,226
単位型	2	5,975
追加型	162	1,622,251
公社債投資信託(合計)	29	412,391
単位型	2	775
追加型	27	411,615

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」の内容を更新します。

<更新後>

3 【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」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、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第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。

なお、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。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31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り監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	8,121,107	8,592,890
有価証券	6,541,218	6,903,772
貯蔵品	4,821	268
立替金	-	2,141
前払金	45,671	26,845
前払費用	16,884	18,185
未収入金	96	29
未収委託者報酬	1,503,847	1,805,198
未収運用受託報酬	4,814	105,245
未収収益	30,417	27,583
繰延税金資産	169,661	183,764
流動資産合計	16,438,542	17,665,924
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 23,023	2 18,397
構築物（純額）	2 2,464	2 2,156
器具・備品（純額）	2 43,414	2 145,416
リース資産（純額）	2 7,465	2 3,064
建設仮勘定	-	6,663
有形固定資産合計	76,366	175,697
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	3 28,112	3 38,365
ソフトウェア仮勘定	-	6,554
無形固定資産合計	28,203	45,012
投資その他の資産		
投資有価証券	5,913,628	4,293,799
関係会社株式	77,100	77,100
長期前払費用	75	-
長期未収入金	4,800	-
長期差入保証金	118,123	125,621
長期繰延税金資産	66,752	65,901
前払年金費用	521,967	471,439
長期性預金	1,300,000	-
その他	22,000	22,000
貸倒引当金	-	13,350
投資その他の資産合計	8,024,447	5,042,512

固定資産合計	8,129,018	5,263,222
資産合計	24,567,560	22,929,146

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,619	17,113
リース債務	11,280	6,508
未払金		
未払収益分配金	968	584
未払償還金	29,105	18,249
未払手数料	1 797,625	1 920,180
その他未払金	207,650	281,635
未払金合計	1,035,350	1,220,650
未払費用	158,152	388,419
未払法人税等	524,492	652,412
賞与引当金	227,900	257,200
役員賞与引当金	29,600	35,000
流動負債合計	2,000,396	2,577,303
固定負債		
長期リース債務	8,870	2,362
退職給付引当金	163,241	169,955
役員退職慰労引当金	93,958	75,625
執行役員退職慰労引当金	123,916	128,916
固定負債合計	389,987	376,859
負債合計	2,390,383	2,954,163
純資産の部		
株主資本		
資本金	4,524,300	4,524,300
資本剰余金		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		
利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	12,118,000	11,118,000
繰越利益剰余金	2,646,588	1,427,158
利益剰余金合計	15,125,082	12,905,651
自己株式	6,827	6,827
株主資本合計	22,404,254	20,184,823
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	227,077	209,840
評価・換算差額等合計	227,077	209,840
純資産合計	22,177,176	19,974,983
負債純資産合計	24,567,560	22,929,146

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
営業収益		

委託者報酬	13,707,658	19,353,740
運用受託報酬	7,734	196,866
営業収益合計	13,715,392	19,550,606
営業費用		
支払手数料	1 7,740,156	1 10,353,047
広告宣伝費	233,413	239,373
公告費	2,409	4,161
調査費		
調査費	236,790	258,007
委託調査費	628,364	2,747,489
図書費	6,246	6,390
調査費合計	871,401	3,011,888
委託計算費	305,544	502,554
営業雑経費		
通信費	35,855	38,375
印刷費	184,349	151,954
協会費	9,581	12,077
諸会費	2,846	2,867
その他	15,462	27,590
営業雑経費合計	248,095	232,865
営業費用合計	9,401,021	14,343,891
一般管理費		
給料		
役員報酬	92,400	92,370
給料・手当	1,163,225	1,276,693
賞与	196,708	228,039
給料合計	1,452,333	1,597,103
交際費	14,854	13,677
寄付金	4,189	7,752
旅費交通費	79,127	81,442
租税公課	39,168	44,308
不動産賃借料	202,024	200,662
賞与引当金繰入	227,900	257,200
役員賞与引当金繰入	29,600	35,000
役員退職慰労引当金繰入	27,000	36,761
退職給付費用	138,708	157,497
減価償却費	74,876	86,469
諸経費	401,431	490,232
一般管理費合計	2,691,215	3,008,107
営業利益	1,623,156	2,198,608

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	65,366	53,031
有価証券利息	54,422	39,104
受取利息	22,062	24,291
時効成立分配金・償還金	33,486	11,287
雑益	5,316	2,968
営業外収益合計	180,654	130,682

営業外費用				
支払利息		1,110		572
時効成立後支払分配金・償還金		1,617		3,264
雑損		924		6,174
営業外費用合計		3,652		10,011
経常利益		1,800,158		2,319,278
特別利益				
投資有価証券売却益		153,176		10,098
特別利益合計		153,176		10,098
特別損失				
貸倒引当金繰入額		-		13,350
固定資産除却損	2	6,253	2	499
投資有価証券売却損		78,650		25,606
投資有価証券評価損		17,772		-
ゴルフ会員権評価損		5,500		-
減損損失		-		441
特別損失合計		108,176		39,897
税引前当期純利益		1,845,159		2,289,480
法人税、住民税及び事業税		734,171		1,006,533
法人税等調整額		3,586		51,486
法人税等合計		730,585		955,047
当期純利益		1,114,573		1,334,432

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)		(自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	
株主資本				
資本金				
当期首残高		4,524,300		4,524,300
当期変動額				
当期変動額合計		-		-
当期末残高		4,524,300		4,524,300
資本剰余金				
資本準備金				
当期首残高		2,761,700		2,761,700
当期変動額				
当期変動額合計		-		-
当期末残高		2,761,700		2,761,700
利益剰余金				
利益準備金				
当期首残高		360,493		360,493
当期変動額				
当期変動額合計		-		-
当期末残高		360,493		360,493
その他利益剰余金				
別途積立金				
当期首残高		12,118,000		12,118,000

当期変動額		
別途積立金の取崩	-	1,000,000
当期変動額合計	-	1,000,000
当期末残高	12,118,000	11,118,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	2,024,119	2,646,588
当期変動額		
剰余金の配当	492,103	3,553,863
別途積立金の取崩	-	1,000,000
当期純利益	1,114,573	1,334,432
当期変動額合計	622,469	1,219,430
当期末残高	2,646,588	1,427,158
利益剰余金合計		
当期首残高	14,502,612	15,125,082
当期変動額		
剰余金の配当	492,103	3,553,863
当期純利益	1,114,573	1,334,432
当期変動額合計	622,469	2,219,430
当期末残高	15,125,082	12,905,651

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
自己株式		
当期首残高	6,074	6,827
当期変動額		
自己株式の取得	753	-
当期変動額合計	753	-
当期末残高	6,827	6,827
株主資本合計		
当期首残高	21,782,538	22,404,254
当期変動額		
剰余金の配当	492,103	3,553,863
当期純利益	1,114,573	1,334,432
自己株式の取得	753	-
当期変動額合計	621,716	2,219,430
当期末残高	22,404,254	20,184,823
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	107,742	227,077
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 額（純額）	119,335	17,237
当期変動額合計	119,335	17,237
当期末残高	227,077	209,840
純資産合計		
当期首残高	21,674,796	22,177,176
当期変動額		

剰余金の配当	492,103	3,553,863
当期純利益	1,114,573	1,334,432
自己株式の取得	753	-
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	119,335	17,237
当期変動額合計	502,380	2,202,193
当期末残高	22,177,176	19,974,983

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法(定額法)

(2) 関係会社株式

総平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)

時価のないもの

総平均法による原価法

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

デリバティブ

時価法

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産(リース資産を除く)

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については、定額法。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8~47年

構築物 20年

器具備品 2~20年

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法により償却しております。

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当期対応分を計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支出に備えるため、支給見込額の当期対応分を計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。

過去勤務債務については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の年数(10年)による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により翌期から費用処理することとしております。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当期末要支給額を計上しております。

(6) 執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当期末要支給額を計上していません。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当期の費用として処理しております。

追加情報

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
未払手数料	639,627千円	598,017千円

2. 有形固定資産の減価償却累計額(減損損失累計額を含む)

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
建物	60,468千円	65,093千円
構築物	254千円	562千円
器具備品	329,664千円	349,229千円
リース資産	98,457千円	102,858千円

3. 無形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
ソフトウェア	202,238千円	227,314千円

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
支払手数料	6,121,248千円	7,038,413千円

2. 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成22年4月1日)	当事業年度 (自平成23年4月1日)
--	-----------------------	-----------------------

至 平成23年3月31日)

至 平成24年3月31日)

建物	4,333千円	-
器具・備品	1,919千円	499千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	-	1,823,250

2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	643	113	-	756

(変動事由の概要)

普通株式の自己株式の株式数の増加113株は、単元未満株式の買取による増加であります。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年6月21日 定時株主総会	普通株式	492,103	270	平成22年3月31日	平成22年6月22日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	1,002,371	550	平成23年3月31日	平成23年6月21日

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	-	1,823,250

2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	756	-	-	756

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年6月20日 定時株主総会	普通株式	1,002,371	550	平成23年3月31日	平成23年6月21日
平成24年2月28日 臨時株主総会	普通株式	2,551,491	1,400	平成24年2月9日	平成24年2月29日

(リース取引関係)

ファイナンス・リース取引(借主側)

所有権移転外ファイナンス・リース取引

(1) リース資産の内容

有形固定資産

主として、投信システム設備としてのサーバー、ネットワーク機器他（器具備品）であります。

(2) リース資産の減価償却方法

重要な会計方針の「3. 固定資産の減価償却の方法（3）リース資産」に記載のとおりであります。

(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、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行ってまいります。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、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の取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主に満期保有目的債券、その他有価証券（債券、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。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

デリバティブ取引については、保有する有価証券の価格変動リスク回避を目的として為替予約を行っております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先や債券の発行体の信用リスク）の管理

預金の預入先や債券の発行体の信用リスクについては、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先や発行体に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また企画総務部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している債券、投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、企画総務部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスク及び為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、企画総務部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

流動性リスクの管理

資金繰りについては、企画総務部が作成した年度の資金計画を経営会議において報告し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上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ることがあります。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、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

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）。

前事業年度（平成23年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	8,121,107	8,121,107	-
(2) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的債券	3,519,057	3,534,800	15,742
その他有価証券	8,686,616	8,686,616	-
(3) 未収委託者報酬	1,503,847	1,503,847	-
(4) 長期性預金	1,300,000	1,300,000	-

当事業年度（平成24年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	8,592,890	8,592,890	-
(2) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的債券	1,502,185	1,506,150	3,964
その他有価証券	9,472,598	9,472,598	-
(3) 未収委託者報酬	1,805,198	1,805,198	-
(4) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されて いないもの	24	24	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 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、債券は日本証券業協会発表の公社債店頭売買参考統計値の価格、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

(3) 未収委託者報酬

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。

(4) デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

(注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
非上場株式	326,273	299,887

これらについては、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ため、「(2) 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。

(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

前事業年度（平成23年3月31日）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	8,120,113	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的債券	2,000,000	1,500,000	-	-
その他有価証券	3,023,600	874,417	74,684	-
(3) 未収委託者報酬	1,503,847	-	-	-
(4) 長期性預金	-	1,300,000	-	-

当事業年度（平成24年3月31日）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	8,592,815	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的債券	1,000,000	500,000	-	-
その他有価証券	4,800,000	809,629	660,677	-
(3) 未収委託者報酬	1,805,198	-	-	-

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度（平成23年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	3,519,057	3,534,800	15,742
	(3)その他	-	-	-
	小計	3,519,057	3,534,800	15,742
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		3,519,057	3,534,800	15,742

当事業年度（平成24年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	1,502,185	1,506,150	3,964
	(3)その他	-	-	-
	小計	1,502,185	1,506,150	3,964
時価が貸借対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
合計		1,502,185	1,506,150	3,964

2. 関係会社株式

関係会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円）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。

3. その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券 国債・地方債等 社債 その他	-	-	-
		1,011,100	1,007,222	3,877
		-	-	-
	(3)その他	1,055,620	1,023,000	32,620
小計	2,066,720	2,030,222	36,498	
	(1)株式	44,761	45,457	695

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	705,120	705,468	348
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,870,014	6,288,333	418,319
	小計	6,619,895	7,039,259	419,363
合計		8,686,616	9,069,481	382,865

(注)非上場株式（貸借対照表計上額249,173千円）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。

当事業年度（平成24年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	580,313	505,000	75,313
	小計	580,313	505,000	75,313
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	41,123	45,457	4,333
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	1,002,560	1,003,574	1,014
	その他	-	-	-
	(3)その他	7,848,601	8,245,960	397,358
	小計	8,892,285	9,294,991	402,706
合計		9,472,598	9,799,991	327,393

(注)非上場株式（貸借対照表計上額222,787千円）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。

4. 売却したその他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	98,200	51,200	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	3,377,773	104,121	80,775
合計	3,475,973	155,321	80,775

当事業年度（平成24年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	15,525	-	14,365
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	303,927	880	-
その他	-	-	-

(3)その他	2,262,094	5,690	3,590
合計	2,581,546	6,570	17,955

5. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について17,772千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

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。

（デリバティブ取引関係）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

当事業年度（平成24年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 （千円）	契約額等のうち1 年超 （千円）	時価 （千円）	評価損益 （千円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 豪ドル	450,000	-	24	24
合計		450,000	-	24	24

（注）時価の算定方法

取引先金融機関等から提示された価格等に基づき算定しております。

（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、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 （平成23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
(1)退職給付債務（千円）	923,938	1,162,110
(2)年金資産（千円）	940,384	876,684
(3)未積立退職給付債務(1) + (2)（千円）	16,445	285,426
(4)未認識数理計算上の差異（千円）	417,207	645,782
(5)未認識過去勤務債務（債務の減額）（千円）	74,927	58,871
(6)貸借対照表計上額純額(3) + (4) + (5)（千円）	358,725	301,484
(7)前払年金費用（千円）	521,967	471,439
(8)退職給付引当金(6) - (7)（千円）	163,241	169,955

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
(1)勤務費用（千円）（注1）	82,778	80,752
(2)利息費用（千円）	21,581	23,098
(3)期待運用収益（減算）（千円）	17,826	18,807
(4)数理計算上の差異の費用処理額（千円）	63,027	73,807
(5)過去勤務債務の費用処理額（千円）	24,747	16,055

(6)小計(1) + (2) - (3) + (4) + (5)（千円）	124,813	142,794
(7)その他（千円）（注2）	13,894	14,702
(8)退職給付費用(6) + (7)（千円）	138,708	157,497

（注）1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額（前事業年度 23,250千円、当事業年度 20,250千円）については

「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

2. 「(7)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4. 退職給付債務の計算基礎

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
(1)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	期間定額基準
(2)割引率	2.5%	1.5%
(3)期待運用収益率	2.0%	2.0%
(4)過去勤務債務の処理年数	10年	10年
(5)数理計算上の差異の処理年数	10年	10年

（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

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
繰延税金資産		
貸倒引当金	- 千円	4,757千円
賞与引当金	104,776	111,065
減価償却超過額	8,449	3,087
退職給付引当金	116,844	106,517
役員退職慰労引当金	38,231	26,952
投資有価証券評価損	7,231	-
非上場株式評価損	32,458	28,430
未払事業税	42,773	49,129
その他有価証券評価差額金	155,788	117,552
その他	40,414	47,307
繰延税金資産小計	546,968	494,801
評価性引当額	96,431	76,506
繰延税金資産合計	450,536	418,294
繰延税金負債		
前払年金費用	212,388	168,021
その他	1,733	607
繰延税金負債合計	214,121	168,628
繰延税金資産の純額	236,414	249,665

（注）繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産 - 繰延税金資産	169,661千円	183,764千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	66,752	65,901

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な項目別の内訳

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
--	-----------------------	-----------------------

法定実効税率	40.69%	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。
（調整）		
役員給与永久に損金算入されない項目	0.53	
交際費等永久に損金算入されない項目	0.81	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.09	
住民税均等割	0.21	
税効果未認識差異	2.54	
その他	0.01	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>39.59</u>	

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.69%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.01%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.64%となります。この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は20,828千円減少し、法人税等調整額が5,165千円増加しております。

（セグメント情報等）

セグメント情報

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）及び当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）及び当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

関連当事者情報

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.70 間接 7.87	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	債券等の現先取引 当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	999,719 6,121,248	短期貸付金 未払手数料	- 639,627

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.70 間接 7.87	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	債券等の現先取引 当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	1,006,734 7,038,413	短期貸付金 未払手数料	- 598,017

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	160,641	長期差入保証金	107,916
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払 ハウジングサービス料支払	48,084 16,824	その他未払金 その他未払金	5,808 1,472

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	165,316	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払 ハウジングサービス料支払 メールシステムサービス料支払	74,884 16,824 18,000	その他未払金 その他未払金 その他未払金	7,593 1,472 3,150

(注) 1. 上記(ア)～(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 現先取引の金利等については、市場金利等を勘案して決定しております。
- (2) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (3) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
- (4) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

(注) 当社の親会社であるみずほ証券株式会社は、平成23年8月29日に東京証券取引所への上場を廃止しております。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	12,168円58銭	10,964円24銭
1株当たり当期純利益金額	611円54銭	732円20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。

	前事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)
当期純利益金額（千円）	1,114,573	1,334,432
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	1,114,573	1,334,432
期中平均株式数（千株）	1,822	1,822

(重要な後発事象)

該当事項はありません

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】

< 訂正前 >

(1) 住友信託銀行株式会社（「受託者」）

ただし、関係当局の認可などを前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

a . 資本金の額

平成23年11月末現在、342,037百万円

(略)

(2) フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（「投資顧問会社」）

a . 資本金の額

平成23年11月末現在、300万ポンド

(略)

(3) 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

(平成23年11月末現在)

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
(略)		

< 訂正後 >

(1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a . 資本金の額

平成24年5月末現在、342,037百万円

(略)

(2) フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（「投資顧問会社」）

a . 資本金の額

平成24年5月末現在、300万ポンド

(略)

(3) 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

(平成24年5月末現在)

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
(略)		

3 【資本関係】

< 訂正前 >

- (1) みずほ証券株式会社は、委託者の株式の76.5%を所有しています。
- (2) 委託者は、三豊証券株式会社の株式の4.5%を所有しています。
- (3) 委託者は、新和証券株式会社の株式の1.2%を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託者の株式または委託者が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が1.0%以上のものを記載しています。

(略)

< 訂正後 >

(1) みずほ証券株式会社は、委託者の株式の76.5%を所有しています。

(2) 委託者は、三豊証券株式会社の株式の4.5%を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託者の株式または委託者が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が1.0%以上のものを記載しています。

(略)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月18日

新光投信株式会社
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 田中俊之
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第52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、新光投信株式会社の平成24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

() 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。

独立監査人の監査報告書

平成24年5月29日

新光投信株式会社
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 業務執行社員	公認会計士	田中俊之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤志保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光7資産バランスファンドの平成23年10月21日から平成24年4月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、新光7資産バランスファンドの平成24年4月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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

新光投信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. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)