

【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25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 後藤 修一

【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】 高島 泰之
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 - 1823

【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25年1月22日付をもって提出した有価証券届出書（平成25年5月7日および平成25年5月27日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。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】

(3) 【ファンドの仕組み】

b. 委託会社の概況

< 訂正前 >

(イ) 資本金の額 (平成24年11月末現在)

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成24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25年5月末現在)

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成25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】

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

< 訂正前 >

(略)

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

(略)

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド (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 テンプルトン インベストメンツ (設立: 1947年、運用総資産: 約58.3兆円) 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9月末現在、1米ドル = 77.8円で換算。

(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25年1月22日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

< 訂正後 >

(略)

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

(略)

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド (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 テンプルトン インベストメンツ (設立: 1947年、運用総資産: 約77.4兆円) 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。

2013年3月末現在、1米ドル＝94.02円で換算。

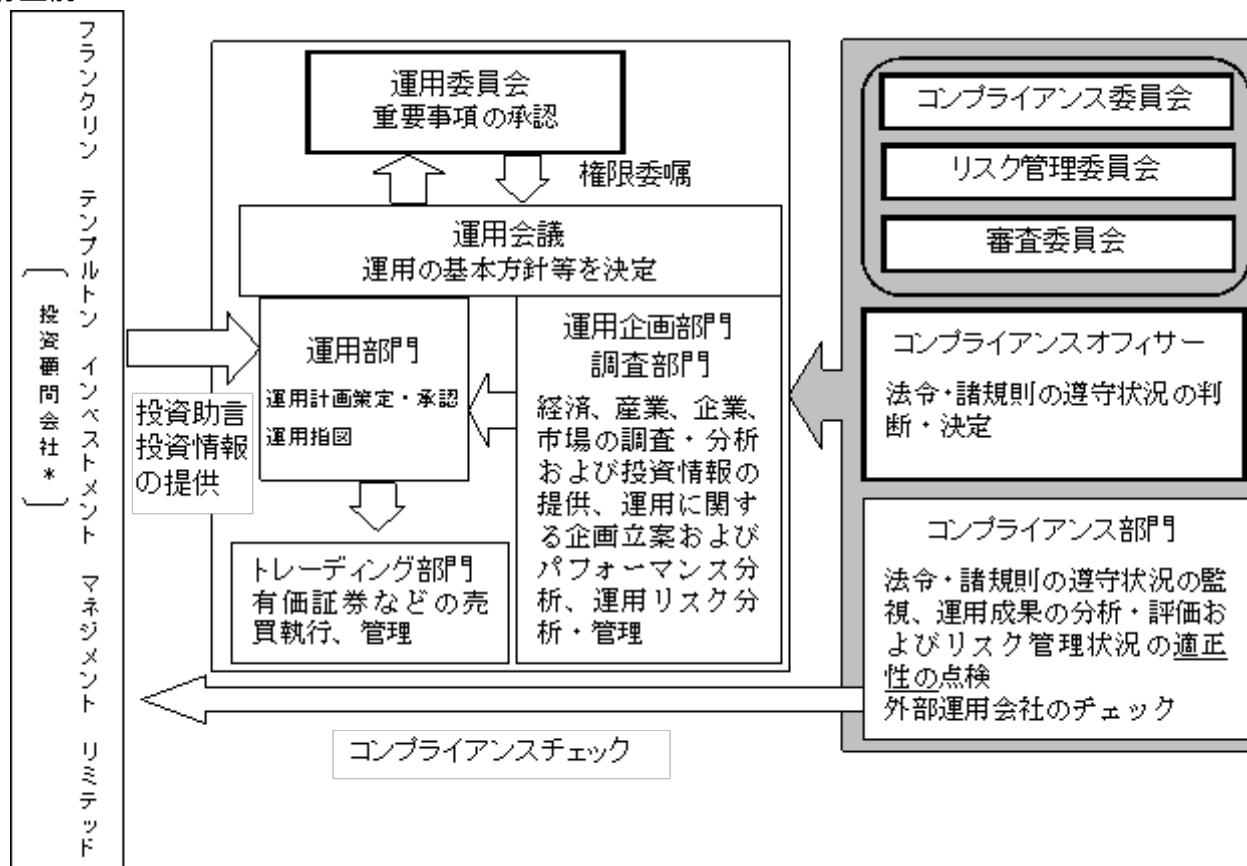
（略）

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25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25年1月22日現在のものであり、今後変更になることがあります。

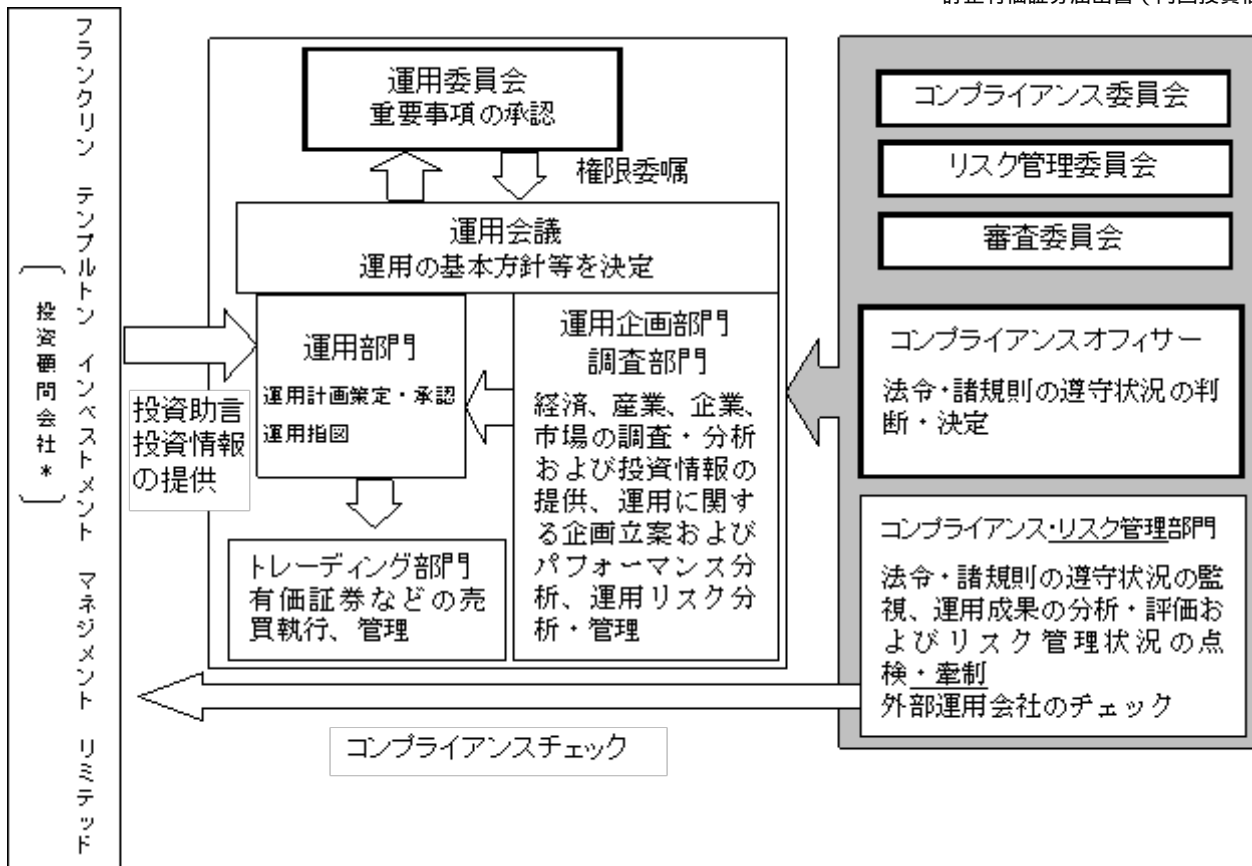
（略）

SEE

- ・コンプライアンス部門（10～15名程度）は日々の運用指図および売買執行について法令・諸規則の遵守状況の点検を行い、必要に応じて運用部門を牽制します。
- ・運用企画部門は日々の運用リスク等の管理のほか、投資信託財産のパフォーマンス分析を行います。
- ・コンプライアンス部門およびコンプライアンスオフィサー（1名）は月次で開催される審査委員会、コンプライアンス委員会、リスク管理委員会において運用成果、法令・諸規則・約款の遵守状況、運用リスク管理状況等について検証・報告を行います。
- ・コンプライアンス部門は、投資信託証券の運用会社に対して、継続的なコンプライアンスチェックを行っております。

（略）

<訂正後>



(略)

上記は平成25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)

SEE

- ・ コンプライアンス・リスク管理部門（20名程度）は日々の運用指図および売買執行について法令・諸規則の遵守状況の点検を行い、必要に応じて運用部門を牽制します。
- ・ 運用企画部門は日々の運用リスク等の管理のほか、投資信託財産のパフォーマンス分析を行います。
- ・ コンプライアンス・リスク管理部門およびコンプライアンスオフィサー（1名）は月次で開催される審査委員会、コンプライアンス委員会、リスク管理委員会において運用成果、法令・諸規則・約款の遵守状況、運用リスク管理状況等について検証・報告を行います。
- ・ コンプライアンス・リスク管理部門は、投資信託証券の運用会社に対して、継続的なコンプライアンスチェックを行っております。

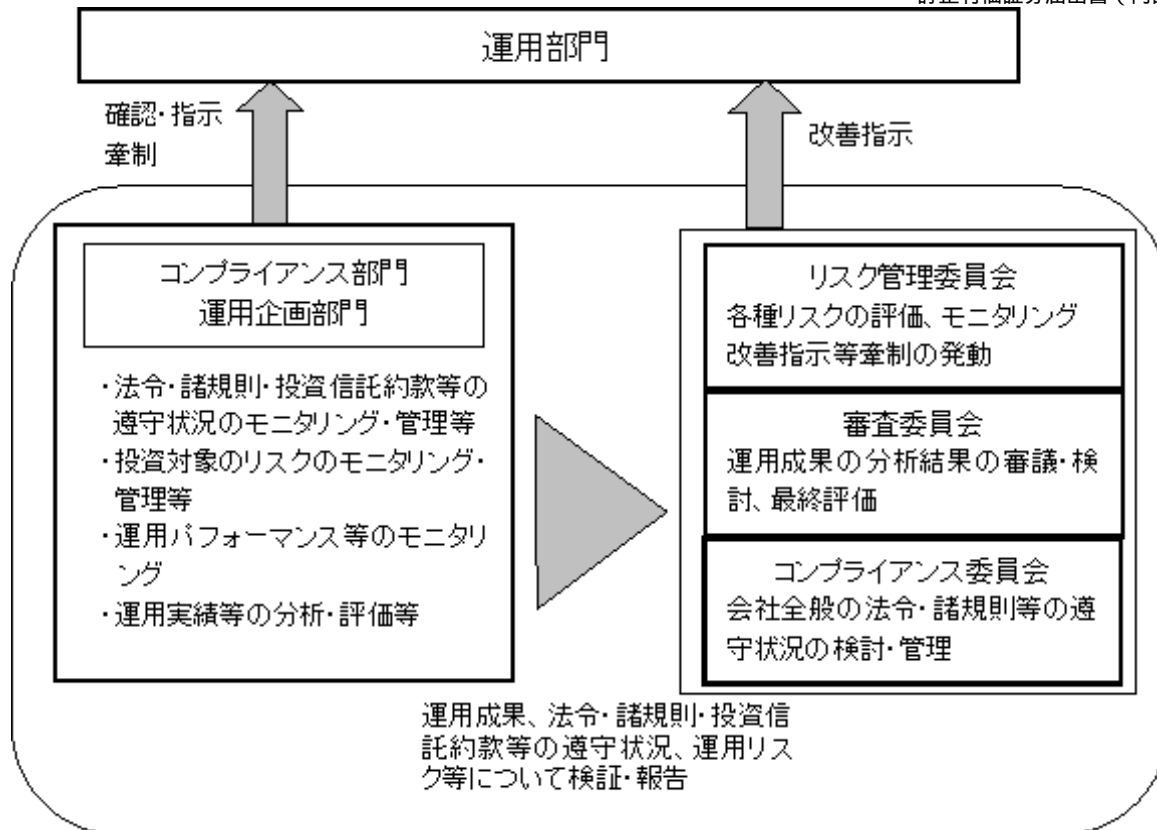
(略)

3【投資リスク】

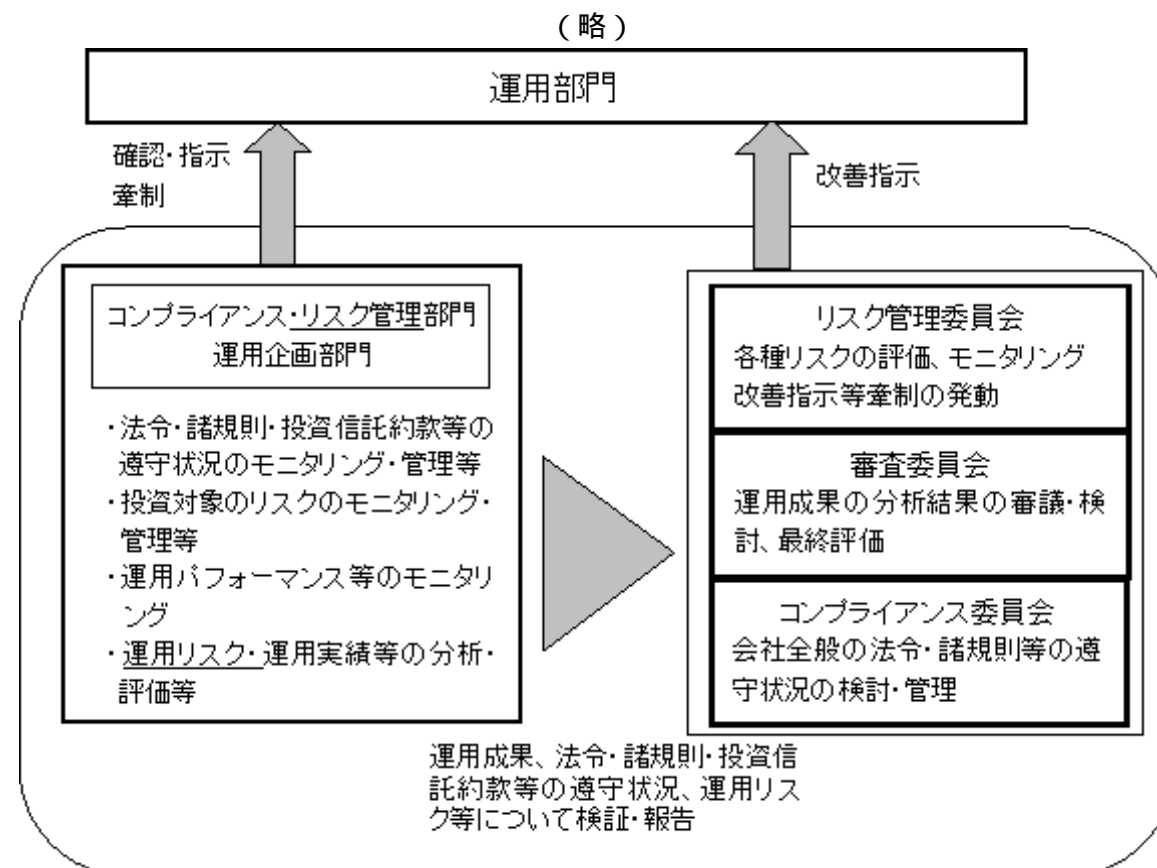
(2) リスク管理体制

< 訂正前 >

(略)



< 訂正後 >



4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

a . 個人の受益者の場合

(八) 損益通算について

< 訂正前 >

(略)

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 訂正後 >

(略)

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合 >

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

5【運用状況】

< 更新後 >

(1)【投資状況】

(平成25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 諸島	円 1,212,244,500	時価	% 13.3		
		小計	円 1,212,244,500	-	% 13.3		
		海外国債 マザーファンド受益証券	日本	円 1,284,728,048	時価	% 14.1	
	親投資 信託	ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券	日本	円 1,302,518,734	時価	% 14.3	
		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	円 1,395,631,498	時価	% 15.3	
		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	円 1,264,699,501	時価	% 13.9	
		新光J-REIT マザーファンド受益証券	日本	円 1,116,005,266	時価	% 12.3	
		新光米国REIT マザーファンド受益証券	日本	円 1,348,492,773	時価	% 14.8	
		小計		円 7,712,075,820	-	% 84.8	
		その他 資産	コール・ローン等	日本他	円 175,295,526	負債控除後の 取得価額	% 1.9
		-	純資産総額		円 9,099,615,846	-	% 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25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	円 14,267,175,210	時価	% 95.8
		小計	円 14,267,175,210	-	% 95.8
その他 資産	コール・ ローン等	日本	円 621,548,741	負債控除後の 取得価額	% 4.2
-	純資産総額		円 14,888,723,951	-	% 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25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	日本	円 13,927,618,700	時価	% 79.2	
			小計	円 13,927,618,700	-	% 79.2	
		地方債証券	日本	円 1,272,610,000	時価	% 7.2	
			小計	円 1,272,610,000	-	% 7.2	
		特殊債券	日本	円 1,461,224,000	時価	% 8.3	
			小計	円 1,461,224,000	-	% 8.3	
	社債券	普通 社債券	日本	円 839,140,000	時価	% 4.8	
			小計	円 839,140,000	-	% 4.8	
	その他 資産	コール・ローン等		日本	円 89,448,200	負債控除後の 取得価額	% 0.5
	-	純資産総額			円 17,590,040,900	-	% 100.0

『新光J - R E I Tマザーファンド』の投資状況

（平成25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 1,084,825,450	時価	% 97.2
		小計	円 1,084,825,450	-	% 97.2
その他 資産	コール・ローン等	日本	円 31,134,516	負債控除後の 取得価額	% 2.8
-	純資産総額		円 1,115,959,966	-	% 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25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 7,695,013,693	時価	% 54.0
		カナダ	円 655,753,785	時価	% 4.6
		ドイツ	円 536,455,119	時価	% 3.8
		イタリア	円 131,866,567	時価	% 0.9
		フランス	円 562,614,604	時価	% 3.9
		オーストラリア	円 480,123,571	時価	% 3.4
		イギリス	円 1,314,818,887	時価	% 9.2
		スイス	円 621,757,692	時価	% 4.4
		バミューダ諸島	円 57,878,619	時価	% 0.4
		香港	円 160,942,798	時価	% 1.1
		シンガポール	円 102,023,197	時価	% 0.7
		ニュージーランド	円 8,442,307	時価	% 0.1
		オランダ	円 199,033,764	時価	% 1.4
		スペイン	円 183,401,542	時価	% 1.3
		ベルギー	円 75,555,149	時価	% 0.5
		スウェーデン	円 204,249,555	時価	% 1.4
		ノルウェー	円 44,442,528	時価	% 0.3
		オーストリア	円 19,434,498	時価	% 0.1
		ルクセンブルグ	円 24,899,047	時価	% 0.2
		フィンランド	円 51,540,202	時価	% 0.4
			円		%

	デンマーク	71,743,783	時価	0.5
		円		%
	アイルランド	107,301,696	時価	0.8
		円		%
	ギリシャ	1,572,185	時価	0.0
		円		%
	イスラエル	33,931,378	時価	0.2

(平成25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	11,278,673	時価	0.1	
			円		%	
		ケイマン諸島	15,663,601	時価	0.1	
			円		%	
		モーリシャス	2,219,040	時価	0.0	
			円		%	
		リベリア	2,900,223	時価	0.0	
			円		%	
		パナマ	7,798,246	時価	0.1	
			円		%	
		キュラソー	52,470,219	時価	0.4	
		円		%		
	ジャージー	70,037,784	時価	0.5		
		円		%		
	ガーンジー	3,830,763	時価	0.0		
		円		%		
	マン島	3,782,016	時価	0.0		
		円		%		
	小 計	13,514,776,731		94.8		
		投資信託受益証券		円		%
			シンガポール	2,185,488	時価	0.0
			円		%	
		小 計	2,185,488		0.0	
		投資証券		円		%
			アメリカ	213,255,675	時価	1.5
				円		%
			カナダ	3,795,055	時価	0.0
				円		%
			フランス	19,459,192	時価	0.1
				円		%
			オーストラリア	38,353,890	時価	0.3
				円		%
	イギリス		17,901,512	時価	0.1	
			円		%	
	香港	6,724,783	時価	0.0		
		円		%		
	シンガポール	6,349,766	時価	0.0		
		円		%		
	オランダ	1,859,250	時価	0.0		
		円		%		
	小 計	307,699,123		2.2		
その他 資産	コール・ローン等	日本他	円	負債控除後の 取得価額	% 3.0	
			円		%	

純資産総額	14,252,765,382	100.0
-------	----------------	-------

『海外国債マザーファンド』の投資状況

(平成25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	円 31,348,120,394	時価	% 42.8
			カナダ	円 1,897,200,041	時価	% 2.6
			ドイツ	円 13,268,203,231	時価	% 18.1
			イタリア	円 7,517,980,251	時価	% 10.3
			フランス	円 13,067,251,905	時価	% 17.8
			イギリス	円 5,025,250,478	時価	% 6.9
			小計	円 72,124,006,300		% 98.4
その他 資産	コール・ローン等	日本他	円 1,172,791,719	負債控除後の 取得価額	% 1.6	
-	純資産総額			円 73,296,798,019		% 100.0

『新光米国REITマザーファンド』の投資状況

(平成25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	円 1,337,669,283	時価	% 99.2
			小計	円 1,337,669,283	-	% 99.2
その他 資産	コール・ローン等	日本他	円 10,840,764	負債控除後の 取得価額	% 0.8	
-	純資産総額			円 1,348,510,047	-	% 100.0

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(平成25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	1,022,290,872	1.3969	1,428,038,119	1.3652	1,395,631,498	15.33
2	新光米国REITマザー ファンド受益証券	日本	親投資信託	1,288,574,079	1.1497	1,481,473,618	1.0465	1,348,492,773	14.81
3	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	973,118,218	1.4968	1,456,563,348	1.3385	1,302,518,734	14.31
4	海外国債マザーファンド 受益証券	日本	親投資信託	669,198,900	1.9602	1,311,763,683	1.9198	1,284,728,048	14.11
5	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	1,102,230,697	1.1447	1,261,723,478	1.1474	1,264,699,501	13.89
6	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	173,500	7.226	1,253,711,000	6.987	1,212,244,500	13.32
7	新光J-REITマザー ファンド受益証券	日本	親投資信託	1,004,866,979	1.2470	1,253,069,122	1.1106	1,116,005,266	12.26

（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25年5月31日現在）

種 類	投資比率（%）
親投資信託	84.75
投資信託受益証券	13.32
合計	98.07

株式業種別投資比率（平成25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25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	116,400	4,260.00	495,864,000	6,010	699,564,000	4.69
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	677,300	479.00	324,426,700	595	402,993,500	2.70
3	本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	76,500	3,380.00	258,570,000	3,830	292,995,000	1.96
4	三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	67,600	3,330.00	225,108,000	4,055	274,118,000	1.84
5	みずほフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1,156,000	169.00	195,364,000	195	225,420,000	1.51
6	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	43,300	3,020.00	130,766,000	5,170	223,861,000	1.50
7	キヤノン	日本	株式	電気機器	56,300	3,370.00	189,731,000	3,530	198,739,000	1.33
8	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	56,400	2,749.21	155,055,444	3,460	195,144,000	1.31
9	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	37,700	3,725.00	140,432,500	5,050	190,385,000	1.27
10	三菱地所	日本	株式	不動産業	63,000	2,104.00	132,552,000	2,547	160,461,000	1.07
11	武田薬品工業	日本	株式	医薬品	35,600	4,270.00	152,012,000	4,500	160,200,000	1.07
12	日立製作所	日本	株式	電気機器	218,000	539.00	117,502,000	700	152,600,000	1.02
13	野村ホールディングス	日本	株式	証券・商品先物取引業	182,900	490.00	89,621,000	789	144,308,100	0.96
14	ファナック	日本	株式	電気機器	9,400	15,630.00	146,922,000	15,240	143,256,000	0.96
15	セブン&アイ・ホールディングス	日本	株式	小売業	37,400	2,614.00	97,763,600	3,505	131,087,000	0.88
16	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	114,500	873.00	99,958,500	1,115	127,667,500	0.85
17	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	16,700	5,790.00	96,693,000	7,580	126,586,000	0.85
18	三菱商事	日本	株式	卸売業	69,800	1,761.00	122,917,800	1,786	124,662,800	0.83
19	三井不動産	日本	株式	不動産業	42,000	2,067.00	86,814,000	2,863	120,246,000	0.80
20	ソニー	日本	株式	電気機器	57,000	983.00	56,031,000	2,049	116,793,000	0.78
21	KDDI	日本	株式	情報・通信業	25,200	3,050.00	76,860,000	4,610	116,172,000	0.78
22	小松製作所	日本	株式	機械	44,300	2,330.00	103,219,000	2,611	115,667,300	0.77
23	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	737	128,500.00	94,704,500	149,800	110,402,600	0.74
24	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	21,100	4,420.00	93,262,000	5,230	110,353,000	0.74
25	信越化学工業	日本	株式	化学	17,000	5,450.00	92,650,000	6,470	109,990,000	0.73
26	新日鐵住金	日本	株式	鉄鋼	401,000	223.00	89,423,000	260	104,260,000	0.70
27	東京海上ホールディングス	日本	株式	保険業	34,600	2,687.00	92,970,200	2,995	103,627,000	0.69
28	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	29,700	2,398.00	71,220,600	3,370	100,089,000	0.67
29	三井物産	日本	株式	卸売業	77,200	1,366.00	105,455,200	1,291	99,665,200	0.66
30	三菱重工業	日本	株式	機械	152,000	467.00	70,984,000	632	96,064,000	0.64

種類別投資比率(平成25年5月31日現在)

種類	投資比率(%)
株式	95.82
合計	95.82

株式業種別投資比率(平成25年5月31日現在)

業種	投資比率(%)
水産・農林業	0.07
鉱業	0.44

建設業	2.32
食料品	3.90
繊維製品	0.78
パルプ・紙	0.24
化学	5.32
医薬品	4.31
石油・石炭製品	0.62
ゴム製品	0.91
ガラス・土石製品	0.89
鉄鋼	1.55
非鉄金属	0.94
金属製品	0.66
機械	5.14
電気機器	11.55
輸送用機器	11.72
精密機器	1.32
その他製品	1.21
電気・ガス業	2.48
陸運業	3.73
海運業	0.32
空運業	0.61
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	6.10
卸売業	4.37
小売業	4.03
銀行業	9.42
証券、商品先物取引業	1.87
保険業	2.26
その他金融業	1.22
不動産業	3.25
サービス業	1.91
合計	95.82

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25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25年6月限	買建	54	620,434,915	611,550,000	4.10

（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25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263回利付国債(10年)	日本	国債証券	280,000,000	102.77	287,778,400	101.91	285,359,200	1.6000	2014.09.20	1.62
2	第273回利付国債(10年)	日本	国債証券	270,000,000	103.97	280,737,900	103.08	278,337,600	1.5000	2015.09.20	1.58
3	第303回利付国債(10年)	日本	国債証券	250,000,000	106.91	267,297,600	105.42	263,572,500	1.4000	2019.09.20	1.49
4	第313回利付国債(10年)	日本	国債証券	250,000,000	106.17	265,445,500	104.31	260,792,500	1.3000	2021.03.20	1.48
5	第269回利付国債(10年)	日本	国債証券	250,000,000	102.81	257,047,500	102.08	255,205,000	1.3000	2015.03.20	1.45
6	第315回利付国債(10年)	日本	国債証券	230,000,000	105.06	241,656,500	103.45	237,941,900	1.2000	2021.06.20	1.35
7	第306回利付国債(10年)	日本	国債証券	220,000,000	107.05	235,529,500	105.39	231,862,400	1.4000	2020.03.20	1.31
8	第290回利付国債(10年)	日本	国債証券	220,000,000	106.23	233,714,800	104.99	230,993,400	1.4000	2018.03.20	1.31
9	第308回利付国債(10年)	日本	国債証券	220,000,000	106.32	233,907,200	104.62	230,172,800	1.3000	2020.06.20	1.30
10	第87回利付国債(5年)	日本	国債証券	220,000,000	100.83	221,837,000	100.57	221,254,000	0.5000	2014.12.20	1.25
11	第270回利付国債(10年)	日本	国債証券	210,000,000	103.12	216,554,100	102.37	214,985,400	1.3000	2015.06.20	1.22
12	第323回利付国債(10年)	日本	国債証券	210,000,000	101.83	213,861,300	100.67	211,413,300	0.9000	2022.06.20	1.20
13	第88回利付国債(5年)	日本	国債証券	200,000,000	100.90	201,817,000	100.66	201,322,000	0.5000	2015.03.20	1.14
14	第280回利付国債(10年)	日本	国債証券	190,000,000	106.34	202,047,200	105.17	199,832,500	1.9000	2016.06.20	1.13
15	第276回利付国債(10年)	日本	国債証券	190,000,000	104.63	198,801,500	103.65	196,935,000	1.6000	2015.12.20	1.11
16	第97回利付国債(5年)	日本	国債証券	190,000,000	100.99	191,894,700	100.63	191,206,500	0.4000	2016.06.20	1.08
17	第101回利付国債(5年)	日本	国債証券	190,000,000	101.01	191,930,300	100.56	191,067,800	0.4000	2016.12.20	1.08
18	第285回利付国債(10年)	日本	国債証券	180,000,000	106.63	191,942,500	105.44	189,802,800	1.7000	2017.03.20	1.07
19	第312回利付国債(10年)	日本	国債証券	180,000,000	105.37	189,675,900	103.65	186,582,600	1.2000	2020.12.20	1.06
20	第318回利付国債(10年)	日本	国債証券	170,000,000	103.31	175,631,900	101.79	173,048,100	1.0000	2021.09.20	0.98
21	第105回利付国債(5年)	日本	国債証券	170,000,000	100.09	170,154,700	99.66	169,422,000	0.2000	2017.06.20	0.96
22	第310回利付国債(10年)	日本	国債証券	160,000,000	103.97	166,355,200	102.33	163,729,600	1.0000	2020.09.20	0.93
23	第103回利付国債(5年)	日本	国債証券	160,000,000	100.58	160,930,400	100.15	160,240,000	0.3000	2017.03.20	0.91
24	第289回利付国債(10年)	日本	国債証券	150,000,000	106.62	159,935,800	105.31	157,965,000	1.5000	2017.12.20	0.89
25	第277回利付国債(10年)	日本	国債証券	150,000,000	104.91	157,376,500	103.95	155,937,000	1.6000	2016.03.20	0.88
26	第92回利付国債(5年)	日本	国債証券	150,000,000	100.57	150,866,800	100.34	150,514,500	0.3000	2015.09.20	0.85
27	第107回利付国債(5年)	日本	国債証券	150,000,000	100.13	150,199,300	99.44	149,160,000	0.2000	2017.12.20	0.84
28	第284回利付国債(10年)	日本	国債証券	140,000,000	106.33	148,869,000	105.15	147,210,000	1.7000	2016.12.20	0.83
29	第319回利付国債(10年)	日本	国債証券	140,000,000	104.04	145,660,000	102.52	143,530,800	1.1000	2021.12.20	0.81
30	第260回利付国債(10年)	日本	国債証券	140,000,000	102.37	143,328,800	101.55	142,174,200	1.6000	2014.06.20	0.80

種類別投資比率(平成25年5月31日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.17
特殊債券	8.30
地方債証券	7.23
社債券	4.77
合計	99.49

株式業種別投資比率(平成25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』-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25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	124	847,931.37	105,143,489	1,045,000	129,580,000	11.61
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	106	767,712.77	81,377,553	1,003,000	106,318,000	9.52
3	日本リテールファンド投資法人	日本	投資証券	373	145,000.00	54,085,000	192,000	71,616,000	6.41
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	413	94,500.00	39,028,500	130,400	53,855,200	4.82
5	日本プライムリアルティ投資法人	日本	投資証券	148	238,000.00	35,224,000	315,500	46,694,000	4.18
6	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	222	169,994.86	37,738,858	210,300	46,686,600	4.18
7	フロンティア不動産投資法人	日本	投資証券	44	695,000.00	30,580,000	933,000	41,052,000	3.67
8	森トラスト総合リート投資法人	日本	投資証券	43	723,000.00	31,089,000	805,000	34,615,000	3.10
9	野村不動産オフィスファンド投資法人	日本	投資証券	55	503,000.00	27,665,000	577,000	31,735,000	2.84
10	オリックス不動産投資法人	日本	投資証券	283	78,700.00	22,272,100	110,000	31,130,000	2.78
11	GLP投資法人	日本	投資証券	329	71,922.33	23,662,446	93,800	30,860,200	2.76
12	アクティビア・プロパティーズ投資法人	日本	投資証券	37	501,000.00	18,537,000	772,000	28,564,000	2.55
13	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	71	259,000.00	18,389,000	394,000	27,974,000	2.50
14	森ヒルズリート投資法人	日本	投資証券	46	384,000.00	17,664,000	601,000	27,646,000	2.47
15	日本プロロジスリート投資法人	日本	投資証券	33	955,948.51	31,546,301	823,000	27,159,000	2.43
16	産業ファンド投資法人	日本	投資証券	28	597,000.00	16,716,000	941,000	26,348,000	2.36
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	41	551,791.87	22,623,466	637,000	26,117,000	2.34
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	27	736,000.00	19,872,000	942,000	25,434,000	2.27
19	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	63	306,000.00	19,278,000	391,500	24,664,500	2.21
20	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	40	443,751.05	17,750,042	587,000	23,480,000	2.10
21	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	51	283,000.00	14,433,000	390,000	19,890,000	1.78
22	福岡リート投資法人	日本	投資証券	25	587,805.03	14,695,125	773,000	19,325,000	1.73
23	東急リアル・エステート投資法人	日本	投資証券	30	436,000.00	13,080,000	593,000	17,790,000	1.59
24	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	238	45,750.00	10,888,500	69,900	16,636,200	1.49
25	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	417	21,950.00	9,153,150	39,650	16,534,050	1.48
26	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	22	552,905.58	12,163,922	712,000	15,664,000	1.40
27	野村不動産レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	27	463,000.00	12,501,000	524,000	14,148,000	1.26
28	プレミア投資法人	日本	投資証券	35	300,500.00	10,517,500	394,500	13,807,500	1.23

29	積水ハウス・S I投資法人	日本	投資証券	27	357,000.00	9,639,000	476,500	12,865,500	1.15
30	トップリート投資法人	日本	投資証券	28	382,500.00	10,710,000	454,500	12,726,000	1.14

種類別投資比率(平成25年5月31日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	97.21
合計	97.21

株式業種別投資比率(平成25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25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	4,900	55,351.53	271,222,500	45,691.87	223,890,193	1.57
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	23,566	8,823.90	207,944,211	9,317.66	219,580,121	1.54
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	39,200	2,917.01	114,347,160	3,544.33	138,937,947	0.97
4	GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	株式	資本財	54,200	2,124.78	115,163,076	2,387.84	129,421,361	0.90
5	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	10,100	10,708.89	108,159,801	12,658.62	127,852,160	0.89
6	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	14,324	7,069.44	101,262,753	8,700.46	124,625,506	0.87
7	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1,400	67,085.37	93,919,525	88,103.49	123,344,895	0.86
8	INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	5,500	19,187.77	105,532,763	21,183.04	116,506,746	0.81
9	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	16,669	6,358.89	105,996,445	6,862.72	114,394,829	0.80
10	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	家庭用品・パーソナル用品	14,092	6,783.10	95,587,546	8,002.32	112,768,780	0.79
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	各種金融	19,600	4,109.93	80,554,659	5,627.63	110,301,579	0.77
12	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	38,126	2,445.52	93,237,918	2,858.33	108,976,880	0.76
13	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	イギリス	株式	銀行	95,137	925.90	88,087,405	1,133.72	107,859,436	0.75
14	WELLS FARGO & COMPANY	アメリカ	株式	銀行	25,788	3,273.17	84,408,585	4,173.67	107,630,730	0.75
15	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	29,419	3,393.57	99,835,647	3,591.88	105,669,811	0.74
16	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	3,631	19,071.38	69,248,202	25,711.36	93,357,977	0.65
17	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	11,890	6,093.72	72,454,348	7,366.56	87,588,416	0.61
18	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	食品・飲料・タバコ	20,900	3,671.82	76,741,083	4,125.10	86,214,769	0.60
19	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	各種金融	15,220	3,635.39	55,330,748	5,389.85	82,033,647	0.57
20	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	アメリカ	株式	食品・飲料・タバコ	8,600	8,642.79	74,328,042	9,351.05	80,419,078	0.56
21	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	各種金融	55,698	954.12	53,142,987	1,399.31	77,939,291	0.54
22	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	254,223	257.28	65,406,544	297.33	75,589,599	0.53
23	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	15,731	4,456.97	70,112,736	4,762.54	74,919,557	0.52

24	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	14,800	4,314.31	63,851,864	4,965.91	73,495,533	0.51
25	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	98,541	660.91	65,127,461	736.86	72,611,805	0.50
26	ORACLE CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	19,900	3,070.81	61,109,178	3,474.52	69,142,971	0.48
27	SANOFI	フランス	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,157	9,052.45	55,735,971	11,087.27	68,264,378	0.47
28	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	27,400	1,701.84	46,630,624	2,465.75	67,561,730	0.47
29	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	25,377	2,109.08	53,522,158	2,652.91	67,322,978	0.47
30	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	19,322	3,292.26	63,613,090	3,428.60	66,247,511	0.46

(注) 外貨建株式の単価および金額は、平成25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25年5月31日現在)

種類	投資比率(%)
株式	94.82
投資証券	2.15
投資信託受益証券	0.01
合計	96.99

株式業種別投資比率(平成25年5月31日現在)

業種	投資比率(%)
エネルギー	10.31
素材	5.81
資本財	7.23
商業・専門サービス	0.95
運輸	1.74
自動車・自動車部品	1.47
耐久消費財・アパレル	1.45
消費者サービス	1.65
メディア	2.77
小売	3.10
食品・生活必需品小売り	2.22
食品・飲料・タバコ	6.59
家庭用品・パーソナル用品	1.87
ヘルスケア機器・サービス	2.88
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.37
銀行	7.44
各種金融	5.40
保険	4.46
不動産	0.65
ソフトウェア・サービス	6.23
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.85
電気通信サービス	3.50

公益事業	3.27
半導体・半導体製造装置	1.47
合計	94.82

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25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	34	266,964,391	284,429,121	1.99
株価指数先物取引	カナダ	S&P/TSE 60IX先物	買建	1	14,347,741	14,332,820	0.10
株価指数先物取引	ドイツ	DJ EURO ST50先物	買建	10	34,400,652	36,896,016	0.25
株価指数先物取引	オーストラリア	SPI 200先物	買建	1	12,188,563	12,099,251	0.08
株価指数先物取引	イギリス	LIFFE FTSE先物	買建	4	38,995,513	40,893,686	0.28
株価指数先物取引	スイス	SWISS MKT IX先物	買建	2	16,210,041	17,022,113	0.11

（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25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25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	30,500,000	10,261.89	3,129,876,825	10,043.69	3,063,327,260	2.0000	2023.02.15	4.17
2	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	27,800,000	11,083.68	3,081,264,141	10,836.53	3,012,557,043	2.6250	2020.11.15	4.11
3	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	18,400,000	15,150.83	2,787,753,838	15,320.55	2,818,982,304	3.7500	2021.04.25	3.84
4	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	28,700,000	9,914.09	2,845,346,650	9,748.06	2,797,693,399	1.6250	2022.11.15	3.81
5	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	22,400,000	11,872.89	2,659,527,998	11,559.02	2,589,221,503	3.6250	2021.02.15	3.53
6	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	17,700,000	14,150.63	2,504,662,161	14,416.63	2,551,743,510	3.0000	2022.04.25	3.48
7	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	24,800,000	10,034.29	2,488,505,658	9,793.90	2,428,889,136	1.6250	2022.08.15	3.31
8	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	16,300,000	14,562.69	2,373,719,573	14,796.67	2,411,857,992	3.2500	2021.10.25	3.29
9	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	16,600,000	13,887.96	2,305,402,429	14,159.30	2,350,445,128	2.5000	2020.10.25	3.20
10	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	21,300,000	10,611.68	2,260,288,066	10,374.11	2,209,685,829	2.1250	2021.08.15	3.01
11	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	21,000,000	10,125.50	2,126,356,985	10,121.16	2,125,443,993	0.2500	2014.12.15	2.89
12	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	20,300,000	10,473.52	2,126,125,572	10,239.73	2,078,665,632	2.0000	2021.11.15	2.83
13	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	18,600,000	11,093.88	2,063,461,914	10,859.45	2,019,859,500	2.6250	2020.08.15	2.75
14	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	16,600,000	11,467.90	1,903,673,010	11,178.01	1,855,551,092	3.1250	2021.05.15	2.53
15	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	17,700,000	10,446.83	1,849,090,432	10,201.78	1,805,716,773	2.0000	2022.02.15	2.46
16	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	11,900,000	15,061.99	1,792,377,050	15,093.58	1,796,136,591	3.0000	2020.07.04	2.45
17	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	18,000,000	10,183.15	1,832,967,271	9,943.30	1,789,795,161	1.7500	2022.05.15	2.44

18	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	13,000,000	13,560.36	1,762,847,042	13,638.06	1,772,948,580	1.7500	2022.07.04	2.41
19	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	12,900,000	13,455.88	1,735,809,625	13,488.95	1,740,074,704	2.2500	2022.10.25	2.37
20	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	15,100,000	11,758.18	1,775,486,324	11,487.09	1,734,550,873	3.5000	2020.05.15	2.36
21	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	10,300,000	15,347.08	1,580,749,631	15,352.22	1,581,279,319	3.2500	2021.07.04	2.15
22	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	10,800,000	13,933.50	1,504,819,056	13,996.99	1,511,675,697	2.0000	2022.01.04	2.06
23	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	10,300,000	14,559.18	1,499,596,079	14,618.52	1,505,708,466	2.5000	2021.01.04	2.05
24	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	9,800,000	13,336.77	1,307,003,494	13,317.40	1,305,105,513	1.5000	2022.09.04	1.78
25	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	9,800,000	13,307.97	1,304,181,793	13,234.26	1,296,958,303	1.5000	2023.02.15	1.76
26	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	8,700,000	14,316.74	1,245,557,244	14,399.47	1,252,754,342	2.2500	2020.09.04	1.70
27	BUONI POLIENNALI DEL TES	イタリア	国債証券	9,300,000	12,943.49	1,203,745,190	13,396.57	1,245,881,865	3.7500	2021.08.01	1.69
28	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ドイツ	国債証券	8,700,000	14,250.83	1,239,822,262	14,317.66	1,245,636,420	2.2500	2021.09.04	1.69
29	TSY	イギリス	国債証券	8,000,000	15,456.12	1,236,490,181	15,140.09	1,211,207,395	1.7500	2022.09.07	1.65
30	FRANCE (GOVT OF)	フランス	国債証券	5,700,000	21,348.22	1,216,848,818	20,949.96	1,194,148,267	8.5000	2023.04.25	1.62

（注）外貨建債券の単価および金額は、平成25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。

種別投資比率（平成25年5月31日現在）

種 類	投資比率（％）
国債証券	98.39
合計	98.39

株式業種別投資比率（平成25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25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	7,105	15,535.17	110,377,434	17,200.60	122,210,263	9.06
2	AMERICAN TOWER CORPORATION	アメリカ	投資証券	9,100	7,471.13	67,987,293	7,969.94	72,526,532	5.37
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	3,300	14,053.75	46,377,384	15,580.70	51,416,337	3.81

4	HCP INC	アメリカ	投資証券	10,400	4,560.18	47,425,899	4,845.51	50,393,306	3.73
5	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	6,755	6,531.16	44,118,046	7,364.89	49,749,846	3.68
6	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	10,600	3,598.97	38,149,109	4,158.49	44,080,078	3.26
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	7,500	5,778.38	43,337,923	5,809.75	43,573,167	3.23
8	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	6,000	6,047.52	36,285,171	7,023.91	42,143,493	3.12
9	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	3,500	11,082.24	38,787,858	10,958.80	38,355,820	2.84
10	WEYERHAEUSER COMPANY	アメリカ	投資証券	12,500	2,834.05	35,425,647	3,000.99	37,512,485	2.78
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	2,642	13,825.23	36,526,271	13,493.36	35,649,469	2.64
12	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	3,835	8,225.93	31,546,456	8,235.04	31,581,379	2.34
13	HOST HOTELS & RESORTS	アメリカ	投資証券	16,579	1,573.34	26,084,553	1,818.20	30,144,014	2.23
14	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	12,350	1,973.41	24,371,664	2,107.57	26,028,605	1.93
15	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	9,400	2,082.28	19,573,473	2,245.18	21,104,731	1.56
16	THE MACERICH COMPANY	アメリカ	投資証券	3,101	5,958.49	18,477,278	6,663.71	20,664,179	1.53
17	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	4,092	4,108.91	16,813,699	4,720.04	19,314,432	1.43
18	SL GREEN REALTY CORPORATION	アメリカ	投資証券	2,100	7,947.68	16,690,146	8,926.09	18,744,809	1.39
19	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	アメリカ	投資証券	3,800	4,462.03	16,955,744	4,833.36	18,366,800	1.36
20	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	2,800	6,613.12	18,516,749	6,195.25	17,346,703	1.28
21	FEDERAL REALTY INVESTMENT	アメリカ	投資証券	1,500	11,014.45	16,521,682	11,040.76	16,561,142	1.22
22	RAYONIER INC	アメリカ	投資証券	2,800	4,975.02	13,930,057	5,617.51	15,729,038	1.16
23	UDR INC	アメリカ	投資証券	5,758	2,500.15	14,395,908	2,468.79	14,215,304	1.05
24	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	1,900	6,615.14	12,568,781	7,018.85	13,335,827	0.98
25	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	800	14,988.80	11,991,044	16,019.82	12,815,863	0.95
26	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	7,400	1,529.84	11,320,827	1,688.69	12,496,337	0.92
27	TAUBMAN CENTERS INC	アメリカ	投資証券	1,400	8,104.51	11,346,325	8,296.76	11,615,464	0.86
28	SENIOR HOUSING PROPERTIES	アメリカ	投資証券	4,300	2,221.94	9,554,380	2,665.08	11,459,849	0.84
29	LIBERTY PROPERTY	アメリカ	投資証券	2,700	3,758.83	10,148,859	4,162.54	11,238,872	0.83
30	REGENCY CENTERS CORPORATION	アメリカ	投資証券	2,100	5,016.50	10,534,659	5,259.33	11,044,606	0.81

（注）外貨建投資証券の単価および金額は、平成25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25年5月31日現在）

種 類	投資比率（％）
投 資 証 券	99.19
合 計	99.19

株式業種別投資比率（平成25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8期特定期間	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	8,395,549,774	8,423,613,455	5,983	6,003
第12期特定期間	第65期計算期間末	7,794,757,508	7,822,463,549	5,627	5,647
	第66期計算期間末	7,810,120,809	7,837,377,028	5,731	5,751
	第67期計算期間末	7,659,894,819	7,686,490,238	5,760	5,780
	第68期計算期間末	7,680,780,324	7,707,043,976	5,849	5,869
	第69期計算期間末	7,635,829,613	7,661,636,464	5,918	5,938
	第70期計算期間末	7,563,587,311	7,588,930,007	5,969	5,989

(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13期特定期間	第71期計算期間末	7,503,534,742	7,528,588,237	5,990	6,010
	第72期計算期間末	7,825,539,467	7,850,287,760	6,324	6,344
	第73期計算期間末	8,286,171,063	8,310,703,430	6,755	6,775
	第74期計算期間末	8,667,834,521	8,692,217,236	7,110	7,130
	第75期計算期間末	8,997,451,810	9,021,515,066	7,478	7,498
	第76期計算期間末 (平成25年4月22日)	9,376,624,758	9,400,502,707	7,854	7,874
平成24年5月末日		7,733,985,756	-	5,626	-
平成24年6月末日		7,724,370,767	-	5,757	-
平成24年7月末日		7,609,306,500	-	5,754	-
平成24年8月末日		7,552,354,501	-	5,805	-
平成24年9月末日		7,538,447,255	-	5,872	-
平成24年10月末日		7,508,060,338	-	5,958	-
平成24年11月末日		7,639,752,901	-	6,118	-

平成24年12月末日	7,975,915,279	-	6,472	-
平成25年1月末日	8,498,015,446	-	6,947	-
平成25年2月末日	8,600,788,137	-	7,085	-
平成25年3月末日	9,004,912,745	-	7,494	-
平成25年4月末日	9,334,478,287	-	7,843	-
平成25年5月末日	9,099,615,846	-	7,704	-

（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2期特定期間	第5期計算期間 (平成19年5月21日)	40円
	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4期特定期間	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6期特定期間	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
第12期特定期間	第65期計算期間 (平成24年5月21日)	20円
	第66期計算期間 (平成24年6月20日)	20円
	第67期計算期間 (平成24年7月20日)	20円
	第68期計算期間 (平成24年8月20日)	20円
	第69期計算期間 (平成24年9月20日)	20円
	第70期計算期間 (平成24年10月22日)	20円

特定期間	決算期	1万口当たりの分配金
第13期特定期間	第71期計算期間 (平成24年11月20日)	20円
	第72期計算期間 (平成24年12月20日)	20円
	第73期計算期間 (平成25年1月21日)	20円
	第74期計算期間 (平成25年2月20日)	20円
	第75期計算期間 (平成25年3月21日)	20円
	第76期計算期間 (平成25年4月22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%
第12期特定期間	第65期計算期間 (平成24年5月21日)	5.6%
	第66期計算期間 (平成24年6月20日)	2.2%
	第67期計算期間 (平成24年7月20日)	0.9%
	第68期計算期間 (平成24年8月20日)	1.9%
	第69期計算期間 (平成24年9月20日)	1.5%
	第70期計算期間 (平成24年10月22日)	1.2%

特定期間	決算期	収益率
第13期特定期間	第71期計算期間 (平成24年11月20日)	0.7%
	第72期計算期間 (平成24年12月20日)	5.9%
	第73期計算期間 (平成25年1月21日)	7.1%
	第74期計算期間 (平成25年2月20日)	5.6%
	第75期計算期間 (平成25年3月21日)	5.5%
	第76期計算期間 (平成25年4月22日)	5.3%

(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口	46,550,000口
	第2期計算期間	4,064,130,486口	66,080,000口
	第3期計算期間	3,689,597,279口	263,233,663口
	第4期計算期間	6,358,819,780口	378,400,000口
第2期特定期間	第5期計算期間	9,269,829,054口	476,460,000口
	第6期計算期間	6,384,553,821口	688,003,187口
	第7期計算期間	4,163,523,649口	597,021,722口
	第8期計算期間	5,001,898,220口	439,121,134口
	第9期計算期間	5,666,297,435口	941,729,104口
	第10期計算期間	3,909,477,753口	771,647,859口
第3期特定期間	第11期計算期間	2,677,910,132口	1,066,470,211口
	第12期計算期間	1,914,581,223口	2,168,049,067口
	第13期計算期間	2,008,886,564口	1,755,933,055口
	第14期計算期間	699,668,119口	2,417,664,794口
	第15期計算期間	284,997,988口	2,929,990,216口
	第16期計算期間	256,345,950口	3,375,209,669口
第4期特定期間	第17期計算期間	191,379,568口	2,425,402,684口
	第18期計算期間	302,720,741口	2,923,993,165口
	第19期計算期間	158,931,559口	2,569,806,744口
	第20期計算期間	123,339,261口	2,686,566,494口
	第21期計算期間	170,941,702口	5,612,165,475口

	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□
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7期特定期間	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11期特定期間	第62期計算期間	3,499,496口	422,073,371口
	第63期計算期間	3,273,577口	440,844,418口
	第64期計算期間	3,212,426口	176,608,380口
第12期特定期間	第65期計算期間	3,253,612口	182,073,364口
	第66期計算期間	3,385,237口	228,296,264口
	第67期計算期間	3,292,188口	333,692,320口
	第68期計算期間	3,277,826口	169,161,458口
	第69期計算期間	3,161,978口	231,562,502口
	第70期計算期間	2,942,750口	235,020,052口

特定期間	計算期間	設定口数	解約口数
第13期特定期間	第71期計算期間	2,953,685口	147,554,060口
	第72期計算期間	4,546,395口	157,147,648口
	第73期計算期間	3,559,260口	111,521,922口
	第74期計算期間	4,160,981口	78,987,065口
	第75期計算期間	2,508,819口	162,238,477口
	第76期計算期間	18,527,341口	111,180,749口

(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。

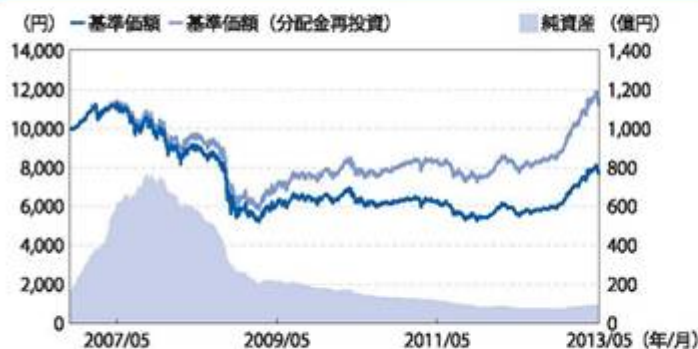
< 参考情報 >

運用実績

新光7資産バランスファンド 愛称：七重奏

2013年5月31日現在

< 基準価額・純資産の推移 > (2006年10月31日～2013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であり、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 >

2013年5月	20円
2013年4月	20円
2013年3月	20円
2013年2月	20円
2013年1月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	2,620円

※分配は1万口当たり・取引日の金額です。
 ※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
新光外国株式インデックスマザーファンド	15.33%
新光米国REITマザーファンド	14.81%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	14.31%
海外国債マザーファンド	14.11%
新光日本債券インデックスマザーファンド	13.89%
フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	13.32%
新光J-REITマザーファンド	12.26%
合計	98.07%

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	4.69%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.70%
本田技研工業	輸送用機器	1.96%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.84%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.51%

※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総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263回利付国債(10年)	2014/09/20	1.600%	1.62%
第273回利付国債(10年)	2015/09/20	1.500%	1.58%
第303回利付国債(10年)	2019/09/20	1.400%	1.49%
第313回利付国債(10年)	2021/03/20	1.300%	1.48%
第269回利付国債(10年)	2015/03/20	1.300%	1.45%

※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。

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	11.61%
ジャパンリアルエステイト投資法人	9.52%
日本リテールファンド投資法人	6.41%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.82%
日本プライムリアルティ投資法人	4.18%

※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。

・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いただけます。

運用実績

2013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	1.57%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.54%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.97%
GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	資本財	0.90%
CHEVRON CORP	アメリカ	エネルギー	0.89%

※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	2023/02/15	2.000%	米ドル	4.17%
US TREASURY N/B	2020/11/15	2.625%	米ドル	4.11%
FRANCE (GOVT OF)	2021/04/25	3.750%	ユーロ	3.84%
US TREASURY N/B	2022/11/15	1.625%	米ドル	3.81%
US TREASURY N/B	2021/02/15	3.625%	米ドル	3.53%

※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・マーケット・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	46.5%
ユーロ	9.1%
ブラジルレアル	5.0%
ウルグアイペソ	3.9%
メキシコペソ	3.4%

②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
ナイジェリア	6.7%
ロシア	6.7%
ウクライナ	5.4%
グルジア	3.9%
ウルグアイ	3.9%

※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・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

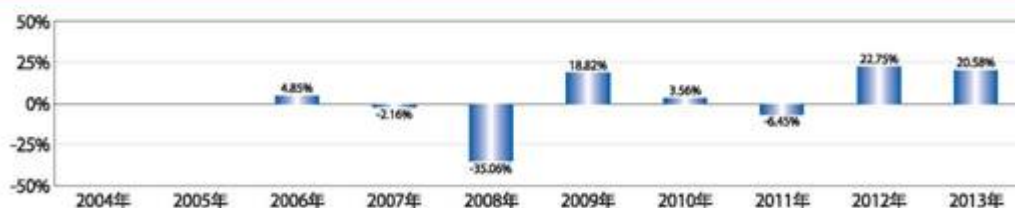
米国REITの組入上位5銘柄（新光米国REITマザーファンド）

銘柄名	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	9.06%
AMERICAN TOWER CORPORATION	5.37%
PUBLIC STORAGE	3.81%
HCP INC	3.73%
VENTAS INC	3.68%

※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



※取引前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。
 ※2013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13期特定期間（平成24年10月23日から平成25年4月22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12期特定期間末 (平成24年10月22日現在)	第13期特定期間末 (平成25年4月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	152,139,146	215,153,101
投資信託受益証券	1,071,757,500	1,229,594,500
親投資信託受益証券	6,388,730,099	7,973,108,952
未収利息	249	279
流動資産合計	7,612,626,994	9,417,856,832
資産合計	7,612,626,994	9,417,856,832
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	25,342,696	23,877,949
未払解約金	17,056,205	9,307,200
未払受託者報酬	556,405	674,215
未払委託者報酬	6,050,865	7,332,098
その他未払費用	33,512	40,612
流動負債合計	49,039,683	41,232,074
負債合計	49,039,683	41,232,074
純資産の部		
元本等		
元本	12,671,348,234	11,938,974,794
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,107,760,923	2,562,350,036
（分配準備積立金）	150,069,235	179,866,812
元本等合計	7,563,587,311	9,376,624,758
純資産合計	7,563,587,311	9,376,624,758
負債純資産合計	7,612,626,994	9,417,856,832

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期特定期間 自平成24年 4月21日 至平成24年10月22日	第13期特定期間 自平成24年10月23日 至平成25年 4月22日
営業収益		
受取配当金	101,250,000	95,220,000
受取利息	32,118	48,288
有価証券売買等損益	51,188,069	2,393,592,853
営業収益合計	152,470,187	2,488,861,141
営業費用		
受託者報酬	3,300,745	3,470,063
委託者報酬	35,895,513	37,736,834
その他費用	171,084	209,009
営業費用合計	39,367,342	41,415,906
営業利益	113,102,845	2,447,445,235
経常利益	113,102,845	2,447,445,235
当期純利益	113,102,845	2,447,445,235
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,321,778	9,790,829
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,636,290,829	5,107,760,923
剰余金増加額又は欠損金減少額	581,171,478	264,933,911
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	581,171,478	264,933,911
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,095,317	10,519,355
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,095,317	10,519,355
分配金	158,970,878	146,658,075
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,107,760,923	2,562,350,036

(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13期特定期間 自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間に関する事項 前特定期間終了日及び当特定期間終了日に該当する日が休業日のため、当特定 期間は平成24年10月23日から平成25年4月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第12期特定期間末 [平成24年10月22日現在]	第13期特定期間末 [平成25年 4月22日現在]
1. 特定期間末日における受益権の総数 12,671,348,234口	1. 特定期間末日における受益権の総数 11,938,974,794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 5,107,760,923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 2,562,350,036円
3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.5969円 (1万口当たり純資産額) (5,969円)	3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7854円 (1万口当たり純資産額) (7,854円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第12期特定期間 自 平成24年 4月21日 至 平成24年10月22日	第13期特定期間 自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日
分配金の計算過程	<p>(1) 第65期計算期間（平成24年4月21日 から平成24年5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（26,843,598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（3,023,797円）及 び分配準備積立金（138,018,393 円）より分配対象収益は 167,885,788円（1万口当たり121.18 円）であり、うち27,706,041円（1万 口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(2) 第66期計算期間（平成24年5月22日 から平成24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（28,867,997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（3,009,412円）及 び分配準備積立金（135,180,853 円）より分配対象収益は 167,058,262円（1万口当たり122.57 円）であり、うち27,256,219円（1万 口当たり20円）を分配しております。</p>	<p>(1) 第71期計算期間（平成24年10月23日 から平成24年11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（24,772,912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（2,938,213円）及 び分配準備積立金（148,559,780 円）より分配対象収益は 176,270,905円（1万口当たり140.70 円）であり、うち25,053,495円（1万 口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(2) 第72期計算期間（平成24年11月21日 から平成24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（28,171,725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（2,959,773円）及 び分配準備積立金（146,550,295 円）より分配対象収益は 177,681,793円（1万口当たり143.57 円）であり、うち24,748,293円（1万 口当たり20円）を分配しております。</p>

	<p>(3) 第67期計算期間（平成24年6月21日から平成24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（31,580,616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（2,971,837円）及び分配準備積立金（133,891,810円）より分配対象収益は168,444,263円（1万口当たり126.65円）であり、うち26,595,419円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>	<p>(3) 第73期計算期間（平成24年12月21日から平成25年1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（33,720,379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（2,980,795円）及び分配準備積立金（148,741,564円）より分配対象収益は185,442,738円（1万口当たり151.17円）であり、うち24,532,367円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>
--	---	--

区 分	第12期特定期間 自 平成24年 4月21日 至 平成24年10月22日	第13期特定期間 自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日
分配金の計算過程	<p>(4) 第68期計算期間（平成24年7月21日から平成24年8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（28,724,802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（2,970,225円）及び分配準備積立金（137,351,314円）より分配対象収益は169,046,341円（1万口当たり128.71円）であり、うち26,263,652円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(5) 第69期計算期間（平成24年8月21日から平成24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（27,956,707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（2,953,543円）及び分配準備積立金（137,699,721円）より分配対象収益は168,609,971円（1万口当たり130.65円）であり、うち25,806,851円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(6) 第70期計算期間（平成24年9月21日から平成24年10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（37,756,316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（2,936,022円）及び分配準備積立金（137,655,615円）より分配対象収益は178,347,953円（1万口当たり140.73円）であり、うち25,342,696円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>	<p>(4) 第74期計算期間（平成25年1月22日から平成25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（27,942,202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（3,017,885円）及び分配準備積立金（156,991,759円）より分配対象収益は187,951,846円（1万口当たり154.14円）であり、うち24,382,715円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(5) 第75期計算期間（平成25年2月21日から平成25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（30,743,741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（3,012,626円）及び分配準備積立金（158,616,452円）より分配対象収益は192,372,819円（1万口当たり159.88円）であり、うち24,063,256円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>(6) 第76期計算期間（平成25年3月22日から平成25年4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（39,852,307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（3,266,986円）及び分配準備積立金（163,892,454円）より分配対象収益は207,011,747円（1万口当たり173.37円）であり、うち23,877,949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12期特定期間 自 平成24年 4月21日 至 平成24年10月22日	第13期特定期間 自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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12期特定期間末 [平成24年10月22日現在]	第13期特定期間末 [平成25年4月22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12期特定期間 自平成24年4月21日 至平成24年10月22日	第13期特定期間 自平成24年10月23日 至平成25年4月22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12期特定期間末 [平成24年10月22日現在]	第13期特定期間末 [平成25年4月22日現在]
期首元本額	14,031,840,603円	12,671,348,234円
期中追加設定元本額	19,313,591円	36,256,481円
期中一部解約元本額	1,379,805,960円	768,629,921円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	第12期特定期間末 [平成24年10月22日現在]	第13期特定期間末 [平成25年 4月22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	12,705,000	37,649,500
親投資信託受益証券	64,862,575	428,774,003
合 計	77,567,575	466,423,503

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12期特定期間末 [平成24年10月22日現在]	第13期特定期間末 [平成25年 4月22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	173,500	1,229,594,500	
投資信託受益証券小計		173,500	1,229,594,500	
親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	669,198,900	1,291,286,197	
	ニュー トピックス インデックス マザーファン ド	1,067,904,948	1,441,137,727	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	1,022,290,872	1,296,878,200	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	998,898,224	1,159,720,838	
	新光J - R E I Tマザーファンド	1,089,586,634	1,416,135,748	
	新光米国R E I Tマザーファンド	1,288,574,079	1,367,950,242	
親投資信託受益証券小計		6,136,453,657	7,973,108,952	
有 価 証 券 合 計		-	9,202,703,452	

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2012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 メロン 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）

2012年11月30日現在

	注記	2012年11月30日現在 (日本円)	2012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	43,296,448,091	43,045,216,459
償還可能受益証券の保有者に対する債権		214,797,122	-
ブローカーに対する債権		181,899,812	147,042,062
現金および現金同等物	6	4,359,104,918	917,164,220
その他の債権	10	3,497,455	206,405
資産合計		48,055,747,398	44,109,629,146
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	47,904,209,696	43,603,106,877
負債			
流動負債			
償還可能受益証券の保有者に対する債務		13,008,555	155,530,989
ブローカーに対する債務		74,851,166	303,801,829
未払費用	7	63,677,981	47,189,451
負債合計		151,537,702	506,522,269
資本および負債合計		48,055,747,398	44,109,629,146

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）

2012年11月30日に終了した半年間

	注記	2012年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2011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		6,859	82,512
為替差益 / (差損) 純額		110,521,699	(60,950,410)
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		7,558,789,747	(4,234,580,623)
純収益 / (損失) 合計		7,669,318,305	(4,295,448,521)
費用			
運用報酬	10(a)	89,902,867	88,326,280
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	10(b)	23,246,168	23,048,823
保管受託銀行報酬	10(c)	10,924,322	6,542,966
費用の払戻し	10(d)	(3,497,455)	-
当座借越利息		85,475	-
その他の営業費用		16,418,964	2,385,128
営業費用合計		137,080,341	120,303,197
税引前利益 / (損失)		7,532,237,964	(4,415,751,718)
源泉税		-	-
当期利益 / (損失)		7,532,237,964	(4,415,751,718)

その他の包括利益	-	-
包括利益 / (損失) 合計	7,532,237,964	(4,415,751,718)

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)

2012年11月30日に終了した半年間

注記	2012年11月30日に 終了した半年間 合計		2011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	7,781,812	43,603,106,877	6,567,000	46,542,655,146
半年間の包括利益 / (損失) 合計	-	7,532,237,964	-	(4,415,751,718)
半年間の分配金	9	(4,186,324,890)	-	(3,681,794,970)
受益証券の発行	1,992,307	11,499,020,858	1,454,406	8,960,395,063
受益証券の償還	(1,831,543)	(10,543,831,113)	(212,985)	(1,390,400,949)
半年間の期末残高	7,942,576	47,904,209,696	7,808,421	46,015,102,572

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)

2012年11月30日に終了した半年間

注記	2012年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2011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 / (損失) 合計	7,532,237,964	(4,415,751,718)
- 受取利息	(6,859)	(82,512)
- 支払利息	85,475	-
運転資本変動前営業キャッシュ・フロー	7,532,316,580	(4,415,834,230)
営業資産および負債の変動		
- 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産の(増加)/減少	(251,231,632)	6,018,510,231
- プローカーに対する債権の(増加)/減少	(34,857,750)	243,210,587
- その他の債権の増加	(3,291,050)	-
- プローカーに対する債務の減少	(228,950,663)	(276,007,989)
- 未払費用の増加 / (減少)	16,488,530	(7,966,687)
営業によるキャッシュ	7,030,474,015	1,561,911,912
利息の受取額	6,859	82,512
営業活動による正味キャッシュ収入	7,030,480,874	1,561,994,424
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	(4,186,324,890)	(3,681,794,970)
受益証券の発行による収入	11,284,223,736	8,440,744,147
受益証券の償還による支払	(10,686,353,547)	(1,129,258,509)
利息の支払額	(85,475)	-
財務活動による正味キャッシュ支出	(3,588,540,176)	3,629,690,668
現金および現金同等物の純増加額	3,441,940,698	5,191,685,092

現金および現金同等物の半年間の期首残高		917,164,220	439,549,887
現金および現金同等物の半年間の期末残高	6	4,359,104,918	5,631,234,979

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)

2012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, Camana Bay, 72 Market Street, Cassia Court, 2nd Floor Suite 2204, P.O. Box 31371, 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 メロン 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。

本財務書類に対する注記において、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。

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。

以下の新基準、修正、および解釈指針は、公表済であるが2012年6月1日開始会計年度において未発効でありかつ当ファンドに早期適用されていない。

IFRS第9号「金融商品」は、2015年1月1日以後開始する年度から発効し、企業がどのように金融資産および金融負債(一部の混合契約を含む。)を分類および測定するべきかを規定している。当該基準は、IAS第39号の規定に比べて、金融資産の分類および測定のアプローチを改善し簡素化している。金融負債の分類および測定に關す

るIAS第39号の規定の大半が、そのまま引き継がれた。当該基準は、金融資産の分類に首尾一貫したアプローチを適用し、IAS第39号における金融資産の多数の区分(各々の区分に固有の分類基準があった。)を置き換えている。当ファンドは金融資産および金融負債(長期および短期の双方)を引き続き純損益を通じて公正価値で測定するものとして分類すると予想されることから、当該基準は、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。

IFRS第10号「連結財務諸表」は、2013年1月1日以後開始する年度から発効し、ある企業を親会社の連結財務諸表に含めるべきかどうかの決定要素として支配という概念を認定して、既存の原則の上に構築されている。当該基準は、評価が困難な場合に支配の決定の助けとなる追加指針を規定している。この新基準は、当ファンドの財政状態および業績に影響を及ぼさないと見込まれている。

IFRS第12号「他の企業への関与の開示」は、2013年1月1日以後開始する年度から発効し、他の企業(共同支配の取決め、関連会社、特別目的ビークル、およびその他の簿外ビークル等)に対するあらゆる形態の関与に関する開示規定を含んでいる。この新基準は、当ファンドの財政状態および業績に影響を及ぼさないと見込まれている。

IFRS第13号「公正価値測定」は、2013年1月1日以後開始する年度から発効し、公正価値の明確な定義、ならびに、IFRS全体で使用するための公正価値測定および開示規定の単一の典拠を規定することで、整合性を改善し複雑性を低減している。これらの規定は、公正価値会計の使用を拡大するものではないが、IFRSの他の基準が公正価値会計の使用をすでに要求または認容している場合に、どのように適用すべきかについての指針を提供している。公正価値で測定する資産または負債に買呼値および売呼値がある場合には、当該基準は、評価が呼値スプレッドの範囲内で公正価値を最もよく表す価格に基づくことを要求し、仲値による価格付けの使用、または市場参加者が呼値スプレッドの範囲内で公正価値測定の実務上の便法として用いているその他の価格付けの慣行の使用を認めている。この新基準は、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。

当ファンドに重要な影響を及ぼすと見込まれる、未発効の基準、解釈指針、および既存の基準の修正は、他にない。

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

投資の通常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、報告期間末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、各報告期間末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の金額は、それぞれ、契約済であるが報告期間末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。これらは短期性のものであり、帳簿価額は公正価値に近似している。

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。

2012年11月30日の感応度分析は、VaRモデルを使用して実施された。VaRモデルの使用により、リスク変数(市場価格リスク、外国為替リスクおよび金利リスクを含む。)間の相互依存性をより反映することが可能である。

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、2012年11月30日現在、8.290%または3,971,258,984円（2012年5月31日現在、9.229%または4,024,130,734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「OIP0」という。）にも投資を行っている。これらのOIP0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、OIP0から導出された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			
	2012年11月30日現在		2012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	1.43	35,255,109	1.54	36,297,759
月次総利回り最小値	(1.58)	(38,953,197)	(5.78)	(136,234,446)
月次総利回り最大値	4.86	119,818,062	4.86	114,550,071
<u>ベネズエラ原油ワラント</u>				
月次総利回り中央値	2.75	51,409,546	1.17	18,736,777
月次総利回り最小値	(2.42)	(45,240,400)	(2.09)	(33,469,969)
月次総利回り最大値	16.36	305,840,063	16.36	261,994,593

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に関連するリスクにさらされている。金利リスクは、当ファンドに対する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)
2012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	3,826,234,855	8,364,739,511	8,327,132,163	18,443,511,305	4,334,830,257	43,296,448,091
償還可能受益証券の保有者に対する債権	-	-	-	-	214,797,122	214,797,122
ブローカーに対する債権	-	-	-	-	181,899,812	181,899,812
現金および現金同等物	4,359,104,918	-	-	-	-	4,359,104,918
その他の債権	-	-	-	-	3,497,455	3,497,455
資産合計	8,185,339,773	8,364,739,511	8,327,132,163	18,443,511,305	4,735,024,646	48,055,747,398
負債						
償還可能受益証券の保有者に対する債務	-	-	-	-	13,008,555	13,008,555
ブローカーに対する債務	-	-	-	-	74,851,166	74,851,166
未払費用	-	-	-	-	63,677,981	63,677,981
負債合計	-	-	-	-	151,537,702	151,537,702
金利感応度ギャップ合計	8,185,339,773	8,364,739,511	8,327,132,163	18,443,511,305	4,583,486,944	47,904,209,696
2012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	5,541,088,511	6,614,278,528	8,526,016,233	18,405,401,906	3,958,431,281	43,045,216,459
ブローカーに対する債権	-	-	-	-	147,042,062	147,042,062
現金および現金同等物	917,164,220	-	-	-	-	917,164,220
その他の債権	-	-	-	-	206,405	206,405
資産合計	6,458,252,731	6,614,278,528	8,526,016,233	18,405,401,906	4,105,679,748	44,109,629,146
負債						
償還可能受益証券の保有者に対する債務	-	-	-	-	155,530,989	155,530,989
ブローカーに対する債務	-	-	-	-	303,801,829	303,801,829
未払費用	-	-	-	-	47,189,451	47,189,451
負債合計	-	-	-	-	506,522,269	506,522,269
金利感応度ギャップ合計	6,458,252,731	6,614,278,528	8,526,016,233	18,405,401,906	3,599,157,479	43,603,106,877

3.4 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。

	2012年11月30日現在 日本円	2012年5月31日現在 日本円
資産		
ブラジル・リアル	1,748,014,808	1,723,300,800
コスタリカ・コロン	474,944,117	-
ドイツ・マルク	1,314,580,818	1,194,614,894
ドミニカ・ペソ	969,030,397	921,942,746
ユーロ	3,731,556,099	4,649,791,138
ガーナ・セディ	1,250,930,656	1,042,412,317
日本円	858,665,321	-
メキシコ・ヌエボ・ペソ	1,787,056,408	1,530,337,193
新トルコ・リラ	1,634,958,633	1,481,037,078
ナイジェリア・ナイラ	1,187,788,517	983,315,063
ロシア・ルーブル	980,987,684	819,293,839
セルビア・ディナール	536,247,696	436,708,011
南アフリカ・ランド	1,022,683,830	929,551,408
ウガンダ・シリング	560,245,883	530,942,653
ウルグアイ・ペソ	1,785,246,720	1,312,511,847
米ドル	28,212,809,811	26,553,870,159
資産合計	48,055,747,398	44,109,629,146
負債		
日本円	58,727,297	187,542,087
シンガポール・ドル	2,143,164	4,304,077
米ドル	90,667,241	314,676,105
負債合計	151,537,702	506,522,269

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。

	2012年11月30日現在 日本円	2012年5月31日現在 日本円
クレジット・リンク債		
ブラジル・リアル	1,748,014,808	1,723,300,800
ユーロ	-	881,214,312
クレジット・リンク債合計	1,748,014,808	2,604,515,112

3.5 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。2012年11月30日現在、当ファンドの有価証券の平均信用格付けは、BB-(2012年5月31日：BB)である。

格付（ムーディーズ/スタンダード・アンド・プアーズ）	2012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 %	2012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 %
A1 / A+	4.04	-
A3 / A-	-	2.16
Baa1 / BBB+	7.58	5.55
Baa2 / BBB	7.37	13.70
Baa3 / BBB-	11.65	10.22
Ba1 / BB+	5.84	7.67
Ba2 / BB	9.76	12.87
Ba3 / BB-	19.12	10.67
B1 / B+	2.24	7.62
B2 / B	15.62	16.60
B3 / B-	13.48	8.83
Caa1 / CCC+	2.16	-
Caa2 / CCC	-	2.02
D（スタンダード・アンド・プアーズのみ）	1.14	2.09
	100.00	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。

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	2012年11月30日現在 純資産に対する割合 （%）	2012年5月31日現在 純資産に対する割合 （%）
Aa3 / AA-	Baa2	-	3.95
A1 / A+	Baa2	3.65	-
A1 / A+	BB-	-	2.02
合計		3.65	5.97

報告期間末日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。

	2012年11月30日現在 （日本円）	2012年5月31日現在 （日本円）
債券	37,213,603,026	36,482,270,066
デリバティブ資産	6,082,845,065	6,562,946,393

償還可能受益証券の保有者に対する債権	214,797,122	-
ブローカーに対する債権	181,899,812	147,042,062
現金および現金同等物	4,359,104,918	917,164,220
その他の債権	3,497,455	206,405
合計	48,055,747,398	44,109,629,146

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。

	2012年11月30日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
Astana Finance 7.785% 08/06/2010	491,592,589	395,310,532
Sphynx Capital Markets 10.25% due 30/01/2010	-	502,538,702
	491,592,589	897,849,234

上記の投資は、不履行となっている支払を2012年11月30日現在の公正価値の考慮に入れている。

3.6 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）に投資する場合がある。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、報告期間末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)	合計 (日本円)
2012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	13,008,555	-	13,008,555
ブローカーに対する債務	74,851,166	-	74,851,166
未払費用	-	63,677,981	63,677,981
合計	87,859,721	63,677,981	151,537,702

2012年5月31日現在			
償還可能受益証券の保有者に対する債務	155,530,989	-	155,530,989
ブローカーに対する債務	303,801,829	-	303,801,829
未払費用	-	47,189,451	47,189,451

合計	459,332,818	47,189,451	506,522,269
----	-------------	------------	-------------

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。

報告期間末日現在、受益証券保有者は1名(2012年5月31日：1名)であり、当ファンドの74%(2012年5月31日：79%)の持分を保有していた。

3.8 公正価値の見積り

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)

公正価値測定が全体として区分される公正価値ヒエラルキーのレベルは、その公正価値測定の全体にとって重要な最も低いレベルのインプットに基づいて決定される。この目的上、インプットの重要性は、その公正価値測定の全体に対して評価される。公正価値測定が、観察不能なインプットに基づく重要な調整を要する観察可能なインプットを使用している場合には、その測定はレベル3の測定である。公正価値測定の全体にとっての特定のインプットの重要性の評価は、当該資産または負債に固有の要素を考慮しながら、判断を必要とする。

何が「観察可能」であるかの決定は、当ファンドによる重要な判断が必要である。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。

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、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。

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、公正価値を算定する際に、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、報告期間末日現在、公正価値で測定した当ファンドの金融資産・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。

2012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)	合計 (日本円)
売買目的金融資産：				
- 債券	-	36,132,409,517	1,081,193,509	37,213,603,026
- デリバティブ資産	-	6,082,845,065	-	6,082,845,065
資産合計	-	42,215,254,582	1,081,193,509	43,296,448,091

2012年5月31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)	合計 (日本円)
売買目的金融資産：				
- 債券	-	35,056,503,056	1,425,767,010	36,482,270,066
- デリバティブ資産	-	6,562,946,393	-	6,562,946,393
資産合計	-	41,619,449,449	1,425,767,010	43,045,216,459

以下の表は、2012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。

	債券 2012年11月30日現在 (日本円)	債券 2012年5月31日現在 (日本円)
期首残高	1,425,767,010	680,530,611
購入	459,923,377	968,866,915
売却	(941,053,562)	(384,787,679)
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	136,556,684	161,157,163
期末残高	1,081,193,509	1,425,767,010
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	136,556,684	17,247,166

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	2012年11月30日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
債券	37,213,603,026	36,482,270,066
クレジット・リンク債	1,748,014,808	2,604,515,112
原油ワラント	4,334,830,257	3,958,431,281
売買目的保有合計	43,296,448,091	43,045,216,459

以下の表は保有する金融資産の要約である。

	2012年11月30日現在 公正価値 日本円	2012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	324,895,288	428,003,618

Province Del Neuquen 7.875% due 26/04/2021 REGS	801,815,363	345,690,061
Province of Salta Argentina 9.5% due 16/03/2022 REGS	682,269,007	511,249,295
アルゼンチン合計	1,808,979,658	1,284,942,974
アゼルバイジャン		
Intl Bank of Azerbaijan (Rubrika Finance) 8.5% due 22/10/2013 series REGS	744,891,233	698,479,862
State Oil Co of The Azerbaijan REP 5.45% due 09/02/2017	-	342,465,435
アゼルバイジャン合計	744,891,233	1,040,945,297
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina 0% due 11/12/2021	1,314,580,818	1,194,614,894
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	1,314,580,818	1,194,614,894
中国		
Franshion Development Ltd 6.75% due 15/04/2021 REGS	416,727,093	340,808,651
中国合計	416,727,093	340,808,651
コスタリカ		
Instituto Costarricense De Electricidad 6.95% due 10/11/2021 REGS	-	244,253,448
Republic of Costa Rica 10.58% due 23/09/2015 REGS	474,944,117	-
コスタリカ合計	474,944,117	244,253,448
クロアチア		
Republic of Croatia 6.75% due 05/11/2019	478,895,435	451,281,148
クロアチア合計	478,895,435	451,281,148
ドミニカ共和国		
Dominican Republic 10.5% due 09/08/2013 Series REGS	969,030,397	921,942,746
Ege Haina Finance Company 9.5% due 26/04/2017 Series REG	403,247,340	381,441,759
ドミニカ共和国合計	1,372,277,737	1,303,384,505
エクアドル		
Republic of Ecuador 9.375% due 15/12/2015 Series REGS	475,054,418	869,026,863
エクアドル合計	475,054,418	869,026,863
エジプト		
Arab Republic of Egypt 6.875% due 30/04/2040 Series REGS	197,940,700	379,547,640
エジプト合計	197,940,700	379,547,640
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	1,599,388,184	1,415,700,909
エルサルバドル合計	1,599,388,184	1,415,700,909
エストニア		
Eesti Energia AS,4.5% due 11/18/2020	-	461,053,651
エストニア合計	-	461,053,651
グルジア		
Georgian Oil & Gas Corp 6.875% due 16/05/2017 REGS	583,213,511	515,753,963
Georgian Railway LLC 9.875% due 22/07/2015	-	921,802,765
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022	725,696,618	-
Republic of Georgia 6.875% due 12/04/2021 REGS	1,013,884,740	879,752,063
グルジア合計	2,322,794,869	2,317,308,791
ガーナ		

2012年11月30日現在
公正価値
日本円2012年5月31日現在
公正価値
日本円

Ghana Govt 13.67% due 11/06/2012	-	1,042,412,317
Ghana Govt 23% due 21/08/2017	1,250,930,656	-
ガーナ合計	1,250,930,656	1,042,412,317
グレナダ		
Government of Grenada FRN due 15/09/2025 Series REGS	460,971,086	499,701,622
グレナダ合計	460,971,086	499,701,622
ハンガリー		
Hungarian Development Bank 5.875% due 31/05/2016	904,151,916	716,980,521
ハンガリー合計	904,151,916	716,980,521
インド		
Indian Oil Corp Ltd 5.625% due 02/08/2021 REGS	497,806,990	434,177,961
NTPC Ltd 5.625% due 14/07/2021	-	357,384,080
インド合計	497,806,990	791,562,041
イラク		
Republic of Iraq 5.8% due 15/01/2028	951,131,619	758,731,651
イラク合計	951,131,619	758,731,651
コートジボワール		
Ivory Coast Republic of 3.75% due 31/12/2032 REGS FRN	1,052,456,626	-
Sphynx Capital Markets 10.25% due 30/01/2010(注記 3.5)	-	502,538,702
コートジボワール合計	1,052,456,626	502,538,702
ヨルダン		
Dev Inv Jordan Arm Force 6.14% due 16/12/2019	2,108,482,279	2,127,710,678
ヨルダン合計	2,108,482,279	2,127,710,678
カザフスタン		
Astana Finance 7.875% due 08/06/2010(注記 3.5)	491,592,589	395,310,532
Kazmunaigaz Finance SUB 11.75% due 23/01/2015 Series REGS	613,243,792	949,833,708
カザフスタン合計	1,104,836,381	1,345,144,240
リトアニア		
Republic of Lithuania 6.125% due 09/03/2021 REGS	-	752,081,374
Republic of Lithuania 6.625% due 01/02/2022 REGS	-	884,833,882
リトアニア合計	-	1,636,915,256
マケドニア		
FYR Macedonia 9.875% due 08/01/2013	778,381,707	757,084,540
マケドニア合計	778,381,707	757,084,540
メキシコ		
Mexican Bondes DesarroII FRN 15/01/2015 Series LD	1,774,558,122	1,524,997,754
メキシコ合計	1,774,558,122	1,524,997,754

2012年11月30日現在 公正価値 日本円	2012年5月31日現在 公正価値 日本円
------------------------------	-----------------------------

モンテネグロ		
Republic of Montenegro 7.875% due 14/09/2015	556,398,612	493,197,260
モンテネグロ合計	556,398,612	493,197,260

ナイジェリア

Government of Nigeria 16.39% due 27/01/2022	641,520,374	-
Nigeria Treasury Bill 09/08/2012	-	176,516,610
Nigeria Treasury Bill 04/10/2012	-	128,657,293
Nigeria Treasury Bill 11/10/2012	-	209,461,338
Nigeria Treasury Bill 06/12/2012	245,503,326	212,019,595
Nigeria Treasury Bill 07/02/2013	299,442,487	256,660,227
ナイジェリア合計	1,186,466,187	983,315,063

ロシア

Gaz Capital SA 9.25% due 23/04/2019 SER REGS	980,503,049	863,726,297
RSHB Capital (RUSS AGRIC BK) 6.00% due 03/06/2021 REGS	828,515,712	733,104,739
Russian Federation 7.85% due 10/03/2018 REGS	484,923,925	403,924,954
RZD Capital Ltd 8.3% due 02/04/2019 REGS	496,063,759	415,368,885
RZD Capital Ltd 5.7% due 05/04/2022 REGS	613,755,768	530,796,113
ロシア合計	3,403,762,213	2,946,920,988

セルビア

Serbia Treasury Bill 06/09/2012 STRP Coupon	-	436,708,011
Serbia Treasury Bill 13/09/2013	536,247,696	-
セルビア合計	536,247,696	436,708,011

南アフリカ

Republic of South Africa 2.25% due 31/01/2038 Index Linked	537,118,283	-
South Africa Republic of 8% due 21/12/2018	485,565,266	929,534,217
南アフリカ合計	1,022,683,549	929,534,217

2012年11月30日現在
公正価値
日本円2012年5月31日現在
公正価値
日本円

トリニダード・トバゴ

Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 Series REGS	1,670,417,560	1,961,258,685
トリニダード・トバゴ合計	1,670,417,560	1,961,258,685

チュニジア

Banque Cent de Tunisie 4.5% due 22/06/2020 REGS	445,842,861	395,165,714
チュニジア合計	445,842,861	395,165,714

トルコ

Turkey Government Bond FRN due 26/02/2014	1,163,923,251	1,072,773,053
Turkey Government Bond FRN due 04/01/2017	459,976,493	408,264,025
Turkey Vakiflar Bankasi Tao due 5.75% due 24/04/2017 REGS	273,997,130	232,524,618
トルコ合計	1,897,896,874	1,713,561,696

ウガンダ

Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 01/01/2015	185,237,170	-
Uganda Treasury Bill 04/10/2012	-	185,418,737
Uganda Treasury Bill 15/11/2012	-	36,993,079
Uganda Treasury Bill 29/11/2012	-	169,310,068
Uganda Treasury Bill 18/04/2013	151,403,727	138,610,564
ウガンダ合計	336,640,897	530,332,448

ウクライナ

Credit Suisse (CITY KYIV) 8.25% due 26/11/2012	-	702,500,588
City of KYIV (CSFB) 8% due 06/11/2015	304,090,676	263,316,443
State Savings Bank of Ukraine 8.25% due 10/03/2016	960,180,455	807,299,013
Ukraine 9.25% due 24/07/2017 REGS	1,017,547,082	-
ウクライナ合計	2,281,818,213	1,773,116,044

ウルグアイ		
Republica Orient Uruguay 3.7% due 26/06/2037	1,785,246,720	1,312,511,847
ウルグアイ合計	1,785,246,720	1,312,511,847
債券合計	37,213,603,026	36,482,270,066
	2012年11月30日現在 公正価値 日本円	2012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	-	881,214,312
アンゴラ合計	-	881,214,312
ブラジル		
HSBC Bank USA 6% due 17/05/2013	1,748,014,808	1,723,300,800
ブラジル合計	1,748,014,808	1,723,300,800
クレジット・リンク債合計	1,748,014,808	2,604,515,112
原油ワラント		
ナイジェリア		
Central Bank of Nigeria Expires 15/11/2020	2,465,392,221	2,356,997,336
ナイジェリア合計	2,465,392,221	2,356,997,336
ベネズエラ		
Republic of Venezuela - Oil Expires 15/04/2020 Series USD	1,869,438,036	1,601,433,945
ベネズエラ合計	1,869,438,036	1,601,433,945
原油ワラント合計	4,334,830,257	3,958,431,281
投資ポートフォリオ	43,296,448,091	43,045,216,459

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年代前半のプレイディ・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。

	2012年11月30日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
現金および現金同等物	4,359,104,918	917,164,220

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

	2012年11月30日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
未払運用報酬	45,718,742	32,011,098
未払受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	11,529,975	8,013,681
未払保管受託銀行報酬	4,286,100	2,860,595
その他の未払費用	2,143,164	4,304,077
	63,677,981	47,189,451

未払費用の帳簿価額は、報告期間末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。報告期間末日現在の、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。

	2012年11月30日現在 (日本円)	2012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)	47,904,209,696	43,603,106,877
買呼値から仲値への調整	478,044,585	390,301,039
資本金および剰余金(仲値)	48,382,254,281	43,993,407,916

9 分配金

受託会社は、当ファンドから受益証券保有者に対し月次分配を行う意向である。当該月次分配にかかわらず、投資顧問会社の助言で受託会社が当ファンドからの分配を随時行う場合がある。受託会社は、当ファンドのインカム・ゲイン純額に、当ファンドの実現キャピタル・ゲイン純額のうち受託会社が決定した一定割合を加算した額を限度として、分配を行うことが可能である。受託会社が決定する適切な分配水準を維持するには、ファンドのインカムまたは実現・未実現キャピタル・ゲイン純額が不十分な場合には、受託会社は、分配金が受益証券保有者の利益のためにのみ充当されることを条件として、受託会社が決定したとおり当ファンドの純資産を使用することができる。受託会社は、毎月分配を行う意向ではあるが、分配を通例または毎月行う義務はない。分配は、投資顧問会社の同意を得て受託会社の裁量で行われている。

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
2012年11月30日		
受益証券 1 口当たり分配金90円	2012年 6 月 6 日	700,363,080
受益証券 1 口当たり分配金90円	2012年 7 月 3 日	672,773,580
受益証券 1 口当たり分配金90円	2012年 8 月 3 日	695,323,440
受益証券 1 口当たり分配金90円	2012年 9 月 4 日	706,425,210
受益証券 1 口当たり分配金90円	2012年10月 3 日	708,391,620
受益証券 1 口当たり分配金90円	2012年11月 5 日	703,047,960
		4,186,324,890

	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
受益証券 1 口当たり分配金90円	2011年 7 月 5 日	587,970,000
受益証券 1 口当たり分配金90円	2011年 8 月 3 日	605,970,000
受益証券 1 口当たり分配金90円	2011年 9 月 6 日	605,970,000
受益証券 1 口当たり分配金90円	2011年10月 3 日	605,970,000
受益証券 1 口当たり分配金90円	2011年11月 4 日	686,144,970
		3,681,794,970

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・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。

(d) 費用の払戻し

当ファンドの営業費用を制限するため、受託会社報酬および管理事務代行会社報酬、保管受託銀行報酬、弁護士報酬および監査報酬の上限は、当ファンドの純資産額の0.15%と定められている。

以下の表は当期間の関連当事者との取引の詳細である。

	費用		債務	
	2012年11月30日現在 日本円	2011年11月30日現在 日本円	2012年11月30日現在 日本円	2012年5月31日現在 日本円
(a) 運用報酬	89,902,867	88,326,280	45,718,742	32,011,098
(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	23,246,168	23,048,823	11,529,975	8,013,681
(c) 保管受託銀行報酬	10,924,322	6,542,966	4,286,100	2,860,595
費用合計	124,073,357	117,918,069	61,534,817	42,885,374
			債権	
(d) 費用の払戻し	(3,497,455)	-	3,497,455	206,405

「海外国債マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

	[平成24年10月22日現在]	[平成25年4月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	-	2,019,674
コール・ローン	1,745,761,348	931,298,942
国債証券	64,962,205,320	73,776,514,685
未収利息	691,233,418	710,783,152
前払費用	66,979,231	111,523,925
流動資産合計	67,466,179,317	75,532,140,378
資産合計	67,466,179,317	75,532,140,378
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	3,300,000
流動負債合計	-	3,300,000
負債合計	-	3,300,000
純資産の部		
元本等		
元本	44,786,498,722	39,142,475,199
剰余金		

剰余金又は欠損金（ ）	22,679,680,595	36,386,365,179
元本等合計	67,466,179,317	75,528,840,378
純資産合計	67,466,179,317	75,528,840,378
負債純資産合計	67,466,179,317	75,532,140,378

(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24年10月23日 至 平成25年 4月22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。

(貸借対照表に関する注記)

[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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 44,786,498,722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 39,142,475,199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 1.5064円 (1万口当たり純資産額) (15,064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 1.9296円 (1万口当たり純資産額) (19,296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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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	<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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	51,647,186,694円	44,786,498,722円
同期中における追加設定元本額	409,833円	54,352,232円
同期中における一部解約元本額	6,861,097,805円	5,698,375,755円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	30,473,504,531円	25,931,315,600円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	3,052,512,115円	2,618,343,011円
新光7資産バランスファンド	691,669,548円	669,198,900円
海外国債ファンド（1年決算型）	296,768,311円	21,408,166円
海外国債ファンド（変額年金）	10,272,044,217円	9,902,209,522円

合 計	44,786,498,722円	39,142,475,199円
-----	-----------------	-----------------

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	2,106,307,741	1,118,478,700
合 計	2,106,307,741	1,118,478,700

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

種 類	[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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 1.875% 2014/2/28	19,200,000.00	19,485,000.00	
		US TREASURY N/B 3.5% 2020/5/15	15,700,000.00	18,234,078.10	
		US TREASURY N/B 8.75% 2020/8/15	2,400,000.00	3,685,687.49	
		US TREASURY N/B 2.625% 2020/8/15	19,300,000.00	21,245,078.11	
		US TREASURY N/B 2.625% 2020/11/15	27,900,000.00	30,696,539.17	
		US TREASURY N/B 3.625% 2021/2/15	22,500,000.00	26,439,257.89	
		US TREASURY N/B 3.125% 2021/5/15	16,700,000.00	18,981,898.49	
		US TREASURY N/B 2.125% 2021/8/15	21,600,000.00	22,820,062.57	
		US TREASURY N/B 8% 2021/11/15	4,400,000.00	6,757,093.76	
		US TREASURY N/B 2% 2021/11/15	20,600,000.00	21,498,031.23	
		US TREASURY N/B 2% 2022/2/15	17,700,000.00	18,414,914.13	
		US TREASURY N/B 1.75% 2022/5/15	18,000,000.00	18,282,656.33	
		US TREASURY N/B 7.25% 2022/8/15	2,700,000.00	4,048,101.56	
		US TREASURY N/B 1.625% 2022/8/15	25,400,000.00	25,421,828.24	
		US TREASURY N/B 1.625% 2022/11/15	31,000,000.00	30,874,062.50	
US TREASURY N/B 7.125% 2023/2/15	2,900,000.00	4,359,968.75			
US TREASURY N/B 2% 2023/2/15	21,500,000.00	22,071,093.75			
米 ド ル 建 小 計			米ドル 289,500,000.00	米ドル 313,315,352.07 (31,253,206,368円)	
カナダドル	国債証券		カナダドル	カナダドル	
		CANADIAN GOVERNMENT 3.5% 2020/6/1	8,400,000.00	9,580,368.00	
		CANADIAN GOVERNMENT 3.25% 2021/6/1	7,400,000.00	8,387,160.00	
		CANADIAN GOVERNMENT 2.75% 2022/6/1	8,200,000.00	8,999,664.00	

カナダドル建小計	カナダドル 24,000,000.00	カナダドル 26,967,192.00 (2,622,020,078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% 2020/7/4	13,400,000.00	15,570,800.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25% 2020/9/4	9,800,000.00	10,864,280.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.5% 2021/1/4	11,600,000.00	13,070,880.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 3.25% 2021/7/4	11,600,000.00	13,743,680.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.25% 2021/9/4	9,800,000.00	10,825,080.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2% 2022/1/4	12,200,000.00	13,178,440.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.75% 2022/7/4	14,600,000.00	15,386,940.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5% 2022/9/4	11,000,000.00	11,314,600.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1.5% 2023/2/15	8,500,000.00	8,698,900.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4% 2020/9/1	6,100,000.00	6,270,190.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75% 2021/3/1	5,900,000.00	5,943,070.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 3.75% 2021/8/1	6,900,000.00	6,964,170.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 4.75% 2021/9/1	6,100,000.00	6,509,310.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5% 2022/3/1	4,500,000.00	4,845,600.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5% 2022/9/1	4,800,000.00	5,300,160.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES 5.5% 2022/11/1	5,200,000.00	5,736,120.00	
		FRANCE (GOVT OF) 3.5% 2020/4/25	16,800,000.00	19,464,480.00	
		FRANCE (GOVT OF) 2.5% 2020/10/25	17,600,000.00	19,148,800.00	
		FRANCE (GOVT OF) 3.75% 2021/4/25	16,800,000.00	19,787,040.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25% 2021/10/25	15,800,000.00	17,975,660.00			
FRANCE (GOVT OF) 3% 2022/4/25	17,600,000.00	19,497,280.00			
FRANCE (GOVT OF) 2.25% 2022/10/25	11,200,000.00	11,636,800.00			
ユーロ建小計			ユーロ 237,800,000.00	ユーロ 261,732,280.00 (34,095,864,115円)	
英ポンド	国債証券		英ポンド	英ポンド	
		TSY 1.75% 2022/9/7	8,200,000.00	8,263,960.00	
		TSY 3.75% 2020/9/7	7,200,000.00	8,485,200.00	
		TSY 3.75% 2021/9/7	7,600,000.00	8,995,208.00	
		TSY 4% 2022/3/7	5,000,000.00	6,034,200.00	
TSY 8% 2021/6/7	4,300,000.00	6,505,685.00			
英ポンド建小計			英ポンド 32,300,000.00	英ポンド 38,284,253.00 (5,805,424,124円)	
合計			-	円 73,776,514,685 (73,776,514,685)	

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 17銘柄	41.4%	42.4%
カナダドル	債券 3銘柄	3.5%	3.6%
ユーロ	債券 22銘柄	45.1%	46.2%
英ポンド	債券 5銘柄	7.7%	7.9%

（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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22日現在]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	503,118,955	594,169,270
株式	12,636,011,345	15,567,672,660
派生商品評価勘定	15,746,901	67,116,487
未収配当金	130,257,645	135,202,352
未収利息	824	770
流動資産合計	13,285,135,670	16,364,161,539
資産合計	13,285,135,670	16,364,161,539
負債の部		
流動負債		
前受金	13,785,000	57,650,000
未払解約金	-	10,000,000
流動負債合計	13,785,000	67,650,000
負債合計	13,785,000	67,650,000
純資産の部		
元本等		
元本	15,080,298,980	12,075,546,870
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,808,948,310	4,220,964,669
元本等合計	13,271,350,670	16,296,511,539
純資産合計	13,271,350,670	16,296,511,539
負債純資産合計	13,285,135,670	16,364,161,539

（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24年10月23日 至平成25年 4月22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。

(貸借対照表に関する注記)

[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22日現在]
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 100,114,600円	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 148,712,100円
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 15,080,298,980口	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 12,075,546,870口
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 1,808,948,310円	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
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 0.8800円 (1万口当たり純資産額) (8,800円)	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 1.3495円 (1万口当たり純資産額) (13,495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24年 4月21日 至平成24年10月22日	自平成24年10月23日 至平成25年 4月22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、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。 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。	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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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24年 4月21日 至平成24年10月22日	自平成24年10月23日 至平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	14,658,360,151円	15,080,298,980円
同期中における追加設定元本額	834,256,921円	78,625,564円
同期中における一部解約元本額	412,318,092円	3,083,377,674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	595,319,368円	566,705,197円
新光7資産バランスファンド	1,233,217,292円	1,067,904,948円

ニュー トピックス インデックス（変額年金）	1,424,925,017円	1,261,343,930円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	3,381,866,771円	2,620,765,860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）	3,937,801,305円	3,020,713,650円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	468,599,365円	240,105,118円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	2,990,785,098円	2,459,064,087円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,047,784,764円	838,944,080円
合 計	15,080,298,980円	12,075,546,870円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	319,114,447	3,335,631,564
合 計	319,114,447	3,335,631,564

（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24年10月22日現在]				[平成25年 4月22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	610,488,099	-	626,235,000	15,746,901	644,023,513	-	711,140,000	67,116,487
TOPIX先物	610,488,099	-	626,235,000	15,746,901	644,023,513	-	711,140,000	67,116,487
合 計	610,488,099	-	626,235,000	15,746,901	644,023,513	-	711,140,000	67,116,487

（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	3,000	250	750,000
日本水産	11,900	192	2,284,800
マルハニチロホールディングス	21,000	193	4,053,000
サカタのタネ	1,600	1,256	2,009,600
ホクト	1,100	1,830	2,013,000
日鉄鉱業	5,000	478	2,390,000
三井松島産業	8,000	179	1,432,000
国際石油開発帝石	134	477,000	63,918,000
石油資源開発	1,600	3,605	5,768,000
ショーボンドホールディングス	1,000	3,620	3,620,000
ミライト・ホールディングス	3,100	941	2,917,100
安藤・間	5,700	229	1,305,300
東急建設	6,640	249	1,653,360
コムシスホールディングス	5,300	1,201	6,365,300
ミサワホーム	1,300	1,822	2,368,600
高松コンストラクショングループ	1,000	1,441	1,441,000
東建コーポレーション	410	6,600	2,706,000
大成建設	56,000	316	17,696,000
大林組	33,000	603	19,899,000
清水建設	34,000	377	12,818,000
飛鳥建設	10,000	136	1,360,000
長谷工コーポレーション	69,000	159	10,971,000
松井建設	5,000	356	1,780,000
鹿島建設	48,000	307	14,736,000
不動テトラ	7,300	192	1,401,600
鉄建建設	10,000	138	1,380,000
太平工業	4,000	359	1,436,000
西松建設	14,000	173	2,422,000
三井住友建設	13,800	108	1,490,400
前田建設工業	7,000	435	3,045,000
奥村組	10,000	382	3,820,000
東鉄工業	1,400	1,582	2,214,800
戸田建設	13,000	258	3,354,000
熊谷組	10,000	111	1,110,000
北野建設	4,000	212	848,000
三井ホーム	1,000	559	559,000
矢作建設工業	1,100	413	454,300
大東建託	4,200	8,720	36,624,000
N I P P O	3,000	1,336	4,008,000
東亜道路工業	3,000	485	1,455,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
前田道路	3,000	1,408	4,224,000	
日本道路	4,000	512	2,048,000	
東亜建設工業	10,000	150	1,500,000	
若築建設	9,000	114	1,026,000	
東洋建設	3,900	294	1,146,600	
五洋建設	13,000	241	3,133,000	
福田組	1,000	386	386,000	
住友林業	7,600	1,109	8,428,400	

日成ビルド工業	6,000	206	1,236,000	
エス・バイ・エル	10,000	184	1,840,000	
パナホーム	4,000	697	2,788,000	
大和ハウス工業	27,000	2,123	57,321,000	
ライト工業	2,700	502	1,355,400	
積水ハウス	33,000	1,474	48,642,000	
西部電気工業	3,000	415	1,245,000	
中電工	1,600	975	1,560,000	
関電工	5,000	425	2,125,000	
きんでん	7,000	682	4,774,000	
東京エネシス	1,000	468	468,000	
住友電設	1,100	1,350	1,485,000	
日本電設工業	2,000	1,032	2,064,000	
協和エクシオ	4,000	1,060	4,240,000	
九電工	4,000	425	1,700,000	
三機工業	5,000	537	2,685,000	
日揮	11,000	2,630	28,930,000	
中外炉工業	7,000	253	1,771,000	
ヤマト	1,000	368	368,000	
太平電業	1,000	591	591,000	
高砂熱学工業	3,100	738	2,287,800	
大気社	1,600	2,097	3,355,200	
ダイダン	3,000	503	1,509,000	
日比谷総合設備	1,100	954	1,049,400	
東芝プラントシステム	2,000	1,283	2,566,000	
東洋エンジニアリング	6,000	459	2,754,000	
千代田化工建設	8,000	991	7,928,000	
新興プランテック	2,300	725	1,667,500	
日本製粉	7,000	443	3,101,000	
日清製粉グループ本社	10,000	1,236	12,360,000	
日東富士製粉	5,000	316	1,580,000	
昭和産業	5,000	318	1,590,000	
鳥越製粉	1,400	635	889,000	
協同飼料	5,000	115	575,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本甜菜製糖	10,000	182	1,820,000	
三井製糖	5,000	295	1,475,000	
森永製菓	11,000	202	2,222,000	
中村屋	7,000	430	3,010,000	
江崎グリコ	4,000	1,117	4,468,000	
不二家	8,000	203	1,624,000	
山崎製パン	8,000	1,221	9,768,000	
モロゾフ	8,000	305	2,440,000	
亀田製菓	600	2,547	1,528,200	
カルビー	1,000	9,150	9,150,000	
森永乳業	9,000	284	2,556,000	
ヤクルト本社	6,400	4,445	28,448,000	
明治ホールディングス	3,300	4,240	13,992,000	
雪印メグミルク	2,200	1,476	3,247,200	

プリマハム	8,000	241	1,928,000
日本ハム	8,000	1,399	11,192,000
伊藤ハム	6,000	429	2,574,000
丸大食品	5,000	314	1,570,000
サッポロホールディングス	18,000	423	7,614,000
アサヒグループホールディングス	22,200	2,333	51,792,600
キリンホールディングス	47,000	1,612	75,764,000
宝ホールディングス	9,000	783	7,047,000
オエノンホールディングス	8,000	275	2,200,000
コカ・コーラウエスト	3,700	1,666	6,164,200
コカ・コーラ セントラル ジャパン	1,400	1,340	1,876,000
ダイドードリンコ	600	4,290	2,574,000
伊藤園	3,000	2,489	7,467,000
キーコーヒー	1,000	1,525	1,525,000
ジャパンフーズ	500	1,089	544,500
日清オイリオグループ	5,000	331	1,655,000
不二製油	2,700	1,519	4,101,300
J - オイルミルズ	2,000	297	594,000
キッコーマン	9,000	1,819	16,371,000
味の素	29,000	1,331	38,599,000
キューピー	5,600	1,432	8,019,200
ハウス食品	3,900	1,692	6,598,800
カゴメ	4,000	1,826	7,304,000
焼津水産化学工業	1,300	868	1,128,400
アリアケジャパン	1,000	2,235	2,235,000
ニチレイ	12,000	569	6,828,000
東洋水産	5,000	3,230	16,150,000
日清食品ホールディングス	4,300	4,555	19,586,500

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
フジッコ	1,000	1,111	1,111,000	
ロック・フィールド	1,000	2,007	2,007,000	
日本たばこ産業	61,200	3,395	207,774,000	
わらべや日洋	1,000	1,630	1,630,000	
ミヨシ油脂	5,000	156	780,000	
片倉工業	1,200	1,636	1,963,200	
ゲンゼ	8,000	254	2,032,000	
東洋紡	44,000	168	7,392,000	
ユニチカ	28,000	60	1,680,000	
富士紡ホールディングス	5,000	273	1,365,000	
日清紡ホールディングス	7,000	664	4,648,000	
倉敷紡績	11,000	185	2,035,000	
シキボウ	10,000	145	1,450,000	
日本毛織	3,000	727	2,181,000	
トーア紡コーポレーション	5,000	74	370,000	
ダイドーリミテッド	2,600	667	1,734,200	
帝国繊維	3,000	897	2,691,000	
帝人	39,000	216	8,424,000	
東レ	80,000	671	53,680,000	
サカイオーベックス	3,000	149	447,000	

アツギ	15,000	116	1,740,000
ダイニック	4,000	183	732,000
セーレン	2,800	628	1,758,400
小松精練	4,000	481	1,924,000
ワコールホールディングス	6,000	1,016	6,096,000
ホギメディカル	600	5,790	3,474,000
T S Iホールディングス	5,300	709	3,757,700
三陽商会	5,000	310	1,550,000
オンワードホールディングス	7,000	969	6,783,000
ルック	3,000	408	1,224,000
ゴールドウイン	3,000	587	1,761,000
デサント	3,000	647	1,941,000
ヤマトインターナショナル	2,600	425	1,105,000
特種東海製紙	7,000	211	1,477,000
王子ホールディングス	46,000	320	14,720,000
日本製紙	5,000	1,228	6,140,000
三菱製紙	12,000	91	1,092,000
北越紀州製紙	6,500	414	2,691,000
中越パルプ工業	3,000	149	447,000
大王製紙	4,000	546	2,184,000
レンゴー	8,000	461	3,688,000
トモク	2,000	306	612,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ザ・バック	1,000	1,964	1,964,000	
クラレ	17,500	1,399	24,482,500	
旭化成	64,000	651	41,664,000	
昭和電工	64,000	153	9,792,000	
住友化学	71,000	286	20,306,000	
住友精化	1,000	357	357,000	
日産化学工業	7,100	1,188	8,434,800	
クレハ	7,000	344	2,408,000	
テイカ	3,000	291	873,000	
石原産業	18,000	85	1,530,000	
日本曹達	6,000	424	2,544,000	
東ソー	28,000	261	7,308,000	
トクヤマ	15,000	241	3,615,000	
セントラル硝子	9,000	327	2,943,000	
東亜合成	12,000	414	4,968,000	
ダイソー	9,000	283	2,547,000	
関東電化工業	2,000	232	464,000	
電気化学工業	21,000	329	6,909,000	
信越化学工業	18,500	6,600	122,100,000	
日本カーバイド工業	3,000	463	1,389,000	
堺化学工業	7,000	295	2,065,000	
エア・ウォーター	8,000	1,485	11,880,000	
大陽日酸	14,000	648	9,072,000	
日本パーカライジング	2,000	1,887	3,774,000	
四国化成工業	3,000	674	2,022,000	
戸田工業	1,000	317	317,000	

ステラ ケミファ	900	1,742	1,567,800
日本触媒	7,000	861	6,027,000
大日精化工業	4,000	448	1,792,000
カネカ	13,000	546	7,098,000
三菱瓦斯化学	16,000	671	10,736,000
三井化学	44,000	196	8,624,000
J S R	9,400	2,024	19,025,600
東京応化工業	2,000	1,989	3,978,000
三菱ケミカルホールディングス	64,500	450	29,025,000
日本合成化学工業	2,000	909	1,818,000
ダイセル	12,000	809	9,708,000
住友ベークライト	8,000	377	3,016,000
積水化学工業	21,000	1,151	24,171,000
日本ゼオン	9,000	972	8,748,000
アイカ工業	2,900	1,872	5,428,800
宇部興産	49,000	182	8,918,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
積水樹脂	1,000	1,411	1,411,000	
タキロン	6,000	354	2,124,000	
旭有機材工業	3,000	211	633,000	
日立化成	4,500	1,533	6,898,500	
ニチバン	2,000	429	858,000	
大倉工業	6,000	406	2,436,000	
積水化成品工業	1,000	243	243,000	
日本カーリット	1,700	723	1,229,100	
日本化薬	7,000	1,376	9,632,000	
A D E K A	4,400	784	3,449,600	
日油	8,000	481	3,848,000	
花王	27,300	3,315	90,499,500	
第一工業製薬	2,000	248	496,000	
三洋化成工業	3,000	530	1,590,000	
大日本塗料	10,000	176	1,760,000	
日本ペイント	9,000	1,077	9,693,000	
関西ペイント	12,000	1,216	14,592,000	
中国塗料	3,000	470	1,410,000	
藤倉化成	1,400	392	548,800	
太陽ホールディングス	800	3,010	2,408,000	
D I C	37,000	208	7,696,000	
サカタインクス	4,000	676	2,704,000	
東洋インキ S C ホールディングス	9,000	441	3,969,000	
富士フイルムホールディングス	22,000	2,050	45,100,000	
資生堂	18,300	1,500	27,450,000	
ライオン	12,000	557	6,684,000	
高砂香料工業	3,000	522	1,566,000	
マンダム	1,100	3,585	3,943,500	
ミルボン	500	3,705	1,852,500	
ファンケル	2,600	1,040	2,704,000	
コーセー	1,900	2,609	4,957,100	
ドクターシーラボ	7	287,500	2,012,500	

ポーラ・オルビスホールディングス	1,200	3,420	4,104,000
エステー	1,000	1,000	1,000,000
コニシ	1,000	1,660	1,660,000
長谷川香料	1,300	1,465	1,904,500
小林製薬	1,600	5,320	8,512,000
荒川化学工業	600	792	475,200
日本高純度化学	10	226,700	2,267,000
JCU	400	4,890	1,956,000
アース製薬	700	3,385	2,369,500
イハラケミカル工業	4,000	637	2,548,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大成ラミック	1,000	2,439	2,439,000	
クミアイ化学工業	3,000	634	1,902,000	
日本農薬	2,000	835	1,670,000	
アキレス	13,000	140	1,820,000	
有沢製作所	1,100	358	393,800	
日東電工	8,500	6,440	54,740,000	
レック	300	1,273	381,900	
きもと	800	786	628,800	
藤森工業	900	2,758	2,482,200	
前澤化成工業	1,300	1,074	1,396,200	
JSP	300	1,387	416,100	
エフピコ	500	6,500	3,250,000	
天馬	400	1,266	506,400	
信越ポリマー	1,700	354	601,800	
東リ	8,000	218	1,744,000	
ニフコ	2,300	2,246	5,165,800	
日本バルカー工業	9,000	242	2,178,000	
ユニ・チャーム	5,700	6,100	34,770,000	
協和発酵キリン	12,000	1,197	14,364,000	
武田薬品工業	38,600	5,260	203,036,000	(注)
アステラス製薬	22,900	5,590	128,011,000	
大日本住友製薬	7,300	1,732	12,643,600	
塩野義製薬	15,000	2,321	34,815,000	
田辺三菱製薬	8,600	1,461	12,564,600	
あすか製薬	1,000	705	705,000	
日本新薬	2,000	1,396	2,792,000	
中外製薬	12,000	2,447	29,364,000	
科研製薬	4,000	1,697	6,788,000	
エーザイ	12,700	4,405	55,943,500	
ロート製薬	4,000	1,363	5,452,000	
小野薬品工業	5,000	6,250	31,250,000	
久光製薬	3,200	5,500	17,600,000	
持田製薬	4,000	1,268	5,072,000	
参天製薬	3,500	4,545	15,907,500	
扶桑薬品工業	7,000	405	2,835,000	
日本ケミファ	3,000	606	1,818,000	
ツムラ	2,800	3,145	8,806,000	
日医工	1,500	2,243	3,364,500	

キッセイ薬品工業	1,900	2,025	3,847,500	
生化学工業	2,000	1,154	2,308,000	
栄研化学	1,100	1,575	1,732,500	
鳥居薬品	700	2,332	1,632,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東和薬品	500	4,780	2,390,000	
沢井製薬	700	12,120	8,484,000	
ゼリア新薬工業	1,000	1,517	1,517,000	
第一三共	32,500	1,863	60,547,500	
キョーリン製薬ホールディングス	2,700	2,558	6,906,600	
大幸薬品	400	1,611	644,400	
大塚ホールディングス	20,400	3,475	70,890,000	
大正製薬ホールディングス	2,500	7,120	17,800,000	
日本コークス工業	13,500	122	1,647,000	
昭和シェル石油	9,200	759	6,982,800	
コスモ石油	28,000	209	5,852,000	
ニチレキ	4,000	708	2,832,000	
東燃ゼネラル石油	16,000	941	15,056,000	
ユシロ化学工業	1,000	944	944,000	
AOCホールディングス	3,000	343	1,029,000	
出光興産	1,200	7,870	9,444,000	
JXホールディングス	114,300	502	57,378,600	
横浜ゴム	12,000	1,269	15,228,000	
東洋ゴム工業	9,000	510	4,590,000	
ブリヂストン	32,300	3,705	119,671,500	
住友ゴム工業	8,000	1,821	14,568,000	
オカモト	3,000	320	960,000	
ニッタ	1,000	2,039	2,039,000	
東海ゴム工業	1,900	1,091	2,072,900	
三ツ星ベルト	3,000	513	1,539,000	
バンドー化学	7,000	301	2,107,000	
日東紡績	8,000	347	2,776,000	
旭硝子	51,000	725	36,975,000	
日本板硝子	47,000	115	5,405,000	
日本山村硝子	10,000	188	1,880,000	
日本電気硝子	18,000	469	8,442,000	
住友大阪セメント	18,000	277	4,986,000	
太平洋セメント	57,000	245	13,965,000	
日本コンクリート工業	2,000	311	622,000	
東海カーボン	9,000	329	2,961,000	
日本カーボン	10,000	228	2,280,000	
東洋炭素	800	2,156	1,724,800	
ノリタケカンパニーリミテド	10,000	245	2,450,000	
TOTO	16,000	908	14,528,000	
日本碍子	13,000	1,128	14,664,000	
日本特殊陶業	9,000	1,602	14,418,000	
MARUWA	100	2,863	286,300	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
黒崎播磨	2,000	219	438,000	
フジインコーポレーテッド	1,000	1,286	1,286,000	
ニチアス	5,000	557	2,785,000	
ニチハ	1,100	1,557	1,712,700	
新日鐵住金	435,000	248	107,880,000	
神戸製鋼所	143,000	116	16,588,000	
合同製鐵	10,000	151	1,510,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	26,300	1,955	51,416,500	
日新製鋼ホールディングス	4,400	786	3,458,400	
東京製鐵	5,700	403	2,297,100	
共英製鋼	1,000	1,783	1,783,000	
大和工業	2,100	3,185	6,688,500	
東京鐵鋼	3,000	362	1,086,000	
大阪製鐵	300	1,637	491,100	
淀川製鋼所	7,000	364	2,548,000	
東洋鋼鈹	1,000	304	304,000	
丸一鋼管	3,400	2,267	7,707,800	
大同特殊鋼	16,000	534	8,544,000	
日本冶金工業	11,500	124	1,426,000	
山陽特殊製鋼	5,000	348	1,740,000	
愛知製鋼	5,000	381	1,905,000	
日立金属	7,000	960	6,720,000	
大平洋金属	7,000	493	3,451,000	
日本電工	7,000	309	2,163,000	
栗本鐵工所	5,000	312	1,560,000	
三菱製鋼	10,000	198	1,980,000	
日本輕金属ホールディングス	21,600	115	2,484,000	
三井金属鉱業	26,000	219	5,694,000	
東邦亜鉛	6,000	357	2,142,000	
三菱マテリアル	60,000	271	16,260,000	
住友金属鉱山	27,000	1,300	35,100,000	
DOWAホールディングス	11,000	705	7,755,000	
古河機械金属	17,000	119	2,023,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,000	1,848	1,848,000	
東邦チタニウム	1,500	773	1,159,500	
住友輕金属工業	25,000	101	2,525,000	
古河スカイ	7,000	300	2,100,000	
古河電気工業	32,000	240	7,680,000	
住友電気工業	36,400	1,306	47,538,400	
フジクラ	17,000	336	5,712,000	
昭和電線ホールディングス	19,000	92	1,748,000	
タツタ電線	1,400	681	953,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日立電線	10,000	163	1,630,000	
リョービ	6,000	231	1,386,000	
アサヒホールディングス	1,600	1,922	3,075,200	
宮地エンジニアリンググループ	7,000	165	1,155,000	

トーカロ	1,000	1,436	1,436,000
SUMCO	6,300	1,030	6,489,000
東洋製罐グループホールディングス	7,300	1,306	9,533,800
横河ブリッジホールディングス	2,000	929	1,858,000
駒井ハルテック	1,000	245	245,000
三和ホールディングス	9,000	605	5,445,000
文化シャッター	5,000	543	2,715,000
三協立山	1,300	2,699	3,508,700
LIXILグループ	14,300	2,130	30,459,000
ノーリツ	2,000	1,960	3,920,000
長府製作所	1,000	2,338	2,338,000
リンナイ	1,700	7,250	12,325,000
岡部	2,000	954	1,908,000
東プレ	2,000	973	1,946,000
高周波熱錬	2,000	757	1,514,000
東京製綱	10,000	123	1,230,000
パイオラックス	900	2,482	2,233,800
日本発條	7,500	1,063	7,972,500
日本製鋼所	16,000	491	7,856,000
三浦工業	1,500	2,389	3,583,500
タクマ	3,000	575	1,725,000
ツガミ	3,000	510	1,530,000
オークマ	7,000	778	5,446,000
東芝機械	5,000	533	2,665,000
アマダ	16,000	737	11,792,000
アイダエンジニアリング	2,400	788	1,891,200
牧野フライス製作所	5,000	618	3,090,000
オーエスジー	4,200	1,440	6,048,000
旭ダイヤモンド工業	2,500	962	2,405,000
森精機製作所	5,400	1,111	5,999,400
ディスコ	1,100	5,870	6,457,000
日東工器	600	1,844	1,106,400
豊和工業	8,000	129	1,032,000
大阪機工	4,000	195	780,000
島精機製作所	1,300	2,145	2,788,500
日阪製作所	2,000	878	1,756,000
やまびこ	300	2,586	775,800
ナブテスコ	5,100	2,046	10,434,600

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
三井海洋開発	900	2,659	2,393,100	
S M C	3,100	19,260	59,706,000	
ホソカワミクロン	4,000	800	3,200,000	
ユニオンツール	300	2,152	645,600	
オイレス工業	1,100	1,864	2,050,400	
サトーホールディングス	1,100	1,927	2,119,700	
小松製作所	48,000	2,508	120,384,000	
住友重機械工業	28,000	414	11,592,000	
日立建機	5,300	2,167	11,485,100	
井関農機	10,000	348	3,480,000	

丸山製作所	2,000	292	584,000
北川鉄工所	10,000	169	1,690,000
クボタ	55,000	1,445	79,475,000
月島機械	2,000	910	1,820,000
新東工業	2,100	862	1,810,200
アイチ コーポレーション	800	448	358,400
小森コーポレーション	2,500	1,155	2,887,500
住友精密工業	3,000	421	1,263,000
酒井重工業	2,000	297	594,000
荏原製作所	20,000	424	8,480,000
西島製作所	1,400	782	1,094,800
ダイキン工業	13,400	3,915	52,461,000
オルガノ	4,000	547	2,188,000
トーヨーカネツ	6,000	329	1,974,000
栗田工業	5,700	2,003	11,417,100
椿本チエイン	5,000	509	2,545,000
大同工業	2,000	159	318,000
アネスト岩田	3,000	410	1,230,000
ダイフク	4,500	821	3,694,500
加藤製作所	5,000	328	1,640,000
タダノ	5,000	1,034	5,170,000
フジテック	3,000	995	2,985,000
C K D	2,800	697	1,951,600
キトー	400	1,092	436,800
平和	2,100	1,866	3,918,600
理想科学工業	800	1,880	1,504,000
S A N K Y O	3,000	4,430	13,290,000
日本金銭機械	1,200	1,218	1,461,600
マースエンジニアリング	900	1,950	1,755,000
ダイコク電機	700	2,268	1,587,600
アマノ	3,000	1,008	3,024,000
J U K I	10,000	161	1,610,000

銘 柄	株 式 数	評 価 額		備 考
		単価(円)	金額(円)	
サンデン	6,000	406	2,436,000	
蛇の目ミシン工業	14,000	83	1,162,000	
マックス	2,000	1,152	2,304,000	
グローリー	2,900	2,318	6,722,200	
大和冷機工業	1,000	576	576,000	
セガサミーホールディングス	10,600	2,477	26,256,200	
日本ピストンリング	10,000	189	1,890,000	
リケン	7,000	390	2,730,000	
T P R	1,100	1,706	1,876,600	
ホシザキ電機	2,100	3,110	6,531,000	
大豊工業	700	1,376	963,200	
日本精工	22,000	768	16,896,000	
N T N	21,000	244	5,124,000	
ジェイテクト	10,500	946	9,933,000	
不二越	9,000	429	3,861,000	
日本トムソン	3,000	466	1,398,000	

THK	6,500	2,041	13,266,500
ユーシン精機	700	1,823	1,276,100
前澤給装工業	400	1,266	506,400
イーグル工業	2,000	893	1,786,000
日本ピラー工業	2,000	794	1,588,000
キッツ	4,000	555	2,220,000
日立工機	2,600	802	2,085,200
マキタ	6,000	4,820	28,920,000
日立造船	39,000	160	6,240,000
三菱重工業	165,000	667	110,055,000
IHI	67,000	358	23,986,000
イビデン	6,000	1,582	9,492,000
コニカミノルタ	26,000	716	18,616,000
ブラザー工業	12,700	1,099	13,957,300
ミネベア	13,000	305	3,965,000
日立製作所	236,000	613	144,668,000
東芝	194,000	535	103,790,000
三菱電機	98,000	901	88,298,000
富士電機	30,000	336	10,080,000
東洋電機製造	1,000	351	351,000
安川電機	11,000	1,107	12,177,000
シンフォニアテクノロジー	10,000	165	1,650,000
明電舎	10,000	283	2,830,000
オリジン電気	3,000	381	1,143,000
デンヨー	1,100	1,405	1,545,500
東芝テック	6,000	639	3,834,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
マブチモーター	1,400	5,200	7,280,000	
日本電産	5,300	5,950	31,535,000	
東光高岳ホールディングス	1,000	1,352	1,352,000	
ダイヘン	6,000	285	1,710,000	
JVCケンウッド	5,500	252	1,386,000	
日新電機	3,000	455	1,365,000	
大崎電気工業	3,000	479	1,437,000	
オムロン	10,400	2,677	27,840,800	
日東工業	1,400	1,400	1,960,000	
IDEC	1,900	861	1,635,900	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	19,000	415	7,885,000	
メルコホールディングス	1,000	1,577	1,577,000	
日本電気	127,000	264	33,528,000	
富士通	95,000	420	39,900,000	
沖電気工業	36,000	156	5,616,000	
電気興業	5,000	450	2,250,000	
サンケン電気	5,000	430	2,150,000	
アイホン	600	1,611	966,600	
ルネサスエレクトロニクス	2,300	271	623,300	
セイコーエプソン	6,700	1,042	6,981,400	
ワコム	18	423,500	7,623,000	
アルバック	1,500	777	1,165,500	

アクセル	1,000	2,150	2,150,000	
E I Z O	1,000	1,694	1,694,000	
日本信号	2,500	772	1,930,000	
京三製作所	4,000	328	1,312,000	
パナソニック	112,400	713	80,141,200	(注)
シャープ	51,000	356	18,156,000	
アンリツ	5,000	1,427	7,135,000	
富士通ゼネラル	2,000	852	1,704,000	
日立国際電気	2,000	1,074	2,148,000	
ソニー	61,800	1,634	100,981,200	(注)
T D K	5,500	3,370	18,535,000	
帝国通信工業	3,000	191	573,000	
ミツミ電機	3,700	538	1,990,600	
タムラ製作所	8,000	195	1,560,000	
アルプス電気	7,200	744	5,356,800	
パイオニア	12,000	208	2,496,000	
日本電波工業	1,000	964	964,000	
ローランド ディー . ジー .	400	1,426	570,400	
フォスター電機	1,000	1,295	1,295,000	
クラリオン	9,000	134	1,206,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
S M K	7,000	298	2,086,000	
東光	8,000	286	2,288,000	
ホシデン	2,600	549	1,427,400	
ヒロセ電機	1,700	13,480	22,916,000	
日本航空電子工業	2,000	758	1,516,000	
T O A	1,000	778	778,000	
ユニデン	6,000	233	1,398,000	
アルパイン	1,900	1,031	1,958,900	
アイコム	1,000	2,500	2,500,000	
船井電機	1,000	1,184	1,184,000	
横河電機	9,800	958	9,388,400	
新電元工業	6,000	404	2,424,000	
アズビル	2,800	2,035	5,698,000	
日本光電工業	2,000	3,740	7,480,000	
チノー	3,000	217	651,000	
共和電業	3,000	309	927,000	
堀場製作所	1,900	3,370	6,403,000	
アドバンテスト	6,700	1,387	9,292,900	
小野測器	1,000	480	480,000	
エスペック	1,500	751	1,126,500	
キーエンス	2,400	29,940	71,856,000	
日置電機	1,000	1,535	1,535,000	
シスメックス	3,500	6,560	22,960,000	
メガチップス	1,000	1,462	1,462,000	
O B A R A G R O U P	1,000	1,996	1,996,000	
コーセル	1,400	1,114	1,559,600	
日立メディコ	1,000	1,655	1,655,000	
オプテックス	900	1,400	1,260,000	

スタンレー電気	7,700	1,792	13,798,400
岩崎電気	8,000	220	1,760,000
ウシオ電機	6,000	940	5,640,000
日本セラミック	900	1,580	1,422,000
日本電子	4,000	434	1,736,000
カシオ計算機	9,400	793	7,454,200
ファナック	10,200	15,170	154,734,000
日本シイエムケイ	2,800	327	915,600
エンプラス	400	5,730	2,292,000
ローム	5,200	3,450	17,940,000
浜松ホトニクス	3,800	3,955	15,029,000
三井ハイテック	1,700	705	1,198,500
新光電気工業	3,300	885	2,920,500
京セラ	8,200	9,340	76,588,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
太陽誘電	4,800	1,429	6,859,200	
村田製作所	10,300	7,850	80,855,000	
ユーシン	1,400	711	995,400	
双葉電子工業	1,800	1,189	2,140,200	
ニチコン	3,100	990	3,069,000	
日本ケミコン	6,000	346	2,076,000	
K O A	1,900	1,030	1,957,000	
小糸製作所	5,000	1,808	9,040,000	
ミツバ	2,000	1,160	2,320,000	
スター精密	1,700	984	1,672,800	
大日本スクリーン製造	10,000	475	4,750,000	
キャノン電子	900	2,015	1,813,500	
キャノン	61,100	3,780	230,958,000	(注)
リコー	30,000	1,229	36,870,000	
東京エレクトロン	8,300	4,680	38,844,000	
トヨタ紡織	3,400	1,405	4,777,000	
鬼怒川ゴム工業	3,000	492	1,476,000	
ユニプレス	1,700	2,031	3,452,700	
豊田自動織機	9,000	3,745	33,705,000	
モリタホールディングス	2,000	830	1,660,000	
三櫻工業	2,100	682	1,432,200	
デンソー	24,300	4,440	107,892,000	
東海理化電機製作所	2,300	1,768	4,066,400	
三井造船	38,000	191	7,258,000	
佐世保重工業	10,000	129	1,290,000	
川崎重工業	77,000	330	25,410,000	
日本車輛製造	4,000	435	1,740,000	
ニチユ三菱フォークリフト	1,000	393	393,000	
日産自動車	124,300	1,052	130,763,600	
いすゞ自動車	57,000	647	36,879,000	
トヨタ自動車	126,400	5,550	701,520,000	(注)
日野自動車	12,000	1,357	16,284,000	
三菱自動車工業	240,000	107	25,680,000	
武蔵精密工業	1,000	2,301	2,301,000	

日産車体	3,000	1,286	3,858,000
新明和工業	4,000	785	3,140,000
極東開発工業	1,800	994	1,789,200
日信工業	2,000	1,910	3,820,000
トピー工業	7,000	221	1,547,000
ティラド	7,000	285	1,995,000
曙ブレーキ工業	4,600	469	2,157,400
タチエス	1,300	1,742	2,264,600

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
NOK	4,800	1,435	6,888,000	
フタバ産業	3,400	442	1,502,800	
カヤバ工業	7,000	473	3,311,000	
大同メタル工業	2,000	740	1,480,000	
プレス工業	4,000	482	1,928,000	
カルソニックカンセイ	7,000	458	3,206,000	
太平洋工業	2,800	584	1,635,200	
ケーヒン	2,000	1,519	3,038,000	
アイシン精機	9,000	3,755	33,795,000	
マツダ	156,000	339	52,884,000	
ダイハツ工業	10,000	1,919	19,190,000	
今仙電機製作所	1,000	1,137	1,137,000	
本田技研工業	83,000	3,915	324,945,000	(注)
スズキ	20,600	2,344	48,286,400	
富士重工業	31,000	1,786	55,366,000	
ヤマハ発動機	15,000	1,380	20,700,000	
ショーワ	2,300	1,067	2,454,100	
エクセディ	1,300	2,199	2,858,700	
豊田合成	2,800	2,442	6,837,600	
ヨロズ	1,000	1,690	1,690,000	
エフ・シー・シー	1,600	2,377	3,803,200	
シマノ	4,000	8,310	33,240,000	
タカタ	1,800	1,758	3,164,400	
テイ・エス テック	2,100	2,740	5,754,000	
テルモ	7,500	4,610	34,575,000	
クリエートメディック	700	878	614,600	
日機装	3,000	1,342	4,026,000	
島津製作所	12,000	698	8,376,000	
長野計器	1,000	722	722,000	
バイ・テクノロジー	1	301,000	301,000	
東京精密	1,800	1,950	3,510,000	
マニー	400	3,305	1,322,000	
ニコン	18,400	2,203	40,535,200	
トプコン	2,000	1,052	2,104,000	
オリンパス	11,600	2,458	28,512,800	
タムロン	800	2,059	1,647,200	
HOYA	23,900	1,892	45,218,800	
シチズンホールディングス	11,100	580	6,438,000	
リズム時計工業	10,000	173	1,730,000	
セイコーホールディングス	6,000	606	3,636,000	

ニプロ	5,200	892	4,638,400	
パラマウントベッドホールディングス	800	3,855	3,084,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
バンダイナムコホールディングス	10,200	1,737	17,717,400	
フランスベッドホールディングス	9,000	216	1,944,000	
パイロットコーポレーション	9	326,500	2,938,500	
トッパン・フォームズ	1,700	873	1,484,100	
フジシールインターナショナル	1,200	2,650	3,180,000	
タカラトミー	3,200	477	1,526,400	
アーク	3,300	347	1,145,100	
ウッドワン	1,000	319	319,000	
大建工業	8,000	270	2,160,000	
凸版印刷	28,000	711	19,908,000	
大日本印刷	30,000	943	28,290,000	
共同印刷	6,000	379	2,274,000	
日本写真印刷	1,500	1,534	2,301,000	
光村印刷	2,000	269	538,000	
宝印刷	2,200	793	1,744,600	
アシックス	9,200	1,771	16,293,200	
ツツミ	200	2,885	577,000	
ローランド	1,000	894	894,000	
ヤマハ	7,200	982	7,070,400	
河合楽器製作所	7,000	177	1,239,000	
クリナップ	600	651	390,600	
ピジョン	700	8,300	5,810,000	
リンテック	2,100	1,747	3,668,700	
イトーキ	2,500	651	1,627,500	
任天堂	5,600	11,630	65,128,000	
三菱鉛筆	800	1,784	1,427,200	
タカラスタANDARD	5,000	758	3,790,000	
コクヨ	5,100	723	3,687,300	
グローブライド	9,000	127	1,143,000	
岡村製作所	4,000	759	3,036,000	
美津濃	5,000	412	2,060,000	
アデランス	1,200	1,643	1,971,600	
東京電力	83,400	458	38,197,200	
中部電力	30,100	1,325	39,882,500	
関西電力	40,100	1,216	48,761,600	
中国電力	13,600	1,420	19,312,000	
北陸電力	9,600	1,416	13,593,600	
東北電力	24,600	1,012	24,895,200	
四国電力	8,900	1,729	15,388,100	
九州電力	21,700	1,338	29,034,600	
北海道電力	9,200	1,238	11,389,600	
沖縄電力	600	3,620	2,172,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

電源開発	6,100	2,608	15,908,800	
東京瓦斯	118,000	542	63,956,000	
大阪瓦斯	95,000	416	39,520,000	
東邦瓦斯	25,000	593	14,825,000	
西部瓦斯	11,000	226	2,486,000	
静岡瓦斯	2,500	751	1,877,500	
東武鉄道	56,000	562	31,472,000	
相鉄ホールディングス	16,000	388	6,208,000	
東京急行電鉄	58,000	803	46,574,000	
京浜急行電鉄	25,000	1,096	27,400,000	
小田急電鉄	32,000	1,184	37,888,000	
京王電鉄	27,000	811	21,897,000	
京成電鉄	15,000	1,005	15,075,000	
富士急行	3,000	895	2,685,000	
東日本旅客鉄道	18,100	8,450	152,945,000	
西日本旅客鉄道	8,500	4,655	39,567,500	
東海旅客鉄道	8,200	11,690	95,858,000	
西日本鉄道	13,000	399	5,187,000	
ハマキョウレックス	700	3,330	2,331,000	
近畿日本鉄道	89,000	473	42,097,000	
阪急阪神ホールディングス	62,000	626	38,812,000	
南海電気鉄道	20,000	394	7,880,000	
京阪電気鉄道	22,000	417	9,174,000	
名糖運輸	1,000	640	640,000	
名古屋鉄道	34,000	299	10,166,000	
日本通運	39,000	526	20,514,000	
ヤマトホールディングス	18,600	1,866	34,707,600	
山九	12,000	458	5,496,000	
センコー	4,000	526	2,104,000	
日本梱包運輸倉庫	3,200	1,515	4,848,000	
日本石油輸送	10,000	233	2,330,000	
福山通運	6,000	544	3,264,000	
セイノーホールディングス	8,000	883	7,064,000	
神奈川中央交通	2,000	717	1,434,000	
日立物流	1,700	1,560	2,652,000	
日本郵船	78,000	250	19,500,000	
商船三井	48,000	367	17,616,000	
川崎汽船	43,000	222	9,546,000	
飯野海運	4,100	738	3,025,800	
第一中央汽船	8,000	130	1,040,000	
日本航空	8,300	4,350	36,105,000	
A N Aホールディングス	193,000	206	39,758,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日新	7,000	284	1,988,000	
三菱倉庫	7,000	1,741	12,187,000	
三井倉庫	5,000	651	3,255,000	
住友倉庫	7,000	693	4,851,000	
澁澤倉庫	4,000	591	2,364,000	
東陽倉庫	9,000	297	2,673,000	

日本トランスシティ	2,000	384	768,000
上組	11,000	901	9,911,000
サンリツ	1,000	620	620,000
キムラユニティー	800	950	760,000
近鉄エクスプレス	900	3,615	3,253,500
NEC ネットエスアイ	900	2,019	1,817,100
システナ	1,000	839	839,000
新日鉄住金ソリューションズ	400	1,966	786,400
コア	700	743	520,100
ITホールディングス	3,200	1,414	4,524,800
グリー	5,000	1,227	6,135,000
コーエーテクモホールディングス	1,900	850	1,615,000
三菱総合研究所	500	2,137	1,068,500
ネクソン	8,000	1,142	9,136,000
ドワンゴ	5	424,000	2,120,000
マクロミル	1,400	1,376	1,926,400
ティーガイア	1,000	1,054	1,054,000
ザッパラス	10	104,000	1,040,000
インターネットイニシアティブ	1,100	3,860	4,246,000
SRAホールディングス	500	1,103	551,500
朝日ネット	1,000	502	502,000
パナソニック インフォメーションシステム	300	2,295	688,500
野村総合研究所	5,500	2,802	15,411,000
フジ・メディア・ホールディングス	94	196,000	18,424,000
オービック	330	24,590	8,114,700
ヤフー	711	46,550	33,097,050
トレンドマイクロ	3,900	2,751	10,728,900
日本オラクル	1,900	4,090	7,771,000
フューチャーアーキテクト	10	46,100	461,000
オービックビジネスコンサルタント	300	5,770	1,731,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,100	4,525	4,977,500
アイティフォー	4,500	521	2,344,500
大塚商会	900	9,970	8,973,000
サイボウズ	10	25,620	256,200
ウェザーニューズ	100	2,363	236,300
C I J	4,700	422	1,983,400

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
WOWOW	2	260,000	520,000	
ネットワンシステムズ	3,500	828	2,898,000	
アルゴグラフィックス	300	1,446	433,800	
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,800	2,683	4,829,400	
日本ユニシス	2,700	828	2,235,600	
兼松エレクトロニクス	1,000	1,199	1,199,000	
東京放送ホールディングス	5,200	1,566	8,143,200	
日本テレビホールディングス	8,900	1,646	14,649,400	
テレビ朝日	2,500	1,968	4,920,000	
スカパーJSATホールディングス	84	47,750	4,011,000	
テレビ東京ホールディングス	400	1,144	457,600	
アイ・ティー・シーネットワーク	2,100	859	1,803,900	

NECモバイルリング	400	6,410	2,564,000	
日本電信電話	40,900	4,805	196,524,500	(注)
KDDI	27,400	4,400	120,560,000	
光通信	1,000	5,200	5,200,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	800	153,600	122,880,000	(注)
GMOインターネット	3,200	1,319	4,220,800	
学研ホールディングス	6,000	284	1,704,000	
ゼンリン	1,300	1,287	1,673,100	
角川グループホールディングス	800	2,735	2,188,000	
アイネット	600	713	427,800	
松竹	6,000	990	5,940,000	
東宝	6,900	2,301	15,876,900	
東映	4,000	724	2,896,000	
AOI Pro.	600	673	403,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	60	303,000	18,180,000	
DTS	1,100	1,560	1,716,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,500	1,085	3,797,500	
シーイーシー	900	689	620,100	
カプコン	1,900	1,641	3,117,900	
SCSK	2,300	2,000	4,600,000	
アイネス	1,000	758	758,000	
TKC	900	1,768	1,591,200	
富士ソフト	1,300	2,472	3,213,600	
NSD	1,900	1,070	2,033,000	
コナミ	4,400	1,991	8,760,400	
JBCCHホールディングス	2,700	885	2,389,500	
ソフトバンク	46,700	4,415	206,180,500	
高千穂交易	2,200	920	2,024,000	
エレマテック	500	1,291	645,500	
あらた	4,000	395	1,580,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
双日	61,200	150	9,180,000	
アルフレッサホールディングス	2,500	5,590	13,975,000	
横浜冷凍	2,400	879	2,109,600	
アルコニックス	200	1,867	373,400	
あいホールディングス	1,700	1,023	1,739,100	
ダイワボウホールディングス	9,000	186	1,674,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,800	913	1,643,400	
UKCホールディングス	1,000	2,252	2,252,000	
TOKAIホールディングス	4,000	316	1,264,000	
シップヘルスケアホールディングス	1,400	3,660	5,124,000	
ナガイレーベン	1,300	1,655	2,151,500	
三菱食品	1,100	2,931	3,224,100	
松田産業	1,000	1,392	1,392,000	
メディカルホールディングス	9,700	1,501	14,559,700	
アズワン	1,000	2,174	2,174,000	
シモジマ	400	988	395,200	
ドウシヤ	1,000	1,569	1,569,000	
高速	600	875	525,000	

黒田電気	1,100	1,237	1,360,700	
ガリバーインターナショナル	320	7,150	2,288,000	
進和	1,400	1,160	1,624,000	
シークス	200	1,452	290,400	
マクニカ	1,000	1,833	1,833,000	
伊藤忠商事	77,400	1,163	90,016,200	
丸紅	80,000	694	55,520,000	
F & A アクアホールディングス	900	1,738	1,564,200	
長瀬産業	5,500	1,178	6,479,000	
豊田通商	10,800	2,541	27,442,800	
兼松	21,000	133	2,793,000	
三井物産	83,800	1,317	110,364,600	
日本紙パルプ商事	5,000	296	1,480,000	
日立ハイテクノロジーズ	2,900	2,216	6,426,400	
カメイ	1,600	982	1,571,200	
スターゼン	2,000	256	512,000	
山善	3,700	612	2,264,400	
住友商事	57,300	1,177	67,442,100	
三菱商事	75,700	1,738	131,566,600	(注)
第一実業	6,000	482	2,892,000	
キャノンマーケティングジャパン	3,200	1,486	4,755,200	
西華産業	6,000	250	1,500,000	
佐藤商事	700	580	406,000	
菱洋エレクトロ	1,700	852	1,448,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ユアサ商事	10,000	207	2,070,000	
神鋼商事	4,000	187	748,000	
阪和興業	10,000	346	3,460,000	
カナデン	1,000	613	613,000	
菱電商事	4,000	626	2,504,000	
岩谷産業	11,000	428	4,708,000	
すてきナイスグループ	8,000	280	2,240,000	
昭光通商	10,000	145	1,450,000	
三愛石油	3,000	451	1,353,000	
稲畑産業	2,400	726	1,742,400	
東邦ホールディングス	3,100	2,211	6,854,100	
サンゲツ	1,700	2,725	4,632,500	
ミツウロコグループホールディングス	2,700	504	1,360,800	
シナネン	1,000	397	397,000	
伊藤忠エネクス	3,100	509	1,577,900	
サンリオ	2,400	4,885	11,724,000	
リョーサン	1,600	1,728	2,764,800	
新光商事	1,000	918	918,000	
三信電気	2,100	604	1,268,400	
東陽テクニカ	1,300	1,441	1,873,300	
モスフードサービス	1,300	1,922	2,498,600	
加賀電子	600	794	476,400	
ソーダニッカ	4,000	406	1,624,000	
P a l t a c	1,000	1,240	1,240,000	

ヤマタネ	10,000	207	2,070,000
トラスコ中山	1,100	1,881	2,069,100
オートバックスセブン	3,600	1,645	5,922,000
加藤産業	1,400	2,049	2,868,600
イエローハット	1,000	1,699	1,699,000
富士エレクトロニクス	1,000	1,193	1,193,000
日伝	600	2,387	1,432,200
杉本商事	2,000	825	1,650,000
因幡電機産業	1,100	2,774	3,051,400
住金物産	2,000	322	644,000
ミスミグループ本社	3,600	2,868	10,324,800
タキヒヨー	1,000	417	417,000
スズケン	3,700	3,725	13,782,500
ローソン	3,700	7,350	27,195,000
サンエー	100	4,715	471,500
カワチ薬品	1,000	2,076	2,076,000
エービーシー・マート	1,100	3,690	4,059,000
ハードオフコーポレーション	700	648	453,600

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アスクル	800	1,726	1,380,800	
ゲオホールディングス	17	115,700	1,966,900	
ポイント	890	4,465	3,973,850	
くらコーポレーション	700	1,741	1,218,700	
キャンドゥ	5	159,500	797,500	
パル	600	3,200	1,920,000	
エディオン	4,200	452	1,898,400	
サーラコーポレーション	800	515	412,000	
ハニーズ	930	1,241	1,154,130	
アルペン	500	1,825	912,500	
ビックカメラ	37	42,750	1,581,750	
DCMホールディングス	4,800	938	4,502,400	
MonotaRO	1,400	2,554	3,575,600	
J.フロントリテイリング	23,000	833	19,159,000	
ドトール・日レスホールディングス	1,700	1,345	2,286,500	
マツモトキヨシホールディングス	1,600	2,672	4,275,200	
スタートトゥデイ	2,000	1,490	2,980,000	
ココカラファイン	1,000	3,690	3,690,000	
三越伊勢丹ホールディングス	19,300	1,570	30,301,000	
ウエルシアホールディングス	300	5,360	1,608,000	
クリエイトSDホールディングス	200	4,135	827,000	
あさひ	1,000	1,525	1,525,000	
コスモス薬品	500	10,740	5,370,000	
セブン&アイ・ホールディングス	40,600	3,865	156,919,000	
ツルハホールディングス	900	9,370	8,433,000	
サンマルクホールディングス	500	4,685	2,342,500	
トリドール	1,000	1,292	1,292,000	
クスリのアオキ	300	7,110	2,133,000	
総合メディカル	300	4,615	1,384,500	
カップ・クリエイトホールディングス	600	1,837	1,102,200	

良品計画	1,000	9,130	9,130,000
コナカ	1,100	1,204	1,324,400
ハウス オブ ローゼ	500	1,307	653,500
コーナン商事	1,200	1,182	1,418,400
エコス	1,000	593	593,000
ワタミ	1,100	1,770	1,947,000
ドン・キホーテ	2,800	4,865	13,622,000
メガネトップ	1,700	1,396	2,373,200
西松屋チェーン	1,900	912	1,732,800
ゼンショーホールディングス	3,700	1,248	4,617,600
幸楽苑	1,600	1,226	1,961,600
サイゼリヤ	1,400	1,286	1,800,400

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ユナイテッドアローズ	1,000	3,770	3,770,000	
ハイデイ日高	1,000	1,962	1,962,000	
京都きもの友禅	1,400	1,075	1,505,000	
コロワイド	3,000	948	2,844,000	
吉番屋	200	4,045	809,000	
スギホールディングス	1,500	3,585	5,377,500	
ファミリーマート	3,000	4,280	12,840,000	
木曽路	1,200	1,918	2,301,600	
千趣会	2,900	817	2,369,300	
ケーヨー	1,000	494	494,000	
上新電機	2,000	854	1,708,000	
日本瓦斯	1,300	1,198	1,557,400	
ロイヤルホールディングス	1,600	1,420	2,272,000	
島忠	2,200	2,533	5,572,600	
チヨダ	1,100	2,865	3,151,500	
ライフコーポレーション	300	1,364	409,200	
カスミ	3,600	663	2,386,800	
リンガーハット	1,600	1,305	2,088,000	
AOKIホールディングス	800	3,115	2,492,000	
オークワ	2,000	1,059	2,118,000	
コメリ	1,500	2,735	4,102,500	
青山商事	2,700	2,802	7,565,400	
しまむら	1,100	12,140	13,354,000	
高島屋	13,000	1,158	15,054,000	
松屋	2,000	1,829	3,658,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,000	1,130	6,780,000	
ニッセンホールディングス	1,200	356	427,200	
パルコ	1,900	1,258	2,390,200	
丸井グループ	12,700	1,143	14,516,100	
原信ナルスホールディングス	1,100	1,738	1,911,800	
ダイエー	5,600	396	2,217,600	
イズミヤ	4,000	492	1,968,000	
イオン	34,200	1,359	46,477,800	
ユニグループ・ホールディングス	9,300	671	6,240,300	
イズミ	2,400	2,706	6,494,400	
東武ストア	10,000	270	2,700,000	

平和堂	2,000	1,658	3,316,000	
フジ	1,100	1,771	1,948,100	
ヤオコー	500	4,275	2,137,500	
ゼビオ	1,300	2,246	2,919,800	
ケーズホールディングス	2,400	3,185	7,644,000	
日産東京販売ホールディングス	1,000	334	334,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アインファーマシーズ	600	4,885	2,931,000	
元気寿司	1,000	1,208	1,208,000	
ヤマダ電機	4,430	4,945	21,906,350	
アーランドサカモト	1,000	2,017	2,017,000	
ニトリホールディングス	1,900	7,020	13,338,000	
グルメ杵屋	1,000	679	679,000	
吉野家ホールディングス	26	111,300	2,893,800	
サガミチェーン	3,000	797	2,391,000	
プレナス	1,100	1,685	1,853,500	
ミニストップ	1,000	1,650	1,650,000	
アークス	1,700	1,830	3,111,000	
パロー	2,100	1,758	3,691,800	
ベルク	800	1,680	1,344,000	
ファーストリテイリング	1,900	34,300	65,170,000	
サンドラッグ	1,800	4,210	7,578,000	
島根銀行	700	1,291	903,700	
じもとホールディングス	7,000	235	1,645,000	
新生銀行	84,000	265	22,260,000	
あおぞら銀行	35,000	296	10,360,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	735,100	653	480,020,300	
りそなホールディングス	99,800	523	52,195,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	203,000	500	101,500,000	
三井住友フィナンシャルグループ	73,400	4,445	326,263,000	
第四銀行	12,000	378	4,536,000	
北越銀行	10,000	227	2,270,000	
西日本シティ銀行	34,000	314	10,676,000	
千葉銀行	37,000	752	27,824,000	
横浜銀行	62,000	595	36,890,000	
常陽銀行	37,000	556	20,572,000	
群馬銀行	22,000	608	13,376,000	
武蔵野銀行	1,500	4,115	6,172,500	
千葉興業銀行	1,900	902	1,713,800	
筑波銀行	4,000	488	1,952,000	
東京都民銀行	1,800	1,336	2,404,800	
七十七銀行	15,000	560	8,400,000	
青森銀行	7,000	287	2,009,000	
秋田銀行	7,000	268	1,876,000	
山形銀行	6,000	469	2,814,000	
岩手銀行	700	3,955	2,768,500	
東邦銀行	8,000	303	2,424,000	
東北銀行	10,000	164	1,640,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	39,000	498	19,422,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
静岡銀行	28,000	1,129	31,612,000	
十六銀行	12,000	401	4,812,000	
スルガ銀行	9,000	1,650	14,850,000	
八十二銀行	18,000	634	11,412,000	
山梨中央銀行	6,000	448	2,688,000	
大垣共立銀行	13,000	355	4,615,000	
福井銀行	8,000	202	1,616,000	
北國銀行	11,000	409	4,499,000	
清水銀行	700	2,918	2,042,600	
滋賀銀行	9,000	664	5,976,000	
南都銀行	10,000	442	4,420,000	
百五銀行	9,000	478	4,302,000	
京都銀行	17,000	1,003	17,051,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	68,000	225	15,300,000	
広島銀行	29,000	496	14,384,000	
山陰合同銀行	6,000	810	4,860,000	
中国銀行	7,000	1,676	11,732,000	
鳥取銀行	5,000	216	1,080,000	
伊予銀行	10,000	979	9,790,000	
百十四銀行	11,000	382	4,202,000	
四国銀行	7,000	301	2,107,000	
阿波銀行	8,000	574	4,592,000	
鹿児島銀行	7,000	691	4,837,000	
大分銀行	6,000	377	2,262,000	
宮崎銀行	6,000	288	1,728,000	
肥後銀行	8,000	620	4,960,000	
佐賀銀行	10,000	243	2,430,000	
十八銀行	6,000	245	1,470,000	
沖縄銀行	700	4,885	3,419,500	
琉球銀行	2,000	1,436	2,872,000	
八千代銀行	500	3,665	1,832,500	
セブン銀行	32,700	316	10,333,200	
みずほフィナンシャルグループ	1,253,200	218	273,197,600	
紀陽ホールディングス	39,000	170	6,630,000	
山口フィナンシャルグループ	10,000	997	9,970,000	
名古屋銀行	9,000	449	4,041,000	
北洋銀行	14,600	326	4,759,600	
愛知銀行	400	5,570	2,228,000	
第三銀行	3,000	180	540,000	
大光銀行	6,000	266	1,596,000	
愛媛銀行	7,000	248	1,736,000	
みなと銀行	9,000	180	1,620,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
京葉銀行	8,000	563	4,504,000	
関西アーバン銀行	14,000	128	1,792,000	

栃木銀行	5,000	404	2,020,000	
北日本銀行	200	2,517	503,400	
東和銀行	15,000	113	1,695,000	
福島銀行	18,000	88	1,584,000	
大東銀行	5,000	97	485,000	
トモニホールディングス	7,400	407	3,011,800	
フィデアホールディングス	7,400	241	1,783,400	
池田泉州ホールディングス	8,000	526	4,208,000	
SBIホールディングス	12,300	1,428	17,564,400	
日本アジア投資	14,000	159	2,226,000	
ジャフコ	1,300	4,765	6,194,500	
大和証券グループ本社	96,000	846	81,216,000	
野村ホールディングス	198,500	759	150,661,500	
岡三証券グループ	8,000	1,196	9,568,000	
丸三証券	3,000	833	2,499,000	
東洋証券	8,000	414	3,312,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	11,100	850	9,435,000	
水戸証券	1,000	595	595,000	
いちよし証券	2,200	1,445	3,179,000	
松井証券	5,800	1,241	7,197,800	
マネックスグループ	110	46,250	5,087,500	
カブドットコム証券	3,800	726	2,758,800	
極東証券	1,300	1,845	2,398,500	
NKSJホールディングス	21,600	2,332	50,371,200	
M&A Dインシュアランスグループホールディングス	29,000	2,485	72,065,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	9,300	1,281	11,913,300	
第一生命保険	519	129,100	67,002,900	
東京海上ホールディングス	37,600	2,980	112,048,000	
T&Dホールディングス	33,300	1,063	35,397,900	
全国保証	800	4,040	3,232,000	
クレディセゾン	8,500	2,774	23,579,000	
芙蓉総合リース	900	4,100	3,690,000	
興銀リース	1,500	3,160	4,740,000	
東京センチュリーリース	2,300	2,910	6,693,000	
日本証券金融	3,700	960	3,552,000	
大阪証券金融	1,000	372	372,000	
アイフル	8,100	930	7,533,000	
ポケットカード	600	818	490,800	
リコーリース	700	3,090	2,163,000	
イオンフィナンシャルサービス	3,500	2,921	10,223,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アコム	1,950	3,565	6,951,750	
ジャックス	5,000	654	3,270,000	
オリエントコーポレーション	18,500	336	6,216,000	
日立キャピタル	1,900	2,238	4,252,200	
オリックス	50,600	1,415	71,599,000	
三菱UFJリース	24,600	533	13,111,800	
日本取引所グループ	1,800	11,850	21,330,000	

日本駐車場開発	262	7,800	2,043,600
ヒューリック	12,600	1,039	13,091,400
野村不動産ホールディングス	4,700	2,644	12,426,800
フージャースホールディングス	1,300	1,663	2,161,900
パーク24	5,100	1,906	9,720,600
三井不動産	46,000	3,435	158,010,000
三菱地所	68,000	3,180	216,240,000
平和不動産	1,800	2,225	4,005,000
東京建物	19,000	974	18,506,000
ダイビル	2,500	1,365	3,412,500
東急不動産	21,000	1,294	27,174,000
京阪神ビルディング	1,100	771	848,100
住友不動産	23,000	4,885	112,355,000
大京	15,000	410	6,150,000
テオーシー	3,300	786	2,593,800
レオパレス21	8,700	569	4,950,300
フジ住宅	1,900	655	1,244,500
空港施設	1,000	648	648,000
住友不動産販売	350	6,890	2,411,500
ゴールドクレスト	800	3,065	2,452,000
東栄住宅	300	2,064	619,200
東急リパブル	1,000	2,404	2,404,000
飯田産業	300	1,940	582,000
アーネストワン	1,600	2,175	3,480,000
タカラレーベン	1,000	2,016	2,016,000
イオンモール	4,400	3,130	13,772,000
タクトホーム	3	201,700	605,100
トーセイ	5	135,900	679,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	60	142,400	8,544,000
日本空港ビルデング	3,400	1,389	4,722,600
日本工営	7,000	380	2,660,000
日本M&Aセンター	500	4,875	2,437,500
アコーディア・ゴルフ	45	114,800	5,166,000
GCAサヴィアン	200	1,226	245,200
エス・エム・エス	200	1,587	317,400

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
テンプホールディングス	1,400	2,003	2,804,200	
クックパッド	200	6,430	1,286,000	
総合警備保障	3,700	1,457	5,390,900	
カカクコム	2,800	2,446	6,848,800	
ツクイ	1,400	1,457	2,039,800	
エムスリー	24	216,400	5,193,600	
ディー・エヌ・エー	5,100	2,752	14,035,200	
博報堂DYホールディングス	1,420	7,920	11,246,400	
ぐるなび	900	1,322	1,189,800	
PGMホールディングス	10	103,400	1,034,000	
イーピーエス	12	150,600	1,807,200	
アミューズ	600	2,332	1,399,200	
ケネディクス	98	79,500	7,791,000	

電通	9,300	3,200	29,760,000
みらかホールディングス	2,700	4,835	13,054,500
アルプス技研	800	1,025	820,000
日本空調サービス	600	884	530,400
オリエンタルランド	3,100	16,190	50,189,000
ダスキン	2,800	1,918	5,370,400
明光ネットワークジャパン	1,800	1,399	2,518,200
ファルコSDホールディングス	1,100	1,222	1,344,200
ラウンドワン	3,200	775	2,480,000
リゾートトラスト	1,700	3,295	5,601,500
ビー・エム・エル	600	2,393	1,435,800
もしもしホットライン	1,700	1,371	2,330,700
リソー教育	141	9,520	1,342,320
ユー・エス・エス	1,150	12,060	13,869,000
テー・オー・ダブリュー	1,300	627	815,100
リロ・ホールディング	400	5,040	2,016,000
エイチ・アイ・エス	800	4,045	3,236,000
共立メンテナンス	1,000	2,807	2,807,000
イチネンホールディングス	1,500	704	1,056,000
燦ホールディングス	1,000	1,402	1,402,000
東京テアトル	10,000	215	2,150,000
よみうりランド	2,000	1,005	2,010,000
東京都競馬	8,000	509	4,072,000
常磐興産	3,000	206	618,000
カナモト	1,000	2,227	2,227,000
東京ドーム	8,000	768	6,144,000
トランス・コスモス	1,300	1,387	1,803,100
乃村工藝社	4,000	642	2,568,000
藤田観光	2,000	552	1,104,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
トーカイ	500	2,819	1,409,500	
白洋舎	5,000	226	1,130,000	
セコム	10,700	5,250	56,175,000	
セントラル警備保障	800	891	712,800	
メイテック	1,600	2,434	3,894,400	
アサツー ディ・ケイ	1,700	2,530	4,301,000	
応用地質	1,100	1,667	1,833,700	
船井総合研究所	2,800	730	2,044,000	
ベネッセホールディングス	3,100	4,200	13,020,000	
イオンディライト	1,000	2,080	2,080,000	
ニチイ学館	2,000	894	1,788,000	
ダイセキ	1,500	1,761	2,641,500	
合計	15,359,659		15,567,672,660	

(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24年10月22日現在]	[平成25年4月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	613,562,916	662,933,089
コール・ローン	9,755,167	31,248,475
株式	11,101,093,438	12,602,152,123
投資信託受益証券	2,346,184	2,181,532
投資証券	260,775,383	316,161,342
派生商品評価勘定	3,816,443	210,776
未収入金	32,725	266,966
未収配当金	8,493,488	22,902,740
未収利息	15	40
差入委託証拠金	85,070,946	149,907,870
流動資産合計	12,084,946,705	13,787,964,953
資産合計	12,084,946,705	13,787,964,953
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,967,788	9,872,367
未払解約金	12,000,000	-
流動負債合計	17,967,788	9,872,367
負債合計	17,967,788	9,872,367
純資産の部		
元本等		
元本	12,866,406,115	10,860,831,302
剰余金		
剰余金又は欠損金()	799,427,198	2,917,261,284
元本等合計	12,066,978,917	13,778,092,586
純資産合計	12,066,978,917	13,778,092,586
負債純資産合計	12,084,946,705	13,787,964,953

(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24年10月23日 至平成25年4月22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。

(貸借対照表に関する注記)

[平成24年10月22日現在]		[平成25年 4月22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	12,866,406,115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	10,860,831,302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	799,427,198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	
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 (1万口当たり純資産額)	0.9379円 (9,379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 (1万口当たり純資産額)	1.2686円 (12,686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24年 4月21日 至平成24年10月22日	自平成24年10月23日 至平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22日現在]
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	13,508,832,506円	12,866,406,115円
同期中における追加設定元本額	373,258,827円	96,542,776円
同期中における一部解約元本額	1,015,685,218円	2,102,117,589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	1,151,568,544円	1,022,290,872円
新光外国株式インデックスVA	5,127,222,499円	4,586,391,308円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	1,272,575,248円	1,059,331,099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）	1,234,629,191円	1,034,807,364円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	1,171,793,306円	669,771,252円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,911,399,730円	1,622,297,727円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	997,217,597円	865,941,680円
合 計	12,866,406,115円	10,860,831,302円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	1,324,879,827	1,166,553,978
投資信託受益証券	458,131	107,730
投 資 証 券	39,423,264	36,140,735
合 計	1,364,761,222	1,202,802,443

（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24年10月22日現在]				[平成25年 4月22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	654,634,376	-	652,348,785	2,285,591	853,514,118	-	843,766,423	9,747,695
S&P500 EMINI 先物	423,670,353	-	417,973,904	5,696,449	549,501,354	-	548,024,505	1,476,849
S&P/TSE 601X 先物	33,800,896	-	33,835,698	34,802	42,631,077	-	40,078,206	2,552,871
DJ EURO ST50 先物	72,456,581	-	73,343,082	886,501	92,000,061	-	88,459,843	3,540,218
LIFFE FTSE先 物	73,649,583	-	74,518,693	869,110	96,085,928	-	94,517,212	1,568,716
SWISS MKT IX 先物	27,960,508	-	28,845,226	884,718	40,829,683	-	40,530,447	299,236
OMXS30 INDEX 先物	5,179,572	-	5,141,735	37,837	6,961,262	-	6,920,312	40,950
SPI 200先物	17,916,883	-	18,690,447	773,564	25,504,753	-	25,235,898	268,855
合 計	654,634,376	-	652,348,785	2,285,591	853,514,118	-	843,766,423	9,747,695

（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。

4.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24年10月22日現在]				[平成25年 4月22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	-	-	-	-	20,834,960	-	20,810,520	24,440
米ドル	-	-	-	-	15,869,790	-	15,858,660	11,130

カナダドル	-	-	-	-	584,220	-	583,320	900
ユーロ	-	-	-	-	1,827,280	-	1,823,780	3,500
英ポンド	-	-	-	-	1,216,880	-	1,213,040	3,840
オーストラリアドル	-	-	-	-	1,336,790	-	1,331,720	5,070
売建	52,231,730	-	52,188,560	43,170	-	-	-	-
米ドル	27,524,000	-	27,524,040	40	-	-	-	-
カナダドル	3,039,680	-	3,032,780	6,900	-	-	-	-
ユーロ	5,064,150	-	5,065,130	980	-	-	-	-
英ポンド	6,991,390	-	6,982,800	8,590	-	-	-	-
スイスフラン	1,110,980	-	1,111,240	260	-	-	-	-
スウェーデンクローナ	481,600	-	481,600	-	-	-	-	-
オーストラリアドル	6,821,850	-	6,792,530	29,320	-	-	-	-
香港ドル	613,800	-	613,800	-	-	-	-	-
シンガポールドル	584,280	-	584,640	360	-	-	-	-
合計	52,231,730	-	52,188,560	43,170	20,834,960	-	20,810,520	24,440

(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	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	2,600	79.99	207,974.00	
	APACHE CORP	2,000	68.84	137,680.00	
	BAKER HUGHES INC	2,400	43.58	104,592.00	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,100	64.60	71,060.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORPORATION	1,400	59.19	82,866.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,400	18.59	63,206.00	
	CHEVRON CORP	10,100	115.90	1,170,590.00	
	CIMAREX ENERGY CO	400	69.89	27,956.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	1,300	26.97	35,061.00	
CONCHO RESOURCES INC	500	82.70	41,350.00		

CONOCOPHILLIPS	6,000	57.49	344,940.00
CONSOL ENERGY INC	1,200	32.28	38,736.00
CONTINENTAL RESOURCES INC	200	73.07	14,614.00
CORE LABORATORIES NV	200	139.50	27,900.00
DENBURY RESOURCES INC	2,200	16.68	36,696.00
DEVON ENERGY CORPORATION	2,000	51.44	102,880.00
DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC	400	65.34	26,136.00
ENERGEN CORPORATION	500	46.61	23,305.00
ENSCO PLC-CLASS A	1,300	53.39	69,407.00
EOG RESOURCES INC	1,400	113.44	158,816.00
EQT CORPORATION	800	66.66	53,328.00
EXXON MOBIL CORP	23,566	87.45	2,060,846.70
FMC TECHNOLOGIES INC	1,200	49.22	59,064.00
HALLIBURTON CO	4,800	37.21	178,608.00
HELMERICH & PAYNE INC	500	57.28	28,640.00
HESS CORPORATION	1,600	66.78	106,848.00
HOLLYFRONTIER CORPORATION	1,100	49.92	54,912.00
KINDER MORGAN INC	3,393	38.87	131,885.91
MARATHON OIL CORP	3,700	29.85	110,445.00
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	1,750	78.75	137,812.50
MURPHY OIL CORPORATION	1,000	60.60	60,600.00
NABORS INDUSTRIES LTD	1,600	14.83	23,728.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	2,204	64.31	141,739.24
NEWFIELD EXPLORATION CO	900	20.04	18,036.00
NOBLE CORPORATION	1,300	36.02	46,826.00
NOBLE ENERGY INC	900	107.21	96,489.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	4,200	79.61	334,362.00
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	600	60.03	36,018.00
PEABODY ENERGY CORP	1,700	19.19	32,623.00

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	
	PHILLIPS 66	3,050	57.84	176,412.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	700	110.59	77,413.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	700	44.60	31,220.00	
	QEP RESOURCES INC	1,000	28.41	28,410.00	
	RANGE RESOURCES CORP	800	75.55	60,440.00	
	ROWAN COMPANIES PLC	700	31.24	21,868.00	
	SCHLUMBERGER LIMITED	6,932	69.95	484,893.40	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	1,800	35.38	63,684.00	
	SPECTRA ENERGY CORPORATION	3,634	30.57	111,091.38	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	800	23.17	18,536.00	
	ULTRA PETROLEUM CORP	1,100	20.75	22,825.00	
	VALERO ENERGY CORP	2,900	39.24	113,796.00	
	WEATHERFORD INTERNATIONAL LIMITED	4,300	12.26	52,718.00	
	WHITING PETROLEUM CORPORATION	600	43.99	26,394.00	
	WILLIAMS COS INC	3,500	37.27	130,445.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,100	85.71	94,281.00	
AIRGAS INC	300	95.87	28,761.00		

ALBEMARLE CORPORATION	600	58.82	35,292.00
ALCOA INC	6,000	8.08	48,480.00
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	700	27.45	19,215.00
BALL CORPORATION	900	46.43	41,787.00
CELANESE CORP-SERIES A	900	47.10	42,390.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	300	179.15	53,745.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	800	17.63	14,104.00
CROWN HOLDINGS INC	700	41.08	28,756.00
DOW CHEMICAL	6,200	30.55	189,410.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	4,800	49.19	236,112.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	800	69.80	55,840.00
ECOLAB INC	1,500	82.23	123,345.00
FMC CORPORATION	800	57.88	46,304.00
FREEMONT-MCMORAN COPPER & GOLD INC	4,938	28.24	139,449.12
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	400	75.06	30,024.00
INTERNATIONAL PAPER CO	2,200	45.67	100,474.00
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	1,600	57.86	92,576.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	200	95.01	19,002.00
MEADWESTVACO CORPORATION	900	34.40	30,960.00
MONSANTO CO	2,800	103.22	289,016.00
NEWMONT MINING CORP	2,600	32.98	85,748.00
NUCOR CORP	1,600	42.38	67,808.00
OWENS-ILLINOIS INC	900	24.88	22,392.00
PPG INDUSTRIES INC	700	141.59	99,113.00

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	
	PRAXAIR INC	1,500	109.75	164,625.00	
	ROCK-TENN COMPANY-CL A	400	86.41	34,564.00	
	SEALED AIR CORPORATION	1,100	21.48	23,628.00	
	SIGMA-ALDRICH	600	76.92	46,152.00	
	THE MOSAIC COMPANY	1,500	57.53	86,295.00	
	THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	500	179.04	89,520.00	
	UNITED STATES STEEL CORP	800	16.39	13,112.00	
	VULCAN MATERIALS CO	800	46.05	36,840.00	
	3M CO	3,400	105.71	359,414.00	
	AGCO CORPORATION	500	49.10	24,550.00	
	AMETEK INC	1,375	40.20	55,275.00	
	BOEING CO	3,700	87.96	325,452.00	
	CATERPILLAR INC	3,400	80.43	273,462.00	
	CUMMINS INC	900	107.06	96,354.00	
	DANAHER CORP	3,000	59.10	177,300.00	
	DEERE & CO	1,900	83.46	158,574.00	
	DOVER CORP	900	68.15	61,335.00	
	EATON CORPORATION PLC	2,474	56.96	140,919.04	
	EMERSON ELECTRIC CO	3,700	53.48	197,876.00	
FASTENAL CO	1,600	48.14	77,024.00		
FLAWSERVE CORPORATION	300	152.83	45,849.00		

FLUOR CORP	900	54.16	48,744.00
GENERAL DYNAMICS CORP	1,600	67.00	107,200.00
GENERAL ELECTRIC CO(US)	54,200	21.75	1,178,850.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	3,800	74.18	281,884.00
ILLINOIS TOOL WORKS	2,200	60.50	133,100.00
INGERSOLL-RAND PLC	1,722	53.90	92,815.80
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	800	50.04	40,032.00
JOY GLOBAL INC	500	54.21	27,105.00
KBR INC	800	28.01	22,408.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	500	81.38	40,690.00
LOCKHEED MARTIN CORP	1,400	96.28	134,792.00
MASCO CORP	2,000	19.27	38,540.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,200	70.98	85,176.00
PACCAR INC	1,800	48.20	86,760.00
PALL CORPORATION	600	63.50	38,100.00
PARKER HANNIFIN CORP	750	85.55	64,162.50
PENTAIR LIMITED	1,159	50.24	58,228.16
PRECISION CASTPARTS CORP	800	186.05	148,840.00
QUANTA SERVICES INC	1,100	27.31	30,041.00
RAYTHEON COMPANY	1,800	57.15	102,870.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	700	83.18	58,226.00

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	
	ROCKWELL COLLINS INC.	800	61.10	48,880.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	500	122.50	61,250.00	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	600	31.24	18,744.00	
	SPX CORP	300	73.70	22,110.00	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	837	76.40	63,946.80	
	TEXTRON INC	1,600	26.35	42,160.00	
	TRANSDIGM GROUP INC	300	145.37	43,611.00	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	4,500	93.22	419,490.00	
	WW GRAINGER INC	300	243.05	72,915.00	
	XYLEM INC	1,000	26.99	26,990.00	
	AVERY DENNISON CORPORATION	600	40.81	24,486.00	
	CINTAS CORPORATION	700	44.80	31,360.00	
	DUN & BRADSTREET CORP	200	84.72	16,944.00	
	EQUIFAX INC	700	58.62	41,034.00	
	IHS INC-CLASS A	300	96.63	28,989.00	
	IRON MOUNTAIN INCORPORATED	779	36.67	28,565.93	
	MANPOWER GROUP	500	53.57	26,785.00	
	NIELSEN HOLDINGS NV	900	34.95	31,455.00	
	PITNEY BOWES INC	1,000	14.31	14,310.00	
	REPUBLIC SERVICES INC	1,630	32.68	53,268.40	
	ROBERT HALF INTL INC	800	36.10	28,880.00	
	STERICYCLE INC	400	107.67	43,068.00	
	THE ADT CORPORATION	1,175	43.84	51,512.00	
	TYCO INTERNATIONAL LIMITED	2,450	31.32	76,734.00	
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	800	59.03	47,224.00	
WASTE MANAGEMENT INC	2,300	38.70	89,010.00		

C H ROBINSON WORLDWIDE INC	900	56.33	50,697.00
CSX CORP	5,300	23.70	125,610.00
DELTA AIR LINES INC	1,400	15.26	21,364.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	1,100	35.34	38,874.00
FEDEX CORP	1,500	92.39	138,585.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,800	23.72	42,696.00
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	500	70.00	35,000.00
KANSAS CITY SOUTHERN	600	106.46	63,876.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,600	74.75	119,600.00
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	1,000	13.34	13,340.00
UNION PACIFIC CORP	2,400	145.85	350,040.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	400	30.60	12,240.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3,700	82.99	307,063.00
AUTOLIV INC	500	67.27	33,635.00
BORGWARNER INC	600	72.69	43,614.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	1,700	41.84	71,128.00

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	
	FORD MOTOR CO	18,400	12.93	237,912.00	
	GENERAL MOTORS CO	4,000	29.15	116,600.00	
	HARLEY-DAVIDSON INC	1,300	51.83	67,379.00	
	JOHNSON CONTROLS INC	3,500	32.64	114,240.00	
	THE GOODYEAR TIRE & RUBBER COMPANY	1,600	12.15	19,440.00	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORPORATION	600	53.57	32,142.00	
	COACH INC	1,500	51.20	76,800.00	
	DR HORTON INC	1,500	21.98	32,970.00	
	FOSSIL INC	300	94.29	28,287.00	
	GARMIN LIMITED	600	32.97	19,782.00	
	HASBRO INC	600	45.02	27,012.00	
	LEGGETT & PLATT INC	700	32.48	22,736.00	
	LENNAR CORPORATION-CLASS A	800	38.17	30,536.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	500	68.38	34,190.00	
	MATTEL INC	1,900	44.01	83,619.00	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	300	111.46	33,438.00	
	NEWELL RUBBERMAID INC	1,600	26.37	42,192.00	
	NIKE INC -CL B	3,700	60.92	225,404.00	
	POLARIS INDUSTRIES INC	300	85.81	25,743.00	
	PULTEGROUP INC	2,100	17.99	37,779.00	
	PVH CORPORATION	400	106.08	42,432.00	
	RALPH LAUREN CORPORATION	300	169.14	50,742.00	
	TOLL BROTHERS INC	800	30.91	24,728.00	
	UNDER ARMOUR INC-CLASS A	500	56.41	28,205.00	
	VF CORP	500	169.15	84,575.00	
WHIRLPOOL CORP	400	117.13	46,852.00		
CARNIVAL CORP(US)	2,300	33.39	76,797.00		
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	200	366.25	73,250.00		
DARDEN RESTAURANTS INC	700	48.89	34,223.00		

H&R BLOCK INC	1,600	27.74	44,384.00
INTL GAME TECHNOLOGY	1,500	16.07	24,105.00
LAS VEGAS SANDS CORP	2,100	53.06	111,426.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	1,326	41.34	54,816.84
MCDONALD'S CORP	5,200	99.92	519,584.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	2,300	12.23	28,129.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	800	33.39	26,712.00
STARBUCKS CORP	3,800	58.41	221,958.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	1,000	61.23	61,230.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	700	63.33	44,331.00
WYNN RESORTS LTD	400	127.56	51,024.00
YUM! BRANDS INC	2,300	65.04	149,592.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	1,400	14.27	19,978.00

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	
	CBS CORP-CLASS B	3,150	46.06	145,089.00	
	CHARTER COMMUNICATION INC-A	200	103.04	20,608.00	
	COMCAST CORP-CL A	11,000	40.56	446,160.00	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	2,700	38.83	104,841.00	
	DIRECTV	3,100	55.18	171,058.00	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	500	71.01	35,505.00	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	650	77.88	50,622.00	
	DISH NETWORK CORPORATION-A	1,200	39.00	46,800.00	
	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	2,200	13.47	29,634.00	
	LIBERTY GLOBAL INC-A	700	73.44	51,408.00	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	600	68.20	40,920.00	
	LIBERTY MEDIA CORPORATION	500	108.75	54,375.00	
	NEWS CORP-CL A	8,000	31.21	249,680.00	
	NEWS CORP-CLASS B	2,400	31.26	75,024.00	
	OMNICOM GROUP	1,400	58.03	81,242.00	
	SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	400	67.04	26,816.00	
	SIRIUS XM RADIO INC	18,500	3.00	55,500.00	
	THE WALT DISNEY CO.	8,700	61.56	535,572.00	
	TIME WARNER CABLE INC	1,601	91.28	146,139.28	
	TIME WARNER INC	4,933	59.75	294,746.75	
	VIACOM INC-CLASS B	2,250	66.17	148,882.50	
	VIRGIN MEDIA INC	1,400	49.09	68,726.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	400	79.93	31,972.00	
	AMAZON.COM INC	1,900	260.32	494,608.00	
	AUTOZONE INC	200	378.43	75,686.00	
	BED BATH & BEYOND INC	1,200	66.74	80,088.00	
	BEST BUY CO INC	1,500	23.25	34,875.00	
	CARMAX INC	1,300	42.76	55,588.00	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	600	47.00	28,200.00	
	DOLLAR GENERAL CORPORATION	1,400	51.82	72,548.00	
	DOLLAR TREE INC	1,300	47.47	61,711.00	
EXPEDIA INC	600	61.69	37,014.00		
FAMILY DOLLAR STORES	600	62.59	37,554.00		

GAMESTOP CORP-CLASS A	700	32.73	22,911.00
GAP INC/THE	1,600	37.00	59,200.00
GENUINE PARTS CO	800	73.66	58,928.00
HOME DEPOT INC	7,700	74.00	569,800.00
J.C. PENNEY CO INC	1,200	15.26	18,312.00
KOHL'S CORP	1,200	47.44	56,928.00
L BRANDS INC	1,300	48.42	62,946.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	2,825	20.06	56,669.50
LKQ CORPORATION	1,800	20.71	37,278.00

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	
	LOWE'S COS INC	5,800	38.12	221,096.00	
	MACY'S INC	2,000	43.54	87,080.00	
	NETFLIX INC	300	163.37	49,011.00	
	NORDSTROM INC	900	54.90	49,410.00	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	600	99.36	59,616.00	
	PETSMART INC	700	66.94	46,858.00	
	PRICELINE COM INC	300	683.57	205,071.00	
	ROSS STORES INC	1,200	62.86	75,432.00	
	SEARS HOLDINGS CORP	300	46.18	13,854.00	
	STAPLES INC	3,900	12.95	50,505.00	
	TARGET CORP	3,200	69.04	220,928.00	
	TIFFANY & CO	700	70.11	49,077.00	
	TJX COMPANIES INC	3,800	47.00	178,600.00	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	400	108.06	43,224.00	
	ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	300	83.70	25,110.00	
	URBAN OUTFITTERS INC	700	39.46	27,622.00	
	COSTCO WHOLESALE CORP	2,200	104.46	229,812.00	
	CVS CAREMARK CORPORATION	6,372	58.00	369,576.00	
	KROGER CO	2,500	33.71	84,275.00	
	SAFEWAY INC	1,300	26.55	34,515.00	
	SYSCO CORP	3,000	34.71	104,130.00	
	WAL-MART STORES INC	8,600	78.29	673,294.00	
	WALGREEN CO	4,600	49.35	227,010.00	
	WHOLE FOODS MARKET INC	900	86.10	77,490.00	
	ALTRIA GROUP INC	10,500	35.02	367,710.00	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3,400	32.18	109,412.00	
	BEAM INC	700	64.87	45,409.00	
	BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	550	71.71	39,440.50	
	BUNGE LIMITED	800	68.26	54,608.00	
	CAMPBELL SOUP COMPANY	1,000	46.46	46,460.00	
	COCA-COLA CO/THE	20,900	42.66	891,594.00	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	1,500	37.00	55,500.00		
CONAGRA FOODS INC	2,100	36.06	75,726.00		
CONSTELLATION BRANDS INC-A	900	48.52	43,668.00		
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	1,239	48.07	59,558.73		
GENERAL MILLS INC	3,300	50.34	166,122.00		

GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS INC	800	55.03	44,024.00
HERSHEY CO/THE	800	90.38	72,304.00
HJ HEINZ CO	1,700	72.45	123,165.00
HORMEL FOODS CORPORATION	700	41.21	28,847.00
KELLOGG COMPANY	1,300	66.10	85,930.00
KRAFT FOODS GROUP INC	2,914	50.35	146,719.90

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	LORILLARD INC	株 2,000	米ドル 41.23	米ドル 82,460.00	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	600	72.30	43,380.00	
	MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	1,000	81.13	81,130.00	
	MOLSON COORS BREWING CO-B	900	52.65	47,385.00	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	8,744	31.68	277,009.92	
	MONSTER BEVERAGE CORPORATION	800	55.72	44,576.00	
	PEPSICO INC	7,986	82.77	661,001.22	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	8,600	91.95	790,770.00	
	REYNOLDS AMERICAN INC	1,800	45.39	81,702.00	
	THE JM SMUCKER COMPANY	600	103.10	61,860.00	
	TYSON FOODS INC-CL A	1,500	24.08	36,120.00	
	AVON PRODUCTS INC	2,500	21.99	54,975.00	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	800	62.55	50,040.00	
	CLOROX COMPANY	600	89.53	53,718.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	2,400	119.72	287,328.00	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	300	94.62	28,386.00	
	ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	1,200	69.67	83,604.00	
	HERBALIFE LIMITED	700	35.78	25,046.00	
	KIMBERLY-CLARK CORP	2,000	106.10	212,200.00	
	PROCTER & GAMBLE CO	14,092	81.43	1,147,511.56	
	ABBOTT LABORATORIES	8,200	37.20	305,040.00	
	AETNA INC	1,700	55.87	94,979.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	1,300	55.92	72,696.00	
	BARD (C.R.) INC	400	99.53	39,812.00	
	BAXTER INTERNATIONAL INC.	2,800	69.09	193,452.00	
	BECTON DICKINSON & CO	1,000	94.56	94,560.00	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	7,103	7.27	51,638.81	
	CARDINAL HEALTH INC	1,800	43.07	77,526.00	
	CAREFUSION CORPORATION	1,050	34.55	36,277.50	
	CERNER CORPORATION	800	91.79	73,432.00	
	CIGNA CORP	1,600	65.15	104,240.00	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	700	48.68	34,076.00	
	COVIDIEN PLC	2,350	66.55	156,392.50	
	DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	500	122.62	61,310.00	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	700	41.56	29,092.00	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	600	83.12	49,872.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	4,225	55.34	233,811.50		
HCA HOLDINGS INC	1,500	37.66	56,490.00		
HENRY SCHEIN INC	500	91.45	45,725.00		
HOLOGIC INC	1,600	21.27	34,032.00		

HUMANA INC	800	73.05	58,440.00
INTUITIVE SURGICAL INC	200	484.75	96,950.00

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	
	LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	500	93.86	46,930.00	
	MCKESSON CORP	1,200	106.25	127,500.00	
	MEDTRONIC INC	5,300	46.03	243,959.00	
	OMNICARE INC	600	41.32	24,792.00	
	PATTERSON COMPANIES INC	500	37.20	18,600.00	
	QUEST DIAGNOSTICS	800	55.92	44,736.00	
	RESMED INC	700	44.02	30,814.00	
	ST JUDE MEDICAL INC	1,600	40.90	65,440.00	
	STRYKER CORP	1,600	64.68	103,488.00	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	5,300	60.04	318,212.00	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	600	67.29	40,374.00	
	WELLPOINT INC	1,600	68.71	109,936.00	
	ZIMMER HOLDINGS INC	900	73.93	66,537.00	
	ABBVIE INC	8,100	42.39	343,359.00	
	ACTAVIS INC	700	98.48	68,936.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,800	42.00	75,600.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,000	92.59	92,590.00	
	ALLERGAN INC	1,600	113.74	181,984.00	
	AMGEN INC	4,000	111.38	445,520.00	
	BIOGEN IDEC INC	1,200	203.27	243,924.00	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	8,500	41.15	349,775.00	
	CELGENE CORP	2,200	122.36	269,192.00	
	ELI LILLY & CO	5,400	57.42	310,068.00	
	FOREST LABORATORIES INC	1,500	35.91	53,865.00	
	GILEAD SCIENCES INC	7,800	53.19	414,882.00	
	HOSPIRA INC	1,000	31.19	31,190.00	
	ILLUMINA INC	700	56.09	39,263.00	
	JOHNSON & JOHNSON	14,324	84.49	1,210,234.76	
	LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	931	73.53	68,456.43	
	MERCK & CO. INC.	15,731	47.49	747,065.19	
	MYLAN INC	2,100	28.34	59,514.00	
	PERRIGO COMPANY	500	119.47	59,735.00	
PFIZER INC	38,126	31.06	1,184,193.56		
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	400	212.58	85,032.00		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,900	80.03	152,057.00		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,100	85.36	93,896.00		
WARNER CHILCOTT PLC	900	13.88	12,492.00		
WATERS CORP	400	88.45	35,380.00		
BB&T CORPORATION	3,800	29.69	112,822.00		
CIT GROUP INC	1,000	41.67	41,670.00		
COMERICA INC	1,000	34.86	34,860.00		
FIFTH THIRD BANCORP	4,600	16.40	75,440.00		

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	
	FIRST REPUBLIC BANK/CA	600	36.89	22,134.00	
	HUDSON CITY BANCORP INC	3,200	8.08	25,856.00	
	KEYCORP	4,800	9.41	45,168.00	
	M & T BANK CORP	600	98.75	59,250.00	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	2,700	13.39	36,153.00	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	2,000	12.88	25,760.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,700	65.23	176,121.00	
	REGIONS FINANCIAL CORP	7,317	7.83	57,292.11	
	SUNTRUST BANKS INC	2,800	28.31	79,268.00	
	US BANCORP	9,700	32.51	315,347.00	
	WELLS FARGO & COMPANY	25,788	36.69	946,161.72	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	300	145.81	43,743.00	
	AMERICAN EXPRESS CO	5,200	67.24	349,648.00	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,140	72.18	82,285.20	
	BANK OF AMERICA CORP	55,698	11.66	649,438.68	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	6,007	26.99	162,128.93	
	BLACKROCK INC	700	250.16	175,112.00	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	3,000	56.17	168,510.00	
	CITIGROUP INC	15,220	45.03	685,356.60	
	CME GROUP INC	1,555	58.98	91,713.90	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,600	43.34	112,684.00	
	EATON VANCE CORPORATION	700	38.16	26,712.00	
	FRANKLIN RESOURCES INC	800	146.83	117,464.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,300	138.72	319,056.00	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	400	154.38	61,752.00	
	INVESCO LIMITED	2,380	28.89	68,758.20	
	JPMORGAN CHASE & CO	19,600	47.23	925,708.00	
	LEGG MASON INC	700	30.19	21,133.00	
	LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,400	29.05	40,670.00	
	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	1,400	51.85	72,590.00	
	MOODY'S CORP	1,100	54.84	60,324.00	
	MORGAN STANLEY	7,700	20.58	158,466.00	
NASDAQ OMX GROUP INC	600	27.97	16,782.00		
NORTHERN TRUST CORP	1,200	52.50	63,000.00		
NYSE EURONEXT	1,300	37.24	48,412.00		
SEI INVESTMENTS COMPANY	800	27.81	22,248.00		
SLM CORPORATION	2,500	20.32	50,800.00		
STATE STREET CORP	2,462	56.93	140,161.66		
T ROWE PRICE GROUP INC	1,300	74.55	96,915.00		
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	1,200	19.28	23,136.00		
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	5,600	16.39	91,784.00		
ACE LIMITED	1,800	89.03	160,254.00		

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	
	AFLAC INC	2,400	49.39	118,536.00	
	ALLEGHANY CORPORATION	100	381.11	38,111.00	

ALLSTATE CORP	2,500	48.97	122,425.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	7,175	38.88	278,964.00
AON PLC	1,700	60.15	102,255.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	700	52.22	36,554.00
ASSURANT INC	400	46.66	18,664.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	600	41.80	25,080.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	5,100	105.28	536,928.00
CHUBB CORP	1,400	87.89	123,046.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	900	47.69	42,921.00
EVEREST RE GROUP LTD	300	125.85	37,755.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-A	1,100	26.29	28,919.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	2,100	26.84	56,364.00
LINCOLN NATIONAL CORP	1,400	31.22	43,708.00
LOEWS CORPORATION	1,600	43.18	69,088.00
MARSH & MCLENNAN COS	2,800	37.27	104,356.00
METLIFE INC	4,500	35.60	160,200.00
PARTNERRE LTD	300	92.90	27,870.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,500	34.34	51,510.00
PROGRESSIVE CORP	3,000	24.74	74,220.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,400	55.77	133,848.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	200	90.56	18,112.00
TORCHMARK CORPORATION	450	59.30	26,685.00
TRAVELERS COS INC/THE	2,000	84.81	169,620.00
UNUM GROUP	1,400	26.37	36,918.00
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	900	38.58	34,722.00
WR BERKLEY CORP	700	44.25	30,975.00
XL GROUP PLC	1,600	30.44	48,704.00
CBRE GROUP INC	1,800	23.83	42,894.00
ACCENTURE PLC	3,300	74.74	246,642.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,300	14.26	32,798.00
ADOBE SYSTEMS INC	2,600	44.75	116,350.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,000	33.55	33,550.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	300	160.07	48,021.00
ANSYS INC	500	74.88	37,440.00
AUTODESK INC	1,300	36.12	46,956.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2,500	65.20	163,000.00
BMC SOFTWARE INC	900	43.86	39,474.00
CA INC	1,900	24.36	46,284.00
CITRIX SYSTEMS INC	1,000	67.14	67,140.00

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	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	1,600	67.81	108,496.00	
	COMPUTER SCIENCES CORP	800	44.23	35,384.00	
	EBAY INC	6,000	52.39	314,340.00	
	ELECTRONIC ARTS INC	1,900	17.09	32,480.50	
	EQUINIX INC	300	210.15	63,045.00	
FACEBOOK INC-A	8,300	25.74	213,642.00		

FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,280	40.81	52,236.80
FISERV INC	700	87.32	61,124.00
GOOGLE INC-CL A	1,400	799.87	1,119,818.00
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	5,500	190.00	1,045,000.00
INTUIT INC	1,500	62.98	94,470.00
LINKEDIN CORPORATION-A	500	174.95	87,475.00
MASTERCARD INC.-CLASS A	600	521.96	313,176.00
MICROSOFT CORP	39,200	29.77	1,166,984.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	1,400	20.39	28,546.00
ORACLE CORP	19,900	32.36	643,964.00
PAYCHEX INC	1,800	35.41	63,738.00
RACKSPACE HOSTING INC	600	45.05	27,030.00
RED HAT INC	1,000	49.25	49,250.00
SAIC INC	1,500	14.09	21,135.00
SALESFORCE COM INC	2,800	40.88	114,464.00
SYMANTEC CORP	3,600	23.55	84,780.00
SYNOPSYS INC	900	33.72	30,348.00
TERADATA CORPORATION	1,000	50.35	50,350.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,000	23.95	23,950.00
VERIFONE SYSTEMS INC	700	19.00	13,300.00
VERISIGN INC	900	44.71	40,239.00
VISA INC-CLASS A SHARES	2,800	163.96	459,088.00
VMWARE INC-CLASS A	400	72.46	28,984.00
WESTERN UNION COMPANY	3,400	14.47	49,198.00
YAHOO! INC	5,800	23.47	136,126.00
AMPHENOL CORPORATION-CL A	800	72.78	58,224.00
APPLE INC	4,900	390.50	1,913,450.00
ARROW ELECTRONICS INC	500	36.81	18,405.00
AVNET INC	800	31.54	25,232.00
CISCO SYSTEMS INC	27,400	20.45	560,330.00
CORNING INC	7,600	12.84	97,584.00
DELL INC	7,600	13.40	101,840.00
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	300	31.86	9,558.00
EMC CORP/MASSACHUSETTS	10,900	21.50	234,350.00
F5 NETWORKS INC	400	71.38	28,552.00
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	4,200	6.69	28,098.00

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	
	FLIR SYSTEMS INC	800	23.53	18,824.00	
	HARRIS CORPORATION	700	41.98	29,386.00	
	HEWLETT-PACKARD COMPANY	10,200	19.56	199,512.00	
	JUNIPER NETWORKS INC	3,000	17.10	51,300.00	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,271	61.72	78,446.12	
	NETAPP INC	1,900	33.00	62,700.00	
	QUALCOMM INC	8,800	63.90	562,320.00	
	SANDISK CORP	1,300	52.31	68,003.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY	1,800	34.44	61,992.00	
TE CONNECTIVITY LIMITED	2,150	39.38	84,667.00		

TRIMBLE NAVIGATION LIMITED	1,300	27.41	35,633.00
WESTERN DIGITAL CORPORATION	1,200	49.93	59,916.00
XEROX CORP	6,641	8.46	56,182.86
AT&T INC	29,419	38.28	1,126,159.32
CENTURYLINK INC	3,226	37.17	119,910.42
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	1,500	75.01	112,515.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	5,632	4.03	22,696.96
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	900	20.15	18,135.00
METROPCS COMMUNICATIONS INC	1,700	11.12	18,904.00
SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	700	76.07	53,249.00
SPRINT NEXTEL CORP	15,500	7.17	111,135.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	14,800	52.25	773,300.00
WINDSTREAM CORPORATION	3,600	8.64	31,104.00
AES CORP	3,300	12.87	42,471.00
ALLIANT ENERGY CORP	600	51.91	31,146.00
AMEREN CORPORATION	1,300	35.82	46,566.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	2,500	49.94	124,850.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,000	42.01	42,010.00
CALPINE CORPORATION	1,700	21.08	35,836.00
CENTERPOINT ENERGY INC	2,100	24.14	50,694.00
CMS ENERGY CORPORATION	1,400	29.09	40,726.00
CONSOLIDATED EDISON INC	1,500	62.48	93,720.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	3,100	61.07	189,317.00
DTE ENERGY COMPANY	900	72.26	65,034.00
DUKE ENERGY CORPORATION	3,597	74.34	267,400.98
EDISON INTERNATIONAL	1,700	52.47	89,199.00
ENTERGY CORP	900	69.71	62,739.00
EXELON CORP	4,402	36.68	161,465.36
FIRSTENERGY CORP	2,267	45.65	103,488.55
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	400	60.47	24,188.00
MDU RESOURCES GROUP INC	1,100	24.11	26,521.00
NEXTERA ENERGY INC	2,100	80.08	168,168.00

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	
	NISOURCE INC	1,600	31.09	49,744.00	
	NORTHEAST UTILITIES	1,718	44.94	77,206.92	
	NRG ENERGY INC	1,900	27.26	51,794.00	
	OGE ENERGY CORPORATION	500	70.99	35,495.00	
	ONEOK INC	1,000	51.35	51,350.00	
	P G & E CORPORATION	2,200	47.77	105,094.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	1,300	21.92	28,496.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	600	59.41	35,646.00	
	PPL CORPORATION	3,000	32.57	97,710.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	2,600	35.90	93,340.00	
	SCANA CORPORATION	600	52.81	31,686.00	
	SEMPRA ENERGY	1,200	82.55	99,060.00	

SOUTHERN CO	4,500	48.51	218,295.00
WISCONSIN ENERGY CORPORATION	1,200	43.61	52,332.00
XCEL ENERGY INC	2,500	31.08	77,700.00
ALTERA CORPORATION	1,800	31.07	55,926.00
ANALOG DEVICES INC	1,700	42.36	72,012.00
APPLIED MATERIALS INC	6,400	12.94	82,816.00
AVAGO TECHNOLOGIES LIMITED	1,400	31.26	43,764.00
BROADCOM CORP-CL A	2,600	31.89	82,914.00
CREE INC	700	53.39	37,373.00
INTEL CORP	25,700	22.44	576,708.00
KLA-TENCOR CORPORATION	1,000	53.05	53,050.00
LAM RESEARCH CORP	900	41.63	37,467.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	1,300	34.61	44,993.00
LSI CORPORATION	3,600	6.10	21,960.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	2,500	9.73	24,325.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	1,600	31.25	50,000.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,100	34.34	37,774.00
MICRON TECHNOLOGY INC	5,300	9.35	49,555.00
NVIDIA CORP	3,200	12.57	40,224.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	5,800	34.25	198,650.00
XILINX INC	1,300	35.51	46,163.00
米ドル建小計	株 1,601,285	-	米ドル 74,226,271.62 (7,404,070,594円)
カナダドル	株	カナダドル	カナダドル
ARC RESOURCES LIMITED	1,600	26.64	42,624.00
ATHABASCA OIL CORPORATION	2,000	7.87	15,740.00
BAYTEX ENERGY CORPORATION	700	37.35	26,145.00
BONAVISTA ENERGY CORP	1,000	14.96	14,960.00
CAMECO CORP (CA)	2,000	18.20	36,400.00

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	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	5,700	29.54	168,378.00	
	CANADIAN OIL SANDS LIMITED	2,700	18.93	51,111.00	
	CENOVUS ENERGY INC	4,100	28.70	117,670.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	2,000	35.85	71,700.00	
	ENBRIDGE INC	3,900	46.17	180,063.00	
	ENCANA CORP	3,800	19.17	72,846.00	
	ENERPLUS CORP	1,200	13.20	15,840.00	
	HUSKY ENERGY INC	1,900	28.13	53,447.00	
	IMPERIAL OIL LTD	1,500	38.84	58,260.00	
	MEG ENERGY CORPORATION	800	27.18	21,744.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	1,700	19.49	33,133.00	
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	1,500	31.78	47,670.00	
	PENGROWTH ENERGY CORPORATION	2,500	4.69	11,725.00	
	PENN WEST PETROLEUM LIMITED	2,500	8.91	22,275.00	
	SUNCOR ENERGY INC	7,948	28.13	223,577.24	
	TALISMAN ENERGY INC	5,800	11.37	65,946.00	

TOURMALINE OIL CORPORATION	800	37.91	30,328.00
TRANSCANADA CORPORATION	3,600	48.76	175,536.00
VERMILION ENERGY INC	500	47.41	23,705.00
AGNICO-EAGLE MINES	1,000	33.18	33,180.00
AGRIUM INC	800	94.53	75,624.00
BARRICK GOLD CORP	5,200	18.65	96,980.00
CENTERRA GOLD INC	1,300	3.65	4,745.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	3,500	7.23	25,305.00
FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	2,500	16.66	41,650.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	800	38.69	30,952.00
GOLDCORP INC	4,207	28.59	120,278.13
IAMGOLD CORPORATIO	2,500	5.00	12,500.00
KINROSS GOLD CORP	6,356	5.45	34,640.20
NEW GOLD INC	2,400	7.35	17,640.00
OSISKO MINING CORPORATION	2,600	3.68	9,568.00
PAN AMERICAN SILVER CORPORATION	700	12.64	8,848.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	4,400	39.36	173,184.00
SILVER WHEATON CORPORATION	1,800	23.32	41,976.00
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	3,045	25.21	76,764.45
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	1,800	5.82	10,476.00
YAMANA GOLD INC	4,300	11.81	50,783.00
BOMBARDIER INC 'B'	8,300	3.89	32,287.00
CAE INC	1,700	10.57	17,969.00
FINNING INTERNATIONAL INC	900	22.31	20,079.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	800	42.49	33,992.00

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	
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS INCORPORATED	600	19.67	11,802.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,200	98.48	216,656.00	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	900	124.21	111,789.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	1,200	57.60	69,120.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	600	40.56	24,336.00	
	TIM HORTONS INC(CA)	800	54.36	43,488.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	2,000	23.11	46,220.00	
	THOMSON REUTERS CORP(CA)	1,900	33.23	63,137.00	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	400	73.05	29,220.00	
	DOLLARAMA INC	400	73.41	29,364.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	800	60.51	48,408.00	
	EMPIRE COMPANY LIMITED A	200	66.95	13,390.00	
	GEORGE WESTON LIMITED	300	75.39	22,617.00	
	LOBLAW COMPANIES LTD	700	41.28	28,896.00	
	METRO INC	500	65.47	32,735.00	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	1,200	44.38	53,256.00	
	SAPUTO INC	800	49.76	39,808.00	
	CATAMARAN CORPORATION	1,200	56.68	68,016.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	1,500	77.54	116,310.00	
BANK OF MONTREAL	3,400	63.00	214,200.00		
BANK OF NOVA SCOTIA	6,100	56.95	347,395.00		

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,100	78.01	163,821.00
NATIONAL BANK OF CANADA	800	73.48	58,784.00
ROYAL BANK OF CANADA	7,500	61.45	460,875.00
TORONTO-DOMINION BANK(CA)	4,738	80.53	381,551.14
CI FINANCIAL CORPORATION	900	27.90	25,110.00
IGM FINANCIAL INC	500	43.75	21,875.00
ONEX CORPORATION	600	48.12	28,872.00
GREAT-WEST LIFECO INC	1,700	26.26	44,642.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES	500	35.00	17,500.00
INTACT FINANCIAL CORPORATION	800	61.48	49,184.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	9,400	14.24	133,856.00
POWER CORP OF CANADA	1,800	26.03	46,854.00
POWER FINANCIAL CORP	1,400	28.35	39,690.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	3,100	27.11	84,041.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,875	37.79	108,646.25
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	1,350	17.85	24,097.50
BROOKFIELD PROPERTY PARTNERS LP(LP)	165	22.02	3,633.30
CGI GROUP INC -CL A	1,100	26.46	29,106.00
OPEN TEXT CORPORATION	400	56.03	22,412.00
RESEARCH IN MOTION LIMITED	2,400	14.19	34,056.00

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	
	BCE INC	1,400	47.16	66,024.00	
	BELL ALIANT INC	500	26.19	13,095.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	2,000	51.76	103,520.00	
	TELUS CORPORATION	1,200	36.25	43,500.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	300	80.00	24,000.00	
	FORTIS INC	1,000	33.61	33,610.00	
	TRANSALTA CORP	1,600	14.08	22,528.00	
カナダドル建小計		株 202,484	-	カナダドル 6,265,290.21 (609,174,167円)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	978	15.62	15,276.36	
	ENI SPA	13,149	17.39	228,661.11	
	FUGRO NV-CVA	463	42.32	19,594.16	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,700	11.74	19,966.50	
	NESTE OIL OYJ	1,100	11.15	12,265.00	
	OMV AG	832	34.05	28,329.60	
	REPSOL SA	4,309	16.31	70,279.79	
	SAIPEM	1,497	20.65	30,913.05	
	TECHNIP S.A.	574	76.44	43,876.56	
	TENARIS SA	2,441	15.41	37,615.81	
	TOTAL SA	11,006	35.54	391,153.24	
	AIR LIQUIDE SA	1,614	93.28	150,553.92	
AKZO NOBEL	1,231	45.65	56,195.15		

ARCELORMITTAL	5,545	8.76	48,596.38
ARKEMA	376	66.34	24,943.84
BASF SE	4,747	65.63	311,545.61
CRH PLC(IE)	3,753	15.36	57,646.08
HEIDELBERGCEMENT AG	727	50.24	36,524.48
IMERYS SA	247	45.90	11,338.53
K+S AG	943	33.60	31,684.80
KONINKLIJKE DSM NV	893	47.52	42,435.36
LAFARGE SA	965	46.32	44,698.80
LANXESS AG	430	52.63	22,630.90
LINDE AG	957	140.00	133,980.00
SALZGITTER AG	292	29.23	8,536.62
SOLVAY SA	350	100.45	35,157.50
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	3,115	4.81	14,983.15
THYSSENKRUPP AG	2,181	13.31	29,029.11
UMICORE	644	33.62	21,654.50
UPM-KYMMENE OYJ	3,192	7.70	24,594.36
VOESTALPINE AG	762	22.40	17,068.80

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユ - 口		株	ユ - 口	ユ - 口	
	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	982	17.98	17,661.27	
	ALSTOM	1,195	29.44	35,180.80	
	ANDRITZ AG	376	48.68	18,303.68	
	BOSKALIS WESTMINSTER NV	485	30.90	14,986.50	
	BOUYGUES SA	1,147	21.00	24,087.00	
	BRENTAG AG	266	123.30	32,797.80	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	2,180	28.37	61,846.60	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE & SPACE CO	2,393	39.93	95,552.49	
	FERROVIAL SA	2,449	12.17	29,804.33	
	FIAT INDUSTRIAL SPA	4,424	8.68	38,400.32	
	FINMECCANICA SPA	2,733	3.95	10,811.74	
	GEA GROUP AG	1,060	24.87	26,362.20	
	HOCHTIEF AG	174	50.06	8,710.44	
	KONE OYJ-B	880	59.40	52,272.00	
	KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRONICS NV	4,947	21.66	107,176.75	
	LEGRAND SA	1,225	33.20	40,670.00	
	MAN SE	273	83.97	22,923.81	
	METSO OYJ	776	28.80	22,348.80	
	PRYSMIAN SPA	1,151	14.40	16,574.40	
	REXEL SA	695	15.71	10,921.92	
SAFRAN SA	1,296	34.96	45,314.64		
SCHNEIDER ELECTRIC SA	2,720	53.15	144,568.00		
SIEMENS AG-REG	4,326	76.14	329,381.64		
THALES SA	471	32.00	15,072.00		
VALLOUREC SA	627	33.84	21,217.68		
VINCI SA	2,383	34.58	82,404.14		
WARTSILA OYJ-B SHARES	867	35.40	30,691.80		

ZARDOYA OTIS SA	1,200	10.42	12,504.00
ZODIAC AEROSPACE	220	92.89	20,435.80
BUREAU VERITAS SA	336	91.63	30,787.68
EDENRED	958	24.69	23,653.02
RANDSTAD HOLDING NV	766	28.55	21,873.13
SOCIETE BIC SA	174	84.99	14,788.26
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,895	13.18	24,976.10
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	206	64.85	13,359.10
ATLANTIA SPA	1,710	12.74	21,785.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,189	13.91	16,544.93
DEUTSCHE POST AG-REG	4,687	17.32	81,202.27
FRAPORT AG	208	44.63	9,284.08
GROUPE EUROTUNNEL SA	3,168	6.12	19,413.50

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユ - 口		株	ユ - 口	ユ - 口	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	4,795	2.94	14,135.66	
	KONINKLIJKE VOPAK NV	427	44.00	18,790.13	
	TNT EXPRESS NV	1,979	5.80	11,490.07	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,711	64.84	110,941.24	
	BMW-PFD	317	49.48	15,686.74	
	CONTINENTAL AG	602	82.60	49,725.20	
	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	4,689	38.84	182,120.76	
	FIAT SPA	4,524	4.18	18,910.32	
	MICHELIN (CGDE) -B	941	60.05	56,507.05	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	580	31.10	18,038.00	
	PEUGEOT SA	1,490	5.35	7,971.50	
	PIRELLI & C SPA	1,444	7.36	10,635.06	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	791	53.62	42,413.42	
	RENAULT SA	994	46.57	46,290.58	
	VOLKSWAGEN AG	167	136.25	22,753.75	
	VOLKSWAGEN AG-PFD	748	141.00	105,468.00	
	ADIDAS AG	1,081	76.53	82,728.93	
	CHRISTIAN DIOR SA	316	122.70	38,773.20	
	HUGO BOSS AG-ORD	134	84.01	11,257.34	
	LUXOTTICA GROUP SPA	851	39.38	33,512.38	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	1,312	123.30	161,769.60	
	ACCOR SA	835	25.37	21,188.12	
	OPAP SA	1,797	7.02	12,614.94	
	SODEXO	533	62.74	33,440.42	
	AXEL SPRINGER AG	342	34.08	11,655.36	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	687	26.44	18,167.71	
	JC DECAUX SA	563	19.50	10,978.50	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	458	72.41	33,163.78	
	LAGARDERE S.C.A.	717	27.31	19,581.27	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	587	26.87	15,772.69		
PUBLICIS GROUPE	1,001	50.79	50,840.79		
REED ELSEVIER NV(NL)	3,560	12.63	44,980.60		
SES	1,663	23.13	38,473.50		

TELENET GROUP HOLDING NV	366	40.93	14,980.38
WOLTERS KLUWER NV-CVA	1,560	16.74	26,114.40
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	1,128	96.97	109,382.16
PPR	391	166.00	64,906.00
CARREFOUR SA	3,116	21.05	65,607.38
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	336	80.35	26,997.60
COLRUYT SA	392	37.12	14,551.04
DELHAIZE GROUP	576	42.67	24,580.80

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユ - 口		株	ユ - 口	ユ - 口	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	3,160	5.78	18,280.60	
	JERONIMO MARTINS SGPS SA	1,138	16.02	18,230.76	
	KESKO OYJ-B SHS	359	21.75	7,808.25	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	5,517	11.38	62,783.46	
	METRO AG	733	21.96	16,096.68	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	4,152	75.60	313,891.20	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING COMPANY SA	1,139	18.40	20,957.60	
	DANONE	2,992	58.72	175,690.24	
	DE MASTER BLENDERS 1753 NV	2,768	12.13	33,589.68	
	HEINEKEN HOLDING NV	612	48.19	29,495.34	
	HEINEKEN NV	1,191	56.11	66,827.01	
	KERRY GROUP PLC-A	772	44.34	34,230.48	
	PERNOD-RICARD SA	1,097	94.53	103,699.41	
	REMY COINTREAU SA	144	88.18	12,697.92	
	SUEDZUCKER AG	402	30.60	12,303.21	
	UNILEVER NV-CVA	8,420	31.46	264,935.30	
	BEIERSDORF AG	521	68.66	35,771.86	
	HENKEL AG & CO KGAA	671	57.67	38,696.57	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	921	69.11	63,650.31	
	L'OREAL	1,257	126.40	158,884.80	
	CELESIO AG	440	14.53	6,395.40	
	ESSILOR INTERNATIONAL SA	1,046	82.99	86,807.54	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	1,093	52.99	57,918.07	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	644	95.97	61,804.68	
	BAYER AG	4,274	78.32	334,739.68	
	ELAN CORPORATION PLC	2,611	8.90	23,245.73	
	GRIFOLS SA	905	28.54	25,828.70	
	MERCK KGAA	334	117.45	39,228.30	
	ORION OYJ-CLASS B	501	20.54	10,290.54	
	QIAGEN NV	1,222	15.52	18,965.44	
	SANOFI	6,157	80.64	496,500.48	
UCB SA	569	47.22	26,871.02		
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	31,043	0.19	6,158.93		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	28,164	6.83	192,360.12		
BANCO DE SABADELL SA	14,697	1.45	21,413.52		
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	12,234	0.77	9,420.18		

BANCO POPOLARE SPA	11,306	1.05	11,905.21
BANCO POPULAR ESPANOL SA	32,416	0.56	18,250.20
BANCO SANTANDER SA	54,473	5.22	284,784.84
BANKIA SA	6,391	0.17	1,086.47
BNP PARIBAS	5,185	38.96	202,033.52

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユ - 口		株	ユ - 口	ユ - 口	
	CAIXABANK	5,828	2.62	15,281.01	
	COMMERZBANK AG	23,484	1.14	26,795.24	
	CREDIT AGRICOLE SA	5,784	6.23	36,069.02	
	ERSTE GROUP BANK AG	1,311	23.55	30,880.60	
	INTESA SANPAOLO	52,081	1.29	67,392.81	
	INTESA SANPAOLO-RSP	9,145	1.08	9,931.47	
	KBC GROEP NV	1,368	27.17	37,168.56	
	NATIXIS SA	5,891	3.09	18,250.31	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	315	25.49	8,030.92	
	SOCIETE GENERALE	3,630	24.78	89,951.40	
	UNICREDIT SPA	20,939	3.62	75,966.69	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	5,745	2.94	16,924.77	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,804	30.10	144,600.40	
	DEUTSCHE BOERSE AG	998	45.22	45,134.55	
	EURAZEO	270	38.31	10,343.70	
	EXOR SPA	362	22.02	7,971.24	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	490	58.25	28,542.50	
	ING GROEP NV-CVA	19,798	5.87	116,214.26	
	MEDIOBANCA SPA	3,553	4.58	16,286.95	
	POHJOLA BANK PLC	716	11.91	8,527.56	
	WENDEL	223	77.36	17,251.28	
	AEGON NV	9,174	4.51	41,411.43	
	AGEAS	1,305	25.53	33,316.65	
	ALLIANZ SE-REG	2,357	103.65	244,303.05	
	ASSICURAZIONI GENERALI	6,035	12.82	77,368.70	
	AXA	9,140	12.99	118,774.30	
	CNP ASSURANCES	1,009	10.75	10,851.79	
	DELTA LLOYD NV	611	13.31	8,135.46	
	HANNOVER RUECK SE	312	60.24	18,794.88	
	MAPFRE SA	5,115	2.59	13,263.19	
	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	927	148.10	137,288.70	
	SAMPO OYJ-A SHS	2,166	28.29	61,276.14	
	SCOR SE	991	22.65	22,446.15	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG	198	38.04	7,531.92		
IMMOFINANZ AG	4,809	3.01	14,513.56		
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	1,771	21.43	37,961.38		
ATOS	284	50.60	14,370.40		
CAP GEMINI SA	898	33.68	30,249.13		
DASSAULT SYSTEMES SA	376	89.05	33,482.80		
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00		
SAP AG	4,762	57.85	275,481.70		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	株 604	ユーロ 20.15	ユーロ 12,173.62	
	GEMALTO NV	409	60.74	24,842.66	
	NOKIA OYJ	19,357	2.31	44,753.38	
	BELGACOM SA	923	19.10	17,633.91	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	14,519	8.67	125,952.32	
	ELISA OYJ	998	13.44	13,413.12	
	FRANCE TELECOM SA	9,584	7.60	72,895.90	
	ILIAD SA	141	162.05	22,849.05	
	KONINKLIJKE KPN NV	6,473	2.76	17,897.84	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	3,244	3.81	12,366.12	
	TELECOM ITALIA SPA	53,084	0.58	31,213.39	
	TELECOM ITALIA-RSP	34,061	0.50	17,354.07	
	TELEFONICA SA	21,171	10.58	223,989.18	
	TELEKOM AUSTRIA AG	1,383	4.95	6,845.85	
	VIVENDI	6,841	16.13	110,379.53	
	ZIGGO NV	731	28.24	20,643.44	
	ACCIONA SA	173	43.38	7,505.60	
	E.ON SE	9,309	13.13	122,273.71	
	ELECTRICITE DE FRANCE	1,242	15.77	19,586.34	
	ENAGAS SA	1,241	19.02	23,603.82	
	ENEL GREEN POWER SPA	11,501	1.53	17,700.03	
	ENEL SPA	34,023	2.66	90,773.36	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	9,865	2.50	24,692.09	
	FORTUM OYJ	2,431	13.93	33,863.83	
	GAS NATURAL SDG SA	1,980	14.64	28,997.10	
	GDF SUEZ	6,857	15.66	107,380.62	
	IBERDROLA SA	24,350	3.78	92,116.05	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	657	37.60	24,703.20	
	RWE AG	2,530	26.09	66,020.35	
	RWE AG-NON VTG PFD	362	24.82	8,986.65	
SNAM SPA	8,740	3.77	33,019.72		
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	1,586	9.84	15,606.24		
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	8,169	3.41	27,856.29		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,918	9.38	18,008.10		
VERBUND AG	511	16.23	8,293.53		
ASML HOLDING NV	1,628	55.47	90,305.16		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	6,145	5.45	33,545.55		
STMICROELECTRONICS NV	3,603	5.53	19,957.01		
ユーロ建小計		株 974,722	-	ユーロ 12,549,139.01 (1,634,776,338円)	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
英ポンド	AMEC PLC	株 1,956	英ポンド 9.99	英ポンド 19,550.22	

BG GROUP PLC	17,583	10.38	182,511.54
BP PLC	98,541	4.46	440,182.64
PETROFAC LIMITED	1,575	13.02	20,506.50
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	19,322	20.92	404,216.24
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	13,543	21.48	290,903.64
TULLOW OIL PLC	4,691	10.48	49,161.68
ANGLO AMERICAN PLC	7,189	15.96	114,772.38
ANTOFAGASTA PLC	2,283	9.02	20,604.07
BHP BILLITON PLC(UK)	10,917	17.82	194,595.52
CRODA INTERNATIONAL PLC	699	25.48	17,810.52
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	1,750	2.91	5,092.50
EVRAZ PLC	2,164	1.61	3,501.35
FRESNILLO PLC	1,218	11.17	13,605.06
GLENORE INTERNATIONAL PLC	20,183	3.14	63,515.90
JOHNSON MATTHEY PLC	1,158	23.89	27,664.62
KAZAKHMYS PLC	1,484	3.85	5,723.78
RANDGOLD RESOURCES LIMITED	452	46.64	21,081.28
REXAM PLC	4,793	5.13	24,588.09
RIO TINTO PLC(UK)	6,929	29.20	202,326.80
VEDANTA RESOURCES PLC	812	11.51	9,346.12
XSTRATA PLC	10,864	9.57	103,968.48
BAE SYSTEMS PLC	16,801	3.80	63,877.40
BALFOUR BEATTY PLC	4,693	2.46	11,572.93
BUNZL PLC	1,817	12.56	22,821.52
COBHAM PLC	5,575	2.39	13,363.27
IMI PLC	1,662	11.74	19,511.88
INVENSYS PLC	4,599	3.47	15,972.32
MEGGITT PLC	4,749	4.75	22,600.49
MELROSE INDUSTRIES PLC	7,772	2.44	19,010.31
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	9,678	11.23	108,683.94
SMITHS GROUP PLC	2,032	12.29	24,973.28
THE WEIR GROUP PLC	1,098	21.31	23,398.38
WOLSELEY PLC	1,416	31.33	44,363.28
AGGREKO PLC	1,387	17.69	24,536.03
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	1,862	10.40	19,364.80
CAPITA PLC	3,696	8.53	31,526.88
EXPERIAN PLC	5,221	11.19	58,422.99
G4S PLC	7,292	3.01	22,014.54
INTERTEK GROUP PLC	931	33.49	31,179.19
SERCO GROUP PLC	3,025	6.06	18,346.62

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	
	GKN PLC	9,207	2.56	23,588.33	
	BURBERRY GROUP PLC	2,284	12.99	29,669.16	
	CARNIVAL PLC(UK)	1,031	22.94	23,651.14	
	COMPASS GROUP PLC	9,502	8.24	78,296.48	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,391	18.66	25,956.06	
TUI TRAVEL PLC	3,418	3.03	10,383.88		

WHITBREAD PLC	1,009	24.50	24,720.50
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	5,490	8.39	46,088.55
ITV PLC	19,207	1.23	23,663.02
PEARSON PLC	4,223	11.20	47,297.60
REED ELSEVIER PLC(UK)	6,204	7.62	47,305.50
WPP PLC	6,532	10.47	68,390.04
KINGFISHER PLC	13,393	2.88	38,598.62
MARKS & SPENCER GROUP PLC	8,312	3.98	33,098.38
NEXT PLC	883	43.20	38,145.60
SAINSBURY (J) PLC	6,344	3.77	23,967.63
TESCO PLC	41,566	3.63	150,884.58
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	11,587	2.81	32,571.05
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,841	18.47	34,003.27
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	9,988	35.26	352,226.82
DIAGEO PLC	12,951	19.75	255,782.25
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	5,100	22.60	115,260.00
SABMILLER PLC	4,949	33.82	167,399.92
TATE & LYLE PLC	2,829	8.37	23,692.87
UNILEVER PLC	6,634	27.76	184,159.84
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3,345	47.09	157,516.05
SMITH & NEPHEW PLC	5,082	7.20	36,590.40
ASTRAZENECA PLC	6,436	33.46	215,348.56
GLAXOSMITHKLINE PLC	25,377	16.52	419,228.04
SHIRE PLC	2,897	19.67	56,983.99
BARCLAYS PLC	60,108	2.86	172,119.25
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	95,137	6.79	646,170.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	218,156	0.47	103,602.28
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	10,982	2.80	30,804.51
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	12,462	15.98	199,142.76
3I GROUP PLC	5,021	3.20	16,082.26
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	5,546	4.00	22,200.63
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,444	9.60	13,869.62
ICAP PLC	2,839	2.86	8,125.21
INVESTEC PLC	3,511	4.39	15,444.88
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	911	12.96	11,806.56
SCHRODERS PLC	763	21.55	16,442.65

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	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,060	13.31	14,108.60	
	AVIVA PLC	15,224	2.95	45,002.14	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	30,558	1.68	51,612.46	
	OLD MUTUAL PLC	25,290	1.99	50,529.42	
	PRUDENTIAL PLC	13,216	10.36	136,917.76	
	RESOLUTION LIMITED	8,449	2.51	21,257.68	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	20,077	1.08	21,703.23	
	STANDARD LIFE PLC	12,188	3.34	40,744.48	
	SAGE GROUP PLC (THE)	6,269	3.40	21,352.21	
BT GROUP PLC	40,718	2.77	113,033.16		

	INMARSAT PLC	2,315	6.89	15,950.35
	VODAFONE GROUP PLC	254,223	1.93	491,285.94
	CENTRICA PLC	26,870	3.82	102,777.75
	NATIONAL GRID PLC	18,805	7.95	149,593.77
	SEVERN TRENT PLC	1,232	17.95	22,114.40
	SSE PLC	4,954	15.32	75,895.28
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	3,525	7.42	26,173.12
	ARM HOLDINGS PLC	7,130	8.72	62,209.25
	英ポンド建小計	株 1,463,407	-	英ポンド 8,333,309.22 (1,263,663,010円)
スイスフラン		株	スイスフラン	スイスフラン
	TRANSOCEAN LIMITED(CHF)	1,967	44.94	88,396.98
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	50	260.00	13,000.00
	GIVAUDAN-REG	43	1,147.00	49,321.00
	HOLCIM LTD-REG	1,183	68.25	80,739.75
	SIKA AG-BR	11	2,097.00	23,067.00
	SYNGENTA AG(CH)	481	389.90	187,541.90
	ABB LIMITED-REG	11,366	19.93	226,524.38
	GEBERIT AG-REG	191	216.20	41,294.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	131	132.70	17,383.70
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	251	134.10	33,659.10
	SULZER AG-REG	124	151.20	18,748.80
	ADECCO SA-REG	749	48.62	36,416.38
	SGS SA-REG	28	2,216.00	62,048.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	279	103.30	28,820.70
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	2,698	69.15	186,566.70
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	245	90.00	22,050.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	159	518.50	82,441.50
	ARYZTA AG	493	57.05	28,125.65
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	14	877.00	12,278.00

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	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	1	42,305.00	42,305.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	5	3,640.00	18,200.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	16,669	65.30	1,088,485.70	
	SONOVA HOLDING AG-REG	259	98.00	25,382.00	
	ACTELION LTD-REG	635	53.90	34,226.50	
	LONZA GROUP AG-REG	274	60.80	16,659.20	
	NOVARTIS AG-REG SHS	11,890	67.30	800,197.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,631	227.50	826,052.50	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	19	552.00	10,488.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	6,482	25.53	165,485.46	
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	1,225	34.87	42,715.75	
	PARGESA HOLDING SA-BR	140	61.45	8,603.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	101	235.30	23,765.30	
	UBS AG-REGISTERED	18,822	14.70	276,683.40	

	BALOISE HOLDING AG-REG	246	89.15	21,930.90
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	158	137.70	21,756.60
	SWISS RE LIMITED	1,820	68.80	125,216.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	762	242.00	184,404.00
	SWISS PRIME SITE AG-REG	316	73.40	23,194.40
	SWISSCOM AG-REG	132	423.40	55,888.80
	スイスフラン建小計	株 84,050	-	スイスフラン 5,050,063.25 (539,700,259円)
スウェーデン ンクローナ		株	スウェーデン ンクローナ	スウェーデンクローナ
	LUNDIN PETROLEUM AB	1,351	148.50	200,623.50
	BOLIDEN AB	1,414	98.20	138,854.80
	ALFA LAVAL AB	1,897	141.80	268,994.60
	ASSA ABLOY AB-B	1,829	248.00	453,592.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	3,676	171.00	628,596.00
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,136	152.50	325,740.00
	SANDVIK AB	5,187	92.60	480,316.20
	SCANIA AB-B SHS	1,943	128.10	248,898.30
	SKANSKA AB-B SHS	1,964	104.60	205,434.40
	SKF AB-B SHARES	2,216	150.00	332,400.00
	VOLVO AB-B SHS	7,885	86.00	678,110.00
	SECURITAS AB-B SHS	2,279	59.50	135,600.50
	ELECTROLUX AB-SER B	1,461	166.40	243,110.40
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,282	35.60	81,239.20
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	4,908	226.70	1,112,643.60
	SWEDISH MATCH AB	1,065	216.50	230,572.50

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
スウェーデン ンクローナ		株	スウェーデン ンクローナ	スウェーデンクローナ	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	3,178	162.30	515,789.40	
	ELEKTA AB-B SHS	1,905	98.35	187,356.75	
	GETINGE AB-B SHS	1,215	190.50	231,457.50	
	NORDEA BANK AB	13,607	73.25	996,712.75	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	7,721	64.50	498,004.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	2,568	266.00	683,088.00	
	SWEDBANK AB-A SHARES	4,179	141.00	589,239.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	903	113.50	102,490.50	
	INVESTOR AB-B SHS	2,354	177.20	417,128.80	
	KINNEVIK INVESTMENT AB	1,249	162.50	202,962.50	
	RATOS AB-B SHS	1,301	59.80	77,799.80	
	ERICSSON LM-B SHS	15,730	76.55	1,204,131.50	
	HEXAGON AB-B SHS	1,371	166.00	227,586.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	405	505.00	204,525.00	
	TELE2 AB-B SHS	1,929	110.10	212,382.90	
	TELIASONERA AB	11,191	42.47	475,281.77	
	スウェーデンクローナ建小計	株 114,299	-	スウェーデンクローナ 12,590,662.67 (192,385,325円)	

銘柄	株数	単価	金額
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	998	99.55	99,350.90
SEADRILL LIMITED	1,819	210.40	382,717.60
STATOIL ASA	5,769	135.80	783,430.20
SUBSEA 7 SA	1,709	124.70	213,112.30
NORSK HYDRO ASA	5,880	25.72	151,233.60
YARA INTERNATIONAL ASA	1,057	270.30	285,707.10
ORKLA ASA	4,362	49.18	214,523.16
DNB ASA	5,051	82.70	417,717.70
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,359	96.70	131,415.30
TELENOR ASA	3,628	129.20	468,737.60
ノルウェークローネ建小計	株 31,632	-	ノルウェークローネ 3,147,945.46 (53,987,264円)

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	株	デンマーククローネ	デンマーククローネ	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,380	207.20	285,936.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	3	38,900.00	116,700.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	7	40,480.00	283,360.00	
	DSV A/S	972	134.70	130,928.40	
	CARLSBERG AS-B	553	546.50	302,214.50	
	COLOPLAST A/S	644	294.00	189,336.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	200	450.10	90,020.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	2,105	948.50	1,996,592.50	
	DANSKE BANK A/S	3,389	102.80	348,389.20	
	TRYG A/S	139	455.60	63,328.40	
	TDC A/S	3,613	43.46	157,020.98	
デンマーククローネ建小計	株 13,005	-		デンマーククローネ 3,963,825.98 (69,287,678円)	
オーストラリアドル	株	株	オーストラリアドル	オーストラリアドル	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	763	20.50	15,641.50	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	5,653	12.12	68,514.36	
	SANTOS LTD	4,968	11.65	57,877.20	
	WHITEHAVEN COAL LIMITED	2,945	1.92	5,669.12	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	3,407	34.10	116,178.70	
	WORLEYPARSONS LIMITED	1,163	22.66	26,353.58	
	ALUMINA LIMITED	16,916	0.95	16,070.20	
	AMCOR LTD	6,237	9.16	57,130.92	
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	16,601	31.40	521,271.40	
	BORAL LIMITED	5,014	4.73	23,716.22	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	8,044	3.77	30,325.88	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	2,164	8.74	18,913.36	
	INCITEC PIVOT LIMITED	9,206	2.87	26,421.22	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	2,814	9.34	26,282.76	
	NEWCREST MINING LIMITED	3,959	16.65	65,917.35	
	ORICA LTD	2,067	22.06	45,598.02	

OZ MINERALS LIMITED	2,510	4.81	12,073.10
RIO TINTO LIMITED(AU)	2,252	54.32	122,328.64
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	1,236	8.90	11,000.40
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	939	19.21	18,038.19
ALS LIMITED	1,925	9.40	18,095.00
BRAMBLES LTD	8,519	8.38	71,389.22
ASCIANO LIMITED	5,042	5.19	26,167.98
AURIZON HOLDINGS LIMITED	9,390	3.82	35,869.80

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	
	QANTAS AIRWAYS LTD	5,737	1.75	10,039.75	
	SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	962	3.37	3,241.94	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	4,560	5.57	25,399.20	
	TRANSURBAN GROUP	7,435	6.55	48,699.25	
	CROWN LTD	2,319	12.45	28,871.55	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	4,748	3.46	16,428.08	
	FLIGHT CENTRE LIMITED	335	35.51	11,895.85	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	4,748	3.25	15,431.00	
	TATTS GROUP LTD	8,275	3.19	26,397.25	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	4,511	2.74	12,360.14	
	METCASH LTD	5,329	4.05	21,582.45	
	WESFARMERS LIMITED	5,203	41.76	217,277.28	
	WOOLWORTHS LIMITED	6,370	35.49	226,071.30	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	2,955	14.50	42,847.50	
	TREASURY WINE ESTATES LIMITED	3,941	5.77	22,739.57	
	COCHLEAR LIMITED	330	62.17	20,516.10	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	742	31.14	23,105.88	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,942	12.84	24,935.28	
	CSL LIMITED	2,593	60.05	155,709.65	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	14,052	28.41	399,217.32	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	2,107	10.13	21,343.91	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	8,318	68.78	572,112.04	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	12,003	31.45	377,494.35	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	15,927	31.23	497,400.21	
	ASX LTD	1,063	36.17	38,448.71	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,826	35.98	65,699.48	
	AMP LIMITED	15,147	5.06	76,643.82	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	10,746	5.63	60,499.98	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	6,551	13.00	85,163.00	
SUNCORP GROUP LIMITED	6,650	11.99	79,733.50		
LEND LEASE GROUP	3,076	10.23	31,467.48		
COMPUTERSHARE LIMITED	2,298	9.55	21,945.90		
TELSTRA CORPORATION	22,511	4.76	107,152.36		
AGL ENERGY LIMITED	3,177	15.42	48,989.34		
APA GROUP	5,038	6.24	31,437.12		
SP AUSNET	11,580	1.22	14,185.50		

オーストラリアドル建小計	株 338,839	-	オーストラリアドル 4,919,327.16 (504,034,260円)
--------------	--------------	---	---

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
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	8.41	37,012.41	
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	4,786	2.94	14,070.84	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	2,982	4.26	12,703.32	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND(NZ)	11,825	2.53	29,917.25	
	CONTACT ENERGY LIMITED	2,496	5.31	13,253.76	
ニュージーランドドル建小計		株 26,490	-	ニュージーランドドル 106,957.58 (8,975,880円)	
香港ドル		株	香港ドル	香港ドル	
	HOPEWELL HOLDINGS LIMITED	3,500	29.35	102,725.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	11,000	80.80	888,800.00	
	NWS HOLDINGS LIMITED	6,500	13.78	89,570.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	6,000	13.08	78,480.00	
	MTR CORPORATION	7,500	30.10	225,750.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LIMITED	1,000	46.55	46,550.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	4,000	25.90	103,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	11,000	31.15	342,650.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	6,000	16.66	99,960.00	
	SANDS CHINA LIMITED	13,600	39.40	535,840.00	
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	8,000	14.04	112,320.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	12,000	18.56	222,720.00	
	WYNN MACAU LIMITED	8,000	21.25	170,000.00	
	LI & FUNG LIMITED	32,000	10.06	321,920.00	
	BANK OF EAST ASIA	6,900	30.15	208,035.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	19,000	25.65	487,350.00	
	HANG SENG BANK LTD	4,000	124.80	499,200.00	
	WING HANG BANK LIMITED	1,500	80.65	120,975.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	10,000	10.70	107,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	5,600	128.40	719,040.00	
	AIA GROUP LIMITED	62,200	33.30	2,071,260.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	7,000	116.50	815,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	13,000	30.25	393,250.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	5,000	56.05	280,250.00		
HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	3,000	37.10	111,300.00		
KERRY PROPERTIES LIMITED	4,000	33.95	135,800.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	22,000	13.16	289,520.00		
SINO LAND CO	18,000	12.76	229,680.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	8,000	110.90	887,200.00		

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	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	4,000	96.00	384,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	7,200	26.80	192,960.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	8,000	68.30	546,400.00	
	WHEELOK AND COMPANY LTD	6,000	41.95	251,700.00	
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	14,000	7.86	110,040.00	
	PCCW LIMITED	32,000	3.92	125,440.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	3,000	55.05	165,150.00	
	CLP HOLDINGS LTD	9,000	67.05	603,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	26,796	23.05	617,647.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	7,000	73.05	511,350.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	1,100	77.45	85,195.00		
香港ドル建小計		株 437,396	-	香港ドル 14,289,577.80 (183,621,074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	
	FRASER AND NEAVE LTD	5,000	9.44	47,200.00	
	KEPPEL CORPORATION LIMITED	6,900	11.19	77,211.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	22,636	1.13	25,578.68	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	6,000	4.90	29,400.00	
	SEMBICORP MARINE LIMITED	5,000	4.25	21,250.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	9,000	4.38	39,420.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	14,000	0.92	12,950.00	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	14,000	1.92	26,950.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,000	10.91	32,730.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	32,000	1.39	44,640.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	8,000	4.28	34,240.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	1,000	50.64	50,640.00	
	OLAM INTERNATIONAL LIMITED	10,000	1.65	16,500.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	48,000	0.52	25,200.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	10,000	3.34	33,400.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	9,000	15.69	141,210.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	13,000	10.80	140,400.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	7,000	20.88	146,160.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	4,000	7.72	30,880.00	
CAPITALAND LTD	13,000	3.51	45,630.00		
CAPITAMALLS ASIA LIMITED	8,000	1.98	15,840.00		
CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	11.25	33,750.00		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	13,000	2.76	35,880.00		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
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	
	KEPPEL LAND LIMITED	4,000	4.14	16,560.00	

	UOL GROUP LIMITED	2,000	7.04	14,080.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	41,000	3.69	151,290.00
	STARHUB LIMITED	3,000	4.53	13,590.00
	シンガポールドル建小計	株 314,536	-	シンガポールドル 1,302,579.68 (104,974,896円)
イスラエル シュケル	DELEK GROUP LIMITED	31	921.80	28,575.80
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	2,517	43.64	109,841.88
	THE ISRAEL CORPORATION LIMITED	19	2,330.00	44,270.00
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	4,632	138.00	639,216.00
	BANK HAPOALIM BM	6,228	16.19	100,831.32
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	7,960	12.06	95,997.60
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	987	36.50	36,025.50
	NICE SYSTEMS LIMITED	300	125.10	37,530.00
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	14,168	5.41	76,663.04
	MELLANOX TECHNOLOGIES LIMITED	229	215.20	49,280.80
	イスラエルシュケル建小計	株 37,071	-	イスラエルシュケル 1,218,231.94 (33,501,378円)
	合計	株 5,639,216	-	円 12,602,152,123 (12,602,152,123)

(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			米ドル	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	27,000	21,870.00	
	米ドル建小計		27,000	米ドル 21,870.00 (2,181,532円)	
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORPORATION	2,000	63,600.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	2,000	162,100.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	5,300	82,892.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	618	82,237.26	
		BOSTON PROPERTIES INC	800	87,840.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	400	28,668.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	600	44,262.00	
		DUKE REALTY CORP	1,800	31,554.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,700	98,549.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	300	34,011.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	2,368	50,983.04	
		HCP INC	2,300	121,233.00	
		HEALTH CARE REIT INC	1,300	94,406.00	
		HOST HOTELS & RESORTS	3,728	65,500.96	
		KIMCO REALTY CORP	2,200	50,358.00	

	LIBERTY PROPERTY	600	24,846.00	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	800	41,832.00	
	PROLOGIS INC	2,440	101,479.60	
	PUBLIC STORAGE	800	127,040.00	
	RAYONIER INC	700	40,565.00	
	REALTY INCOME CORP	900	44,100.00	
	REGENCY CENTERS CORPORATION	600	32,472.00	
	SIMON PROPERTY GROUP	1,589	279,838.79	
	SL GREEN REALTY CORPORATION	500	43,850.00	
	THE MACERICH COMPANY	700	47,026.00	
	UDR INC	1,500	36,840.00	
	VENTAS INC	1,500	118,575.00	
	VORNADO REALTY TRUST	937	80,600.74	
	WEYERHAEUSER COMPANY	2,798	83,492.32	
	米ドル建小計	43,778	米ドル 2,200,751.71 (219,524,983円)	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	600	カナダドル 14,010.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	900	25,362.00	
		カナダドル建小計	1,500	カナダドル 39,372.00 (3,828,139円)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	404	ユーロ 14,798.52	
		FONCIERE DES REGIONS	198	11,979.00	
		GECINA SA	159	14,023.80	
		ICADE	121	7,940.02	
		KLEPIERRE	564	17,185.08	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	477	89,389.80	
ユーロ建小計	1,923	ユーロ 155,316.22 (20,233,043円)			
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	5,272	英ポンド 30,182.20	
		HAMMERSON PLC	3,684	18,935.76	
		INTU PROPERTIES PLC	3,843	13,204.54	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	4,030	34,778.90	
		SEGRO PLC	5,141	13,052.99	
英ポンド建小計	21,970	英ポンド 110,154.39 (16,703,811円)			
オーストラリアドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	12,602	オーストラリアドル 27,598.38	
		DEXUS PROPERTY GROUP	23,762	27,088.68	
		FEDERATION CENTRES	8,228	20,405.44	
		GOODMAN GROUP	8,796	45,387.36	

	GPT GROUP	7,306	29,881.54	
	MIRVAC GROUP	17,706	30,454.32	
	STOCKLAND	11,385	43,718.40	
	WESTFIELD GROUP	11,048	129,372.08	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	16,400	53,464.00	
	オーストラリアドル建小計	117,233	オーストラリアドル 407,370.20 (41,739,150円)	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
香港ドル	投資証券	THE LINK REIT	13,000	香港ドル 574,600.00	
	香港ドル建小計		13,000	香港ドル 574,600.00 (7,383,610円)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,000	シンガポールドル 29,920.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	12,000	19,920.00	
		CAPITAMALL TRUST	15,000	33,900.00	
	シンガポールドル建小計		38,000	シンガポールドル 83,740.00 (6,748,606円)	
	合計		-	円 318,342,874 (318,342,874)	

(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 574銘柄	53.7%	-	-	57.3%
	投資信託受益証券 1銘柄	-	0.0%	-	0.0%
	投資証券 29銘柄	-	-	1.6%	1.7%
カナダドル	株式 94銘柄	4.4%	-	-	4.7%
	投資証券 2銘柄	-	-	0.0%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	11.9%	-	-	12.7%
	投資証券 6銘柄	-	-	0.1%	0.2%
英ポンド	株式 101銘柄	9.2%	-	-	9.8%
	投資証券 5銘柄	-	-	0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.9%	-	-	4.2%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	1.4%	-	-	1.5%

ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.4%	-	-	0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	0.5%	-	-	0.5%
オーストラリアドル	株式	60銘柄	3.7%	-	-	3.9%
	投資証券	9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	40銘柄	1.3%	-	-	1.4%
	投資証券	1銘柄	-	-	0.1%	0.1%
シンガポールドル	株式	27銘柄	0.8%	-	-	0.8%
	投資証券	3銘柄	-	-	0.0%	0.1%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	0.2%	-	-	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24年10月22日現在]	[平成25年4月22日現在]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,147,178	47,736,656
国債証券	12,438,632,100	13,614,633,800
地方債証券	1,132,035,700	1,250,488,500
特殊債券	1,374,718,800	1,475,243,400
社債券	841,940,000	743,780,000
未収入金	10,499,100	-
未収利息	44,562,570	44,956,208
前払費用	1,188,179	1,957,382
流動資産合計	15,859,723,627	17,178,795,946
資産合計	15,859,723,627	17,178,795,946
負債の部		
流動負債		
未払金	-	21,989,300
未払解約金	-	300,000
流動負債合計	-	22,289,300
負債合計	-	22,289,300
純資産の部		

元本等		
元本	13,887,186,265	14,777,050,461
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,972,537,362	2,379,456,185
元本等合計	15,859,723,627	17,156,506,646
純資産合計	15,859,723,627	17,156,506,646
負債純資産合計	15,859,723,627	17,178,795,946

(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24年10月23日 至 平成25年 4月22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。

(貸借対照表に関する注記)

[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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 13,887,186,265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 14,777,050,461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 1.1420円 (1万口当たり純資産額) (11,420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 1.1610円 (1万口当たり純資産額) (11,610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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	14,605,107,257円	13,887,186,265円
同期中における追加設定元本額	122,648,830円	1,450,612,728円
同期中における一部解約元本額	840,569,822円	560,748,532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）	106,819,838円	106,774,641円
新光7資産バランスファンド	942,995,923円	998,898,224円
日本債券ファンド	267,415,669円	281,142,371円
新光日本債券インデックスVA	2,451,050,804円	2,840,278,176円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,021,094,328円	2,275,158,485円

新光ワールドバランスファンドVA(適格機関投資家私募)	2,984,957,031円	3,054,878,711円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	733,525,835円	552,220,776円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	3,054,588,140円	3,246,825,617円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	1,324,738,697円	1,420,873,460円
合 計	13,887,186,265円	14,777,050,461円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	80,692,200	126,547,600
地方債証券	2,898,200	1,995,900
特殊債券	1,362,700	169,700
社 債 券	22,270,000	2,860,000
合 計	107,223,100	131,573,200

(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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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83回利付国債(5年)	90,000,000	90,815,400	
	第84回利付国債(5年)	100,000,000	100,675,000	
	第85回利付国債(5年)	110,000,000	110,896,500	
	第86回利付国債(5年)	70,000,000	70,471,800	
	第87回利付国債(5年)	220,000,000	221,364,000	
	第88回利付国債(5年)	180,000,000	181,281,600	
	第89回利付国債(5年)	120,000,000	120,696,000	
	第92回利付国債(5年)	150,000,000	150,594,000	
	第93回利付国債(5年)	10,000,000	10,096,600	
	第95回利付国債(5年)	30,000,000	30,399,000	
	第96回利付国債(5年)	120,000,000	121,249,200	
	第97回利付国債(5年)	190,000,000	191,461,100	
	第99回利付国債(5年)	100,000,000	100,779,000	
	第101回利付国債(5年)	190,000,000	191,483,900	

第103回利付国債(5年)	170,000,000	170,690,200	
第105回利付国債(5年)	170,000,000	169,964,300	
第106回利付国債(5年)	120,000,000	119,920,800	
第107回利付国債(5年)	150,000,000	149,826,000	
第1回利付国債(40年)	20,000,000	23,823,400	
第2回利付国債(40年)	20,000,000	22,840,600	
第3回利付国債(40年)	30,000,000	34,295,700	
第4回利付国債(40年)	40,000,000	45,824,800	
第5回利付国債(40年)	50,000,000	54,599,000	
第260回利付国債(10年)	140,000,000	142,399,600	
第261回利付国債(10年)	20,000,000	20,389,000	
第263回利付国債(10年)	280,000,000	285,824,000	
第265回利付国債(10年)	100,000,000	102,274,000	
第266回利付国債(10年)	110,000,000	112,318,800	
第267回利付国債(10年)	90,000,000	91,748,700	
第268回利付国債(10年)	90,000,000	92,349,900	
第269回利付国債(10年)	250,000,000	255,580,000	
第270回利付国債(10年)	210,000,000	215,281,500	
第273回利付国債(10年)	280,000,000	289,172,800	
第276回利付国債(10年)	190,000,000	197,370,100	
第277回利付国債(10年)	150,000,000	156,355,500	
第280回利付国債(10年)	190,000,000	200,444,300	
第282回利付国債(10年)	110,000,000	115,722,200	
第283回利付国債(10年)	20,000,000	21,108,200	
第284回利付国債(10年)	140,000,000	147,732,200	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第285回利付国債(10年)	180,000,000	190,569,600	
	第286回利付国債(10年)	80,000,000	85,276,000	
	第288回利付国債(10年)	130,000,000	138,460,400	
	第289回利付国債(10年)	150,000,000	158,887,500	
	第290回利付国債(10年)	220,000,000	232,595,000	
	第291回利付国債(10年)	20,000,000	21,047,800	
	第293回利付国債(10年)	130,000,000	140,435,100	
	第296回利付国債(10年)	110,000,000	117,399,700	
	第297回利付国債(10年)	110,000,000	117,023,500	
	第299回利付国債(10年)	90,000,000	95,359,500	
	第300回利付国債(10年)	70,000,000	74,981,200	
	第301回利付国債(10年)	100,000,000	107,285,000	
	第303回利付国債(10年)	250,000,000	266,952,500	
	第305回利付国債(10年)	40,000,000	42,486,000	
	第306回利付国債(10年)	220,000,000	235,254,800	
	第308回利付国債(10年)	220,000,000	233,774,200	
	第309回利付国債(10年)	10,000,000	10,483,300	
	第310回利付国債(10年)	160,000,000	166,606,400	
	第311回利付国債(10年)	10,000,000	10,269,300	
	第312回利付国債(10年)	180,000,000	190,062,000	
第313回利付国債(10年)	250,000,000	265,912,500		
第315回利付国債(10年)	210,000,000	221,867,100		
第317回利付国債(10年)	40,000,000	41,919,600		
第318回利付国債(10年)	170,000,000	176,715,000		

第319回利付国債(10年)	140,000,000	146,727,000	
第320回利付国債(10年)	40,000,000	41,573,200	
第321回利付国債(10年)	70,000,000	72,734,900	
第322回利付国債(10年)	40,000,000	41,205,600	
第323回利付国債(10年)	210,000,000	216,123,600	
第325回利付国債(10年)	170,000,000	173,335,400	
第326回利付国債(10年)	70,000,000	70,670,600	
第327回利付国債(10年)	40,000,000	40,748,800	
第328回利付国債(10年)	60,000,000	59,943,600	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	22,634,000	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	22,846,800	
第10回利付国債(30年)	30,000,000	28,074,300	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	20,715,200	
第12回利付国債(30年)	20,000,000	22,082,000	
第13回利付国債(30年)	30,000,000	32,596,800	
第15回利付国債(30年)	40,000,000	46,989,600	
第17回利付国債(30年)	40,000,000	46,301,200	
第19回利付国債(30年)	20,000,000	22,793,200	
第20回利付国債(30年)	10,000,000	11,775,800	
第21回利付国債(30年)	30,000,000	34,203,000	
第22回利付国債(30年)	20,000,000	23,590,400	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第23回利付国債(30年)	30,000,000	35,399,100	
	第24回利付国債(30年)	30,000,000	35,412,000	
	第26回利付国債(30年)	40,000,000	46,456,800	
	第27回利付国債(30年)	40,000,000	47,315,600	
	第28回利付国債(30年)	40,000,000	47,381,200	
	第29回利付国債(30年)	50,000,000	58,278,500	
	第30回利付国債(30年)	50,000,000	57,301,500	
	第31回利付国債(30年)	50,000,000	56,300,500	
	第32回利付国債(30年)	60,000,000	68,936,400	
	第33回利付国債(30年)	60,000,000	65,068,200	
	第34回利付国債(30年)	70,000,000	79,016,700	
	第35回利付国債(30年)	70,000,000	75,838,700	
	第36回利付国債(30年)	60,000,000	65,129,400	
	第37回利付国債(30年)	70,000,000	74,347,700	
	第38回利付国債(30年)	30,000,000	31,213,500	
	第45回利付国債(20年)	30,000,000	34,122,600	
	第47回利付国債(20年)	60,000,000	67,699,800	
	第48回利付国債(20年)	60,000,000	69,159,000	
	第50回利付国債(20年)	30,000,000	33,296,700	
	第51回利付国債(20年)	10,000,000	11,197,800	
	第52回利付国債(20年)	30,000,000	33,915,300	
	第53回利付国債(20年)	30,000,000	33,954,900	
	第55回利付国債(20年)	30,000,000	33,765,000	
	第57回利付国債(20年)	30,000,000	33,544,800	
	第58回利付国債(20年)	30,000,000	33,607,800	
	第59回利付国債(20年)	40,000,000	44,137,200	
	第61回利付国債(20年)	30,000,000	31,136,100	
第63回利付国債(20年)	20,000,000	22,340,200		

第64回利付国債（20年）	20,000,000	22,558,000	
第65回利付国債（20年）	90,000,000	101,566,800	
第69回利付国債（20年）	40,000,000	46,046,400	
第70回利付国債（20年）	30,000,000	35,534,700	
第72回利付国債（20年）	30,000,000	34,583,100	
第76回利付国債（20年）	50,000,000	56,561,500	
第78回利付国債（20年）	40,000,000	45,225,200	
第81回利付国債（20年）	50,000,000	57,159,500	
第84回利付国債（20年）	90,000,000	102,826,800	
第85回利付国債（20年）	70,000,000	80,738,000	
第88回利付国債（20年）	60,000,000	70,670,400	
第90回利付国債（20年）	70,000,000	81,521,300	
第92回利付国債（20年）	70,000,000	80,558,800	
第94回利付国債（20年）	70,000,000	80,479,700	
第95回利付国債（20年）	70,000,000	82,253,500	
第97回利付国債（20年）	60,000,000	69,637,200	
第99回利付国債（20年）	70,000,000	80,201,800	

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評 価 額（円）	備 考
国債証券	第100回利付国債（20年）	70,000,000	81,053,000	
	第103回利付国債（20年）	70,000,000	81,922,400	
	第105回利付国債（20年）	60,000,000	68,445,600	
	第108回利付国債（20年）	70,000,000	77,739,200	
	第111回利付国債（20年）	80,000,000	91,945,600	
	第113回利付国債（20年）	80,000,000	90,615,200	
	第114回利付国債（20年）	10,000,000	11,304,300	
	第116回利付国債（20年）	90,000,000	102,936,600	
	第118回利付国債（20年）	100,000,000	110,986,000	
	第121回利付国債（20年）	90,000,000	98,223,300	
	第123回利付国債（20年）	100,000,000	111,971,000	
	第125回利付国債（20年）	80,000,000	90,654,400	
	第128回利付国債（20年）	90,000,000	97,502,400	
	第130回利付国債（20年）	80,000,000	85,244,800	
	第132回利付国債（20年）	70,000,000	73,322,900	
	第134回利付国債（20年）	100,000,000	106,217,000	
	第137回利付国債（20年）	90,000,000	93,935,700	
	第140回利付国債（20年）	90,000,000	93,762,000	
	第141回利付国債（20年）	80,000,000	83,186,400	
第143回利付国債（20年）	40,000,000	40,863,600		
	国債証券小計	12,810,000,000	13,614,633,800	
地方債証券	第18回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,720,000	
	第613回東京都公募公債	50,000,000	50,990,000	
	第654回東京都公募公債	100,000,000	106,160,000	
	第678回東京都公募公債	80,000,000	85,304,000	
	平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	31,890,000	
	第126回神奈川県公募公債	60,000,000	60,828,000	
	第164回神奈川県公募公債	100,000,000	107,240,000	
	第277回大阪府公募公債（10年）	30,000,000	30,708,000	
	第302回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	42,452,000	
	平成17年度第8回兵庫県公募公債	10,000,000	10,288,000	
	平成18年度第2回静岡県公募公債	10,000,000	10,571,000	

平成21年度第4回愛知県公募公債（5年）	50,000,000	50,410,000	
平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	67,148,400	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,790,000	
第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,870,000	
第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	52,110,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	39,000,000	41,367,300	
第12回す号名古屋市公募公債	30,000,000	31,317,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	32,040,000	
平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,774,800	
平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,510,000	
地方債証券小計	1,188,000,000	1,250,488,500	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,720,000	
	第33回日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,600,000	
	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	105,910,000	
	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	112,510,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,910,000	
	第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,490,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	107,979,100	
	第188回政府保証中小企業債券	100,000,000	105,440,000	
	第29回都市再生債券	100,000,000	100,950,000	
	第14回政府保証国民生活債券	107,000,000	109,022,300	
	第2回成田国際空港社債	100,000,000	103,580,000	
	い第736号商工債券	70,000,000	70,392,000	
	い第715号農林債券	40,000,000	40,300,000	
	第274回信金中金債(5年)	100,000,000	99,940,000	
	第13回中日本高速道路社債	100,000,000	106,500,000	
特殊債券小計	1,418,000,000	1,475,243,400		
社債券	第30回新日本製鐵社債	100,000,000	111,590,000	
	第8回トヨタ自動車社債	100,000,000	109,130,000	
	第30回住友商事社債	100,000,000	104,060,000	
	第112回三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	100,750,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,040,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	108,300,000	
	第524回東京電力社債	100,000,000	95,910,000	
社債券小計	700,000,000	743,780,000		
有価証券合計	16,116,000,000	17,084,145,700		

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

「新光J-REITマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

	[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,381,271	7,784,392
投資証券	1,012,191,310	1,399,838,220
未収配当金	10,019,327	8,555,105
未収利息	17	10
流動資産合計	1,032,591,925	1,416,177,727
資産合計	1,032,591,925	1,416,177,727
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	1,257,021,193	1,089,586,634
剰余金		
剰余金又は欠損金()	224,429,268	326,591,093
元本等合計	1,032,591,925	1,416,177,727
純資産合計	1,032,591,925	1,416,177,727
負債純資産合計	1,032,591,925	1,416,177,727

(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24年10月23日 至平成25年 4月22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。

(貸借対照表に関する注記)

[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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 1,257,021,193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 1,089,586,634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 224,429,268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
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 0.8215円 (1万口当たり純資産額) (8,215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 1.2997円 (1万口当たり純資産額) (12,997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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22日現在]

本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,658,164,064円	1,257,021,193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	401,142,871円	167,434,559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	1,257,021,193円	1,089,586,634円
合計	1,257,021,193円	1,089,586,634円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	147,975,899	482,763,745
合計	147,975,899	482,763,745

（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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	46	34,546,000	
	M I Dリート投資法人	36	9,453,600	
	森ヒルズリート投資法人	50	34,500,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	30	18,390,000	
	産業ファンド投資法人	31	33,046,000	
	大和ハウスリート投資法人	24	18,312,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	245	58,114,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	15	3,294,000	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	41	35,424,000	
	G L P投資法人	363	36,263,700	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	12	8,856,000	
	日本プロロジスリート投資法人	33	29,304,000	
	日本ビルファンド投資法人	137	192,074,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	117	151,515,000	
	日本リテールファンド投資法人	411	92,351,700	
	オリックス不動産投資法人	284	37,772,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	163	59,739,500	
	プレミアム投資法人	39	18,505,500	
東急リアル・エステート投資法人	33	21,186,000		

グローバル・ワン不動産投資法人	19	12,635,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人	60	39,900,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	453	73,295,400	
森トラスト総合リート投資法人	48	45,696,000	
インヴィンシブル投資法人	266	3,410,120	
フロンティア不動産投資法人	49	49,931,000	
平和不動産リート投資法人	157	13,376,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	29	30,479,000	
福岡リート投資法人	27	21,870,000	
ケネディクス不動産投資法人	57	27,844,500	
積水ハウス・S I 投資法人	27	13,554,000	
いちご不動産投資法人	167	11,389,400	
大和証券オフィス投資法人	78	36,075,000	
阪急リート投資法人	17	11,237,000	
スターツプロシード投資法人	21	4,069,800	
トップリート投資法人	31	16,802,000	

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	69	29,670,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	417	17,472,300	
	日本賃貸住宅投資法人	263	19,488,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	44	28,996,000	
投資証券小計		4,409	1,399,838,220	
有価証券合計		4,409	1,399,838,220	

（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24年10月22日現在]	[平成25年4月22日現在]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,622,006	5,433,321
コール・ローン	3,888,175	3,481,120
投資証券	1,065,935,042	1,357,852,178
未収配当金	924,691	1,180,134
未収利息	6	4
流動資産合計	1,073,369,920	1,367,946,757
資産合計	1,073,369,920	1,367,946,757
負債の部		
流動負債		
未払金	1,416,900	-

流動負債合計	1,416,900	-
負債合計	1,416,900	-
純資産の部		
元本等		
元本	1,450,564,933	1,288,574,079
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	378,611,913	79,372,678
元本等合計	1,071,953,020	1,367,946,757
純資産合計	1,071,953,020	1,367,946,757
負債純資産合計	1,073,369,920	1,367,946,757

(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24年10月23日 至 平成25年 4月22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。

(貸借対照表に関する注記)

[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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 1,450,564,933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 1,288,574,079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 378,611,913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
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 0.7390円 (1万口当たり純資産額) (7,390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 1.0616円 (1万口当たり純資産額) (10,616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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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24年 4月21日 至 平成24年10月22日	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22日現在]
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,665,446,503円	1,450,564,933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	214,881,570円	161,990,854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	1,450,564,933円	1,288,574,079円
合 計	1,450,564,933円	1,288,574,079円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種 類	[平成24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	201,302,503	149,135,675
合 計	201,302,503	149,135,675

（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24年10月22日現在]	[平成25年 4月22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	1,123	31,444.00	
		AGREE REALTY CORPORATION	300	8,835.00	
		ALEXANDER'S INC	100	28,800.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	1,500	106,860.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	800	26,432.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,400	105,096.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	9,100	737,555.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	3,375	105,030.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,200	14,580.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	1,200	21,288.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,642	351,570.94	
		BIOMED REALTY TRUST INC	3,800	85,348.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,500	384,300.00	
		BRANDYWINE REALTY	3,300	49,269.00	
		BRE PROPERTIES -CL A	1,800	91,656.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,900	136,173.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	1,400	19,278.00	
		CAPLEASE INC	1,500	10,185.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,684	86,647.68	

CEDAR REALTY TRUST INC	1,800	11,034.00	
CHATHAM LODGING TRUST	400	7,296.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	1,100	25,333.00	
COLONIAL PROPERTIES TRUST	1,800	41,634.00	
COMMONWEALTH REIT	2,775	61,521.75	
CORESITE REALTY CORPORATION	500	18,590.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,800	51,516.00	
COUSINS PROPERTIES INC	2,062	22,022.16	
CUBESMART	3,000	48,270.00	
CYRUSONE INC	400	9,572.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	6,200	47,058.00	
DDR CORPORATION	5,597	99,738.54	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	4,652	44,380.08	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,800	206,556.00	
DOUGLAS EMMETT INC	3,000	77,640.00	
DUKE REALTY CORP	7,400	129,722.00	

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	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	1,500	38,085.00	
		EASTGROUP PROPERTIES	700	42,581.00	
		EDUCATION REALTY TRUST	2,700	29,025.00	
		EPR PROPERTIES	1,100	59,994.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	900	72,351.00	
		EQUITY ONE INC	1,400	34,440.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	7,500	434,775.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	800	124,168.00	
		EXCEL TRUST INC	1,000	14,590.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,400	100,824.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	1,500	170,055.00	
		FELCOR LODGING TRUST	3,000	17,130.00	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY	2,300	39,077.00	
		FIRST POTOMAC REALTY	1,200	18,732.00	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES	1,700	25,262.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,350	265,895.50	
		GETTY REALTY CORP	600	12,384.00	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	300	5,994.00	
		GLIMCHER REALTY TRUST	3,400	40,086.00	
		GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	1,300	33,969.00	
		HCP INC	10,400	548,184.00	
		HEALTH CARE REIT INC	6,000	435,720.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,000	59,160.00	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,100	13,332.00	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,900	22,581.00	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,900	76,646.00	
		HOME PROPERTIES INC	1,200	79,068.00	
		HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	3,200	89,536.00	
		HOST HOTELS & RESORTS	16,579	291,293.03	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	1,000	22,230.00	
		INLAND REAL ESTATE CORP	1,800	19,962.00	

	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,100	20,286.00	
	KILROY REALTY CORP	1,700	92,514.00	
	KIMCO REALTY CORP	9,400	215,166.00	
	KITE REALTY GROUP TRUST	1,900	12,483.00	
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	2,200	56,100.00	
	LEXINGTON REALTY TRUST	4,854	59,315.88	
	LIBERTY PROPERTY	2,700	111,807.00	
	LTC PROPERTIES INC	700	31,234.00	
	MACK-CALI REALTY CORP	2,000	54,640.00	

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	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,500	55,090.00	
		MID-AMERICA APARTMENT	1,000	68,720.00	
		MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR-CL A	900	9,567.00	
		MPG OFFICE TRUST INC	1,700	4,284.00	
		NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	600	38,796.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,500	95,650.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,600	85,332.00	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	300	6,579.00	
		PARKWAY PROPERTIES INC	1,000	17,680.00	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,400	35,896.00	
		PENN REAL ESTATE INVESTMENT	1,300	24,752.00	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	3,900	77,493.00	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	3,800	198,702.00	
		POST PROPERTIES INC	1,200	60,360.00	
		POTLATCH CORPORATION	900	40,896.00	
		PROLOGIS INC	10,600	440,854.00	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	400	31,204.00	
		PUBLIC STORAGE	3,300	524,040.00	
		RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1,400	23,254.00	
		RAYONIER INC	2,800	162,260.00	
		REALTY INCOME CORP	4,092	200,508.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,100	113,652.00	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	1,200	17,076.00	
		RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	3,100	46,128.00	
		RLJ LODGING TRUST	2,500	55,700.00	
		ROUSE PROPERTIES INC	520	9,443.20	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,200	51,096.00	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	800	24,016.00	
		SAUL CENTERS INC	300	13,137.00	
		SELECT INCOME REIT	400	11,224.00	
		SENIOR HOUSING PROPERTIES	4,300	120,744.00	
		SILVER BAY REALTY TRUST CORPORATION	300	6,000.00	
		SIMON PROPERTY GROUP	7,105	1,251,261.55	
		SL GREEN REALTY CORPORATION	2,100	184,170.00	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	700	45,290.00	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	800	16,344.00	

	STAG INDUSTRIAL INC	1,000	22,440.00	
	STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	3,900	30,693.00	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,500	14,775.00	
	SUN COMMUNITIES INC	700	34,587.00	

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	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS	3,675	44,430.75	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	2,200	81,356.00	
		TAUBMAN CENTERS INC	1,400	114,240.00	
		TERRENO REALTY CORP	300	5,538.00	
		THE GEO GROUP INC	1,600	60,336.00	
		THE MACERICH COMPANY	3,101	208,325.18	
		UDR INC	5,758	141,416.48	
		UMH PROPERTIES INC	300	3,282.00	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	300	17,235.00	
		URSTADT BIDDLE-CL A	500	11,000.00	
		VENTAS INC	6,755	533,982.75	
		VORNADO REALTY TRUST	3,835	329,886.70	
		WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,500	42,555.00	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	2,500	81,300.00	
		WEYERHAEUSER COMPANY	12,500	373,000.00	
		WHITESTONE REIT	400	6,596.00	
		WINTHROP REALTY TRUST INC	620	7,502.00	
		WP CAREY INC	1,300	87,971.00	
	米ドル建小計		346,454	米ドル 13,612,553.17 (1,357,852,178円)	
	合計		-	円 1,357,852,178 (1,357,852,178)	

(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133銘柄	99.3%	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25年5月31日現在）

「新光7資産バランスファンド」

資産総額	9,118,703,292 円
負債総額	19,087,446 円
純資産総額（ - ）	9,099,615,846 円
発行済口数	11,811,403,509 口
1万口当たり純資産額（ / ）	7,704 円

（参考）

「海外国債マザーファンド」

資産総額	73,296,948,019 円
負債総額	150,000 円
純資産総額（ - ）	73,296,798,019 円
発行済口数	38,179,507,946 口
1万口当たり純資産額（ / ）	19,198 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	14,924,001,366 円
負債総額	35,277,415 円
純資産総額（ - ）	14,888,723,951 円
発行済口数	11,123,336,461 口
1万口当たり純資産額（ / ）	13,385 円

「新光外国株式インデックスマザーファンド」

資産総額	14,269,924,709 円
負債総額	17,159,327 円
純資産総額（ - ）	14,252,765,382 円
発行済口数	10,439,903,709 口
1万口当たり純資産額（ / ）	13,652 円

「新光日本債券インデックスマザーファンド」

資産総額	17,624,618,600 円
負債総額	34,577,700 円
純資産総額（ - ）	17,590,040,900 円
発行済口数	15,329,969,803 口
1万口当たり純資産額（ / ）	11,474 円

「新光J - R E I Tマザーファンド」

資産総額	1,115,959,966 円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	1,115,959,966 円
発行済口数	1,004,866,979 口
1万口当たり純資産額（ / ）	11,106 円

「新光米国REITマザーファンド」

資産総額	1,348,510,047 円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	1,348,510,047 円
発行済口数	1,288,574,079 口
1万口当たり純資産額（ / ）	10,465 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24年11月末現在）

（略）

< 訂正後 >

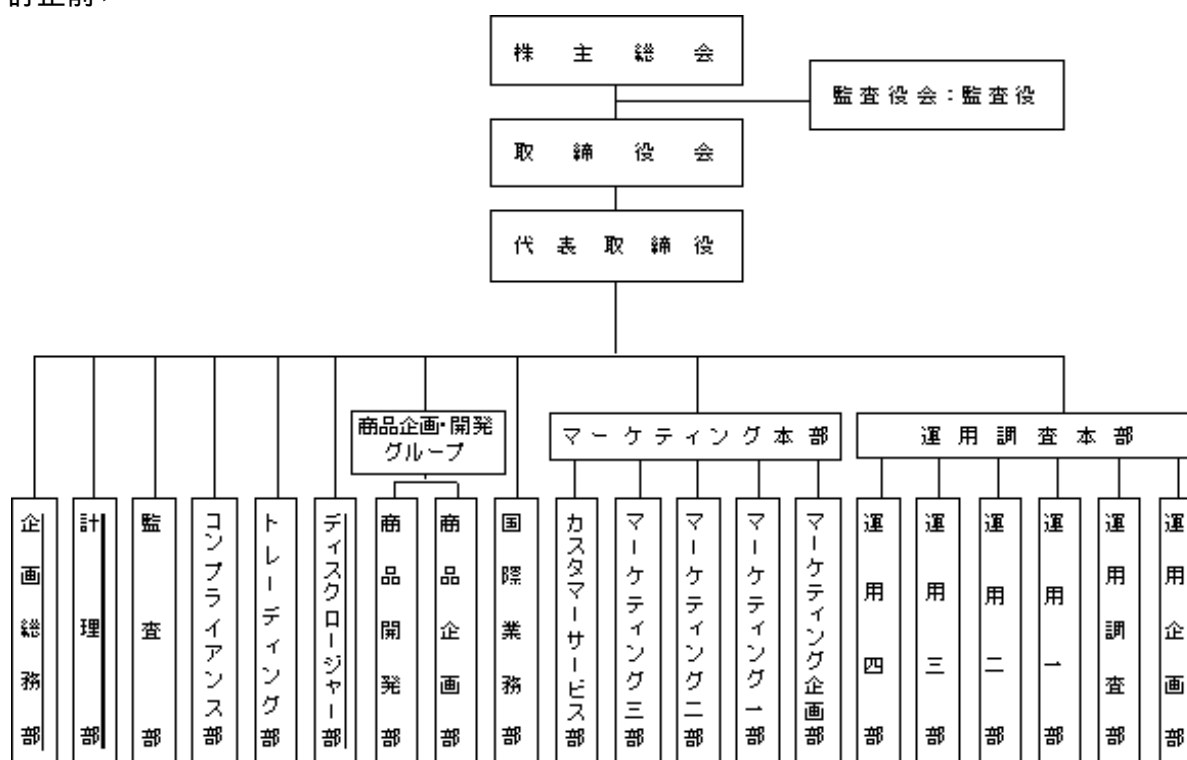
a . 資本金の額（平成25年5月末現在）

（略）

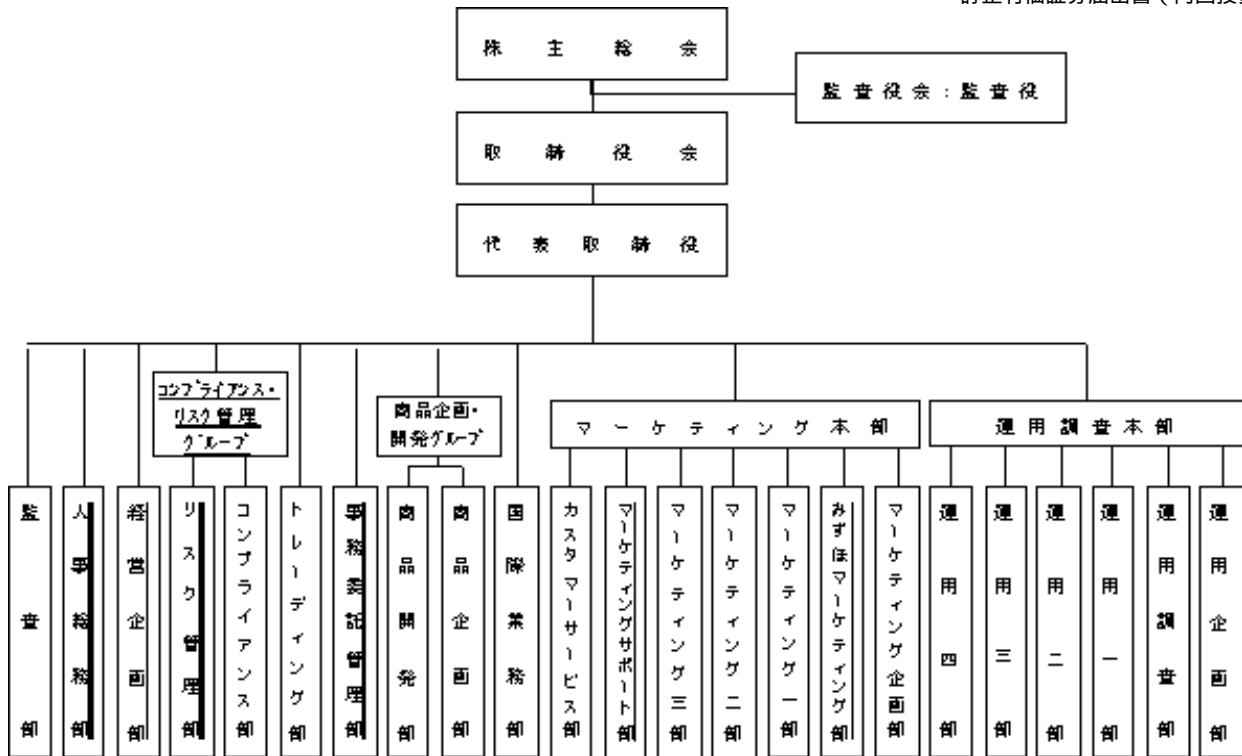
b . 委託会社の機構

（口）組織図

< 訂正前 >

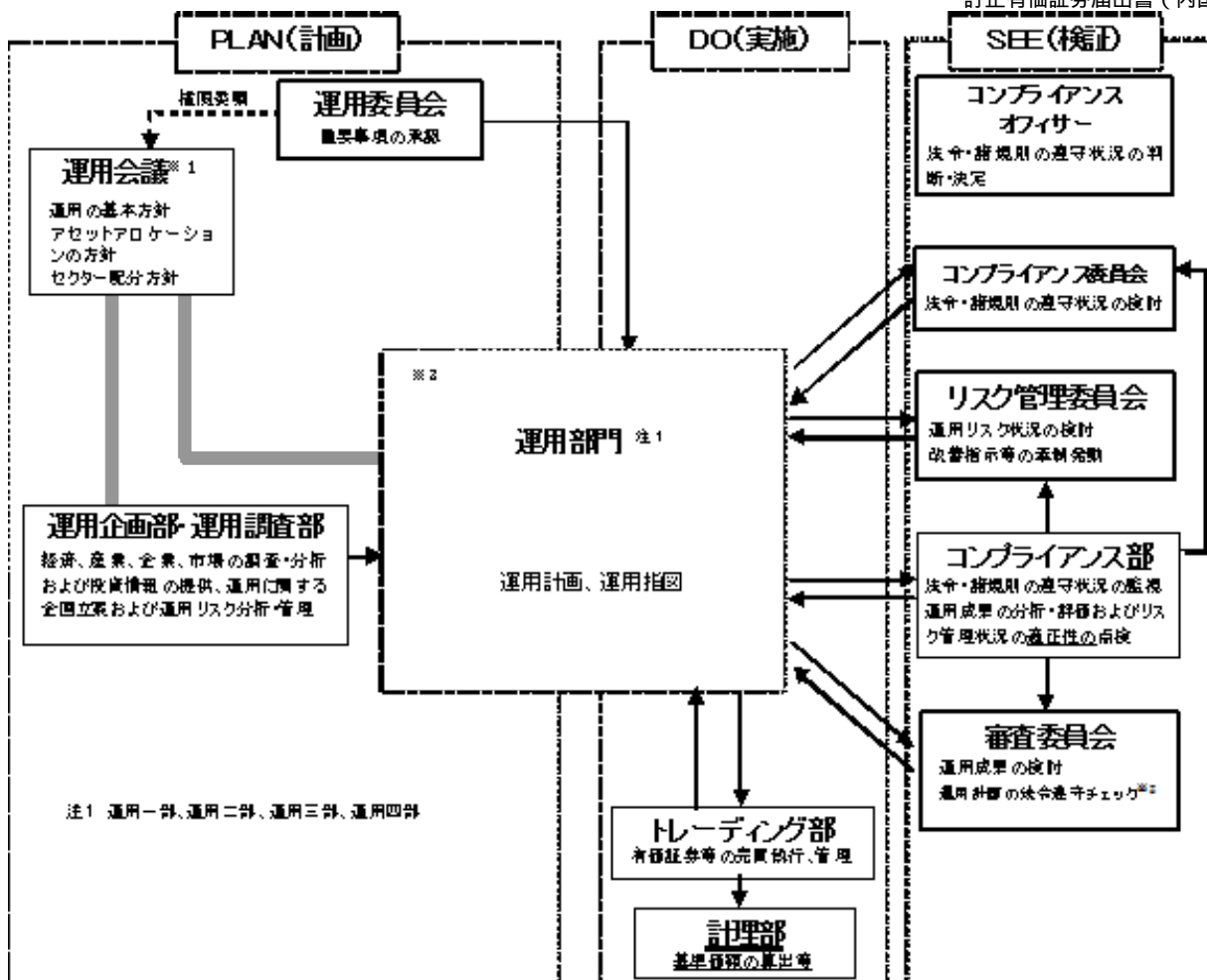


< 訂正後 >



(八) 投資運用の意思決定機構

< 訂正前 >



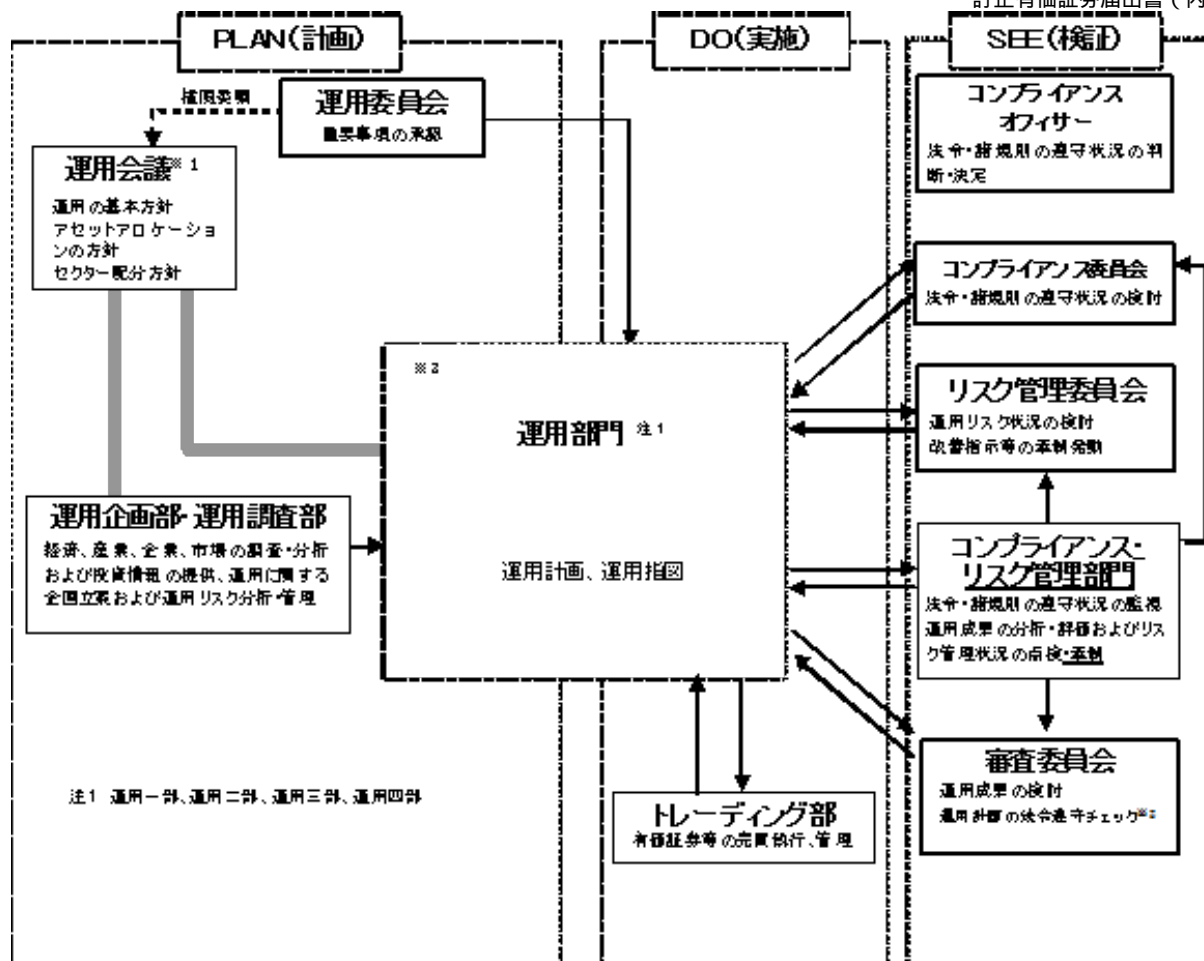
実線の矢印は情報の流れを示します。

※1 運用会議は運用企画部・運用調査部、運用部門(運用一部～四部)で構成されます。

※2 コンプライアンス部およびコンプライアンスオフィサーによる運用指図の法令遵守チェックは取締役会からの委任を受れたものです。

※3 運用部門において、運用計画および運用指図の承認は各々の上位職者が行います。

< 訂正後 >



実線の矢印は情報の流れを示します。

※1 運用会議は運用企画部・運用調査部、運用部門(運用一部～四部)で構成されます。

※2 コンプライアンス・リスク管理部門およびコンプライアンスオフィサーによる運用計画の法令遵守チェックは取締役会からの委任を受けられたものです。

※3 運用部門において、運用計画および運用指図の承認は各々の上位職者が行います。

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24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24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	202	2,059,106
株式投資信託（合計）	173	1,631,786
単位型	1	2,091
追加型	172	1,629,695
公社債投資信託（合計）	29	427,320
単位型	2	829
追加型	27	426,491

< 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25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25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	210	3,153,533
株式投資信託（合計）	181	2,521,356
単位型	1	2,470
追加型	180	2,518,885
公社債投資信託（合計）	29	632,176
単位型	2	984
追加型	27	631,191

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24年4月1日から平成25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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	8,592,890	10,766,270
有価証券	6,903,772	5,259,693
貯蔵品	268	1,062
立替金	2,141	30,280
前払金	26,845	25,483
前払費用	18,185	20,286
未収入金	29	-
未収委託者報酬	1,805,198	1,891,689
未収運用受託報酬	105,245	86,074
未収収益	27,583	13,810
繰延税金資産	183,764	192,202
流動資産合計	17,665,924	18,286,853
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 18,397	2 15,051
構築物（純額）	2 2,156	2 1,886
器具・備品（純額）	2 145,416	2 95,877
リース資産（純額）	2 3,064	2 680
建設仮勘定	6,663	-
有形固定資産合計	175,697	113,496
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	3 38,365	3 39,774
ソフトウェア仮勘定	6,554	-
無形固定資産合計	45,012	39,866
投資その他の資産		
投資有価証券	4,293,799	2,929,683
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	125,621	125,515
長期繰延税金資産	65,901	8,695
前払年金費用	471,439	410,271
その他	22,000	10,632
貸倒引当金	13,350	-
投資その他の資産合計	5,042,512	3,561,898
固定資産合計	5,263,222	3,715,261
資産合計	22,929,146	22,002,115

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	17,113	18,156
リース債務	6,508	1,206
未払金		
未払収益分配金	584	336
未払償還金	18,249	14,470
未払手数料	1,920,180	1,964,634
その他未払金	281,635	195,035
未払金合計	1,220,650	1,174,476
未払費用	388,419	402,634
未払法人税等	652,412	471,902
賞与引当金	257,200	299,000
役員賞与引当金	35,000	45,500
流動負債合計	2,577,303	2,412,875
固定負債		
長期リース債務	2,362	1,156
退職給付引当金	169,955	168,209
役員退職慰労引当金	75,625	80,416
執行役員退職慰労引当金	128,916	99,750
固定負債合計	376,859	349,532
負債合計	2,954,163	2,762,408
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	11,118,000	10,000,000
繰越利益剰余金	1,427,158	1,559,003
利益剰余金合計	12,905,651	11,919,497
自己株式	6,827	72,415
株主資本合計	20,184,823	19,133,081
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	209,840	106,625
評価・換算差額等合計	209,840	106,625
純資産合計	19,974,983	19,239,706
負債純資産合計	22,929,146	22,002,115

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	19,353,740	19,893,907
運用受託報酬	196,866	170,563
営業収益合計	19,550,606	20,064,471

営業費用		
支払手数料	1 10,353,047	1 10,580,803
広告宣伝費	239,373	213,908
公告費	4,161	1,919
調査費		
調査費	258,007	275,599
委託調査費	2,747,489	2,855,086
図書費	6,390	5,332
調査費合計	3,011,888	3,136,017
委託計算費	502,554	533,813
営業雑経費		
通信費	38,375	37,161
印刷費	151,954	132,025
協会費	12,077	14,855
諸会費	2,867	3,088
その他	27,590	23,541
営業雑経費合計	232,865	210,672
営業費用合計	14,343,891	14,677,134
一般管理費		
給料		
役員報酬	92,370	93,516
給料・手当	1,276,693	1,395,728
賞与	228,039	221,930
給料合計	1,597,103	1,711,175
交際費	13,677	9,782
寄付金	7,752	2,465
旅費交通費	81,442	81,050
租税公課	44,308	52,119
不動産賃借料	200,662	211,739
賞与引当金繰入	257,200	299,000
役員賞与引当金繰入	35,000	45,500
役員退職慰労引当金繰入	36,761	28,335
退職給付費用	157,497	195,268
減価償却費	86,469	88,183
諸経費	490,232	533,744
一般管理費合計	3,008,107	3,258,364
営業利益	2,198,608	2,128,972

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	53,031	157,357
有価証券利息	39,104	12,764
受取利息	24,291	22,364
時効成立分配金・償還金	11,287	3,608
雑益	2,968	26,471
営業外収益合計	130,682	222,565
営業外費用		
支払利息	572	222

時効成立後支払分配金・償還金	3,264	1,339
雑損	6,174	22
営業外費用合計	10,011	1,585
経常利益	2,319,278	2,349,952
特別利益		
貸倒引当金戻入	-	1,982
投資有価証券売却益	10,098	146,334
特別利益合計	10,098	148,316
特別損失		
貸倒引当金繰入額	13,350	-
固定資産除却損	2 499	2 101
投資有価証券売却損	25,606	37,198
投資有価証券評価損	-	49,352
減損損失	441	4,291
特別損失合計	39,897	90,943
税引前当期純利益	2,289,480	2,407,325
法人税、住民税及び事業税	1,006,533	983,713
法人税等調整額	51,486	129,642
法人税等合計	955,047	854,070
当期純利益	1,334,432	1,553,255

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25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	11,118,000
当期変動額		
別途積立金の取崩	1,000,000	1,118,000

当期変動額合計	1,000,000	1,118,000
当期末残高	11,118,000	10,000,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	2,646,588	1,427,158
当期変動額		
剰余金の配当	3,553,863	2,539,409
別途積立金の取崩	1,000,000	1,118,000
当期純利益	1,334,432	1,553,255
当期変動額合計	1,219,430	131,845
当期末残高	1,427,158	1,559,003
利益剰余金合計		
当期首残高	15,125,082	12,905,651
当期変動額		
剰余金の配当	3,553,863	2,539,409
当期純利益	1,334,432	1,553,255
当期変動額合計	2,219,430	986,154
当期末残高	12,905,651	11,919,497

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
自己株式		
当期首残高	6,827	6,827
当期変動額		
自己株式の取得	-	65,588
当期変動額合計	-	65,588
当期末残高	6,827	72,415
株主資本合計		
当期首残高	22,404,254	20,184,823
当期変動額		
剰余金の配当	3,553,863	2,539,409
当期純利益	1,334,432	1,553,255
自己株式の取得	-	65,588
当期変動額合計	2,219,430	1,051,742
当期末残高	20,184,823	19,133,081
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	227,077	209,840
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	17,237	316,465
当期変動額合計	17,237	316,465
当期末残高	209,840	106,625
純資産合計		
当期首残高	22,177,176	19,974,983
当期変動額		
剰余金の配当	3,553,863	2,539,409
当期純利益	1,334,432	1,553,255

自己株式の取得	-	65,588
株主資本以外の項目の当期変動額 （純額）	17,237	316,465
当期変動額合計	2,202,193	735,276
当期末残高	19,974,983	19,239,706

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) 関連会社株式

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. 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 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、当期会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。なお、これによる営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響額は軽微であります。

(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率法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 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。

(2) 役員賞与引当金

役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) 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発生翌期から費用処理することとしております。

(4) 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。

(5) 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おります。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(未適用の会計基準等)

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日)

概要

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正(退職給付見込額の期間帰属方法について、期間定額基準のほか給付算定式基準の適用が可能となったほか、割引率の算定方法の改正等)

適用予定日

平成25年4月1日以後開始する事業年度の期末から適用予定

当該会計基準等の適用による影響

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
未払手数料	598,017千円	572,094千円

2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額(減損損失累計額を含む)の額

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	517,744千円	578,691千円

3. 無形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
無形固定資産の減価償却累計額	227,314千円	238,992千円

(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23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
支払手数料	7,038,413千円	6,343,293千円

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	当事業年度
--	-------	-------

(自 平成23年4月1日 (自 平成24年4月1日
至 平成24年3月31日) 至 平成25年3月31日)

器具・備品	499千円	101千円
-------	-------	-------

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25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	8,630	-	9,386

(変動事由の概要)

普通株式の自己株式の株式数の増加8,630株は、平成24年6月18日の定時株主総会の決議に基づいて行った自己株式取得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24年12月25日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成24年11月28日	平成24年12月26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「2. 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（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。

また経営企画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、経営企画部長が毎月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、経営企画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、経営企画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
其他有価証券	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	-

当事業年度（平成25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	10,766,270	10,766,270	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 満期保有目的債券	500,129	500,400	270
其他有価証券	7,490,195	7,490,195	-
(3) 未収委託者報酬	1,891,689	1,891,689	-

（注）1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(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、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。

（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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
非上場株式	299,887	276,151

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 其他有価証券」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	-	-
其他有価証券	4,800,000	809,629	660,677	-
(3) 未収委託者報酬	1,805,198	-	-	-

当事業年度（平成25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	10,766,163	-	-	-

(2) 有価証券及び投資有価証券 満期保有目的債券	500,000	-	-	-
其他有価証券	4,258,263	357,062	1,056,875	-
(3) 未収委託者報酬	1,891,689	-	-	-

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度（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

当事業年度（平成25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	500,129	500,400	270
	(3)その他	-	-	-
	小計	500,129	500,400	270
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		500,129	500,400	270

2. 関連会社株式

関連会社株式（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。

当事業年度（平成25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	1,461,472	1,219,754	241,717
	小計	1,461,472	1,219,754	241,717
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	6,028,723	6,102,958	74,234
	小計	6,028,723	6,102,958	74,234
合計		7,490,195	7,322,713	167,483

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）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

当事業年度（平成25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	106,355	38,075	1,080
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-

社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	3,921,927	108,259	36,118
合計	4,028,282	146,334	37,198

5. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について49,352千円（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

前事業年度（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。

当事業年度（平成25年3月31日）

該当事項はありません。

（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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
(1)退職給付債務（千円）	1,162,110	1,281,738
(2)年金資産（千円）	876,684	1,018,974
(3)未積立退職給付債務(1) + (2)（千円）	285,426	262,764
(4)未認識数理計算上の差異（千円）	645,782	547,641
(5)未認識過去勤務債務（債務の減額）（千円）	58,871	42,815
(6)貸借対照表計上額純額(3) + (4) + (5)（千円）	301,484	242,061
(7)前払年金費用（千円）	471,439	410,271
(8)退職給付引当金(6) - (7)（千円）	169,955	168,209

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	当事業年度 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

(1)勤務費用（千円）（注1）	80,752	108,925
(2)利息費用（千円）	23,098	17,431
(3)期待運用収益（減算）（千円）	18,807	17,533
(4)数理計算上の差異の費用処理額（千円）	73,807	86,570
(5)過去勤務債務の費用処理額（千円）	16,055	16,055
(6)小計(1) + (2) - (3) + (4) + (5)（千円）	142,794	179,338
(7)その他（千円）（注2）	14,702	15,930
(8)退職給付費用(6) + (7)（千円）	157,497	195,268

（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 20,250千円、当事業年度 34,585千円）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24年3月31日）	当事業年度 （平成25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	1.5%	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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
繰延税金資産		
貸倒引当金	4,757千円	- 千円
賞与引当金	111,065	130,944
減価償却超過額	3,087	796
退職給付引当金	106,517	95,500
役員退職慰労引当金	26,952	28,660
投資有価証券評価損	-	17,589
非上場株式評価損	28,430	28,430
未払事業税	49,129	42,964
その他有価証券評価差額金	117,552	-
その他	<u>47,307</u>	<u>63,091</u>
繰延税金資産小計	494,801	407,976
評価性引当額	<u>76,506</u>	<u>-</u>
繰延税金資産合計	<u>418,294</u>	<u>407,976</u>
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	60,857
前払年金費用	168,021	146,220
その他	<u>607</u>	<u>-</u>
繰延税金負債合計	<u>168,628</u>	<u>207,078</u>
繰延税金資産の純額	<u>249,665</u>	<u>200,897</u>

（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	183,764千円	192,202千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	65,901	8,695

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 当事業年度

	(平成24年3月31日)	(平成25年3月31日)
法定実効税率	法定実効税率と税効果会	38.01%
(調整)	計適用後の法人税等の負担	
役員給与永久に損金算入されない項目	率との間の差異が法定実効	0.55
交際費等永久に損金算入されない項目	税率の100分の5以下であ	0.36
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	るため注記を省略しており	0.51
住民税均等割	ます。	0.16
評価性引当額の増減		3.18
その他		<u>0.09</u>
税効果会計適用後の法人税等の負担率		<u>35.48</u>

(セグメント情報等)

セグメント情報

前事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）及び

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25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23年4月1日至平成24年3月31日）及び

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25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。

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25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

前事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

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

前事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

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	1,006,734	短期貸付金	-
							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	7,038,413	未払手数料	598,017

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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77.05 間接 7.91	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	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	6,343,293	未払手数料	572,094

(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	74,884	その他未払金	7,593
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,472
							メールシステムサービス料支払	18,000	その他未払金	3,150

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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	173,969	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	91,562 16,824 36,000	その他未払金 その他未払金 その他未払金	8,536 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）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	10,960円24銭	10,607円02銭
1株当たり当期純利益金額	732円20銭	854円62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23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益金額(千円)	1,334,432	1,553,255
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)	1,334,432	1,553,255
期中平均株式数(千株)	1,822	1,817

(重要な後発事象)

該当事項はありません

5【その他】

b．訴訟事件その他の重要事項

<訂正前>

訴訟事件等委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

なお、前記「3 委託会社等の経理状況 2. 中間財務諸表」の注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、平成24年12月25日付の臨時株主総会で期中配当を行うことを決議しました。

<訂正後>

訴訟事件等委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(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24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24年11月末現在）

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
（略）		
S M B C 日興証券株式会社 ¹	10,000	同上
立花証券株式会社 ²	6,695	同上
東京海上日動火災保険株式会社	101,994	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

1 資本金の額は、平成24年9月末現在。

2 立花証券株式会社は平成25年6月1日から募集・販売の取り扱いを開始します。資本金の額は、平成25年3月末現在。

<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25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25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25年5月末現在)

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
(略)		
S M B C 日興証券株式会社	10,000	同上
立花証券株式会社	6,695	同上
東京海上日動火災保険株式会社	101,994	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

独立監査人の監査報告書

平成25年6月19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24年4月1日から平成25年3月31日までの第53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25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25年5月28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24年10月23日から平成25年4月22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25年4月22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](#)