

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年1月21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
【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ファンドの名称】	新光7資産バランスファンド
【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】	継続募集額(平成26年1月22日から平成27年1月20日まで) 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

新光7資産バランスファンド

愛称として「七重奏」という名称を用いることがあります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

（イ）追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

（ロ）当初元本は1口当たり1円です。

（ハ）新光投信株式会社（以下「委託者」といいます。）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付け、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

（イ）発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

<http://www.shinkotoushin.co.jp/>

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

（５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.625%^{*}（税抜2.5%）を上限と

して販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。当該手数料には消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)(5%)が含まれます。

*消費税率が8%となった場合には、2.7%となります。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

<http://www.shinkotoushin.co.jp/>

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

(6)【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

お申込コースには、収益の分配時に分配金を受け取るコース(「分配金受取コース」)と、分配金が税引き後無手数料で再投資されるコース(「分配金再投資コース」)の2コースがあります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取り扱いとなる場合があります。

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

<http://www.shinkotoushin.co.jp/>

(7)【申込期間】

平成26年1月22日から平成27年1月20日までです。

なお、申込期間は原則として更新されます。

(8)【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所(販売会社)については、下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

<http://www.shinkotoushin.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
--------	------	--------	------

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

その他資産 (投資信託証券(資産複合 (株式一般、債券一 般、不動産投信)) (資産配分固定型))	投資信託証券への投資を通じて、実質的に株式一般、債券一般、不動産投信の複数の資産に投資を行います。 資産配分固定型とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。
年12回(毎月)	目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル(含む日本) エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界(含む日本)・エマージング地域(複数の新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジなし ^(注)	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

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

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

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



b. ファンドの特色

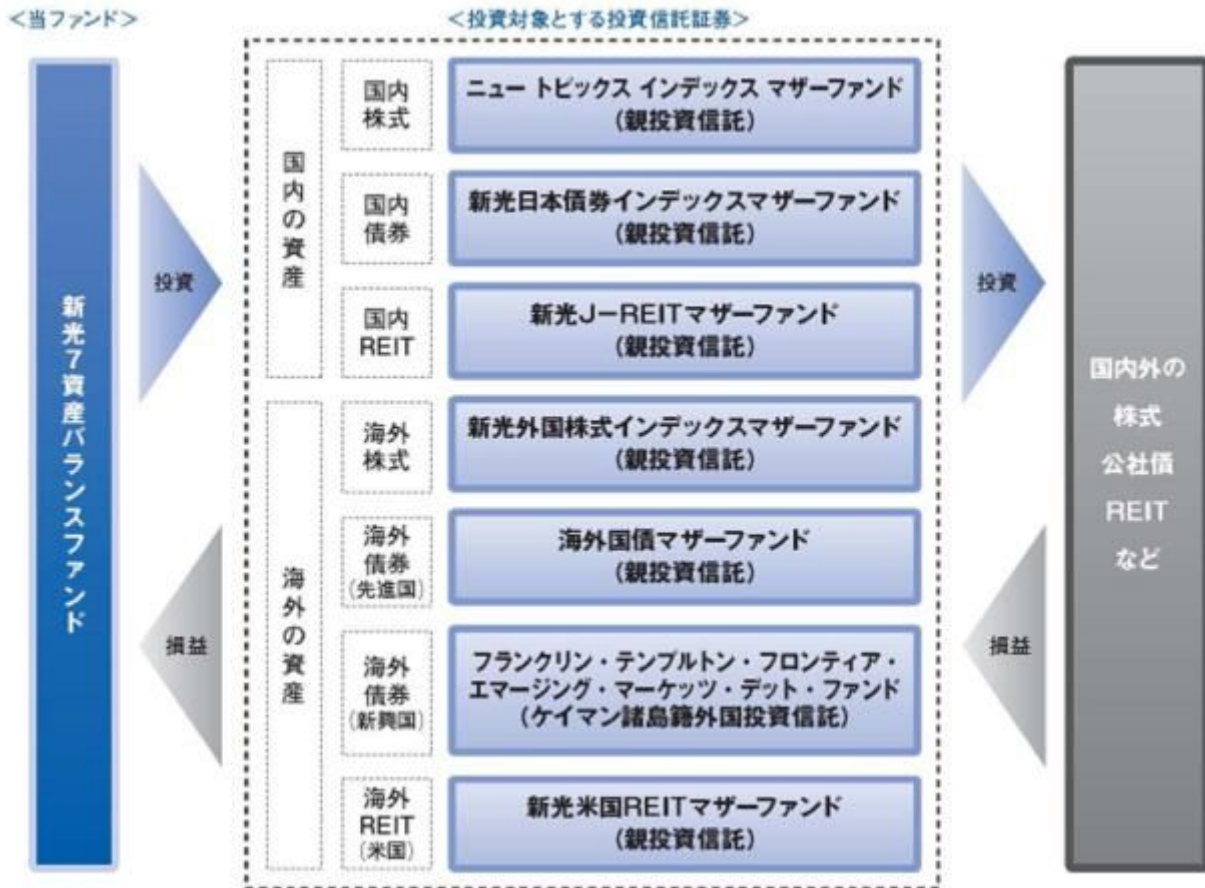
1. 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産(株式、公社債、不動産投資信託証券)にバランスよく分散投資します。

国内外の、株式、公社債および不動産投資信託証券(以下「REIT」といいます。)に実質的に投資することにより、リスク分散を図りながら、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指すファンド・オブ・ファンズです。

投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とします。

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

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



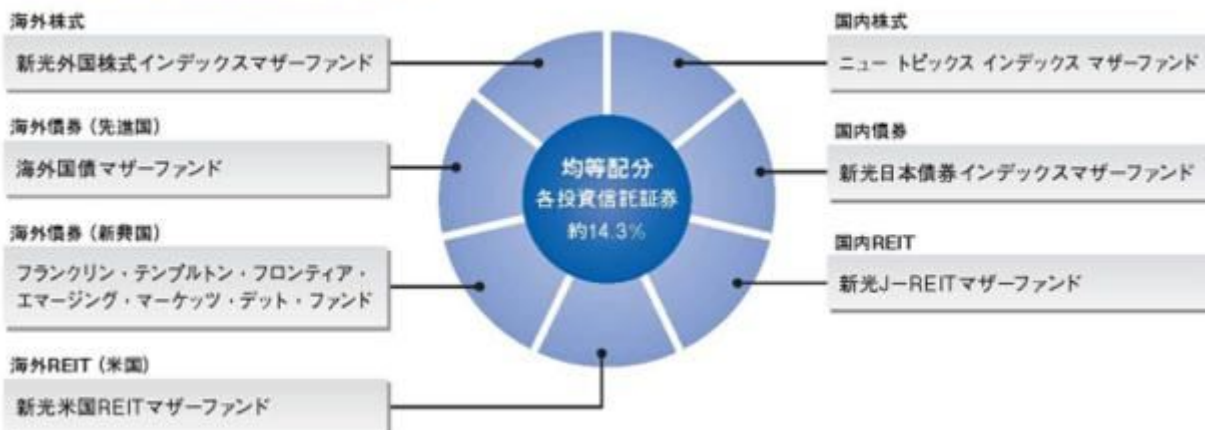
2. 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。 基本投資配分比率は均等とします。

基本投資配分比率は、各投資信託証券につき純資産総額に対し約14.3%となります。

各投資信託証券の組入比率については、原則として、6ヵ月ごとにチェックを行い、基本投資配分比率に対し±5%の範囲を超過している場合には調整を行います。

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



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

主な投資制限

ファンドの投資制限	投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みません。）以外には投資を行いません。
投資信託証券への投資割合	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
外貨建資産への投資割合	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
同一銘柄の投資信託証券への投資割合	同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の50%未満とします。

分配方針

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



分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

上記にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。

留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金と基準価額の関係（イメージ）



分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

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

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

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

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

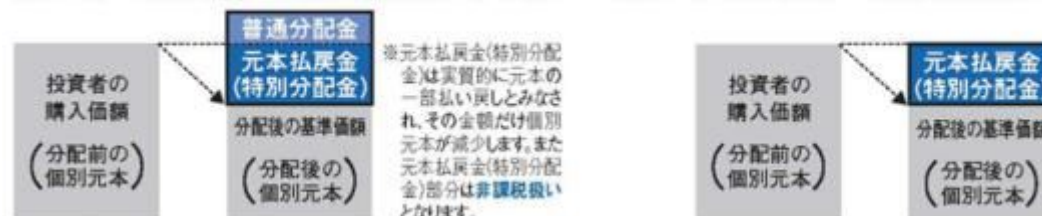
A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

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

分配金の一部が元本の一部払い戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払い戻しに相当する場合



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

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

c. 信託金限度額

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

（２）【ファンドの沿革】

平成18年 9月29日

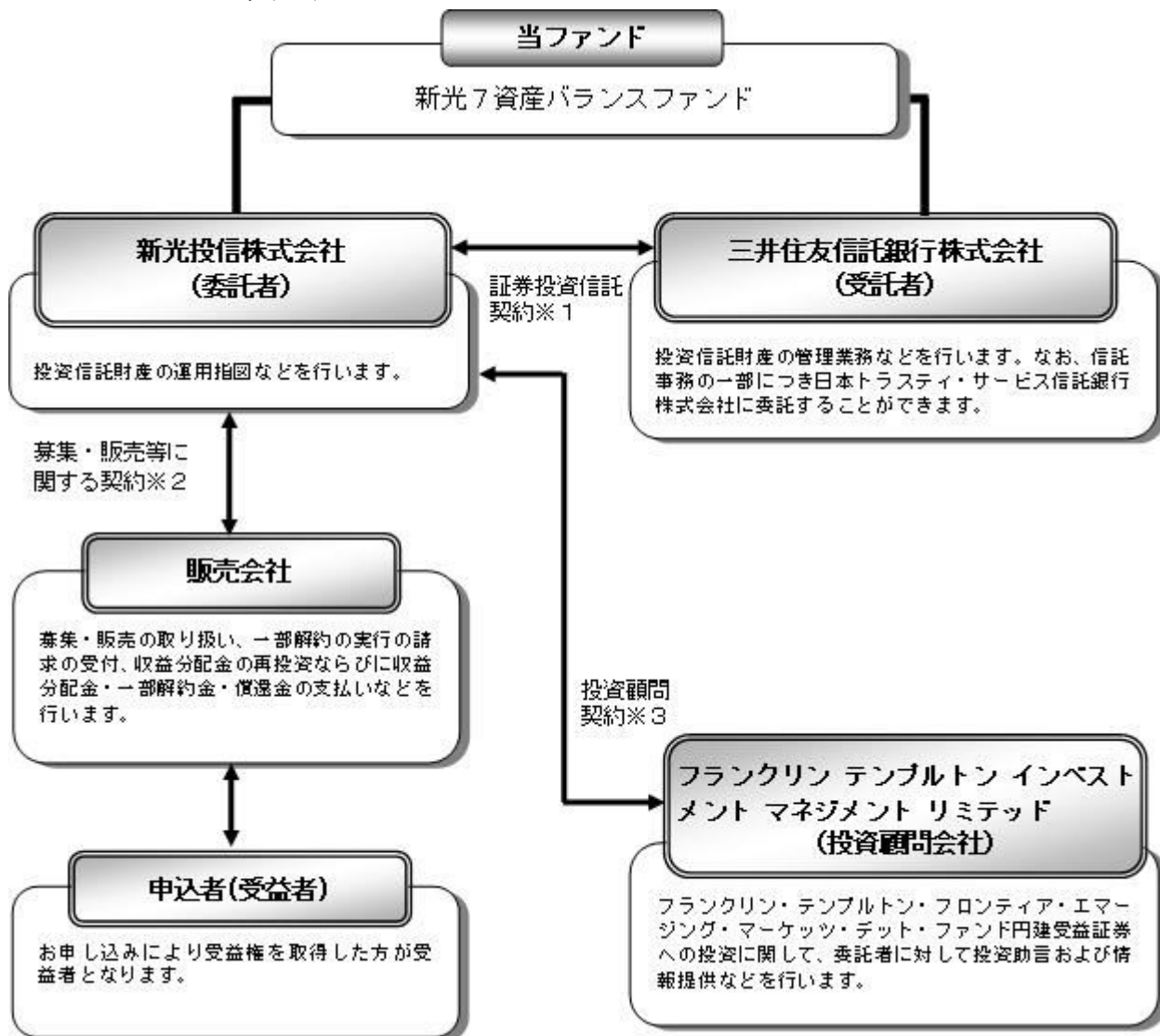
関東財務局長に対して有価証券届出書提出

平成18年10月31日

投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み



1 証券投資信託契約

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

2 募集・販売等に関する契約

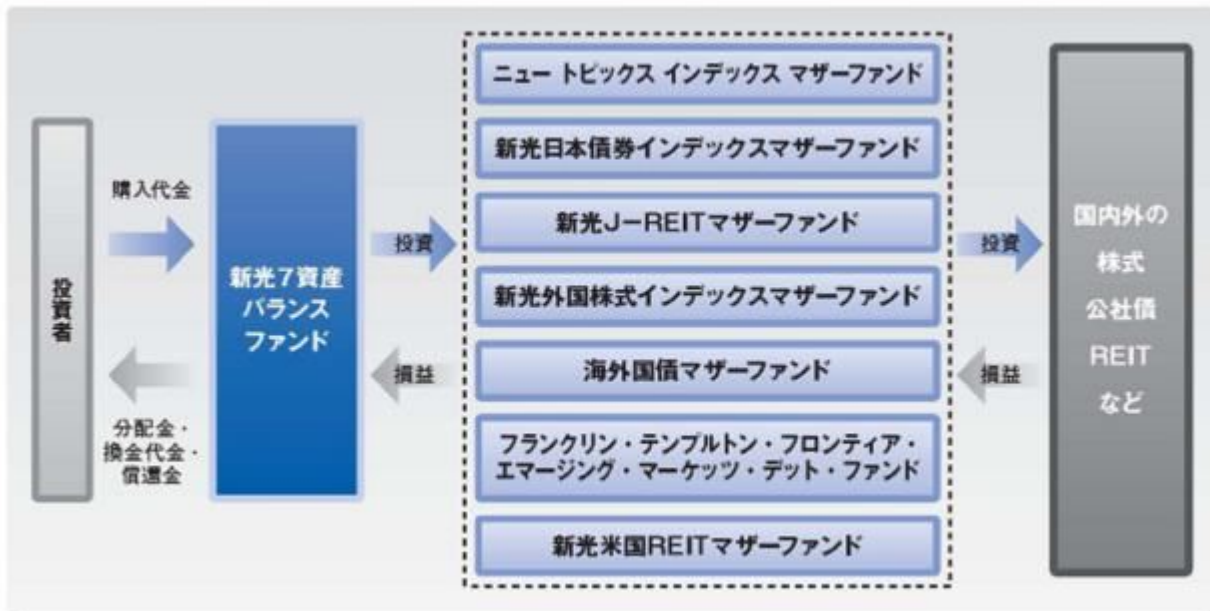
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



b. 委託会社の概況

(イ) 資本金の額（平成25年11月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株

(ロ) 委託会社の沿革

昭和36年 6月	大井証券投資信託委託株式会社設立・免許取得
昭和44年10月	新和光投信委託株式会社に社名変更
昭和61年11月	有価証券等に関する投資助言・情報提供業務の認可
平成 8年 8月	投資顧問業者の登録
平成 8年12月	投資一任契約にかかる業務の認可
平成 9年11月	投資信託の直接販売業務の認可
平成10年12月	証券投資信託法の改正に伴う投資信託の証券投資信託委託業のみなし認可
平成12年 4月	太陽投信委託株式会社と合併し、新光投信株式会社に社名変更

(ハ) 大株主の状況

（平成25年11月末現在）

株主名	住所	持株数	持株比率
みずほ証券株式会社	東京都千代田区大手町 1 - 5 - 1	1,396,362株	76.58%
株式会社みずほ銀行	東京都千代田区丸の内 1 - 3 - 3	182,115	9.98
株式会社みずほ証券リサーチ & コンサルティング	東京都中央区日本橋 1 - 17 - 10	137,200	7.52

2【投資方針】

（１）【投資方針】

a．基本方針

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

b．運用の方法

（イ）主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

（ロ）投資態度

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

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

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

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

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

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

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

（ハ）主な投資制限

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の

50%未満とします。

（２）【投資対象】

a．投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

b．運用の指図範囲

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

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

2．証券投資信託 ニュー トピックス インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

3．証券投資信託 新光日本債券インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

4．証券投資信託 新光外国株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

5．証券投資信託 海外債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

6．証券投資信託 新光J-REITマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

7．証券投資信託 新光米国REITマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券

8．コマーシャル・ペーパー

9．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの

10．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。）

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

12．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第1号に掲げる外国投資信託の受益証券および第2号から第7号に掲げる証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）を以下「投資信託証券」といい、第5号の証券を以下「公社債」といいます。公社債にかかる運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売り戻し条件付きの買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借り入れ）に限り行うことができるものとします。

（ロ）委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

（ハ）上記（イ）の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、上記（ロ）に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

1. ニュー トピックス インデックス マザーファンドの概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ 東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・ 東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。 ・ 投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。 ・ 資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。 ・ 株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・ 株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式への投資割合には制限を設けません。 ・ 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年1月14日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成14年1月15日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

東証株価指数について

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

TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、東証の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。

東証は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

東証は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東証は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

ニュー トピックス インデックス マザーファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として

運用しますが、ニュー トピックス インデックス マザーファンドの基準価額と T O P I X の指数値の動向がかい離することがあります。

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

東証は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

東証は、新光投信株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、 T O P I X の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

2．新光日本債券インデックスマザーファンドの概要

ファンド名	新光日本債券インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得したものに限りません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成17年8月17日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

NOMURA - B P I 総合について

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

NOMURA - B P I に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果などに関して一切責任を負うものではありません。

3．新光 J - R E I T マザーファンドの概要

ファンド名	新光 J - R E I T マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として東証 R E I T 指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証 R E I T 指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 不動産投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができるものとします。 外貨建資産への直接投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成18年10月31日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

東証REIT指数（配当込み）について

東証REIT指数（配当込み）は、東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均の指数で、東京証券取引所上場のREIT全体の値動きを、配当金を反映させたうえで表す指数です。

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利および東証REIT指数の商標に関するすべての権利は東証が有します。

東証は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

東証は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東証は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

東証は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

東証は、新光投信株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

4. 新光外国株式インデックスマザーファンドの概要

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成17年8月17日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

MSCIコクサイ・インデックスは、Morgan Stanley Capital International（以下「MSCI」といいます。）が開発した指数で、日本を除く世界の先進国の株式で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCIおよびMSCI指数は、MSCIおよびその関係会社のサービスマークであり、新光投信株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。本書に記載されたいかなるファンドについても、MSCI、その関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者もその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、本書に記載されたいかなるファンドに関して、いかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

5. 海外国債マザーファンドの概要

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

決算日	毎年11月4日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成13年11月5日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）について

シティグループ世界国債インデックスとは、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均して指数化したもので、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した指数です。

同指数は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクの知的財産です。同社は、各指数の算出、公表、利用など各指数に関する一切の権利を有しています。同社は、当ファンドの運用成績などに関する一切の責任を負いません。

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

ファンド名	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・単一発行体または単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・クレジットリンク債への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・発行体格付けにおいて、ムーディーズ社またはスタンダード・アンド・プアーズ社のソブリン信用格付けがCaa1またはCCC+以下の証券または無格付けの証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。 ・ファンドにおける証券の平均信用格付けは、ムーディーズ社またはスタンダード・アンド・プアーズ社の格付けにおいてB1またはB+以上とします。 ・ファンドにおける証券の平均デュレーションは、8年以下とします。
信託期間	150年
決算日	毎年5月31日
収益分配方針	受託会社は毎月3日（休業日の場合は翌営業日）に受益者に分配金を支払います。当該月次分配にかかわらず、投資顧問会社からの通知により受託会社は分配を行う場合があります。 分配はネット・インカム収益とネット実現損益の合計の範囲内で行うことができますが、受益者の利益にかなうと判断される場合には純資産から分配を行うこともできます。
信託報酬等	運用報酬 : 純資産総額に対し0.40% その他報酬 : 純資産総額に対し0.15%（上限） その他報酬には、受託会社報酬、管理事務代行会社報酬、保管受託銀行報酬、監査報酬、法的費用が含まれます。
信託設定日	平成18年3月8日
関係法人	受託会社兼管理事務代行会社：BNY メロン ファンド マネジメント（ケイマン）リミテッド 副管理事務代行会社：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店 保管受託銀行：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン 投資顧問会社：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

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82.9兆円）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9月末現在、1米ドル = 98.125円で換算

7. 新光米国REITマザーファンドの概要

ファンド名	新光米国REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。 ・REITの組入比率は原則として高位を保ちます。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・REITおよび短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 ・REITへの投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成18年10月31日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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

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

FTSE、London Stock Exchange Plc（以下「ロンドン証券取引所」といいます。）、The Financial Times Limited（以下「FT」といいます。）、National Association of Real Estate Investment Trusts（以下「全米不動産投資信託協会」といいます。）は、新光米国REITマザーファンドに関して、保証、推奨、販売もしくは奨励を行うものではありません。FTSE、ロンドン証券取引所、全米不動産投資信託協会は、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの使用により得られる結果もしくは特定日の特定時刻などにおける当該インデックスの数値に関して、明示的であるか黙示的であるかを問わず、一切の表明または保証を行いません。FTSE、ロンドン証券取引所、FT、全米不動産投資信託協会は、過失によるか否かを問わず、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおけるいかなる過誤に対しても、一切の責任を負うものではなくまた通知する義

務を負いません。

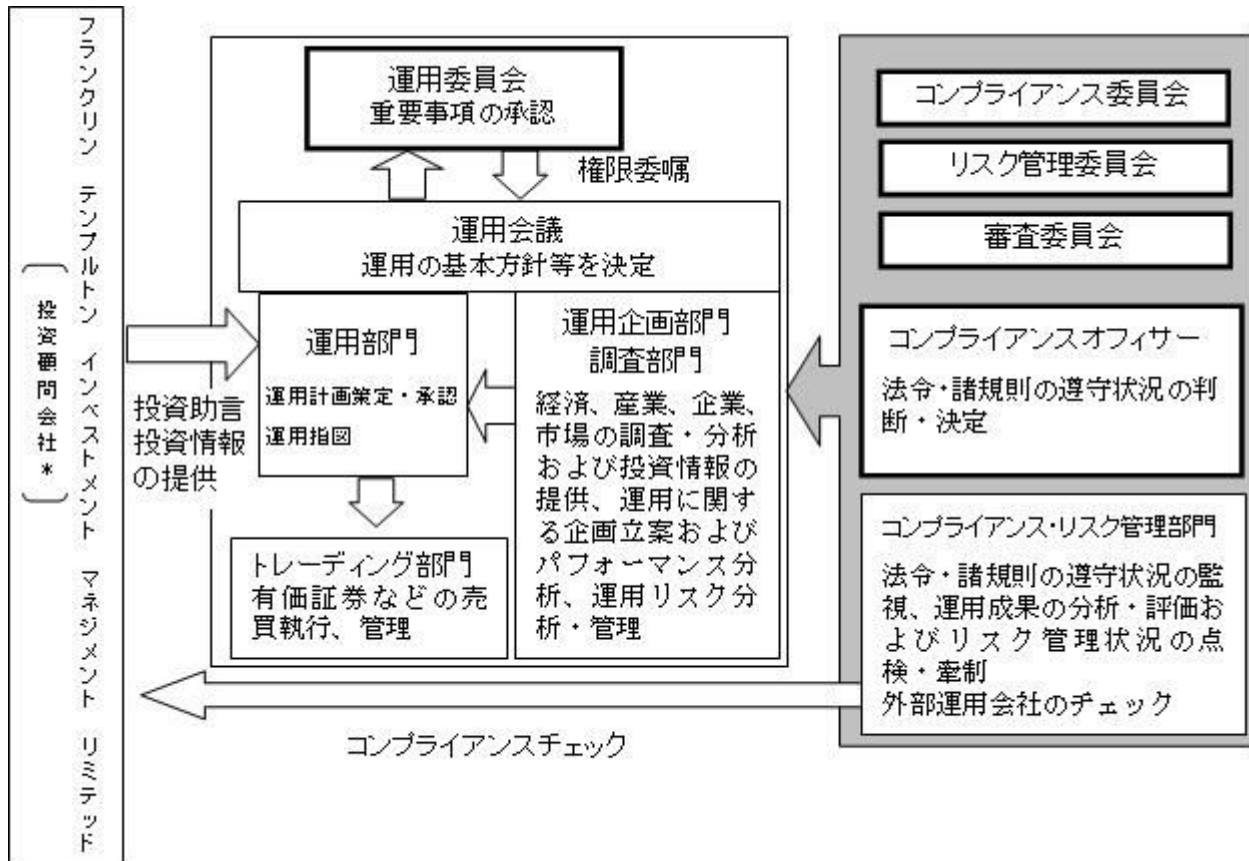
F T S E^(R) は、London Stock Exchange PlcおよびThe Financial Times Limitedの登録商標であり、許諾のもとにF T S Eにより使用されます。N A R E I T^(R) は、全米不動産投資信託協会の登録商標です。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成26年 1月21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



* 投資顧問会社は、フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド円建受益証券への投資に関して、委託者に対し投資助言および情報の提供等を行います。

上記は平成26年 1月21日現在のものであり、今後変更になることがあります。

PLAN

- ・運用委員会から権限委嘱された運用会議を運用部署全体（運用部門、運用企画部門、調査部門）で開催し、アセットアロケーションの方針等の運用の基本方針を決定します。
- ・運用担当者はこの運用の基本方針を踏まえ、投資顧問会社からの投資助言および提供された情報等を参考に運用計画を作成します。
- ・運用計画は運用調査本部長および副本部長により承認されます。

DO

- ・ファンドマネージャーは承認された運用計画に基づいて指図を行います。
- ・売買の執行・管理はトレーディング部門が行います。

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。

< 受託者に対する管理体制 >

投資信託財産の管理業務を通じ、受託者の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を総合的に検証しています。また、受託者より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

b. 運用体制に関する社内規則

運用に関する社内規則として運用規程・細則および職務権限規程等を設けており、ファンドマネージャーの任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図っています。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規があります。

（4）【配分方針】

- a. 収益分配は原則として、毎月20日（該当日が休業日の場合は翌営業日。）の決算時に以下の方針に基づき収益の分配を行います。
 - 1. 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
 - 2. 分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
 - 3. 上記2.にかかわらず、上記2.にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。
 - 4. 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。
- b. 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
 - 1. 分配金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- c. 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- d. 「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日まで

に、受益者に支払われます。

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

（５）【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

c．公社債の借り入れ

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

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

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

（ニ）借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d．同一銘柄の投資信託証券への投資制限

委託者は、原則として、投資信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

e．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

f．外国為替予約の指図

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

g．資金の借り入れ

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

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

借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

h. 受託者の自己または利害関係人等との取引

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

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

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

これらの運用による損益は、すべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金とは異なります。

a. 資産配分リスク

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

b. 株価変動リスク

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

c. REITの価格変動リスク

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

d. 為替変動リスク

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

また、当ファンドは新興国通貨建証券に実質的な投資を行うことから、為替変動リスクが

相対的に高くなる可能性があります。

e．カントリーリスク

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

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

f．金利変動リスク

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

g．信用リスク

公社債や短期金融商品の信用力の変化や格付けの変更により、債券価格が変動したり、財政難、経営不振、その他の理由により、利息や元本があらかじめ決められた条件で支払われなくなること（債務不履行）があります。信用力の低下、格付けの引き下げ、債務不履行が生じた場合、通常、債券価格は下落し、その結果、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。また、発行体の格付けの変更に伴い価格が下落するリスクもあります。

また、当ファンドが実質的に投資する株式の発行企業が、業績悪化、経営不振あるいは倒産などに陥った場合には、その企業の株式の価値が大きく減少すること、もしくは無くなることがあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。これらの影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

h．流動性リスク

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

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

i．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

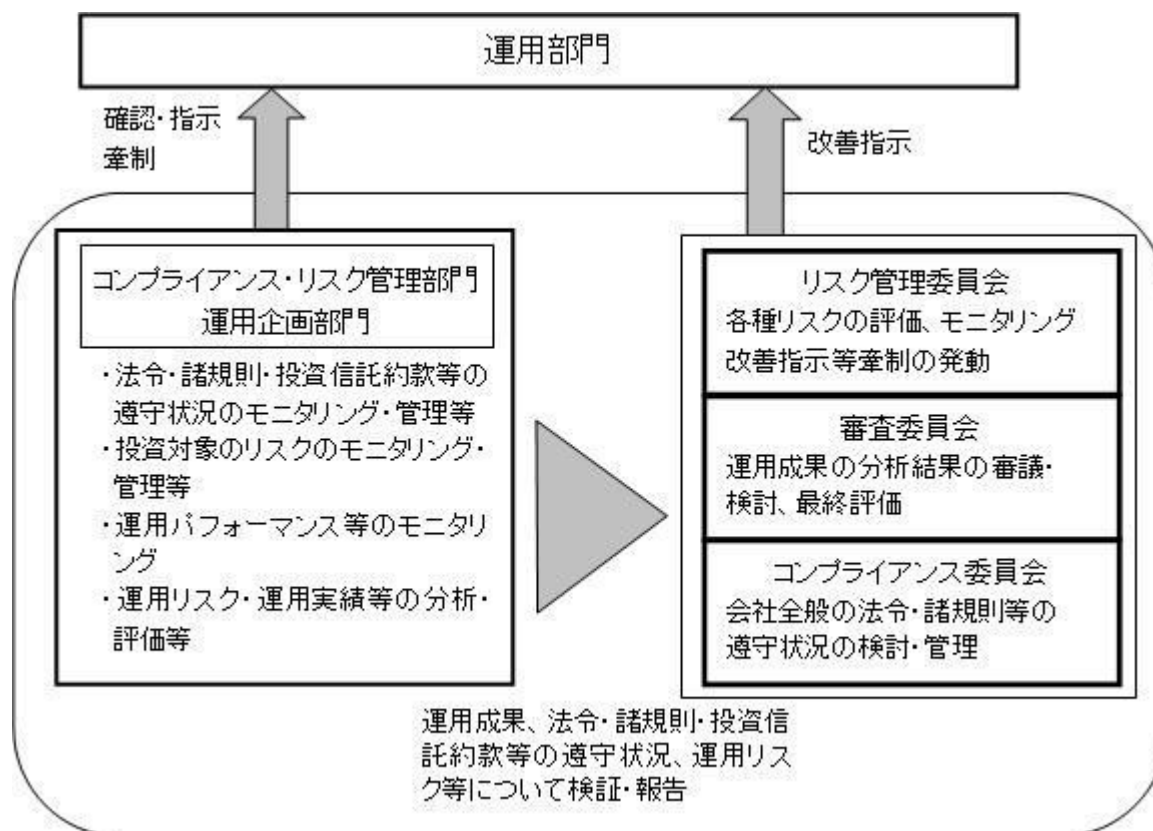
- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- (ロ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ハ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ニ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入る有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ホ) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (ヘ) 投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券（ベビーファンド）が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている

他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券（ベビーファンド）の価額が変動する可能性があります。

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

（２）リスク管理体制

- パフォーマンスの分析・管理 : 運用成果を分析し、その結果を審議・検討してその評価を行います。
- 運用リスクの管理 : 投資信託財産の運用リスクの管理およびその管理の現状・適正性を把握し、管理方針を協議、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。



上記は平成26年 1月21日現在のものであり、今後変更になることがあります。

4 【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.625%^{*}（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。当該手数料には消費税等（5%）が含まれます。

*消費税率が8%となった場合には、2.7%となります。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

<http://www.shinkotoushin.co.jp/>

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

a．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

b．信託財産留保額

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

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

（3）【信託報酬等】

当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.9975%^{*1}（税抜0.95%）を乗じて得た額とします。

なお、投資対象の投資信託証券における信託報酬を含めた当ファンドの実質的な信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に対して年率1.07615%^{*2}（税抜1.02865%）程度となります。

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産から支払われます。

<ファンド・オブ・ファンズの信託報酬の配分>

	信託報酬（対純資産総額・年率）		
販売会社別純資産額 ^{（注1）}	300億円未満の部分	300億円以上 500億円未満の部分	500億円以上の部分
委託者 ^{（注2）}	0.42%（税抜）	0.37%（税抜）	0.32%（税抜）

販売会社	0.45%（税抜）	0.50%（税抜）	0.55%（税抜）
受託者	0.08%（税抜）		
投資対象とする 投資信託証券	0.07865% ^{（注3）}		
実質的な負担 ^{（注4）}	1.07615% ^{*2} （税抜1.02865%）程度		

* 1 消費税率が8%となった場合には、年率1.026%となります。

* 2 消費税率が8%となった場合には、年率1.10465%となります。

（注1）販売会社別純資産額とは、当ファンドの純資産総額における、販売会社ごとの取り扱いにかかる額をいいます。

（注2）委託者の信託報酬には投資顧問会社（フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド）に対する報酬（投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうち当ファンドにおける保有分に対し年率0.05%）が含まれています。

（注3）フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンドの組入比率を14.3%として概算したものです。親投資信託の信託報酬はありません。

（注4）「実質的な負担」は、概算の数値です。実際の信託報酬は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。

（4）【その他の手数料等】

a．投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、投資信託財産にかかる監査報酬、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。

投資信託財産にかかる監査報酬は、毎計算期末または信託終了のときに、当該監査報酬にかかる消費税等とともに投資信託財産中から支払われます。

b．証券取引に伴う手数料・税金等、当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税および外貨建資産の保管等に要する費用についても投資信託財産が負担します。

c．「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。

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

（5）【課税上の取扱い】

a．個人の受益者の場合

（イ）収益分配金の取扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません。）・申告分離課税のいずれかを選択することもできます。また、特定口座（源泉徴収あり）の利用も可能です。

（ロ）一部解約金・償還金の取扱い

一部解約時および償還時の譲渡益（解約価額または償還価額から取得費（申込手数料

（税込）を含みます。）を控除した額）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座（源泉徴収あり）の利用も可能です。

（八）損益通算について

一部解約時、償還時に生じた損失（譲渡損）は、確定申告を行うことにより上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得の金額（申告分離課税を選択したものに限りま

す。）から差し引くこと（損益通算）ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。一部解約時、償還時に生じた差益（譲渡益）は、上場株式等の譲渡損と損益通算が

できます。

また、特定口座（源泉徴収あり）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行うことが可能です（申告不要）。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」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。

b. 法人の受益者の場合

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金および一部解約金・償還金の個別元本超過額については15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されま

す。なお、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

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

なお、益金不算入制度は適用されません。

c. 個別元本について

（イ）追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

（ハ）受益者が同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社ごとに、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等ごとに、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

（ニ）受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、「d. 収益分配金の課税について」をご参照ください。）

d. 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払い戻しに相当する部分）の区分があります。（前述の「収益分配金に関する留意事項」をご参照ください。）

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個

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

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

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

税法が改正された場合等は、上記「（５）課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

（１）【投資状況】

新光7資産バランスファンド

（平成25年11月29日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン諸島	1,115,778,500	12.97
親投資信託受益証券	日本	7,325,091,349	85.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		157,163,377	1.82
純資産総額		8,598,033,226	100.00

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

（参考）海外国債マザーファンド

（平成25年11月29日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	22,690,041,998	35.97
	カナダ	1,467,786,578	2.32
	ドイツ	9,404,932,766	14.91
	イタリア	10,362,749,624	16.43
	フランス	11,637,579,984	18.45
	イギリス	6,301,195,915	9.99
	小計	61,864,286,865	98.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,205,460,143	1.91
純資産総額		63,069,747,008	100.00

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

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	14,251,866,800	95.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		694,138,405	4.64
純資産総額		14,946,005,205	100.00

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

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	7,488,005,001	52.52
	カナダ	625,091,243	4.38
	モーリシャス	2,252,160	0.01
	パナマ	7,042,502	0.04
	ドイツ	577,950,062	4.05
	イタリア	134,260,833	0.94
	フランス	575,606,470	4.03
	オランダ	230,118,405	1.61
	スペイン	207,950,513	1.45
	ベルギー	75,869,246	0.53
	オーストリア	20,071,222	0.14
	ルクセンブルク	26,383,534	0.18
	フィンランド	61,057,348	0.42
	アイルランド	119,060,884	0.83
	ポルトガル	11,714,356	0.08
	イギリス	1,306,265,916	9.16
	スイス	610,152,766	4.28
	スウェーデン	200,973,499	1.40
	ノルウェー	42,197,837	0.29
	デンマーク	71,685,261	0.50
	ケイマン諸島	18,395,687	0.12
	リベリア	3,626,487	0.02
	オーストラリア	455,299,118	3.19
バミューダ諸島	56,082,772	0.39	
ニュージーランド	8,294,961	0.05	

	香港	150,768,681	1.05
	シンガポール	90,193,086	0.63
	イスラエル	30,720,438	0.21
	キュラソー	54,191,159	0.38
	ジャージー	67,150,092	0.47
	ガーンジー	4,025,957	0.02
	英ヴァージン諸島	7,543,848	0.05
	マン島	3,877,632	0.02
	小計	13,343,878,976	93.60
投資信託受益証券	シンガポール	1,894,257	0.01
投資証券	アメリカ	187,052,725	1.31
	カナダ	3,389,429	0.02
	フランス	18,915,912	0.13
	オランダ	1,813,362	0.01
	イギリス	18,389,739	0.12
	オーストラリア	33,669,524	0.23
	香港	5,742,387	0.04
	シンガポール	5,833,176	0.04
	小計	274,806,254	1.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		634,329,013	4.44
純資産総額		14,254,908,500	100.00

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

(参考)新光日本債券インデックスマザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	13,925,797,400	79.13
地方債証券	日本	1,285,928,100	7.30
特殊債券	日本	1,462,253,700	8.30
社債券	日本	839,810,000	4.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		83,806,008	0.47
純資産総額		17,597,595,208	100.00

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

(参考)新光J-REITマザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

投資証券	日本	1,203,601,400	98.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,874,981	1.46
純資産総額		1,221,476,381	100.00

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

(参考) 新光米国REITマザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	1,176,913,432	99.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,702,358	0.98
純資産総額		1,188,615,790	100.00

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

新光7資産バランスファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成25年11月29日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式インデックスマザー ファンド	837,711,594	1.4773	1,237,551,337	1.5229	1,275,750,986	14.83
2	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	626,195,083	1.9289	1,207,867,695	1.9789	1,239,177,449	14.41
3	日本	親投資信託 受益証券	新光J-REITマザーファンド	1,004,866,979	1.1980	1,203,830,640	1.2156	1,221,516,299	14.20
4	日本	親投資信託 受益証券	ニュー トピックス インデック ス マザーファンド	810,552,338	1.4652	1,187,621,286	1.4954	1,212,099,966	14.09
5	日本	親投資信託 受益証券	新光米国REITマザーファンド	1,191,174,643	0.9802	1,167,589,385	0.9979	1,188,673,176	13.82
6	日本	親投資信託 受益証券	新光日本債券インデックスマザー ファンド	1,015,710,537	1.1683	1,186,654,620	1.1695	1,187,873,473	13.81
7	ケイマン 諸島	投資信託受 益証券	フランクリン・テンブルトン・フ ロンティア・エマージング・マー ケッツ・デット・ファンド	173,500	6,344	1,100,684,000	6,431	1,115,778,500	12.97

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

ロ. 種類別投資比率

(平成25年11月29日現在)

種類	投資比率(%)
----	---------

投資信託受益証券	12.97
親投資信託受益証券	85.19
合計	98.17

(参考) 海外国債マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成25年11月29日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	24,700,000	10,252.34	2,532,329,387	10,253.2021	2,532,540,940	0.2500	2014.12.15	4.01
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	23,400,000	10,167.14	2,379,111,781	10,053.1631	2,352,440,172	2.5000	2023.08.15	3.72
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	23,400,000	9,558.55	2,236,702,368	9,435.4425	2,207,893,545	1.7500	2023.05.15	3.50
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,100,000	10,707.97	2,152,303,491	10,634.8767	2,137,610,229	2.6250	2020.11.15	3.38
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,900,000	9,831.39	2,054,762,051	9,711.4964	2,029,702,757	2.0000	2023.02.15	3.21
6	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	12,300,000	16,029.53	1,971,632,486	16,018.3756	1,970,260,200	3.7500	2021.04.25	3.12
7	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	11,900,000	16,383.76	1,949,667,535	16,414.4420	1,953,318,598	4.2500	2023.10.25	3.09
8	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	12,600,000	15,506.55	1,953,826,231	15,495.4005	1,952,420,475	3.2500	2021.10.25	3.09
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	16,200,000	11,379.67	1,843,507,190	11,298.2062	1,830,309,412	3.6250	2021.02.15	2.90
10	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	11,800,000	15,146.75	1,787,316,570	15,095.1503	1,781,227,747	3.0000	2022.04.25	2.82
11	イギリス	国債証券	TSY	10,300,000	15,800.69	1,627,472,073	15,655.4441	1,612,510,752	1.7500	2022.09.07	2.55
12	イギリス	国債証券	TSY	8,300,000	18,597.30	1,543,576,237	18,446.6704	1,531,073,646	3.7500	2021.09.07	2.42
13	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000	14,237.68	1,494,956,811	14,318.3582	1,503,427,611	3.7500	2021.08.01	2.38
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,800,000	10,077.04	1,491,403,233	9,995.5518	1,479,341,677	2.0000	2021.11.15	2.34
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,500,000	10,222.40	1,482,248,249	10,145.9812	1,471,167,281	2.1250	2021.08.15	2.33
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,400,000	9,563.03	1,472,707,934	9,449.8453	1,455,276,177	1.6250	2022.11.15	2.30
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9,300,000	15,067.37	1,401,266,049	15,166.2750	1,410,463,575	4.7500	2021.09.01	2.23
18	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9,300,000	14,953.17	1,390,644,914	15,067.2583	1,401,255,031	4.7500	2023.08.01	2.22
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9,100,000	14,267.20	1,298,315,282	14,383.9043	1,308,935,300	3.7500	2021.03.01	2.07
20	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,900,000	14,330.90	1,275,450,955	14,252.8120	1,268,500,268	1.7500	2022.07.04	2.01
21	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000	15,636.66	1,250,933,467	15,758.9800	1,260,718,400	5.5000	2022.11.01	1.99
22	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	9,200,000	13,440.27	1,236,505,496	13,428.6034	1,235,431,514	1.7500	2023.05.25	1.95
23	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	8,500,000	14,191.44	1,206,273,217	14,180.2928	1,205,324,888	2.2500	2022.10.25	1.91
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,600,000	11,002.34	1,166,248,541	10,919.7323	1,157,491,631	3.1250	2021.05.15	1.83
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000	15,649.50	1,142,413,785	15,768.7421	1,151,118,180	5.5000	2022.09.01	1.82
26	イギリス	国債証券	TSY	4,800,000	23,600.77	1,132,837,385	23,388.5740	1,122,651,552	8.0000	2021.06.07	1.78

27	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000	16,057.42	1,124,019,708	15,968.1700	1,117,771,900	3.2500	2021.07.04	1.77
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,200,000	9,778.88	1,095,235,476	9,683.4909	1,084,550,984	1.7500	2022.05.15	1.71
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,900,000	10,031.03	1,093,382,711	9,941.1412	1,083,584,396	2.0000	2022.02.15	1.71
30	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,400,000	14,675.37	1,085,977,809	14,626.5647	1,082,365,795	2.0000	2022.01.04	1.71

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成25年11月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別投資比率

(平成25年11月29日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.08
合計	98.08

(参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(平成25年11月29日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	111,600	4,389.03	489,815,748	6,380.00	712,008,000	4.76
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	599,600	479.00	287,208,400	659.00	395,136,400	2.64
3	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	38,900	3,020.00	117,478,000	8,290.00	322,481,000	2.15
4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	72,200	3,406.52	245,950,744	4,330.00	312,626,000	2.09
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	59,900	3,330.00	199,467,000	5,070.00	303,693,000	2.03
6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,024,500	169.00	173,140,500	215.00	220,267,500	1.47
7	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	49,800	2,749.21	136,910,658	3,460.00	172,308,000	1.15
8	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	31,100	3,725.00	115,847,500	5,140.00	159,854,000	1.06
9	日本	株式	キヤノン	電気機器	46,500	3,370.00	156,705,000	3,410.00	158,565,000	1.06
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	24,600	3,219.88	79,209,048	6,430.00	158,178,000	1.05
11	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	31,500	4,270.00	134,505,000	4,975.00	156,712,500	1.04
12	日本	株式	三菱地所	不動産業	55,000	2,104.00	115,720,000	2,844.00	156,420,000	1.04
13	日本	株式	ファナック	電気機器	8,900	15,638.06	139,178,734	17,240.00	153,436,000	1.02
14	日本	株式	日立製作所	電気機器	193,000	539.00	104,027,000	755.00	145,715,000	0.97
15	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	161,800	490.00	79,282,000	811.00	131,219,800	0.87
16	日本	株式	三井不動産	不動産業	37,000	2,067.00	76,479,000	3,475.00	128,575,000	0.86
17	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	33,100	2,614.00	86,523,400	3,770.00	124,787,000	0.83

18	日本	株式	三菱商事	卸売業	61,800	1,761.00	108,829,800	2,015.00	124,527,000	0.83
19	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	14,800	5,790.00	85,692,000	8,390.00	124,172,000	0.83
20	日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	355,000	223.00	79,165,000	332.00	117,860,000	0.78
21	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	19,300	4,461.79	86,112,547	6,070.00	117,151,000	0.78
22	日本	株式	パナソニック	電気機器	91,600	551.00	50,471,600	1,175.00	107,630,000	0.72
23	日本	株式	N T Tドコモ	情報・通信業	65,200	1,285.00	83,782,000	1,650.00	107,580,000	0.71
24	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	112,600	885.00	99,651,000	936.00	105,393,600	0.70
25	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	30,700	2,687.00	82,490,900	3,400.00	104,380,000	0.69
26	日本	株式	三井物産	卸売業	72,900	1,368.44	99,759,276	1,419.00	103,445,100	0.69
27	日本	株式	デンソー	輸送用機器	19,800	3,180.00	62,964,000	5,130.00	101,574,000	0.67
28	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	26,300	2,398.00	63,067,400	3,750.00	98,625,000	0.65
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	80,000	770.00	61,600,000	1,183.00	94,640,000	0.63
30	日本	株式	三菱重工業	機械	143,000	473.48	67,707,640	657.00	93,951,000	0.62

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成25年11月29日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.41
		建設業	2.36
		食料品	3.66
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.15
		医薬品	4.19
		石油・石炭製品	0.60
		ゴム製品	0.87
		ガラス・土石製品	0.96
		鉄鋼	1.64
		非鉄金属	1.00
		金属製品	0.64
		機械	5.00
		電気機器	11.34
		輸送用機器	11.60
		精密機器	1.32
		その他製品	1.36
		電気・ガス業	2.13
陸運業	3.59		
海運業	0.37		

	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	6.79
	卸売業	4.20
	小売業	3.96
	銀行業	9.41
	証券、商品先物取引業	1.77
	保険業	2.23
	その他金融業	1.44
	不動産業	3.46
	サービス業	2.01
合計		95.35

（参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成25年11月29日現在）

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4,131	53,319.85	220,264,309	55,917.2231	230,994,049	1.62
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	20,014	9,497.40	190,081,096	9,606.9960	192,274,418	1.34
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	35,981	3,869.42	139,225,874	3,850.9919	138,562,543	0.97
4	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,246	104,223.63	129,862,654	108,883.7263	135,669,123	0.95
5	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO (US)	資本財	46,304	2,770.46	128,283,426	2,747.9286	127,240,086	0.89
6	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	12,813	9,632.60	123,422,517	9,727.8516	124,642,963	0.87
7	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	8,785	12,412.27	109,041,878	12,538.2563	110,148,582	0.77
8	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	14,663	7,490.52	109,833,641	7,490.5299	109,833,641	0.77
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	12,451	8,450.67	105,219,344	8,631.9575	107,476,504	0.75
10	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	23,088	4,374.35	100,995,182	4,534.1334	104,684,072	0.73
11	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	17,115	5,526.58	94,587,472	5,887.1016	100,757,744	0.70
12	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	30,126	3,207.79	96,638,014	3,265.1496	98,365,897	0.69

13	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	銀行	85,485	1,164.23	99,524,943	1,141.8043	97,607,149	0.68
14	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,194	28,479.85	90,964,657	28,536.4298	91,145,357	0.63
15	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	24,148	3,602.11	86,983,786	3,626.6921	87,577,363	0.61
16	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	ソフトウェア・サービス	4,732	18,434.57	87,232,412	18,330.1073	86,738,068	0.60
17	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10,557	8,027.99	84,751,517	8,056.2800	85,050,148	0.59
18	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	220,298	381.71	84,091,624	382.6384	84,294,475	0.59
19	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	48,848	1,466.65	71,643,134	1,621.3085	79,197,682	0.55
20	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	13,827	5,114.85	70,723,097	5,433.3809	75,127,359	0.52
21	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	18,141	4,101.92	74,412,949	4,116.2597	74,673,069	0.52
22	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	85,706	798.59	68,444,246	806.1272	69,089,946	0.48
23	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	13,306	4,793.25	63,779,064	5,103.5886	67,908,350	0.47
24	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	13,100	5,141.48	67,353,441	5,113.8306	66,991,181	0.46
25	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,662	35,878.75	59,630,483	39,606.8381	65,826,565	0.46
26	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	食品・飲料・タバコ	7,359	9,157.37	67,389,102	8,756.9100	64,442,101	0.45
27	アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品 小売り	7,500	7,984.66	59,884,975	8,288.8506	62,166,380	0.43
28	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	7,086	8,792.75	62,305,476	8,646.2963	61,267,656	0.42
29	フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	9,817	6,108.34	59,965,652	6,214.3375	61,006,152	0.42
30	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	22,274	2,759.08	61,455,783	2,697.9732	60,094,657	0.42

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成25年11月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成25年11月29日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	9.65
		素材	5.42

	資本財	7.50
	商業・専門サービス	0.95
	運輸	1.78
	自動車・自動車部品	1.68
	耐久消費財・アパレル	1.63
	消費者サービス	1.72
	メディア	2.87
	小売	3.07
	食品・生活必需品小売り	2.18
	食品・飲料・タバコ	5.89
	家庭用品・パーソナル用品	1.82
	ヘルスケア機器・サービス	2.87
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.39
	銀行	7.65
	各種金融	5.71
	保険	4.20
	不動産	0.63
	ソフトウェア・サービス	6.13
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.78
	電気通信サービス	3.44
	公益事業	3.13
	半導体・半導体製造装置	1.40
投資信託受益証券		0.01
投資証券		1.92
合計		95.55

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成25年11月29日現在）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第89回利付国債(5年)	310,000,000	100.50	311,559,300	100.49	311,528,300	0.4000	2015.06.20	1.77
2	日本	国債証券	第269回利付国債(10年)	250,000,000	101.63	254,087,500	101.57	253,940,000	1.3000	2015.03.20	1.44
3	日本	国債証券	第323回利付国債(10年)	240,000,000	103.42	248,222,400	103.32	247,968,000	0.9000	2022.06.20	1.40
4	日本	国債証券	第273回利付国債(10年)	240,000,000	102.60	246,256,800	102.54	246,115,200	1.5000	2015.09.20	1.39
5	日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	230,000,000	107.01	246,141,400	106.99	246,081,600	1.4000	2020.03.20	1.39
6	日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	230,000,000	106.72	245,467,500	106.78	245,605,500	1.4000	2019.09.20	1.39
7	日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	230,000,000	106.53	245,037,400	106.52	245,014,400	1.3000	2021.03.20	1.39

8	日本	国債証券	第112回利付 国債（5年）	240,000,000	100.95	242,296,800	101.03	242,488,800	0.4000	2018.06.20	1.37
9	日本	国債証券	第308回利付 国債（10年）	220,000,000	106.50	234,313,200	106.45	234,196,600	1.3000	2020.06.20	1.33
10	日本	国債証券	第290回利付 国債（10年）	220,000,000	105.28	231,629,200	105.30	231,679,800	1.4000	2018.03.20	1.31
11	日本	国債証券	第315回利付 国債（10年）	210,000,000	105.86	222,308,100	105.82	222,222,000	1.2000	2021.06.20	1.26
12	日本	国債証券	第270回利付 国債（10年）	210,000,000	101.93	214,059,300	101.88	213,952,200	1.3000	2015.06.20	1.21
13	日本	国債証券	第88回利付 国債（5年）	200,000,000	100.55	201,116,000	100.54	201,084,000	0.5000	2015.03.20	1.14
14	日本	国債証券	第280回利付 国債（10年）	190,000,000	104.64	198,816,000	104.58	198,707,700	1.9000	2016.06.20	1.12
15	日本	国債証券	第97回利付 国債（5年）	190,000,000	100.75	191,426,900	100.77	191,470,600	0.4000	2016.06.20	1.08
16	日本	国債証券	第312回利付 国債（10年）	170,000,000	105.85	179,950,100	105.80	179,875,300	1.2000	2020.12.20	1.02
17	日本	国債証券	第101回利付 国債（5年）	170,000,000	100.83	171,417,800	100.89	171,521,500	0.4000	2016.12.20	0.97
18	日本	国債証券	第91回利付 国債（5年）	170,000,000	100.57	170,974,100	100.57	170,975,800	0.4000	2015.09.20	0.97
19	日本	国債証券	第87回利付 国債（5年）	170,000,000	100.45	170,775,200	100.43	170,746,300	0.5000	2014.12.20	0.97
20	日本	国債証券	第105回利付 国債（5年）	170,000,000	100.17	170,304,300	100.26	170,448,800	0.2000	2017.06.20	0.96
21	日本	国債証券	第285回利付 国債（10年）	160,000,000	105.21	168,344,000	105.21	168,347,200	1.7000	2017.03.20	0.95
22	日本	国債証券	第310回利付 国債（10年）	160,000,000	104.48	167,182,400	104.48	167,180,800	1.0000	2020.09.20	0.95
23	日本	国債証券	第318回利付 国債（10年）	160,000,000	104.32	166,926,400	104.30	166,880,000	1.0000	2021.09.20	0.94
24	日本	国債証券	第276回利付 国債（10年）	160,000,000	103.16	165,067,200	103.10	164,968,000	1.6000	2015.12.20	0.93
25	日本	国債証券	第103回利付 国債（5年）	160,000,000	100.53	160,852,800	100.60	160,969,600	0.3000	2017.03.20	0.91
26	日本	国債証券	第289回利付 国債（10年）	150,000,000	105.41	158,125,500	105.45	158,176,500	1.5000	2017.12.20	0.89
27	日本	国債証券	第277回利付 国債（10年）	150,000,000	103.51	155,269,500	103.45	155,182,500	1.6000	2016.03.20	0.88
28	日本	国債証券	第92回利付 国債（5年）	150,000,000	100.38	150,582,000	100.39	150,591,000	0.3000	2015.09.20	0.85
29	日本	国債証券	第284回利付 国債（10年）	140,000,000	104.86	146,811,000	104.84	146,780,200	1.7000	2016.12.20	0.83
30	日本	国債証券	第325回利付 国債（10年）	140,000,000	102.45	143,438,400	102.35	143,297,000	0.8000	2022.09.20	0.81

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

ロ.種類別投資比率

(平成25年11月29日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.13
地方債証券	7.30
特殊債券	8.30
社債券	4.77
合計	99.52

（参考）新光J-REITマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成25年11月29日現在）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	116	1,218,000	141,288,000	1,204,000	139,664,000	11.43
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	100	1,143,000	114,300,000	1,082,000	108,200,000	8.85
3	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	407	200,530.54	81,615,933	202,000	82,214,000	6.73
4	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	400	151,000	60,400,000	146,900	58,760,000	4.81
5	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	139	328,500	45,661,500	343,000	47,677,000	3.90
6	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	48	965,000	46,320,000	990,000	47,520,000	3.89
7	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	208	217,000	45,136,000	222,100	46,196,800	3.78
8	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	42	998,000	41,916,000	958,000	40,236,000	3.29
9	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	43	878,000	37,754,000	858,000	36,894,000	3.02
10	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	288	119,920.07	34,536,980	127,700	36,777,600	3.01
11	日本	投資証券	GLP投資法人	353	101,100	35,688,300	102,500	36,182,500	2.96
12	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	48	684,788.5	32,869,848	700,000	33,600,000	2.75
13	日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	63	506,000	31,878,000	485,500	30,586,500	2.50
14	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	67	437,000	29,279,000	422,000	28,274,000	2.31
15	日本	投資証券	野村不動産マスタ-ファンド投資法人	280	100,300	28,084,000	100,600	28,168,000	2.30
16	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	28	1,003,000	28,084,000	997,000	27,916,000	2.28
17	日本	投資証券	アクティブア-プロパティーズ投資法人	35	828,000	28,980,000	793,000	27,755,000	2.27
18	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	39	711,000	27,729,000	699,000	27,261,000	2.23
19	日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	55	466,533.56	25,659,346	477,000	26,235,000	2.14
20	日本	投資証券	大和ハウス-レジデンシャル投資法人	64	414,245.21	26,511,694	405,500	25,952,000	2.12
21	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	26	903,000	23,478,000	900,000	23,400,000	1.91
22	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	38	609,000	23,142,000	606,000	23,028,000	1.88
23	日本	投資証券	ジャパン-ホテル-リート投資法人	432	45,810.69	19,790,219	48,200	20,822,400	1.70
24	日本	投資証券	東急リアル-エステート投資法人	32	601,000	19,232,000	612,000	19,584,000	1.60
25	日本	投資証券	福岡リート投資法人	23	804,000	18,492,000	811,000	18,653,000	1.52
26	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	21	744,000	15,624,000	749,000	15,729,000	1.28
27	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	242	68,864.06	16,665,103	64,200	15,536,400	1.27
28	日本	投資証券	プレミアム投資法人	36	419,805.66	15,113,004	399,000	14,364,000	1.17
29	日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	26	564,000	14,664,000	539,000	14,014,000	1.14
30	日本	投資証券	積水ハウス-SI投資法人	27	498,500	13,459,500	497,000	13,419,000	1.09

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

ロ. 種類別投資比率

（平成25年11月29日現在）

種類	投資比率（％）
投資証券	98.53
合計	98.53

（参考）新光米国REITマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成25年11月29日現在）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	6,205	16,183.38	100,417,899	15,540.1866	96,426,858	8.11
2	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	8,000	8,092.20	64,737,633	8,026.6553	64,213,243	5.40
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2,900	17,632.62	51,134,618	15,792.1396	45,797,205	3.85
4	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	10,000	4,078.36	40,783,644	3,942.1458	39,421,458	3.31
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	7,200	5,654.60	40,713,179	5,326.8641	38,353,422	3.22
6	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	11,700	3,083.86	36,081,234	3,133.0277	36,656,425	3.08
7	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	5,955	6,712.60	39,973,574	5,903.4888	35,155,276	2.95
8	アメリカ	投資証券	HCP INC	9,100	4,360.01	39,676,176	3,827.4353	34,829,662	2.93
9	アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	5,700	6,641.93	37,859,040	5,814.3833	33,141,985	2.78
10	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,642	13,584.98	35,891,541	12,261.7225	32,395,471	2.72
11	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	3,100	11,145.34	34,550,567	10,407.9203	32,264,553	2.71
12	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	3,335	9,124.59	30,430,534	9,131.7673	30,454,444	2.56
13	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	14,979	1,902.96	28,504,492	1,900.9152	28,473,809	2.39
14	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	11,150	2,154.91	24,027,323	2,147.7474	23,947,384	2.01
15	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	8,200	2,136.48	17,519,146	2,138.5296	17,535,943	1.47
16	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	1,800	9,700.19	17,460,357	9,389.8655	16,901,758	1.42
17	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	2,801	6,051.99	16,951,646	5,896.3195	16,515,591	1.38
18	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3,992	4,287.30	17,114,906	3,925.7585	15,671,628	1.31
19	アメリカ	投資証券	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	3,300	5,000.14	16,500,477	4,543.3512	14,993,059	1.26
20	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	1,300	10,910.80	14,184,043	10,744.8823	13,968,347	1.17
21	アメリカ	投資証券	COLE REAL ESTATE INVESTMENTS INC	9,400	1,302.78	12,246,154	1,480.9931	13,921,336	1.17
22	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2,600	5,760.10	14,976,262	4,837.2965	12,576,971	1.05
23	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	800	16,392.32	13,113,857	15,675.3812	12,540,305	1.05
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	5,058	2,561.52	12,956,190	2,427.3540	12,277,557	1.03
25	アメリカ	投資証券	RAYONIER INC	2,500	5,966.98	14,917,473	4,578.1740	11,445,435	0.96
26	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	6,600	1,716.55	11,329,291	1,561.9050	10,308,573	0.86
27	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,700	6,753.57	11,481,078	5,988.4976	10,180,446	0.85
28	アメリカ	投資証券	DDR CORPORATION	6,097	1,711.43	10,434,639	1,659.2040	10,116,167	0.85
29	アメリカ	投資証券	LIBERTY PROPERTY	2,900	3,850.99	11,167,877	3,362.4486	9,751,101	0.82
30	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT	1,476	6,687.00	9,870,015	6,247.6199	9,221,487	0.77

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成25年11月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ. 種類別投資比率

(平成25年11月29日現在)

種類	投資比率（％）
投資証券	99.01
合計	99.01

【投資不動産物件】

新光7資産バランスファンド

該当事項はありません。

(参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

新光7資産バランスファンド

該当事項はありません。

(参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	東京証券取引所	東証東証株価指数先物	買建	52	日本円	632,760,600	656,500,000	4.39

(注)時価評価にあたっては、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	S&P500 EMINI	買建	47	米ドル	4,158,112.5	425,873,880	4,240,105	434,271,552	3.04
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60IX	買建	1	カナダド ル	153,980	14,902,184	153,960	14,900,248	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EURO ST50	買建	15	ユーロ	455,878	63,576,743	463,650	64,660,627	0.45
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI 200	買建	1	オース トラリアド ル	135,225	12,586,743	133,800	12,454,104	0.08
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	LIFFE FTSE	買建	5	英ポンド	333,666	55,862,360	332,700	55,700,631	0.39
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	SWISS MKT IX	買建	3	スイスフ ラン	247,142	27,964,116	247,620	28,018,203	0.19
	スウェ ーデン	ストックホル ム・オブ ション取引 所	OMXS30 INDEX	買建	1	スウェ ーデンク ローナ	127,895	2,004,114	131,650	2,062,955	0.01

(注)時価評価にあたっては、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外貨建先物取引については、平成25年11月29日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光J - R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光米国R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

（ 3 ） 【運用実績】

【純資産の推移】

新光7資産バランスファンド

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（平成19年 4月20日）	46,505,640,498	46,672,485,568	1.0946	1.0985
第2特定期間末（平成19年10月22日）	73,335,259,420	73,622,000,840	1.0050	1.0090
第3特定期間末（平成20年 4月21日）	60,571,391,084	60,839,591,183	0.9027	0.9067
第4特定期間末（平成20年10月20日）	31,463,032,178	31,656,566,896	0.6503	0.6543
第5特定期間末（平成21年 4月20日）	21,963,360,031	22,110,320,662	0.5978	0.6018
第6特定期間末（平成21年10月20日）	19,553,950,956	19,673,764,141	0.6526	0.6566
第7特定期間末（平成22年 4月20日）	16,678,962,105	16,777,904,047	0.6743	0.6783
第8特定期間末（平成22年10月20日）	13,023,510,796	13,108,669,225	0.6117	0.6157
第9特定期間末（平成23年 4月20日）	12,014,371,674	12,090,851,540	0.6284	0.6324
第10特定期間末（平成23年10月20日）	9,331,021,288	9,365,284,964	0.5447	0.5467
第11特定期間末（平成24年 4月20日）	8,395,549,774	8,423,613,455	0.5983	0.6003
第12特定期間末（平成24年10月22日）	7,563,587,311	7,588,930,007	0.5969	0.5989
第13特定期間末（平成25年 4月22日）	9,376,624,758	9,400,502,707	0.7854	0.7874
第14特定期間末（平成25年10月21日）	8,609,105,823	8,631,386,804	0.7728	0.7748
平成24年11月末日	7,639,752,901		0.6118	
12月末日	7,975,915,279		0.6472	
平成25年 1月末日	8,498,015,446		0.6947	
2月末日	8,600,788,137		0.7085	
3月末日	9,004,912,745		0.7494	
4月末日	9,334,478,287		0.7843	
5月末日	9,099,615,846		0.7704	
6月末日	8,715,543,883		0.7456	
7月末日	8,490,475,441		0.7456	
8月末日	8,258,734,968		0.7292	
9月末日	8,557,657,215		0.7628	
10月末日	8,598,227,054		0.7748	
11月末日	8,598,033,226		0.7892	

(注)表中の(分配付)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】

新光7資産バランスファンド

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	平成18年10月31日～平成19年 4月20日	0.0100
第2特定期間	平成19年 4月21日～平成19年10月22日	0.0240
第3特定期間	平成19年10月23日～平成20年 4月21日	0.0240
第4特定期間	平成20年 4月22日～平成20年10月20日	0.0240
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年 4月20日	0.0240
第6特定期間	平成21年 4月21日～平成21年10月20日	0.0240
第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年 4月20日	0.0240
第8特定期間	平成22年 4月21日～平成22年10月20日	0.0240
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年 4月20日	0.0240
第10特定期間	平成23年 4月21日～平成23年10月20日	0.0220
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年 4月20日	0.0120
第12特定期間	平成24年 4月21日～平成24年10月22日	0.0120
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年 4月22日	0.0120
第14特定期間	平成25年 4月23日～平成25年10月21日	0.0120

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

【収益率の推移】

新光7資産バランスファンド

期	計算期間	収益率（％）
第1特定期間	平成18年10月31日～平成19年 4月20日	10.4
第2特定期間	平成19年 4月21日～平成19年10月22日	6.0
第3特定期間	平成19年10月23日～平成20年 4月21日	7.8
第4特定期間	平成20年 4月22日～平成20年10月20日	25.3
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年 4月20日	4.4
第6特定期間	平成21年 4月21日～平成21年10月20日	13.2
第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年 4月20日	7.0
第8特定期間	平成22年 4月21日～平成22年10月20日	5.7
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年 4月20日	6.7
第10特定期間	平成23年 4月21日～平成23年10月20日	9.8
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年 4月20日	12.0
第12特定期間	平成24年 4月21日～平成24年10月22日	1.8
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年 4月22日	33.6
第14特定期間	平成25年 4月23日～平成25年10月21日	0.1

(注)収益率は各特定期間における騰落率を表示しており、当該特定期間中の分配金合計額を加算して計算しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

新光7資産バランスファンド

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1特定期間	平成18年10月31日～平成19年4月20日	43,240,359,545	754,263,663
第2特定期間	平成19年4月21日～平成19年10月22日	34,395,579,932	3,913,983,006
第3特定期間	平成19年10月23日～平成20年4月21日	7,842,389,976	13,713,317,012
第4特定期間	平成20年4月22日～平成20年10月20日	995,245,882	19,708,278,668
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年4月20日	176,344,143	11,818,197,061
第6特定期間	平成21年4月21日～平成21年10月20日	262,138,325	7,040,526,124
第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年4月20日	65,470,071	5,293,476,712
第8特定期間	平成22年4月21日～平成22年10月20日	64,807,629	3,510,685,871
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年4月20日	93,294,151	2,262,935,013
第10特定期間	平成23年4月21日～平成23年10月20日	55,270,668	2,043,398,766
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年4月20日	24,129,070	3,124,126,893
第12特定期間	平成24年4月21日～平成24年10月22日	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年4月22日	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	平成25年4月23日～平成25年10月21日	22,407,208	820,891,392

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

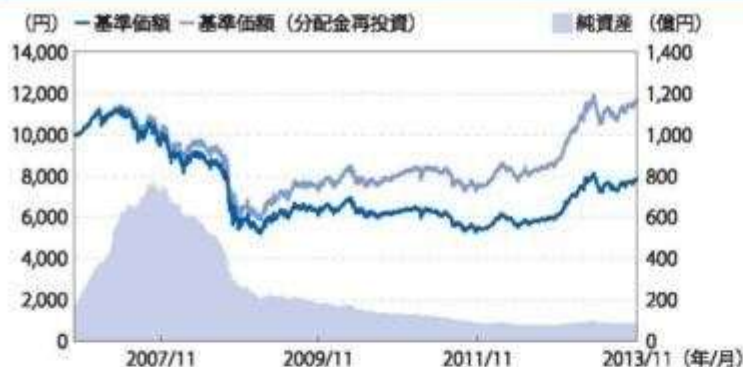
参考情報

運用実績

新光7資産バランスファンド 愛称：七重奏

2013年11月29日現在

<基準価額・純資産の推移> (2006年10月31日～2013年11月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。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、取引前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11月	20円
2013年10月	20円
2013年9月	20円
2013年8月	20円
2013年7月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	2,740円

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

<主要な資産の状況>

組入状況

ファンド名	純資産比率
新光外国株式インデックスマザーファンド	14.83%
海外国債マザーファンド	14.41%
新光J-REITマザーファンド	14.20%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	14.09%
新光米国REITマザーファンド	13.82%
新光日本債券インデックスマザーファンド	13.81%
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	12.97%
合計	98.17%

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	4.76%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.64%
ソフトバンク	情報・通信業	2.15%
本田技研工業	輸送用機器	2.09%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.03%

※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89回利付国債(5年)	2015/06/20	0.400%	1.77%
第269回利付国債(10年)	2015/03/20	1.300%	1.44%
第323回利付国債(10年)	2022/06/20	0.900%	1.40%
第273回利付国債(10年)	2015/09/20	1.500%	1.39%
第306回利付国債(10年)	2020/03/20	1.400%	1.39%

※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	11.43%
ジャパレリアルエステイト投資法人	8.85%
日本リテールファンド投資法人	6.73%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.81%
日本プライムリアルティ投資法人	3.90%

※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ください。

運用実績

2013年11月29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	1.62%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.34%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.97%
GOOGLE INC-CL A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.95%
GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	資本財	0.89%

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

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	2014/12/15	0.250%	米ドル	4.01%
US TREASURY N/B	2023/08/15	2.500%	米ドル	3.72%
US TREASURY N/B	2023/05/15	1.750%	米ドル	3.50%
US TREASURY N/B	2020/11/15	2.625%	米ドル	3.38%
US TREASURY N/B	2023/02/15	2.000%	米ドル	3.21%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

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11月14日現在)

①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	54.9%
ユーロ	8.7%
ブラジルレアル	4.7%
メキシコペソ	3.4%
ウルグアイペソ	3.2%

②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
ロシア	8.8%
ナイジェリア	7.5%
ウクライナ	5.2%
トリニダード・トバゴ	4.8%
その他(国際機関債)	4.7%

※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。

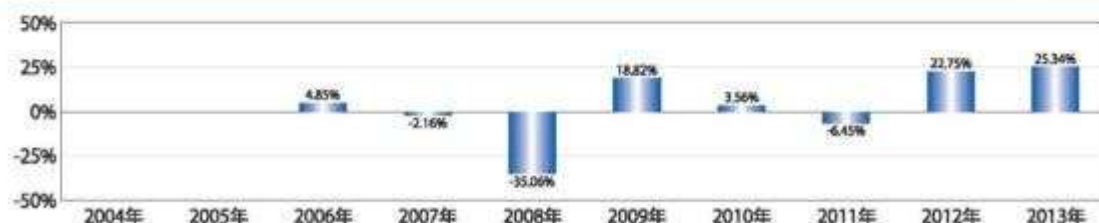
米国REITの組入上位5銘柄(新光米国REITマザーファンド)

銘柄名	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	8.11%
AMERICAN TOWER CORPORATION	5.40%
PUBLIC STORAGE	3.85%
PROLOGIS INC	3.31%
EQUITY RESIDENTIAL	3.22%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

<年間収益率の推移>

暦年ベース



※税引前の分配金を単純に計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11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。

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

2【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

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

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

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

<http://www.shinkotoushin.co.jp/>

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

当ファンドの主な投資対象の評価方法は以下のとおりです。

投資対象	評価方法
内国投資信託証券 (親投資信託受益証券)	原則として基準価額計算日の基準価額で評価
外国籍投資信託証券	原則として基準価額計算時に知りうる直近の日の基準価額で評価
外貨建資産	原則として基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値で円換算により評価
為替予約取引	原則として基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から平成28年10月20日までです。

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

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

(ハ) 上記(ロ)の投資信託契約の解約にかかる公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- (二) 上記(八)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、投資信託契約の解約をしません。
- (ホ) 委託者は、上記(二)の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ヘ) 上記(八)から(ホ)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(ホ)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (ト) 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。
- (チ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

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

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

b. 投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d. 運用報告書

当ファンドについて、委託者は原則として6ヵ月ごと(原則として4月、10月の各特定期間の終了時)および償還時に、期中の運用経過のほか、投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

運用報告書は、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。また、販売会社で、受け取ることができます。

e. 公告

委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

f. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g. 信託事務処理の再信託

(イ) 受託者は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

(ロ) 上記(イ)における日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

h. 信託業務の委託等

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

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

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

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

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

i. 関係法人との契約の更改

委託者と販売会社との間において締結している「証券投資信託に関する基本契約」の有効期間は契約の締結日から1年ですが、期間満了前に委託者、販売会社いずれからも別段の意

思表示のないときは自動的に1年間更新されるものとし、その後も同様とします。

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日まで)に受益者に支払います。

受益者が、収益分配金について、支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

上記にかかわらず、「分配金再投資コース」の受益者の収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。

b．一部解約請求権

受益者は、販売会社ごとに定める単位で、一部解約の実行を請求することができます。

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

c．償還金請求権

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日まで)に受益者に支払います。

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

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14期特定期間（平成25年4月23日から平成25年10月21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】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期特定期間末 平成25年 4月22日現在	第14期特定期間末 平成25年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	215,153,101	239,526,728
投資信託受益証券	1,229,594,500	1,097,734,500
親投資信託受益証券	7,973,108,952	7,318,365,132
未収利息	279	260
流動資産合計	9,417,856,832	8,655,626,620
資産合計		
	9,417,856,832	8,655,626,620
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	23,877,949	22,280,981
未払解約金	9,307,200	16,966,499
未払受託者報酬	674,215	609,929
未払委託者報酬	7,332,098	6,632,978
その他未払費用	40,612	30,410
流動負債合計	41,232,074	46,520,797
負債合計		
	41,232,074	46,520,797
純資産の部		
元本等		
元本	11,938,974,794	11,140,490,610
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,562,350,036	2,531,384,787
（分配準備積立金）	179,866,812	194,335,120
元本等合計	9,376,624,758	8,609,105,823
純資産合計		
	9,376,624,758	8,609,105,823
負債純資産合計		
	9,417,856,832	8,655,626,620

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期特定期間		第14期特定期間	
	自	平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日	自	平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日
営業収益				
受取配当金		95,220,000		93,690,000
受取利息		48,288		53,000
有価証券売買等損益		2,393,592,853		76,603,820
営業収益合計		2,488,861,141		17,139,180
営業費用				
受託者報酬		3,470,063		3,664,915
委託者報酬		37,736,834		39,855,914
その他費用		209,009		180,970
営業費用合計		41,415,906		43,701,799
営業利益		2,447,445,235		26,562,619
経常利益		2,447,445,235		26,562,619
当期純利益		2,447,445,235		26,562,619
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		9,790,829		815,542
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,107,760,923		2,562,350,036
剰余金増加額又は欠損金減少額		264,933,911		199,480,615
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		264,933,911		199,480,615
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,519,355		5,297,744
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,519,355		5,297,744
分配金		146,658,075		137,470,545
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,562,350,036		2,531,384,787

(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14期特定期間 自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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 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、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 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、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25年 4月23日から平成25年10月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第13期特定期間末 平成25年 4月22日現在	第14期特定期間末 平成25年10月21日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 11,938,974,794口	1. 特定期間末日における受益権の総数 11,140,490,610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 2,562,350,036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 2,531,384,787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)	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 0.7728円 (1万口当たり純資産額) (7,728円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	第14期特定期間 自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日

<p>分配金の計算過程</p>	<p>第71期(自平成24年10月23日至平成24年11月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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>第72期(自平成24年11月21日至平成24年12月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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>第73期(自平成24年12月21日至平成25年1月21日)</p> <p>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> <p>第74期(自平成25年1月22日至平成25年2月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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>第75期(自平成25年2月21日至平成25年3月21日)</p> <p>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>第77期(自平成25年4月23日至平成25年5月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(30,994,092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(3,279,825円)及び分配準備積立金(178,710,136円)より分配対象収益は212,984,053円(1万口当たり179.65円)であり、うち23,707,679円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第78期(自平成25年5月21日至平成25年6月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,180,336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(3,303,792円)及び分配準備積立金(184,144,411円)より分配対象収益は208,628,539円(1万口当たり177.97円)であり、うち23,442,620円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第79期(自平成25年6月21日至平成25年7月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(29,922,964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(3,264,720円)及び分配準備積立金(177,364,075円)より分配対象収益は210,551,759円(1万口当たり184.46円)であり、うち22,827,776円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第80期(自平成25年7月23日至平成25年8月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,072,262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(3,315,158円)及び分配準備積立金(183,595,743円)より分配対象収益は207,983,163円(1万口当たり183.13円)であり、うち22,712,347円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第81期(自平成25年8月21日至平成25年9月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(29,208,930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(3,352,425円)及び分配準備積立金(180,328,923円)より分配対象収益は212,890,278円(1万口当たり189.23円)であり、うち22,499,142円(1万口当たり20円)を分配しております。</p>
-----------------	---	--

第76期（自 平成25年 3月22日 至 平成25年 4月22日）	第82期（自 平成25年 9月21日 至 平成25年10月21日）
<p>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>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（31,238,985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（3,414,543円）及び分配準備積立金（185,377,116円）より分配対象収益は220,030,644円（1万口当たり197.49円）であり、うち22,280,981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13期特定期間 自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日	第14期特定期間 自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資信託受益証券、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p>	同左

<p>3.金融商品に係るリスクの管理体制</p>	<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>	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、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>
<p>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>	<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>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

<p>第13期特定期間末 平成25年 4月22日現在</p>	<p>第14期特定期間末 平成25年10月21日現在</p>
<p>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。</p> <p>2.時価の算定方法 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	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	第14期特定期間 自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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13期特定期間末 平成25年 4月22日現在	第14期特定期間末 平成25年10月21日現在
期首元本額	12,671,348,234円	11,938,974,794円
期中追加設定元本額	36,256,481円	22,407,208円
期中一部解約元本額	768,629,921円	820,891,392円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第13期特定期間末 平成25年 4月22日現在	第14期特定期間末 平成25年10月21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	37,649,500	13,359,500
親投資信託受益証券	428,774,003	55,402,030
合計	466,423,503	42,042,530

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	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	1,097,734,500	
投資信託受益証券 小計		173,500	1,097,734,500	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	626,195,083	1,182,757,272	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	864,493,408	1,244,956,956	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	900,021,204	1,281,720,196	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	1,015,710,537	1,185,638,909	
	新光J - R E I Tマザーファンド	1,004,866,979	1,224,731,874	
	新光米国R E I Tマザーファンド	1,191,174,643	1,198,559,925	
親投資信託受益証券 小計		5,602,461,854	7,318,365,132	
合計		5,602,635,354	8,416,099,632	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」、「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・マーケッツ・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。同ファンドの平成25年5月31日現在の財務書類は、国際財務報告基準に従い作成されており、独立監査人の監査を受けております。

同ファンドの財政状態計算書、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BNY 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

2013年5月31日現在

	注記	2013年5月31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	57,033,825,945	43,045,216,459
ブローカーに対する債権		-	147,042,062
発行に係る未収入金		1,646,943,740	-
現金および現金同等物	6	8,730,924,392	917,164,220
その他の債権	11	-	206,405
資産合計		<u>67,411,694,077</u>	<u>44,109,629,146</u>
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	<u>66,979,115,060</u>	<u>43,603,106,877</u>
負債			
流動負債			
償還に係る未払金		141,861,135	155,530,989
ブローカーに対する債務		231,334,913	303,801,829
未払費用	7	59,382,969	47,189,451
負債合計		<u>432,579,017</u>	<u>506,522,269</u>
資本および負債合計		<u>67,411,694,077</u>	<u>44,109,629,146</u>

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

2013年5月31日終了会計年度

	注記	2013年5月31日終了会計年度 （日本円）	2012年5月31日終了会計年度 （日本円）
収益			
保管受託銀行に預けた預金からの受取利息		79,848	107,128
その他の収益	10	23,032,411	-
為替差益 / （差損）純額		1,132,990,380	(26,976,999)
純損益を通じて公正価値で測定する金融 資産に係る公正価値のその他の純変動額	4	<u>18,799,379,522</u>	<u>(2,104,323,844)</u>
純収益 / （損失）合計		<u>19,955,482,161</u>	<u>(2,131,193,715)</u>
費用			
運用報酬	11(a)	207,017,727	184,337,323
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	11(b)	51,630,992	46,953,783
保管受託銀行報酬	11(c)	24,841,163	17,967,708

費用の払戻し	11(d)	-	(206,405)
当座借越利息		85,474	-
その他の営業費用		18,314,140	7,165,863
営業費用合計		301,889,496	256,218,272
税引前利益/(損失)		19,653,592,665	(2,387,411,987)
源泉税		-	-
当期利益/(損失)		19,653,592,665	(2,387,411,987)
その他の包括利益		-	-
包括利益/(損失)合計		19,653,592,665	(2,387,411,987)

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

2013年5月31日終了会計年度

	注記	2013年5月31日終了会計年度		2012年5月31日終了会計年度	
		受益証券 口数	(日本円)	受益証券 口数	(日本円)
期首残高		7,781,812	43,603,106,877	6,567,000	46,542,655,146
当期包括利益/(損失)合計		-	19,653,592,665	-	(2,387,411,987)
当期分配金	9	-	(8,820,848,250)	-	(8,010,993,510)
受益証券の発行		5,039,283	31,634,238,087	3,131,300	19,314,057,008
受益証券の償還		(3,189,960)	(19,090,974,319)	(1,916,488)	(11,855,199,780)
期末残高		9,631,135	66,979,115,060	7,781,812	43,603,106,877

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

2013年5月31日終了会計年度

	注記	2013年5月31日終了会計年度 (日本円)	2012年5月31日終了会計年度 (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		19,653,592,665	(2,387,411,987)
- 受取利息		(79,848)	(107,128)
- 当座借越利息		85,474	-
運転資本変動前営業キャッシュ・フロー		19,653,598,291	(2,387,519,115)
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 融資産の純(増加)/減少額		(13,988,609,486)	3,329,606,891
- ブローカーに対する債権の減少		147,042,062	96,168,525
- その他の債権の減少/(増加)		206,405	(206,405)
- ブローカーに対する債務の減少		(72,466,916)	(160,821,581)
- 未払費用の増加/(減少)		12,193,518	(3,115,817)
営業によるキャッシュ		5,751,963,874	874,112,498
利息の受取額		79,848	107,128
営業活動による正味キャッシュ収入		5,752,043,722	874,219,626

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	(8,820,848,250)	(8,010,993,510)
受益証券の発行による収入	29,987,294,347	19,314,057,008
受益証券の償還による支払	(19,104,644,173)	(11,699,668,791)
当座借越利息	(85,474)	-
財務活動による正味キャッシュ収入 / (支出)	2,061,716,450	(396,605,293)
現金および現金同等物の純増加額	7,813,760,172	477,614,333
現金および現金同等物期首残高	917,164,220	439,549,887
現金および現金同等物期末残高	6 8,730,924,392	917,164,220

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

2013年5月31日終了会計年度

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・マーケッツ・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, PO 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 シンガポール支店は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。

本財務書類は、2013年8月20日に受託会社によって公表を承認された。

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年度において首尾一貫して適用されている。

2.1 表示の基礎

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

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

(a) 2012年6月1日発効の基準および既存の基準の修正

2012年6月1日開始会計年度から発効し、当ファンドに重要な影響を及ぼすと見込まれる基準、解釈指針および既存の基準の修正はない。

(b) 当ファンドにより早期適用された2012年6月1日以降に発効された基準

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、早期適用された。当該基準は、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の他の規定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、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。当該基準の適用により、当ファンドは、上場金融資産および負債の評価インプットを、当ファンドの募集要項で規定されている発行および償還に係る当ファンドの1口当たりの取引価値の計算についてのインプットに合致する仲値に変更した。仲値の使用は、業界内で標準的な価格付けの慣行として認識されている。前年において、当ファンドは、IAS第39号に従って、上場金融資産および負債の買呼値および売呼値を使用した。評価インプットの変更は、IAS第8号に従った推定の変更とみなされる。

(c) 2012年6月1日以降に発効された早期適用されていない新基準、修正および解釈指針

IAS第1号「その他の包括利益の項目の表示」の修正は、2012年7月1日以後開始される年度から発効され、企業がその他の包括利益（以下「OIC」という。）において表示される項目を、後に潜在的に損益に再区分されるかどうかに基づいてグループ化することを要求し、当該修正により生じる変更を規定している。当該修正は、いずれの項目がOICに表示されるかを指定するものではない。当該修正はまだ発効されておらず、当ファンドの財務状況または業績に重大な影響を及ぼすものではないと見込まれる。

IFRS第7号「金融資産と金融負債の相殺」の修正は、2013年1月1日以後開始される年度から発効され、IFRSに従って財務諸表を作成した企業と、米国会計基準に従って財務諸表を作成した企業との比較を容易にする新しい開示を含む。当該修正はまだ発効されておらず、当ファンドの財務状況または業績に重大な影響を及ぼすものではないと見込まれる。

IFRS第9号「金融商品」は、金融資産および金融負債の分類、測定、および認識を取り扱っている。IFRS第9号は、2009年11月および2010年10月に公表された。同基準は、金融商品の分類および測定に関するIAS第39号の各部分を置き換えたものである。IFRS第9号は、金融資産を2つの測定カテゴリー、すなわち、公正価値で測定するものと償却原価で測定するものとに分類するよう要求している。この決定は、当初認識時に行われる。かかる分類は、企業が当該金融商品を管理する事業モデルおよび当該金融商品の契約上のキャッシュ・フローの性質による。金融負債に関しては、同基準は、IAS第39号の規定の大半を引き継いでいる。主な変更は、金融負債について公正価値オプションを選択した場合には、企業自身の信用リスクによる公正価値の変動部分を、会計上のミスマッチを創出しない限り、損益計算書ではなくその他の包括利益に計上する点である。当ファンドは、IFRS第9号を2015年1月1日以後開始する会計期間までに採用する予定である。当該基準は、当ファンドの財務状況または業績に重大な影響を及ぼすものではないと見込まれる。

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および金融負債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仲値である。

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、リターンの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。

国/地方または地域毎に、投資顧問会社が当ファンドの純資産価値の一定割合以上に投資することを制限する投資方針がある。下表をご参照のこと。

分類	投資上限（％）
国/地方	最大20%
地域（ラテンアメリカ、東欧、中東/アフリカ、極東/アジア）	最小10%、最大40%

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。当ファンドの純資産価値全体に基づく投資制限は、以下に示されている。

リスクベースのカテゴリー	カテゴリー1	カテゴリー2	カテゴリー3

投資上限(%)	国/地方当たり最大16%	国/地方当たり最大8%	国/地方当たり最大4%
---------	--------------	-------------	-------------

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。

2013年5月31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、以下の通りである。

	2013年5月31日現在	2012年5月31日現在
VaR(%)	7.105%	9.229%
VaR(金額)	4,758,866,125円	4,024,130,734円

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、当レビュー年度中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2013年度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			
	2013年5月31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	0.00	-	1.54	36,297,759
月次総利回り最小値	(1.58)	(46,217,579)	(5.78)	(136,234,446)
月次総利回り最大値	4.30	125,782,019	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	0.40	7,901,808	1.17	18,736,777
月次総利回り最小値	(2.42)	(47,805,939)	(2.09)	(33,469,969)
月次総利回り最大値	4.60	90,870,794	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)
2013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						
償還可能受益証券の保有者に対する債権	4,939,613,996	5,714,266,800	15,937,289,589	25,542,040,291	4,900,615,269	57,033,825,945
現金および現金同等物	8,730,924,392	-	-	-	-	8,730,924,392
資産合計	13,670,538,388	5,714,266,800	15,937,289,589	25,542,040,291	6,547,559,009	67,411,694,077

負債						
償還可能受益証券の保有者に対する債務	-	-	-	-	141,861,135	141,861,135
ブローカーに対する債務	-	-	-	-	231,334,913	231,334,913
未払費用	-	-	-	-	59,382,969	59,382,969
負債合計	-	-	-	-	432,579,017	432,579,017

金利感応度ギャップ合計	13,670,538,388	5,714,266,800	15,937,289,589	25,542,040,291		
-------------	----------------	---------------	----------------	----------------	--	--

	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
-----------------	---------------	---------------	---------------	----------------

金利感応度分析

金利リスクに対する感応度分析は、VaRが使用されていることから、2012年および2013年5月31日現在において、独立して開示されていない。注記3.2 市場価格リスクを参照のこと。

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。

	2013年5月31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	3,207,379,309	1,723,300,800
コスタリカ・コロン	1,420,839,628	-
ドイツ・マルク	1,707,953,635	1,194,614,894
ドミニカ・ペソ	1,261,521,070	921,942,746
ユーロ	4,693,392,063	4,649,791,138
ガーナ・セディ	1,548,019,358	1,042,412,317
日本円	8,630,903,593	-
メキシコ・ヌエボ・ペソ	2,215,182,089	1,530,337,193
新トルコ・リラ	1,962,703,244	1,481,037,078
ナイジェリア・ナイラ	1,769,053,553	983,315,063
ロシア・ルーブル	1,393,128,994	819,293,839
セルビア・ディナール	702,603,445	436,708,011
南アフリカ・ランド	1,131,367,523	929,551,408
ウガンダ・シリング	741,689,760	530,942,653
ウルグアイ・ペソ	2,384,539,746	1,312,511,847
米ドル	32,641,417,067	26,553,870,159
資産合計	67,411,694,077	44,109,629,146
負債		
日本円	185,693,856	187,542,087
シンガポール・ドル	5,351,339	4,304,077
米ドル	241,533,822	314,676,105
負債合計	432,579,017	506,522,269

当ファンドは、2013年5月31日現在、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ない。以下の表は、エクスポージャーの要約である。

2013年5月31日現在

2012年5月31日現在

クレジット・リンク債	(日本円)	(日本円)
ブラジル・リアル	-	1,723,300,800
ユーロ	-	881,214,312
クレジット・リンク債合計	-	2,604,515,112

為替リスク感応度分析

為替リスクに対する感応度分析は、VaRが使用されていることから、2012年および2013年5月31日現在において、独立して開示されていない。注記3.2 市場価格リスクを参照のこと。

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。2013年5月31日現在、当ファンドの有価証券の平均信用格付は、BB-(2012年：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)	2013年5月31日現在	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 (%)	純損益を通じて公正価値 で測定する金融資産の割 合 (%)
A3 / A-	-	2.16
Baa1 / BBB+	5.80	5.55
Baa2 / BBB	7.49	13.70
Baa3 / BBB-	17.09	10.22
Ba1 / BB+	2.23	7.67
Ba2 / BB	3.49	12.87
Ba3 / BB-	25.08	10.67
B1 / B+	7.83	7.62
B2 / B	11.59	16.60
B3 / B-	17.56	8.83
Caa1 / CCC+	0.91	-
Caa2 / CCC	-	2.02
D(スタンダード・アンド・プアーズのみ)	0.93	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。当ファンドは、2013年5月31日現在、クレジット・リンク債に対してエクスポージャーを有していない。

発行体の格付	基礎となる企業の格付	2013年5月31日現在	2012年5月31日現在
--------	------------	--------------	--------------

(ムーディーズ/スタンダード・アンド・プアーズ)		純資産に対する割合 (%)	純資産に対する割合 (%)
Aa3 / AA-	Baa2	-	3.95
A1 / A+	BB-	-	2.02
合計		-	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。

	2013年5月31日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
債券	52,133,210,676	36,482,270,066
デリバティブ資産	4,900,615,269	6,562,946,393
ブローカーに対する債権	-	147,042,062
現金および現金同等物	8,730,924,392	917,164,220
その他の債権	-	206,405
償還可能受益証券保有者に対する債権	1,646,943,740	-
合計	67,411,694,077	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。

	2013年5月31日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
Astana Finance 7.875% 08/06/2010	532,706,620	395,310,532
Sphynx Capital Markets 10.25% due 30/01/2010	-	502,538,702
合計	532,706,620	897,849,234

上記の投資は、不履行となっている支払を2013年5月31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)
2013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	141,861,135	-	141,861,135

ブローカーに対する債務	231,334,913	-	231,334,913
未払費用	-	59,382,969	59,382,969
合計	373,196,048	59,382,969	432,579,017

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：1名)であり、当ファンドの80%(2012年：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の公正価値測定の対象となりうる資産は、すべて1年以内に満期を迎えるソブリン短期証券である。ソブリン短期証券は、日々増価する当初購入水準から額面への割引分を短期証券の最終満期日まで償却する単一の直線的な価格付けの手法を用いて評価され、それは公正価値に近似する。当初の価格付けの条件からの重要な逸脱が生じた場合、もしくは新しい価格付けによって額面への割引分が適切に更新される場合、更新された条件が評価測定の算出に適用される。

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。

2013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	-	50,503,141,364	1,630,069,312	52,133,210,676
- デリバティブ資産	-	4,900,615,269	-	4,900,615,269
資産合計	-	55,403,756,633	1,630,069,312	57,033,825,945

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、2013年5月31日終了年度に係るレベル3の商品の変動を示したものである。

	債券 2013年5月31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	1,256,073,958	968,866,915
売却	(619,498,858)	(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	(432,272,798)	161,157,163
期末残高	1,630,069,312	1,425,767,010
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その他の純変動額に含まれる期末現在保有のレベル3の商品に係る未実現利益または損失の変動額	(250,236,437)	17,247,166

以下の表は、2013年5月31日現在、公正価値で測定されていないが当該公正価値が開示されている当ファンドの資産および負債を、公正価値ヒエラルキーの範囲内で分析したものである。

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)
資産				
流動資産				
償還可能受益証券保有者に対する債権	-	1,646,943,740	-	1,646,943,740
現金および現金同等物	8,730,924,392	-	-	8,730,924,392

合計	8,730,924,392	1,646,943,740	-	10,377,868,132
負債				
流動負債				
償還可能受益証券保有者に対する債務	-	141,861,135	-	141,861,135
ブローカーに対する債務	-	231,334,913	-	231,334,913
未払費用	-	59,382,969	-	59,382,969
合計	-	432,579,017	-	432,579,017

上表に含まれる資産および負債は、償却原価で帳簿計上される。当該帳簿額は公正価値の合理的な近似値である。

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。

償還に係る支払額、ブローカーに対する債務および未払費用は、償還、取引および費用の当ファンドの決済に係る契約上の金額および債務を表す。

4 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産

	2013年5月31日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
売買目的保有債券	52,133,210,676	36,482,270,066
クレジット・リンク債	-	2,604,515,112
原油ワラント	4,900,615,269	3,958,431,281
売買目的保有合計	57,033,825,945	43,045,216,459

以下の表は保有する金融資産の要約である。

	2013年5月31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	305,116,439	428,003,618
Province Del Neuquen 7.875% due 26/04/2021 REGS	1,229,324,884	345,690,061
Province of Salta Argentina 9.50% due 16/03/2022 REGS	958,771,413	511,249,295
アルゼンチン合計	2,493,212,736	1,284,942,974
アゼルバイジャン		
Intl Bank of Azerbaijan (Rubrika Finance) 8.50% due 22/10/2013 series REGS	935,208,438	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	935,208,438	1,040,945,297
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina 0% due 11/12/2021	1,707,953,635	1,194,614,894
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	1,707,953,635	1,194,614,894
中国		
Bright Food Hong Kong Ltd 3.00% due 21/05/2018 REGS	985,793,403	-
Franshion Development Ltd 6.75% due 15/04/2021 REGS	569,468,170	340,808,651
中国合計	1,555,261,573	340,808,651
コスタリカ		
Republic of Costa Rica 10.58% due 23/09/2015 REGS	986,937,497	-
Republic of Costa Rica 10.58% due 22/06/2016 REGS	433,902,131	-
Instituto Costarricense De Electricidad 6.95% due 10/11/2021 REGS	-	244,253,448
コスタリカ合計	1,420,839,628	244,253,448
クロアチア		
Republic of Croatia 6.75% due 05/11/2019	-	451,281,148
クロアチア合計	-	451,281,148

	2013年5月31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)
ドミニカ共和国		
Dominican Republic 10.50% due 09/08/2013 Series REGS	1,261,521,070	921,942,746
Ege Haina Finance Company 9.50% due 26/04/2017 Series REGS	493,009,515	381,441,759
ドミニカ共和国合計	1,754,530,585	1,303,384,505
エクアドル		
Republic of Ecuador 9.375% due 15/12/2015 Series REGS	327,944,500	869,026,863
エクアドル合計	327,944,500	869,026,863
エジプト		
Arab Republic of Egypt 6.875% due 30/04/2040 Series REGS	191,281,601	379,547,640
エジプト合計	191,281,601	379,547,640
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	1,895,999,498	1,415,700,909
エルサルバドル合計	1,895,999,498	1,415,700,909
エストニア		
Eesti Energia AS,4.50% due 11/18/2020	-	461,053,651
エストニア合計	-	461,053,651
グルジア		
Georgian Railway LLC 9.875% due 22/07/2015	-	921,802,765
Georgian Oil & Gas Corp 6.875% due 16/05/2017 REGS	829,516,695	515,753,963
Republic of Georgia 6.875% due 12/04/2021 REGS	1,365,873,646	879,752,063
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022	384,173,223	-
グルジア合計	2,579,563,564	2,317,308,791
ガーナ		
Ghana Govt 13.67% due 11/06/2012	-	1,042,412,317
Ghana Govt 23.00% due 21/08/2017	1,548,019,358	-
ガーナ合計	1,548,019,358	1,042,412,317
グレナダ		
Government of Grenada FRN due 15/09/2025 Series REGS	-	499,701,622
グレナダ合計	-	499,701,622
ハンガリー		
Hungarian Development Bank 5.875% due 31/05/2016	1,270,231,477	716,980,521
ハンガリー合計	1,270,231,477	716,980,521
	2013年5月31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)
ホンジュラス		
Honduras Government 7.50% due 15/03/2024 REGS	371,982,253	-
ホンジュラス合計	371,982,253	-
インド		
Indian Oil Corp Ltd 5.625% 02/08/2021 REGS	693,694,983	434,177,961
NTPC Ltd 5.625% 14/07/2021	-	357,384,080
インド合計	693,694,983	791,562,041
イラク		
Republic of Iraq 5.80% due 15/01/2028	1,317,324,069	758,731,651
イラク合計	1,317,324,069	758,731,651
コートジボワール		
Sphynx Capital Markets 10.25% due 30/01/2010(注記 3.5)	-	502,538,702
Ivory Coast 2.50% due 31/12/2032 Series REGS	398,376,950	-
コートジボワール合計	398,376,950	502,538,702
ヨルダン		
Dev Inv Jordan Arm Force 6.14% due 16/12/2019	2,491,745,425	2,127,710,678
ヨルダン合計	2,491,745,425	2,127,710,678
カザフスタン		
Astana Finance 7.875% due 08/06/2010(注記 3.5)	532,706,620	395,310,532
Kazmunaigaz Finance SUB 11.75% due 23/01/2015 Series REGS	716,038,842	949,833,708

カザフスタン合計	1,248,745,462	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	-	757,084,540
Former Yugoslav Republic of Macedonia due 4.625% 08/12/2015	855,978,396	-
マケドニア合計	855,978,396	757,084,540
メキシコ		
Mexican Bondes Desarroll FRN due 15/01/2015 Series LD	2,201,383,082	1,524,997,754
メキシコ合計	2,201,383,082	1,524,997,754
	2013年5月31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	916,065,542	493,197,260
モンテネグロ合計	916,065,542	493,197,260
ナイジェリア		
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	-	212,019,595
Nigeria Treasury Bill 07/02/2013	-	256,660,227
Nigeria Treasury Bill 13/06/2013	441,596,205	-
Nigeria Treasury Bill 01/08/2013	209,753,601	-
Government of Nigeria 16.39% 27/01/2022	591,444,273	-
Government of Nigeria 10.00% 23/07/2030	294,707,038	-
ナイジェリア合計	1,537,501,117	983,315,063
パラグアイ		
Republic of Paraguay 4.625% due 01/25/2023 REGS	154,903,158	-
パラグアイ合計	154,903,158	-
ロシア		
Russian Federation 7.85% due 10/03/2018 REGS	-	403,924,954
Federal Grid Co OJSC/Finance Ltd 8.446% due 13/03/2019 REGS	716,565,971	-
RZD Capital Ltd 8.30% due 02/04/2019 REGS	676,563,023	415,368,885
Gaz Capital SA 9.25% due 23/04/2019 SER REGS	1,163,774,486	863,726,297
RSHB Capital (RUSS AGRIC BK) 6.00% due 03/06/2021 REGS	1,000,589,319	733,104,739
RZD Capital Ltd 5.70% due 05/04/2022 REGS	825,962,802	530,796,113
ロシア合計	4,383,455,601	2,946,920,988
セルビア		
Serbia Treasury Bill 06/09/2012 STRP Coupon	-	436,708,011
Serbia Treasury Bill 0% 13/09/2013	702,603,445	-
セルビア合計	702,603,445	436,708,011
南アフリカ		
South Africa Republic of 8.00% due 21/12/2018	514,160,112	929,534,217
Republic of South Africa 2.25% due 31/01/2038 Index Linked	592,238,800	-
南アフリカ合計	1,106,398,912	929,534,217
国際機関		
International Bank Recon & Dev 6.00% due 15/09/2016	3,207,379,309	-
国際機関合計	3,207,379,309	-
	2013年5月31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	2,380,374,184	1,961,258,685
トリニダード・トバゴ合計	2,380,374,184	1,961,258,685
タンザニア		
Tanzania Government International Bond 0% due 08/03/2020 FRN REGS	516,938,399	-
タンザニア合計	516,938,399	-
チュニジア		

Banque Cent de Tunisie 4.50% due 22/06/2020 REGS	789,704,027	395,165,714
チュニジア合計	789,704,027	395,165,714
トルコ		
Turkey Government Bond FRN due 26/02/2014	1,329,777,293	1,072,773,053
Turkey Government Bond FRN due 04/01/2017	538,322,947	408,264,025
Turkey Vakiflar Bankasi Tao due 5.75% due 24/04/2017 REGS	-	232,524,618
Turkiye Halk Bankasi As 3.875% due 05/02/2020 REGS	602,703,834	-
トルコ合計	2,470,804,074	1,713,561,696
ウクライナ		
Credit Suisse (CITY KYIV) 8.25% due 26/11/2012	-	702,500,588
City of KYIV (CSFB) 8.00% due 06/11/2015	378,254,590	263,316,443
State Savings Bank of Ukraine 8.25% due 10/03/2016	1,222,074,335	807,299,013
State Savings Bank Of Ukraine 8.875% due 20/03/2018 REGS	641,795,067	-
Ukraine 9.25% due 24/07/2017 REG S	1,341,752,536	-
ウクライナ合計	3,583,876,528	1,773,116,044
ウガンダ		
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	-	138,610,564
Uganda Treasury Bills 0% 13/06/2013	55,974,454	-
Uganda Treasury Bills 0% 12/12/2013	220,141,607	-
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% 01/01/2015	244,387,461	-
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% 21/04/2016	109,968,439	-
Republic of Uganda Government Bonds 10.75% 22/02/2018	108,917,460	-
ウガンダ合計	739,389,421	530,332,448
ウルグアイ		
Republica Orient Uruguay 3.70% due 26/06/2037	2,384,539,746	1,312,511,847
ウルグアイ合計	2,384,539,746	1,312,511,847
債券合計	52,133,210,676	36,482,270,066

	2013年5月31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 0% due 17/05/2013	-	1,723,300,800
ブラジル合計	-	1,723,300,800
クレジット・リンク債合計	-	2,604,515,112
原油ワラント		
ナイジェリア		
Central Bank of Nigeria Expires 15/11/2020	2,925,163,235	2,356,997,336
ナイジェリア合計	2,925,163,235	2,356,997,336
ベネズエラ		
Republic of Venezuela - Oil Expires 15/04/2020 Series USD	1,975,452,034	1,601,433,945
ベネズエラ合計	1,975,452,034	1,601,433,945
原油ワラント合計	4,900,615,269	3,958,431,281
投資ポートフォリオ	57,033,825,945	43,045,216,459
	2013年5月31日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
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その他の純変動額		
- 実現	1,607,929,594	2,118,463,799
- 未実現の変動額	17,191,449,928	(4,222,787,643)
利益/(損失)合計	18,799,379,522	(2,104,323,844)

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/保有していた。

(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「OIPO」という。）は、1990年代前半のブレイディ・ボンドによるソブリン債務再編の一環として発行され、最初は債券に付属していたが、後に分離され別々に取引された。OIPO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、OIPOに基づく最終支払の期日は2020年の予定である。

OIPO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。

	2013年5月31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	8,730,924,392	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

	2013年5月31日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
未払運用報酬	43,832,721	32,011,098
未払受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	8,072,278	8,013,681
未払保管受託銀行報酬	2,126,631	2,860,595
その他の未払費用	5,351,339	4,304,077
	59,382,969	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。

当ファンドは、2013年にIFRS第13号を早期適用し、上場金融資産および負債の評価インプットを仲値に変更した。このことは、当ファンドの1口当たりの取引価値の計算について当ファンドの募集要項で規定されているインプットに合致する。前年において、当ファンドは、IAS第39号に従って、上場金融資産および負債の買呼

値および売呼値を使用した。この結果、仲値を使用して計算された当ファンドの1口当たりの取引価値と相違することとなった。この変更により、2013年5月31日現在、募集要項とIFRSとの金融商品の測定の相違が解消された。しかし、2012年5月31日現在においては、390,301,039円の相違が存在した。この相違は、2012年5月31日現在の財務書類に示されている。当ファンドの純資産額は、財政状態計算書日現在、66,979,115,060円(2012年:43,603,106,877円)である。

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、毎月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。

当期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)
2013年5月31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
受益証券1口当たり分配金90円	2012年12月3日	714,831,840
受益証券1口当たり分配金90円	2013年1月4日	717,264,360
受益証券1口当たり分配金90円	2013年2月4日	750,641,850
受益証券1口当たり分配金90円	2013年3月4日	791,724,870
受益証券1口当たり分配金90円	2013年4月3日	823,449,330
受益証券1口当たり分配金90円	2013年5月7日	836,611,110
		8,820,848,250

	権利付最終日	分配金額 (日本円)
2012年5月31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
受益証券1口当たり分配金90円	2011年12月5日	702,941,310
受益証券1口当たり分配金90円	2012年1月4日	712,615,950
受益証券1口当たり分配金90円	2012年2月3日	726,357,780
受益証券1口当たり分配金90円	2012年3月5日	734,239,980
受益証券1口当たり分配金90円	2012年4月3日	733,979,340
受益証券1口当たり分配金90円	2012年5月8日	719,064,180
		8,010,993,510

10 その他の収益

その他の収益は、当ファンドに対して過大に課された保管受託銀行報酬の払戻しを表す。

11 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、当期に以下の関連当事者との取引が行われた。

(a) 運用報酬

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

(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬

受託会社報酬および管理事務代行会社報酬は、当ファンドの純資産額のうち、最初の100百万米ドルに相当する日本円に対しては0.135%、100百万米ドル超300百万米ドル以下に相当する日本円に対しては0.12%、300百万米ドル超500百万米ドル以下に相当する日本円に対しては0.085%、500百万米ドル超に相当する日本円に対しては0.05%で課される。

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

(c) 保管受託銀行報酬

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

(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。

以下の表は当期の関連当事者との取引の詳細である。

	費用		債務	
	2013年5月31日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)	2012年5月31日現在 (日本円)
(a) 運用報酬	207,017,727	184,337,323	43,832,721	32,011,098
(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	51,630,992	46,953,783	8,072,278	8,013,681
(c) 保管受託銀行報酬	24,841,163	17,967,708	2,126,631	2,860,595
費用合計	283,489,882	249,258,814	54,031,630	42,885,374
			債権	
(d) 費用 払戻し	-	(206,405)	-	206,405

12 後発事象

2013年5月31日と本財務書類の公表が可能となった日との間に、本財務書類における修正および追加開示を要する後発事象はなかった。

海外国債マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,019,674	-
コール・ローン	931,298,942	664,970,773
国債証券	73,776,514,685	61,365,491,317
未収入金	-	392,347,253
未収利息	710,783,152	521,108,244
前払費用	111,523,925	109,936,005
流動資産合計	75,532,140,378	63,053,853,592
資産合計	75,532,140,378	63,053,853,592
負債の部		
流動負債		
前受金	-	390,343,605
未払解約金	3,300,000	10,000,000
流動負債合計	3,300,000	400,343,605
負債合計	3,300,000	400,343,605
純資産の部		
元本等		
元本	39,142,475,199	33,171,251,198
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	36,386,365,179	29,482,258,789
元本等合計	75,528,840,378	62,653,509,987
純資産合計	75,528,840,378	62,653,509,987
負債純資産合計	75,532,140,378	63,053,853,592

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
1. 計算日における受益権の総数 39,142,475,199□	1. 計算日における受益権の総数 33,171,251,198□

2. 計算日における1単位当たりの純資産の額		2. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.9296円	1口当たり純資産額	1.8888円
(1万口当たり純資産額)	(19,296円)	(1万口当たり純資産額)	(18,888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10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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>	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、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>	
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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
<p>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ぬ。</p> <p>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。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21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	44,786,498,722円	39,142,475,199円
期中追加設定元本額	54,352,232円	151,534,847円
期中一部解約元本額	5,698,375,755円	6,122,758,848円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	25,931,315,600円	20,776,359,308円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	2,618,343,011円	2,301,816,597円
新光7資産バランスファンド	669,198,900円	626,195,083円
海外国債ファンド（1年決算型）	21,408,166円	21,162,115円
海外国債ファンド（変額年金）	9,902,209,522円	9,445,718,095円
合計	39,142,475,199円	33,171,251,198円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,118,478,700	1,266,832,006
合計	1,118,478,700	1,266,832,006

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-0.25%-14/12/15	49,200,000.00	49,242,281.49	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	18,700,000.00	19,487,445.38	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	15,000,000.00	16,625,390.66	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	9,800,000.00	10,496,718.73	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	13,600,000.00	13,523,500.00	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	3,000,000.00	4,296,562.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	13,800,000.00	13,526,156.23	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	10,600,000.00	10,335,000.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	11,000,000.00	10,453,437.50	
		US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	1,700,000.00	2,370,437.50	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	10,700,000.00	10,001,992.23	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	15,800,000.00	14,681,656.24	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	20,100,000.00	19,212,773.52	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	21,700,000.00	20,181,000.00	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	3,400,000.00	4,507,656.25	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	14,800,000.00	14,684,375.00			
米ドル建小計			232,900,000.00	233,626,383.23 (22,909,403,139)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	4,600,000.00	4,924,714.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	5,000,000.00	5,129,200.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	5,600,000.00	5,112,800.00	
カナダドル建小計			15,200,000.00	15,166,714.00 (1,444,781,175)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	5,000,000.00	5,220,650.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-21/01/04	9,800,000.00	10,632,020.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	9,800,000.00	11,159,260.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-21/09/04	8,200,000.00	8,719,060.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-22/01/04	10,300,000.00	10,714,060.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-22/07/04	12,300,000.00	12,459,900.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	9,300,000.00	9,202,350.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	9,300,000.00	9,116,790.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	9,300,000.00	9,063,780.00	

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	2,600,000.00	2,637,960.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/03/01	7,200,000.00	7,344,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	8,300,000.00	8,452,720.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-21/09/01	7,400,000.00	7,969,060.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-22/03/01	5,400,000.00	5,876,280.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/09/01	5,800,000.00	6,471,060.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	6,300,000.00	7,030,800.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	5,300,000.00	5,521,540.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	7,300,000.00	7,801,510.00	
	FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	5,000,000.00	5,192,500.00	
	FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	12,600,000.00	13,282,920.00	
	FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	13,200,000.00	14,984,640.00	
	FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	13,400,000.00	14,703,820.00	
	FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	12,600,000.00	13,488,300.00	
	FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	9,000,000.00	9,015,300.00	
	FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	4,100,000.00	6,268,490.00	
	FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	7,500,000.00	7,095,000.00	
ユーロ建小計		216,300,000.00	229,423,770.00 (30,768,021,794)	
英ポンド	国債証券	TSY-8.0%-21/06/07	5,200,000.00	7,304,700.00
		TSY-3.75%-21/09/07	9,000,000.00	9,964,710.00
		TSY-4.0%-22/03/07	6,000,000.00	6,742,800.00
		TSY-1.75%-22/09/07	11,300,000.00	10,584,823.00
		TSY-2.25%-23/09/07	5,000,000.00	4,797,750.00
英ポンド建小計		36,500,000.00	39,394,783.00 (6,243,285,209)	
合計			61,365,491,317 (61,365,491,317)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	債券 16銘柄	36.6%	37.3%

カナダドル	債券	3銘柄	2.3%	2.4%
ユーロ	債券	26銘柄	49.1%	50.1%
英ポンド	債券	5銘柄	10.0%	10.2%

（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

該当事項はありません。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	594,169,270	576,406,064
株式	15,567,672,660	14,303,173,200
派生商品評価勘定	67,116,487	13,601,600
未収配当金	135,202,352	103,600,449
未収利息	770	626
流動資産合計	16,364,161,539	14,996,781,939
資産合計	16,364,161,539	14,996,781,939
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	287,350
前受金	57,650,000	8,972,000
未払解約金	10,000,000	-
流動負債合計	67,650,000	9,259,350
負債合計	67,650,000	9,259,350
純資産の部		
元本等		
元本	12,075,546,870	10,407,539,324
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,220,964,669	4,579,983,265
元本等合計	16,296,511,539	14,987,522,589
純資産合計	16,296,511,539	14,987,522,589
負債純資産合計	16,364,161,539	14,996,781,939

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25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
1. 担保資産 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	1. 担保資産 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 147,154,700円
2. 計算日における受益権の総数 12,075,546,870口	2. 計算日における受益権の総数 10,407,539,324口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3495円 (1万口当たり純資産額) (13,495円)	3. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.4401円 (1万口当たり純資産額) (14,401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10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、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>
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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	15,080,298,980円	12,075,546,870円
期中追加設定元本額	78,625,564円	182,695,893円
期中一部解約元本額	3,083,377,674円	1,850,703,439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	566,705,197円	541,875,861円
新光7資産バランスファンド	1,067,904,948円	864,493,408円
ニュー トピックス インデックス（変額年 金）	1,261,343,930円	1,021,424,993円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関 投資家私募）	2,620,765,860円	2,419,528,318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）	3,020,713,650円	2,475,906,263円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家 私募）	240,105,118円	206,339,736円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関 投資家私募）	2,459,064,087円	2,125,484,837円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機 関投資家私募）	838,944,080円	752,485,908円
合計	12,075,546,870円	10,407,539,324円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,335,631,564	3,631,608,098
合計	3,335,631,564	3,631,608,098

(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25年 4月22日現在				平成25年10月21日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超				うち1年超			
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	644,023,513	-	711,140,000	67,116,487	654,935,750	-	668,250,000	13,314,250
東証東証株価指数先物	644,023,513	-	711,140,000	67,116,487	654,935,750	-	668,250,000	13,314,250
合計	644,023,513	-	711,140,000	67,116,487	654,935,750	-	668,250,000	13,314,250

時価の算定方法

先物取引

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	10,000	267.00	2,670,000	

日本水産	10,200	209.00	2,131,800	
マルハニチロホールディングス	18,000	188.00	3,384,000	
サカタのタネ	1,400	1,349.00	1,888,600	
ホクト	1,000	1,858.00	1,858,000	
日鉄鉱業	4,000	555.00	2,220,000	
三井松島産業	10,000	155.00	1,550,000	
国際石油開発帝石	46,400	1,153.00	53,499,200	
日本海洋掘削	200	7,000.00	1,400,000	
石油資源開発	1,400	3,980.00	5,572,000	
ショーボンドホールディングス	800	4,480.00	3,584,000	
ミライト・ホールディングス	2,700	846.00	2,284,200	
安藤・間	5,600	328.00	1,836,800	
東急建設	3,300	551.00	1,818,300	
コムシスホールディングス	4,600	1,383.00	6,361,800	
ミサワホーム	1,100	1,842.00	2,026,200	
高松コンストラクショングループ	1,200	1,798.00	2,157,600	
東建コーポレーション	350	5,310.00	1,858,500	
大成建設	48,000	490.00	23,520,000	
大林組	29,000	611.00	17,719,000	
清水建設	29,000	485.00	14,065,000	
飛鳥建設	10,700	158.00	1,690,600	
長谷工コーポレーション	11,900	714.00	8,496,600	
鹿島建設	42,000	408.00	17,136,000	
不動テトラ	10,600	172.00	1,823,200	
鉄建建設	6,000	317.00	1,902,000	
日鉄住金テックスエンジ	1,000	378.00	378,000	
西松建設	12,000	315.00	3,780,000	
三井住友建設	16,400	121.00	1,984,400	
前田建設工業	6,000	674.00	4,044,000	
奥村組	8,000	429.00	3,432,000	
東鉄工業	1,200	2,063.00	2,475,600	
戸田建設	11,000	332.00	3,652,000	
熊谷組	12,000	234.00	2,808,000	
北野建設	6,000	217.00	1,302,000	
大東建託	3,600	10,590.00	38,124,000	
N I P P O	2,000	1,760.00	3,520,000	
東亜道路工業	3,000	458.00	1,374,000	
前田道路	3,000	1,661.00	4,983,000	
日本道路	3,000	596.00	1,788,000	
東亜建設工業	13,000	221.00	2,873,000	
若築建設	5,000	125.00	625,000	
東洋建設	5,400	308.00	1,663,200	

五洋建設	11,500	278.00	3,197,000
住友林業	6,500	1,090.00	7,085,000
日成ビルド工業	3,000	187.00	561,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	9,000	146.00	1,314,000
パナホーム	4,000	630.00	2,520,000
大和ハウス工業	26,000	1,885.00	49,010,000
ライト工業	2,100	747.00	1,568,700
積水ハウス	29,000	1,332.00	38,628,000
西部電気工業	4,000	431.00	1,724,000
中電工	1,400	1,449.00	2,028,600
関電工	4,000	590.00	2,360,000
きんでん	5,000	1,077.00	5,385,000
住友電設	1,200	1,460.00	1,752,000
日本電設工業	2,000	1,142.00	2,284,000
協和エクシオ	3,400	1,183.00	4,022,200
新日本空調	700	617.00	431,900
三機工業	4,000	587.00	2,348,000
日揮	10,000	3,775.00	37,750,000
中外炉工業	7,000	252.00	1,764,000
太平電業	1,000	712.00	712,000
高砂熱学工業	2,700	811.00	2,189,700
大気社	1,400	2,342.00	3,278,800
日比谷総合設備	2,700	1,178.00	3,180,600
東芝プラントシステム	2,000	1,772.00	3,544,000
東洋エンジニアリング	5,000	411.00	2,055,000
千代田化工建設	7,000	1,206.00	8,442,000
新興プランテック	2,000	805.00	1,610,000
日本製粉	6,000	492.00	2,952,000
日清製粉グループ本社	9,300	1,071.00	9,960,300
日東富士製粉	2,000	303.00	606,000
鳥越製粉	1,200	654.00	784,800
協同飼料	5,000	115.00	575,000
日本甜菜製糖	12,000	191.00	2,292,000
三井製糖	4,000	320.00	1,280,000
森永製菓	9,000	208.00	1,872,000
中村屋	8,000	406.00	3,248,000
江崎グリコ	3,000	1,008.00	3,024,000
不二家	12,000	195.00	2,340,000
山崎製パン	7,000	1,051.00	7,357,000
モロゾフ	2,000	311.00	622,000
亀田製菓	500	2,929.00	1,464,500
カルビー	3,600	2,631.00	9,471,600

森永乳業	8,000	318.00	2,544,000
ヤクルト本社	5,600	5,010.00	28,056,000
明治ホールディングス	2,800	5,520.00	15,456,000
雪印メグミルク	1,900	1,396.00	2,652,400
プリマハム	8,000	209.00	1,672,000
日本ハム	7,000	1,427.00	9,989,000
伊藤ハム	5,000	413.00	2,065,000
丸大食品	5,000	310.00	1,550,000
サッポロホールディングス	16,000	445.00	7,120,000
アサヒグループホールディングス	19,100	2,790.00	53,289,000
キリンホールディングス	41,000	1,493.00	61,213,000
宝ホールディングス	7,000	920.00	6,440,000
オエノンホールディングス	7,000	257.00	1,799,000
コカ・コーラウエスト	2,900	1,998.00	5,794,200
コカ・コーライーストジャパン	2,000	1,611.00	3,222,000
サントリー食品インターナショナル	4,900	3,365.00	16,488,500
ダイトードリンコ	500	4,235.00	2,117,500
伊藤園	2,600	2,303.00	5,987,800
キーコーヒー	700	1,540.00	1,078,000
日清オイリオグループ	4,000	339.00	1,356,000
不二製油	2,300	1,776.00	4,084,800
J - オイルミルズ	4,000	316.00	1,264,000
キッコーマン	8,000	1,776.00	14,208,000
味の素	23,000	1,376.00	31,648,000
キューピー	4,800	1,457.00	6,993,600
ハウス食品グループ本社	3,300	1,552.00	5,121,600
カゴメ	3,400	1,704.00	5,793,600
アリアケジャパン	900	2,342.00	2,107,800
ニチレイ	10,000	530.00	5,300,000
東洋水産	4,000	3,125.00	12,500,000
日清食品ホールディングス	3,700	4,165.00	15,410,500
ロック・フィールド	1,400	1,957.00	2,739,800
日本たばこ産業	52,800	3,480.00	183,744,000
わらべや日洋	300	1,864.00	559,200
片倉工業	1,000	1,211.00	1,211,000
グンゼ	7,000	265.00	1,855,000
東洋紡	38,000	189.00	7,182,000
ユニチカ	24,000	61.00	1,464,000
富士紡ホールディングス	6,000	205.00	1,230,000
日清紡ホールディングス	6,000	888.00	5,328,000
倉敷紡績	9,000	169.00	1,521,000
シキボウ	10,000	128.00	1,280,000

日本毛織	3,000	770.00	2,310,000
ガイドーリミテッド	2,300	676.00	1,554,800
帝国繊維	2,000	910.00	1,820,000
帝人	34,000	228.00	7,752,000
東レ	69,000	623.00	42,987,000
住江織物	4,000	283.00	1,132,000
アツギ	17,000	118.00	2,006,000
ダイニック	4,000	179.00	716,000
セーレン	2,400	641.00	1,538,400
小松精練	2,000	517.00	1,034,000
ワコールホールディングス	5,000	1,024.00	5,120,000
ホギメディカル	600	5,360.00	3,216,000
T S Iホールディングス	4,600	714.00	3,284,400
三陽商会	8,000	265.00	2,120,000
オンワードホールディングス	6,000	836.00	5,016,000
ゴールドウイン	3,000	470.00	1,410,000
デサント	2,000	723.00	1,446,000
ヤマトインターナショナル	2,900	433.00	1,255,700
特種東海製紙	3,000	201.00	603,000
王子ホールディングス	39,000	484.00	18,876,000
日本製紙	4,300	1,665.00	7,159,500
三菱製紙	28,000	90.00	2,520,000
北越紀州製紙	5,500	487.00	2,678,500
大王製紙	4,000	695.00	2,780,000
レンゴー	7,000	545.00	3,815,000
トーモク	7,000	301.00	2,107,000
ザ・パック	1,300	1,816.00	2,360,800
クラレ	15,100	1,138.00	17,183,800
旭化成	55,000	729.00	40,095,000
昭和電工	59,000	136.00	8,024,000
住友化学	61,000	362.00	22,082,000
日産化学工業	6,100	1,503.00	9,168,300
クレハ	6,000	363.00	2,178,000
石原産業	21,000	88.00	1,848,000
日本曹達	5,000	618.00	3,090,000
東ソー	24,000	405.00	9,720,000
トクヤマ	13,000	393.00	5,109,000
セントラル硝子	8,000	343.00	2,744,000
東亜合成	10,000	449.00	4,490,000
ダイソー	8,000	304.00	2,432,000
関東電化工業	2,000	214.00	428,000
電気化学工業	18,000	409.00	7,362,000

信越化学工業	15,900	5,890.00	93,651,000
日本カーバイド工業	3,000	332.00	996,000
堺化学工業	7,000	327.00	2,289,000
エア・ウォーター	7,000	1,416.00	9,912,000
大陽日酸	12,000	640.00	7,680,000
日本パーカラライジング	2,000	2,018.00	4,036,000
高圧ガス工業	1,000	528.00	528,000
四国化成工業	3,000	797.00	2,391,000
ステラ ケミファ	200	1,700.00	340,000
日本触媒	6,000	1,203.00	7,218,000
大日精化工業	3,000	414.00	1,242,000
カネカ	11,000	614.00	6,754,000
三菱瓦斯化学	14,000	843.00	11,802,000
三井化学	38,000	269.00	10,222,000
J S R	8,200	1,765.00	14,473,000
東京応化工業	1,700	2,172.00	3,692,400
三菱ケミカルホールディングス	55,500	469.00	26,029,500
日本合成化学工業	2,000	959.00	1,918,000
ダイセル	11,000	858.00	9,438,000
住友ベークライト	7,000	353.00	2,471,000
積水化学工業	18,000	1,050.00	18,900,000
日本ゼオン	8,000	1,262.00	10,096,000
アイカ工業	2,500	1,993.00	4,982,500
宇部興産	45,000	201.00	9,045,000
積水樹脂	1,000	1,457.00	1,457,000
タキロン	5,000	425.00	2,125,000
旭有機材工業	2,000	224.00	448,000
日立化成	3,800	1,475.00	5,605,000
大倉工業	4,000	357.00	1,428,000
群栄化学工業	2,000	493.00	986,000
日本化薬	6,000	1,407.00	8,442,000
カーリットホールディングス	900	501.00	450,900
A D E K A	3,800	1,179.00	4,480,200
日油	7,000	672.00	4,704,000
花王	23,100	3,115.00	71,956,500
第一工業製薬	4,000	241.00	964,000
三洋化成工業	3,000	710.00	2,130,000
大日本塗料	9,000	166.00	1,494,000
日本ペイント	8,000	1,670.00	13,360,000
関西ペイント	10,000	1,277.00	12,770,000
中国塗料	3,000	613.00	1,839,000
太陽ホールディングス	700	3,005.00	2,103,500

D I C	31,000	282.00	8,742,000	
サカティクス	2,000	955.00	1,910,000	
東洋インキSCホールディングス	8,000	500.00	4,000,000	
富士フィルムホールディングス	19,000	2,364.00	44,916,000	
資生堂	15,800	1,773.00	28,013,400	
ライオン	10,000	593.00	5,930,000	
高砂香料工業	3,000	537.00	1,611,000	
マンダム	1,000	3,390.00	3,390,000	
ミルボン	500	4,120.00	2,060,000	
ファンケル	2,200	1,210.00	2,662,000	
コーセー	1,600	2,881.00	4,609,600	
ドクターシーラボ	6	296,100.00	1,776,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	900	3,495.00	3,145,500	
エステー	1,600	993.00	1,588,800	
コニシ	1,100	1,914.00	2,105,400	
長谷川香料	1,100	1,426.00	1,568,600	
小林製薬	1,300	5,480.00	7,124,000	
日本高純度化学	8	215,000.00	1,720,000	
J C U	300	4,120.00	1,236,000	
アース製薬	600	3,690.00	2,214,000	
イハラケミカル工業	3,000	739.00	2,217,000	
大成ラミック	800	2,480.00	1,984,000	
クミアイ化学工業	3,000	736.00	2,208,000	
日本農薬	2,000	1,050.00	2,100,000	
アキレス	15,000	159.00	2,385,000	
有沢製作所	600	668.00	400,800	
日東電工	7,300	5,720.00	41,756,000	
きもと	800	1,038.00	830,400	
藤森工業	800	2,955.00	2,364,000	
前澤化成工業	1,800	1,041.00	1,873,800	
エフピコ	400	7,570.00	3,028,000	
天馬	300	1,298.00	389,400	
東リ	7,000	206.00	1,442,000	
ニフコ	2,000	2,629.00	5,258,000	
日本バルカー工業	9,000	280.00	2,520,000	
ユニ・チャーム	4,900	6,360.00	31,164,000	
協和発酵キリン	11,000	1,082.00	11,902,000	
武田薬品工業	33,300	4,695.00	156,343,500	2,600株 代用有価証券
アステラス製薬	19,300	5,250.00	101,325,000	
大日本住友製薬	6,300	1,358.00	8,555,400	
塩野義製薬	13,000	2,128.00	27,664,000	

田辺三菱製薬	7,400	1,399.00	10,352,600
あすか製薬	2,000	737.00	1,474,000
日本新薬	2,000	1,714.00	3,428,000
中外製薬	8,800	2,143.00	18,858,400
科研製薬	3,000	1,541.00	4,623,000
エーザイ	10,900	3,945.00	43,000,500
ロート製薬	4,000	1,414.00	5,656,000
小野薬品工業	4,300	6,150.00	26,445,000
久光製薬	2,800	5,500.00	15,400,000
持田製薬	600	6,380.00	3,828,000
参天製薬	3,000	5,010.00	15,030,000
扶桑薬品工業	5,000	324.00	1,620,000
日本ケミファ	3,000	481.00	1,443,000
ツムラ	2,400	2,946.00	7,070,400
日医工	1,300	2,420.00	3,146,000
キッセイ薬品工業	1,600	2,262.00	3,619,200
生化学工業	1,700	1,296.00	2,203,200
栄研化学	1,200	1,843.00	2,211,600
鳥居薬品	500	2,540.00	1,270,000
東和薬品	500	4,950.00	2,475,000
沢井製薬	1,200	7,170.00	8,604,000
ゼリア新薬工業	1,100	2,297.00	2,526,700
第一三共	28,000	1,822.00	51,016,000
キョーリン製薬ホールディングス	2,400	2,149.00	5,157,600
大幸薬品	300	1,675.00	502,500
大塚ホールディングス	17,600	2,694.00	47,414,400
大正製薬ホールディングス	2,100	6,850.00	14,385,000
日本コークス工業	17,500	129.00	2,257,500
昭和シェル石油	7,900	1,100.00	8,690,000
コスモ石油	25,000	180.00	4,500,000
ニチレキ	2,000	1,000.00	2,000,000
東燃ゼネラル石油	13,000	920.00	11,960,000
ユシロ化学工業	500	928.00	464,000
富士石油	3,100	355.00	1,100,500
出光興産	1,100	8,500.00	9,350,000
JXホールディングス	98,600	491.00	48,412,600
横浜ゴム	10,000	991.00	9,910,000
東洋ゴム工業	7,000	630.00	4,410,000
ブリヂストン	27,800	3,485.00	96,883,000
住友ゴム工業	6,900	1,412.00	9,742,800
オカモト	2,000	311.00	622,000
ニッタ	900	2,170.00	1,953,000

東海ゴム工業	1,600	954.00	1,526,400
三ツ星ベルト	4,000	522.00	2,088,000
パンドー化学	6,000	399.00	2,394,000
日東紡績	7,000	448.00	3,136,000
旭硝子	44,000	598.00	26,312,000
日本板硝子	40,000	126.00	5,040,000
日本山村硝子	10,000	184.00	1,840,000
日本電気硝子	16,000	469.00	7,504,000
住友大阪セメント	16,000	390.00	6,240,000
太平洋セメント	49,000	429.00	21,021,000
日本ヒューム	1,000	887.00	887,000
東海カーボン	8,000	352.00	2,816,000
日本カーボン	9,000	204.00	1,836,000
東洋炭素	800	1,908.00	1,526,400
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	269.00	2,152,000
TOTO	14,000	1,390.00	19,460,000
日本碍子	12,000	1,497.00	17,964,000
日本特殊陶業	8,000	2,246.00	17,968,000
フジインコーポレーテッド	1,400	1,365.00	1,911,000
ニチアス	4,000	681.00	2,724,000
ニチハ	1,000	1,363.00	1,363,000
新日鐵住金	378,000	340.00	128,520,000
神戸製鋼所	123,000	179.00	22,017,000
合同製鐵	6,000	189.00	1,134,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	22,700	2,459.00	55,819,300
日新製鋼ホールディングス	3,800	1,418.00	5,388,400
東京製鐵	4,900	578.00	2,832,200
共英製鋼	800	1,839.00	1,471,200
大和工業	1,800	3,775.00	6,795,000
東京鐵鋼	3,000	487.00	1,461,000
淀川製鋼所	6,000	450.00	2,700,000
丸一鋼管	3,000	2,491.00	7,473,000
大同特殊鋼	14,000	585.00	8,190,000
日本冶金工業	6,500	317.00	2,060,500
山陽特殊製鋼	4,000	538.00	2,152,000
愛知製鋼	5,000	524.00	2,620,000
日立金属	7,000	1,271.00	8,897,000
大平洋金属	6,000	376.00	2,256,000
日本電工	6,000	290.00	1,740,000
栗本鐵工所	5,000	290.00	1,450,000
三菱製鋼	5,000	312.00	1,560,000
日本輕金属ホールディングス	18,700	151.00	2,823,700

三井金属鉱業	23,000	259.00	5,957,000
東邦亜鉛	5,000	306.00	1,530,000
三菱マテリアル	52,000	391.00	20,332,000
住友金属鉱山	23,000	1,361.00	31,303,000
DOWAホールディングス	10,000	947.00	9,470,000
古河機械金属	15,000	216.00	3,240,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	900	2,107.00	1,896,300
東邦チタニウム	2,400	785.00	1,884,000
UACJ	7,000	327.00	2,289,000
古河電気工業	28,000	229.00	6,412,000
住友電気工業	31,400	1,453.00	45,624,200
フジクラ	14,000	406.00	5,684,000
昭和電線ホールディングス	19,000	115.00	2,185,000
タツタ電線	1,700	740.00	1,258,000
リョービ	5,000	438.00	2,190,000
アサヒホールディングス	1,300	1,668.00	2,168,400
宮地エンジニアリンググループ	2,000	211.00	422,000
トーカロ	1,200	1,554.00	1,864,800
SUMCO	5,400	891.00	4,811,400
東洋製罐グループホールディングス	6,300	2,075.00	13,072,500
横河ブリッジホールディングス	2,000	1,339.00	2,678,000
三和ホールディングス	8,000	636.00	5,088,000
文化シャッター	3,000	542.00	1,626,000
三協立山	1,200	2,108.00	2,529,600
LIXILグループ	12,400	2,155.00	26,722,000
ノーリツ	1,700	2,211.00	3,758,700
長府製作所	900	2,281.00	2,052,900
リンナイ	1,400	7,410.00	10,374,000
岡部	1,700	1,272.00	2,162,400
東プレ	1,700	1,383.00	2,351,100
高周波熱錬	2,300	921.00	2,118,300
東京製綱	11,000	171.00	1,881,000
パイオラックス	800	3,305.00	2,644,000
日本発條	6,400	1,039.00	6,649,600
三益半導体工業	300	878.00	263,400
日本製鋼所	14,000	567.00	7,938,000
三浦工業	1,300	2,636.00	3,426,800
タクマ	3,000	891.00	2,673,000
ツガミ	3,000	498.00	1,494,000
オークマ	6,000	878.00	5,268,000
東芝機械	4,000	540.00	2,160,000
アマダ	14,000	888.00	12,432,000

アイダエンジニアリング	2,100	944.00	1,982,400
牧野フライス製作所	4,000	711.00	2,844,000
オーエスジー	3,600	1,586.00	5,709,600
旭ダイヤモンド工業	2,100	984.00	2,066,400
D M G 森精機	4,700	1,690.00	7,943,000
ディスコ	1,000	5,970.00	5,970,000
豊和工業	1,200	830.00	996,000
大阪機工	8,000	143.00	1,144,000
島精機製作所	1,200	2,210.00	2,652,000
日阪製作所	2,000	885.00	1,770,000
やまびこ	500	3,255.00	1,627,500
ナブテスコ	4,400	2,472.00	10,876,800
三井海洋開発	700	3,040.00	2,128,000
S M C	2,500	23,510.00	58,775,000
新川	300	663.00	198,900
ホソカワミクロン	2,000	687.00	1,374,000
ユニオンツール	900	2,249.00	2,024,100
オイレス工業	900	2,250.00	2,025,000
サトーホールディングス	900	1,974.00	1,776,600
小松製作所	41,400	2,402.00	99,442,800
住友重機械工業	24,000	430.00	10,320,000
日立建機	4,500	2,237.00	10,066,500
井関農機	8,000	330.00	2,640,000
丸山製作所	1,000	264.00	264,000
北川鉄工所	10,000	196.00	1,960,000
クボタ	46,000	1,483.00	68,218,000
月島機械	1,000	1,005.00	1,005,000
東京機械製作所	1,000	124.00	124,000
新東工業	1,800	741.00	1,333,800
アイチ コーポレーション	900	542.00	487,800
小森コーポレーション	2,200	1,479.00	3,253,800
荏原製作所	18,000	530.00	9,540,000
西島製作所	2,000	889.00	1,778,000
ダイキン工業	11,600	5,810.00	67,396,000
オルガノ	1,000	489.00	489,000
トーヨーカネツ	5,000	299.00	1,495,000
栗田工業	4,900	2,074.00	10,162,600
椿本チエイン	5,000	652.00	3,260,000
アネスト岩田	3,000	481.00	1,443,000
ダイフク	4,000	1,181.00	4,724,000
加藤製作所	4,000	676.00	2,704,000
タダノ	4,000	1,240.00	4,960,000

フジテック	2,000	1,227.00	2,454,000	
C K D	2,400	966.00	2,318,400	
キトー	700	1,558.00	1,090,600	
平和	1,800	1,691.00	3,043,800	
理想科学工業	800	2,275.00	1,820,000	
S A N K Y O	2,600	4,660.00	12,116,000	
日本金銭機械	1,200	2,201.00	2,641,200	
マースエンジニアリング	800	1,920.00	1,536,000	
ダイコク電機	600	2,195.00	1,317,000	
アマノ	2,400	998.00	2,395,200	
J U K I	9,000	188.00	1,692,000	
サンデン	5,000	398.00	1,990,000	
蛇の目ミシン工業	15,000	85.00	1,275,000	
マックス	1,000	1,129.00	1,129,000	
グローリー	2,500	2,464.00	6,160,000	
大和冷機工業	2,000	625.00	1,250,000	
セガサミーホールディングス	9,100	2,764.00	25,152,400	
日本ピストンリング	4,000	183.00	732,000	
リケン	5,000	434.00	2,170,000	
T P R	900	1,876.00	1,688,400	
ホシザキ電機	1,900	3,575.00	6,792,500	
大豊工業	900	1,261.00	1,134,900	
日本精工	19,000	1,115.00	21,185,000	
N T N	18,000	493.00	8,874,000	
ジェイテクト	9,000	1,393.00	12,537,000	
不二越	8,000	521.00	4,168,000	
日本トムソン	3,000	552.00	1,656,000	
T H K	5,600	2,137.00	11,967,200	
ユーシン精機	400	1,871.00	748,400	
イーグル工業	1,000	1,669.00	1,669,000	
日本ピラー工業	1,000	705.00	705,000	
キッツ	3,500	442.00	1,547,000	
日立工機	2,300	764.00	1,757,200	
マキタ	5,200	5,460.00	28,392,000	
日立造船	6,700	796.00	5,333,200	
三菱重工業	142,000	621.00	88,182,000	
I H I	58,000	403.00	23,374,000	
イビデン	5,200	1,717.00	8,928,400	
コニカミノルタ	22,500	860.00	19,350,000	
ブラザー工業	11,000	1,150.00	12,650,000	
ミネベア	12,000	541.00	6,492,000	
日立製作所	204,000	620.00	126,480,000	

東芝	167,000	429.00	71,643,000	
三菱電機	85,000	1,041.00	88,485,000	
富士電機	26,000	435.00	11,310,000	
安川電機	9,000	1,340.00	12,060,000	
シンフォニアテクノロジー	12,000	170.00	2,040,000	
明電舎	8,000	371.00	2,968,000	
山洋電気	2,000	769.00	1,538,000	
デンヨー	1,400	1,237.00	1,731,800	
東芝テック	5,000	592.00	2,960,000	
マブチモーター	1,200	5,250.00	6,300,000	
日本電産	4,600	8,910.00	40,986,000	
東光高岳ホールディングス	700	1,784.00	1,248,800	
ダイヘン	5,000	397.00	1,985,000	
JVCケンウッド	6,700	192.00	1,286,400	
日新電機	1,000	512.00	512,000	
大崎電気工業	1,000	601.00	601,000	
オムロン	9,000	3,665.00	32,985,000	
日東工業	1,200	1,617.00	1,940,400	
I D E C	2,500	891.00	2,227,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	16,000	625.00	10,000,000	
メルコホールディングス	1,000	1,385.00	1,385,000	
日本電気	110,000	232.00	25,520,000	
富士通	82,000	414.00	33,948,000	
沖電気工業	31,000	210.00	6,510,000	
電気興業	4,000	682.00	2,728,000	
サンケン電気	4,000	565.00	2,260,000	
アイホン	300	1,619.00	485,700	
ルネサスエレクトロニクス	1,400	562.00	786,800	
セイコーエプソン	5,800	1,795.00	10,411,000	
ワコム	6,200	833.00	5,164,600	
アルパック	1,900	961.00	1,825,900	
アクセル	1,000	1,902.00	1,902,000	
E I Z O	700	2,482.00	1,737,400	
日本信号	2,100	754.00	1,583,400	
日本無線	2,000	390.00	780,000	
パナソニック	96,900	949.00	91,958,100	代用有価証券 7,500株
シャープ	44,000	295.00	12,980,000	
アンリツ	4,600	1,218.00	5,602,800	
富士通ゼネラル	2,000	1,120.00	2,240,000	
日立国際電気	2,000	1,287.00	2,574,000	

ソニー	53,300	1,921.00	102,389,300	代用有価証券 3,700株
T D K	4,800	4,260.00	20,448,000	
帝国通信工業	5,000	173.00	865,000	
ミツミ電機	3,200	670.00	2,144,000	
タムラ製作所	7,000	256.00	1,792,000	
アルプス電気	6,200	829.00	5,139,800	
パイオニア	10,300	177.00	1,823,100	
日本電波工業	1,400	922.00	1,290,800	
日本トリム	200	7,770.00	1,554,000	
ローランド ディー . ジー .	500	3,015.00	1,507,500	
フォスター電機	900	2,065.00	1,858,500	
クラリオン	2,000	135.00	270,000	
S M K	5,000	442.00	2,210,000	
東光	7,000	348.00	2,436,000	
ホシデン	4,000	528.00	2,112,000	
ヒロセ電機	1,500	15,520.00	23,280,000	
日本航空電子工業	2,000	1,028.00	2,056,000	
T O A	2,000	803.00	1,606,000	
ユニデン	4,000	244.00	976,000	
アルパイン	1,700	1,104.00	1,876,800	
アイコム	800	2,286.00	1,828,800	
船井電機	1,300	1,104.00	1,435,200	
横河電機	8,500	1,364.00	11,594,000	
新電元工業	3,000	704.00	2,112,000	
アズビル	2,400	2,286.00	5,486,400	
日本光電工業	1,700	3,935.00	6,689,500	
共和電業	1,000	388.00	388,000	
堀場製作所	1,600	3,510.00	5,616,000	
アドバンテスト	5,800	1,247.00	7,232,600	
小野測器	2,000	434.00	868,000	
エスペック	2,000	764.00	1,528,000	
キーエンス	2,100	37,000.00	77,700,000	
日置電機	1,400	1,395.00	1,953,000	
シスメックス	3,000	6,670.00	20,010,000	
メガチップス	1,300	1,643.00	2,135,900	
O B A R A G R O U P	500	2,580.00	1,290,000	
コーセル	1,200	1,202.00	1,442,400	
日立メディコ	1,000	1,332.00	1,332,000	
オブテックス	1,200	1,499.00	1,798,800	
レーザーテック	800	985.00	788,000	
スタンレー電気	6,600	2,190.00	14,454,000	

岩崎電気	5,000	214.00	1,070,000	
ウシオ電機	5,200	1,252.00	6,510,400	
日本セラミック	600	1,551.00	930,600	
日本電子	3,000	449.00	1,347,000	
カシオ計算機	8,100	939.00	7,605,900	
ファナック	8,800	16,800.00	147,840,000	
日本シイエムケイ	1,000	275.00	275,000	
エンプラス	400	5,800.00	2,320,000	
ローム	4,500	4,130.00	18,585,000	
浜松ホトニクス	3,300	3,710.00	12,243,000	
三井ハイテック	2,300	710.00	1,633,000	
新光電気工業	2,800	988.00	2,766,400	
京セラ	14,200	5,110.00	72,562,000	
太陽誘電	4,100	1,269.00	5,202,900	
村田製作所	8,900	7,620.00	67,818,000	
ユーシン	1,800	704.00	1,267,200	
双葉電子工業	1,600	1,364.00	2,182,400	
北陸電気工業	8,000	139.00	1,112,000	
ニチコン	2,700	1,053.00	2,843,100	
日本ケミコン	5,000	481.00	2,405,000	
K O A	1,800	996.00	1,792,800	
小糸製作所	4,000	1,931.00	7,724,000	
ミツバ	2,000	1,573.00	3,146,000	
スター精密	1,500	984.00	1,476,000	
大日本スクリーン製造	9,000	573.00	5,157,000	
キャノン電子	800	1,862.00	1,489,600	
キャノン	49,200	3,185.00	156,702,000	代用有価証券 4,100株
リコー	26,000	1,073.00	27,898,000	
東京エレクトロン	7,100	5,600.00	39,760,000	
トヨタ紡織	3,000	1,321.00	3,963,000	
鬼怒川ゴム工業	3,000	549.00	1,647,000	
ユニプレス	1,500	1,903.00	2,854,500	
豊田自動織機	7,700	4,300.00	33,110,000	
モリタホールディングス	3,000	807.00	2,421,000	
三櫻工業	1,200	707.00	848,400	
デンソー	21,000	4,820.00	101,220,000	
東海理化電機製作所	2,000	2,078.00	4,156,000	
三井造船	33,000	214.00	7,062,000	
佐世保重工業	14,000	102.00	1,428,000	
川崎重工業	66,000	420.00	27,720,000	
日本車輛製造	3,000	560.00	1,680,000	

日産自動車	107,200	1,015.00	108,808,000	
いすゞ自動車	49,000	653.00	31,997,000	
トヨタ自動車	109,000	6,300.00	686,700,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	11,000	1,484.00	16,324,000	
三菱自動車工業	21,300	1,036.00	22,066,800	
武蔵精密工業	900	2,510.00	2,259,000	
日産車体	3,000	1,740.00	5,220,000	
新明和工業	3,000	775.00	2,325,000	
極東開発工業	1,600	1,217.00	1,947,200	
日信工業	1,700	1,827.00	3,105,900	
トピー工業	7,000	221.00	1,547,000	
ティラド	5,000	327.00	1,635,000	
曙ブレーキ工業	3,900	473.00	1,844,700	
タチエス	1,100	1,583.00	1,741,300	
NOK	4,100	1,509.00	6,186,900	
フタバ産業	3,700	388.00	1,435,600	
カヤバ工業	6,000	590.00	3,540,000	
大同メタル工業	2,000	1,068.00	2,136,000	
プレス工業	4,000	444.00	1,776,000	
カルソニックカンセイ	6,000	498.00	2,988,000	
太平洋工業	2,700	732.00	1,976,400	
ケーヒン	1,800	1,612.00	2,901,600	
アイシン精機	7,800	4,210.00	32,838,000	
マツダ	134,000	455.00	60,970,000	
ダイハツ工業	9,000	1,879.00	16,911,000	
今仙電機製作所	1,100	1,418.00	1,559,800	
本田技研工業	71,600	3,950.00	282,820,000	代用有価証券 6,000株
スズキ	17,700	2,470.00	43,719,000	
富士重工業	27,000	2,826.00	76,302,000	
ヤマハ発動機	12,900	1,513.00	19,517,700	
ショーワ	2,000	1,373.00	2,746,000	
エクセディ	1,200	2,546.00	3,055,200	
豊田合成	2,400	2,486.00	5,966,400	
ヨロズ	1,100	1,949.00	2,143,900	
エフ・シー・シー	1,400	2,232.00	3,124,800	
シマノ	3,700	8,780.00	32,486,000	
タカタ	1,500	2,548.00	3,822,000	
テイ・エス テック	1,800	3,900.00	7,020,000	
テルモ	6,500	4,960.00	32,240,000	
クリエートメディック	1,300	930.00	1,209,000	

日機装	3,000	1,168.00	3,504,000
島津製作所	10,000	973.00	9,730,000
ブイ・テクノロジー	1	276,500.00	276,500
東京計器	3,000	320.00	960,000
東京精密	1,500	1,844.00	2,766,000
マニー	600	3,650.00	2,190,000
ニコン	15,800	1,840.00	29,072,000
トプコン	2,000	1,564.00	3,128,000
オリンパス	11,200	3,140.00	35,168,000
タムロン	700	2,150.00	1,505,000
H O Y A	20,600	2,325.00	47,895,000
エー・アンド・デイ	600	596.00	357,600
シチズンホールディングス	9,600	720.00	6,912,000
セイコーホールディングス	5,000	449.00	2,245,000
ニプロ	4,500	925.00	4,162,500
パラマウントベッドホールディングス	700	3,255.00	2,278,500
S H O - B I	1,200	421.00	505,200
前田工織	300	1,270.00	381,000
バンダイナムコホールディングス	8,800	1,908.00	16,790,400
フランスベッドホールディングス	9,000	210.00	1,890,000
パイロットコーポレーション	700	3,685.00	2,579,500
トッパン・フォームズ	1,500	968.00	1,452,000
フジシールインターナショナル	1,000	3,050.00	3,050,000
タカラトミー	3,000	523.00	1,569,000
アーク	3,200	259.00	828,800
プロネクサス	1,100	605.00	665,500
ウッドワン	1,000	283.00	283,000
大建工業	7,000	261.00	1,827,000
凸版印刷	24,000	816.00	19,584,000
大日本印刷	26,000	1,068.00	27,768,000
共同印刷	5,000	273.00	1,365,000
日本写真印刷	1,300	1,621.00	2,107,300
光村印刷	3,000	262.00	786,000
宝印刷	1,300	675.00	877,500
アシックス	7,900	1,713.00	13,532,700
ツツミ	700	2,377.00	1,663,900
ローランド	1,000	1,199.00	1,199,000
小松ウオール工業	500	2,096.00	1,048,000
ヤマハ	6,200	1,487.00	9,219,400
クリナップ	1,300	863.00	1,121,900
ピジョン	1,300	5,020.00	6,526,000
リンテック	1,800	2,073.00	3,731,400

イトーキ	2,700	512.00	1,382,400	
任天堂	4,900	11,660.00	57,134,000	
三菱鉛筆	700	2,492.00	1,744,400	
タカスタンダード	4,000	803.00	3,212,000	
コクヨ	4,400	769.00	3,383,600	
ナカバヤシ	5,000	214.00	1,070,000	
グロープライド	2,000	202.00	404,000	
岡村製作所	3,000	691.00	2,073,000	
美津濃	4,000	566.00	2,264,000	
アデランス	1,100	1,223.00	1,345,300	
東京電力	72,000	515.00	37,080,000	
中部電力	26,000	1,450.00	37,700,000	
関西電力	34,600	1,342.00	46,433,200	
中国電力	11,700	1,564.00	18,298,800	
北陸電力	8,300	1,418.00	11,769,400	
東北電力	21,200	1,268.00	26,881,600	
四国電力	7,600	1,757.00	13,353,200	
九州電力	18,700	1,471.00	27,507,700	
北海道電力	7,900	1,350.00	10,665,000	
沖縄電力	500	3,470.00	1,735,000	
電源開発	5,300	3,410.00	18,073,000	
東京瓦斯	99,000	533.00	52,767,000	
大阪瓦斯	82,000	420.00	34,440,000	
東邦瓦斯	22,000	520.00	11,440,000	
西部瓦斯	10,000	243.00	2,430,000	
静岡瓦斯	2,200	670.00	1,474,000	
東武鉄道	48,000	521.00	25,008,000	
相鉄ホールディングス	14,000	369.00	5,166,000	
東京急行電鉄	50,000	711.00	35,550,000	
京浜急行電鉄	22,000	954.00	20,988,000	
小田急電鉄	27,000	989.00	26,703,000	
京王電鉄	24,000	712.00	17,088,000	
京成電鉄	13,000	1,048.00	13,624,000	
富士急行	2,000	801.00	1,602,000	
東日本旅客鉄道	15,600	8,650.00	134,940,000	
西日本旅客鉄道	7,300	4,410.00	32,193,000	
東海旅客鉄道	7,100	13,130.00	93,223,000	
西日本鉄道	11,000	380.00	4,180,000	
ハマキョウレックス	400	2,689.00	1,075,600	
近畿日本鉄道	77,000	368.00	28,336,000	
阪急阪神ホールディングス	54,000	573.00	30,942,000	
南海電気鉄道	18,000	368.00	6,624,000	

京阪電気鉄道	19,000	411.00	7,809,000	
名古屋鉄道	30,000	287.00	8,610,000	
日本通運	34,000	505.00	17,170,000	
ヤマトホールディングス	15,800	2,222.00	35,107,600	
山九	10,000	334.00	3,340,000	
丸全昭和運輸	5,000	363.00	1,815,000	
センコー	3,000	520.00	1,560,000	
日本梱包運輸倉庫	2,600	1,770.00	4,602,000	
福山通運	5,000	640.00	3,200,000	
セイノーホールディングス	7,000	992.00	6,944,000	
神奈川中央交通	3,000	515.00	1,545,000	
日立物流	1,500	1,433.00	2,149,500	
日本郵船	67,000	336.00	22,512,000	
商船三井	41,000	459.00	18,819,000	
川崎汽船	37,000	239.00	8,843,000	
N S ユナイテッド海運	5,000	323.00	1,615,000	
乾汽船	500	411.00	205,500	
飯野海運	3,500	674.00	2,359,000	
第一中央汽船	12,000	121.00	1,452,000	
日本航空	9,600	5,750.00	55,200,000	
A N A ホールディングス	167,000	220.00	36,740,000	
日新	7,000	284.00	1,988,000	
三菱倉庫	6,000	1,470.00	8,820,000	
三井倉庫	4,000	532.00	2,128,000	
住友倉庫	6,000	617.00	3,702,000	
澁澤倉庫	3,000	481.00	1,443,000	
日本トランスシティ	4,000	330.00	1,320,000	
安田倉庫	600	1,191.00	714,600	
上組	9,000	860.00	7,740,000	
サンリツ	1,700	526.00	894,200	
郵船ロジスティクス	300	1,166.00	349,800	
近鉄エクスプレス	800	3,680.00	2,944,000	
N E C ネットズエスアイ	800	2,469.00	1,975,200	
システナ	1,800	724.00	1,303,200	
コア	2,500	746.00	1,865,000	
I T ホールディングス	2,800	1,287.00	3,603,600	
グリー	4,300	838.00	3,603,400	
コーエーテクモホールディングス	1,700	1,055.00	1,793,500	
ポルトウウィン・ビットクルーホールディングス	100	3,205.00	320,500	
ネクソン	6,900	1,227.00	8,466,300	
ブロードリーフ	800	2,316.00	1,852,800	

ドワンゴ	800	2,058.00	1,646,400	
マクロミル	2,700	628.00	1,695,600	
ティーガイア	900	968.00	871,200	
GMOペイメントゲートウェイ	300	3,260.00	978,000	
ザップラス	3	69,900.00	209,700	
インターネットイニシアティブ	1,100	2,899.00	3,188,900	
SRAホールディングス	500	1,088.00	544,000	
野村総合研究所	4,700	3,535.00	16,614,500	
フジ・メディア・ホールディングス	8,100	2,027.00	16,418,700	
オービック	2,900	3,085.00	8,946,500	
ヤフー	60,600	503.00	30,481,800	
トレンドマイクロ	3,700	3,830.00	14,171,000	
日本オラクル	1,700	3,695.00	6,281,500	
フューチャーアーキテクト	800	589.00	471,200	
オービックビジネスコンサルタント	500	3,380.00	1,690,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,000	3,760.00	3,760,000	
アイティフォー	1,800	422.00	759,600	
大塚商会	800	13,000.00	10,400,000	
アグレックス	700	857.00	599,900	
C I J	2,000	418.00	836,000	
WOWOW	400	3,730.00	1,492,000	
ネットワンシステムズ	3,000	704.00	2,112,000	
マーベラスAQL	500	579.00	289,500	
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,500	2,725.00	4,087,500	
日本ユニシス	2,300	866.00	1,991,800	
兼松エレクトロニクス	400	1,291.00	516,400	
東京放送ホールディングス	4,500	1,318.00	5,931,000	
日本テレビホールディングス	7,600	1,818.00	13,816,800	
テレビ朝日	2,100	2,322.00	4,876,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	7,300	524.00	3,825,200	
テレビ東京ホールディングス	800	1,692.00	1,353,600	
コネクシオ	2,300	828.00	1,904,400	
日本電信電話	35,300	5,270.00	186,031,000	代用有価証券 3,200株
KDDI	23,600	5,300.00	125,080,000	
光通信	800	7,290.00	5,832,000	
NTTドコモ	69,000	1,557.00	107,433,000	
GMOインターネット	2,800	1,280.00	3,584,000	
学研ホールディングス	5,000	301.00	1,505,000	
ゼンリン	1,400	1,143.00	1,600,200	
KADOKAWA	700	3,325.00	2,327,500	
アイネット	2,000	741.00	1,482,000	

松竹	6,000	985.00	5,910,000
東宝	6,000	2,155.00	12,930,000
東映	4,000	596.00	2,384,000
エヌ・ティ・ティ・データ	5,200	3,245.00	16,874,000
D T S	1,400	1,657.00	2,319,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,000	1,652.00	4,956,000
シーイーシー	1,300	621.00	807,300
カプコン	1,600	1,953.00	3,124,800
ジャステック	700	775.00	542,500
S C S K	2,000	2,391.00	4,782,000
アイネス	2,600	605.00	1,573,000
T K C	600	1,651.00	990,600
富士ソフト	1,200	1,938.00	2,325,600
N S D	1,600	1,150.00	1,840,000
コナミ	3,800	2,414.00	9,173,200
J B C Cホールディングス	1,400	926.00	1,296,400
ソフトバンク	40,600	7,480.00	303,688,000
高千穂交易	2,300	943.00	2,168,900
あらた	3,000	344.00	1,032,000
双日	52,800	193.00	10,190,400
アルフレッサ ホールディングス	2,200	5,350.00	11,770,000
横浜冷凍	2,100	786.00	1,650,600
アルコニックス	200	2,108.00	421,600
あい ホールディングス	1,500	1,310.00	1,965,000
ダイワボウホールディングス	10,000	178.00	1,780,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,100	719.00	1,509,900
U K Cホールディングス	900	1,987.00	1,788,300
T O K A Iホールディングス	5,900	352.00	2,076,800
シップヘルスケアホールディングス	1,200	4,250.00	5,100,000
協栄産業	3,000	198.00	594,000
小野建	400	1,180.00	472,000
エコートレーディング	800	725.00	580,000
ナガイレーベン	1,100	1,586.00	1,744,600
三菱食品	900	2,760.00	2,484,000
松田産業	200	1,416.00	283,200
メディバルホールディングス	8,400	1,257.00	10,558,800
アズワン	900	2,089.00	1,880,100
ドウシシャ	1,700	1,390.00	2,363,000
黒田電気	1,100	1,412.00	1,553,200
ガリバーインターナショナル	2,800	578.00	1,618,400
進和	1,200	1,113.00	1,335,600
シークス	200	1,262.00	252,400

マクニカ	400	2,596.00	1,038,400	
伊藤忠商事	66,800	1,191.00	79,558,800	
丸紅	69,000	766.00	52,854,000	
長瀬産業	4,700	1,201.00	5,644,700	
豊田通商	9,300	2,761.00	25,677,300	
兼松	18,000	134.00	2,412,000	
三井物産	72,300	1,427.00	103,172,100	
日本紙パルプ商事	4,000	321.00	1,284,000	
日立ハイテクノロジーズ	2,500	2,174.00	5,435,000	
カメイ	1,500	728.00	1,092,000	
スターゼン	3,000	265.00	795,000	
山善	3,200	642.00	2,054,400	
住友商事	49,400	1,320.00	65,208,000	
三菱商事	65,300	2,000.00	130,600,000	代用有価証券 5,200株
第一実業	5,000	424.00	2,120,000	
キヤノンマーケティングジャパン	2,400	1,334.00	3,201,600	
西華産業	7,000	246.00	1,722,000	
菱洋エレクトロ	2,900	901.00	2,612,900	
ユアサ商事	9,000	201.00	1,809,000	
神鋼商事	2,000	207.00	414,000	
阪和興業	8,000	456.00	3,648,000	
菱電商事	2,000	677.00	1,354,000	
岩谷産業	9,000	425.00	3,825,000	
すてきナイスグループ	6,000	248.00	1,488,000	
昭光通商	9,000	158.00	1,422,000	
三愛石油	6,000	426.00	2,556,000	
稲畑産業	2,100	984.00	2,066,400	
東邦ホールディングス	2,700	1,891.00	5,105,700	
サンゲツ	1,500	2,587.00	3,880,500	
伊藤忠エネクス	1,600	534.00	854,400	
サンリオ	2,100	5,760.00	12,096,000	
リョーサン	1,400	1,865.00	2,611,000	
新光商事	2,300	870.00	2,001,000	
三信電気	700	648.00	453,600	
東陽テクニカ	1,200	1,182.00	1,418,400	
モスフードサービス	1,100	1,900.00	2,090,000	
ソーダニッカ	4,000	410.00	1,640,000	
P a l t a c	1,000	1,366.00	1,366,000	
太平洋興発	6,000	111.00	666,000	
ヤマタネ	8,000	195.00	1,560,000	
日鉄住金物産	4,000	312.00	1,248,000	

トラスコ中山	1,000	2,059.00	2,059,000
オートバックスセブン	2,900	1,467.00	4,254,300
加藤産業	1,200	2,052.00	2,462,400
イエローハット	800	1,770.00	1,416,000
杉本商事	700	900.00	630,000
因幡電機産業	1,100	2,994.00	3,293,400
ミスミグループ本社	3,100	2,880.00	8,928,000
スズケン	3,200	3,465.00	11,088,000
ローソン	3,200	7,710.00	24,672,000
サンエー	600	2,943.00	1,765,800
キリン堂	700	657.00	459,900
カワチ薬品	1,100	1,982.00	2,180,200
エービーシー・マート	1,000	5,050.00	5,050,000
アスクル	700	2,592.00	1,814,400
ゲオホールディングス	1,500	947.00	1,420,500
アダストリアホールディングス	700	4,450.00	3,115,000
くらコーポレーション	900	1,640.00	1,476,000
キャンドウ	1,000	1,615.00	1,615,000
パル	500	2,636.00	1,318,000
エディオン	3,600	488.00	1,756,800
ひらまつ	800	680.00	544,000
ハニーズ	700	1,093.00	765,100
ジェイアイエヌ	400	3,720.00	1,488,000
ビックカメラ	32	47,500.00	1,520,000
D C Mホールディングス	4,100	728.00	2,984,800
MonotaRO	1,300	3,075.00	3,997,500
J・フロント リテイリング	20,000	773.00	15,460,000
ドトール・日レスホールディングス	1,500	1,678.00	2,517,000
マツモトキヨシホールディングス	1,400	3,225.00	4,515,000
スタートトゥデイ	2,300	2,829.00	6,506,700
ココカラファイン	900	3,040.00	2,736,000
三越伊勢丹ホールディングス	16,600	1,444.00	23,970,400
ウエルシアホールディングス	300	5,260.00	1,578,000
クリエイトSDホールディングス	500	3,585.00	1,792,500
あさひ	500	1,723.00	861,500
コスモス薬品	400	12,030.00	4,812,000
セブン&アイ・ホールディングス	35,000	3,720.00	130,200,000
ツルハホールディングス	800	8,010.00	6,408,000
サンマルクホールディングス	400	5,040.00	2,016,000
トリドール	900	948.00	853,200
クスリのアオキ	100	6,120.00	612,000
総合メディカル	300	3,900.00	1,170,000

カップ・クリエイトホールディングス	1,200	1,836.00	2,203,200
良品計画	900	9,560.00	8,604,000
コナカ	1,400	947.00	1,325,800
コーナン商事	1,700	1,039.00	1,766,300
エコス	3,600	608.00	2,188,800
ワタミ	1,000	1,573.00	1,573,000
ドン・キホーテ	2,500	6,500.00	16,250,000
西松屋チェーン	1,700	753.00	1,280,100
ゼンショーホールディングス	3,200	1,125.00	3,600,000
幸楽苑	1,500	1,224.00	1,836,000
サイゼリヤ	1,200	1,234.00	1,480,800
ユナイテッドアローズ	900	4,200.00	3,780,000
ハイデイ日高	800	2,160.00	1,728,000
京都きもの友禅	400	1,048.00	419,200
コロワイド	3,000	987.00	2,961,000
壱番屋	400	4,160.00	1,664,000
トップカルチャー	2,000	490.00	980,000
スギホールディングス	1,300	4,280.00	5,564,000
ヨンドシーホールディングス	1,000	1,245.00	1,245,000
ファミリーマート	2,600	4,240.00	11,024,000
木曽路	1,000	1,839.00	1,839,000
千趣会	2,500	853.00	2,132,500
上新電機	2,000	803.00	1,606,000
日本瓦斯	1,200	1,141.00	1,369,200
ロイヤルホールディングス	1,400	1,540.00	2,156,000
島忠	1,900	2,431.00	4,618,900
チヨダ	1,000	2,128.00	2,128,000
カスミ	4,100	608.00	2,492,800
リンガーハット	1,600	1,407.00	2,251,200
AOKIホールディングス	700	3,325.00	2,327,500
オークワ	1,000	908.00	908,000
コメリ	1,300	2,539.00	3,300,700
青山商事	2,300	2,577.00	5,927,100
しまむら	1,000	10,820.00	10,820,000
高島屋	11,000	947.00	10,417,000
松屋	1,700	1,259.00	2,140,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,000	786.00	3,930,000
パルコ	1,600	942.00	1,507,200
丸井グループ	10,900	950.00	10,355,000
アクシアル リテイリング	1,100	1,599.00	1,758,900
井筒屋	2,000	89.00	178,000
ダイエー	4,850	310.00	1,503,500

イズミヤ	3,000	461.00	1,383,000
イオン	29,900	1,340.00	40,066,000
ユニーグループ・ホールディングス	8,000	600.00	4,800,000
イズミ	2,100	3,165.00	6,646,500
東武ストア	3,000	255.00	765,000
平和堂	1,700	1,540.00	2,618,000
フジ	900	1,775.00	1,597,500
ヤオコー	400	3,635.00	1,454,000
ゼビオ	1,100	2,158.00	2,373,800
ケーズホールディングス	2,100	2,618.00	5,497,800
アインファーマシーズ	500	4,240.00	2,120,000
元気寿司	700	1,258.00	880,600
ヤマダ電機	38,200	281.00	10,734,200
アークランドサカモト	1,000	1,530.00	1,530,000
ニトリホールディングス	1,650	9,000.00	14,850,000
吉野家ホールディングス	2,300	1,120.00	2,576,000
サガミチェーン	2,000	872.00	1,744,000
プレナス	900	2,169.00	1,952,100
ミニストップ	700	1,545.00	1,081,500
アークス	1,400	1,851.00	2,591,400
パロー	1,800	1,462.00	2,631,600
ファーストリテイリング	2,000	34,200.00	68,400,000
サンドラッグ	1,600	4,935.00	7,896,000
ベルーナ	3,100	516.00	1,599,600
じもとホールディングス	6,600	207.00	1,366,200
新生銀行	72,000	240.00	17,280,000
あおぞら銀行	30,000	290.00	8,700,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	634,400	635.00	402,844,000
りそなホールディングス	79,600	529.00	42,108,400
三井住友トラスト・ホールディングス	165,000	502.00	82,830,000
三井住友フィナンシャルグループ	63,300	4,890.00	309,537,000
第四銀行	11,000	351.00	3,861,000
北越銀行	8,000	220.00	1,760,000
西日本シティ銀行	29,000	277.00	8,033,000
千葉銀行	32,000	734.00	23,488,000
横浜銀行	52,000	547.00	28,444,000
常陽銀行	31,000	529.00	16,399,000
群馬銀行	19,000	582.00	11,058,000
武蔵野銀行	1,300	3,500.00	4,550,000
千葉興業銀行	2,500	781.00	1,952,500
筑波銀行	4,700	350.00	1,645,000
東京都民銀行	1,600	1,094.00	1,750,400

七十七銀行	13,000	508.00	6,604,000	
青森銀行	6,000	263.00	1,578,000	
秋田銀行	6,000	258.00	1,548,000	
山形銀行	5,000	427.00	2,135,000	
岩手銀行	600	4,605.00	2,763,000	
東邦銀行	7,000	311.00	2,177,000	
東北銀行	17,000	146.00	2,482,000	
みちのく銀行	2,000	207.00	414,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	34,000	459.00	15,606,000	
静岡銀行	25,000	1,133.00	28,325,000	
十六銀行	10,000	381.00	3,810,000	
スルガ銀行	8,000	1,572.00	12,576,000	
八十二銀行	15,000	617.00	9,255,000	
山梨中央銀行	5,000	434.00	2,170,000	
大垣共立銀行	11,000	288.00	3,168,000	
福井銀行	7,000	219.00	1,533,000	
北國銀行	9,000	372.00	3,348,000	
清水銀行	500	2,808.00	1,404,000	
滋賀銀行	8,000	562.00	4,496,000	
南都銀行	8,000	403.00	3,224,000	
百五銀行	8,000	412.00	3,296,000	
京都銀行	15,000	874.00	13,110,000	
紀陽銀行	3,300	1,355.00	4,471,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	57,000	203.00	11,571,000	
広島銀行	25,000	437.00	10,925,000	
山陰合同銀行	5,000	758.00	3,790,000	
中国銀行	6,000	1,429.00	8,574,000	
伊予銀行	9,000	1,044.00	9,396,000	
百十四銀行	9,000	377.00	3,393,000	
四国銀行	6,000	232.00	1,392,000	
阿波銀行	7,000	532.00	3,724,000	
鹿児島銀行	6,000	684.00	4,104,000	
大分銀行	5,000	375.00	1,875,000	
宮崎銀行	6,000	297.00	1,782,000	
肥後銀行	7,000	580.00	4,060,000	
佐賀銀行	11,000	213.00	2,343,000	
十八銀行	9,000	241.00	2,169,000	
沖縄銀行	600	4,070.00	2,442,000	
琉球銀行	1,700	1,143.00	1,943,100	
八千代銀行	500	2,900.00	1,450,000	
セブン銀行	28,200	349.00	9,841,800	
みずほフィナンシャルグループ	1,083,600	209.00	226,472,400	

山口フィナンシャルグループ	8,000	958.00	7,664,000
名古屋銀行	8,000	368.00	2,944,000
北洋銀行	12,600	449.00	5,657,400
愛知銀行	300	4,645.00	1,393,500
大光銀行	6,000	225.00	1,350,000
愛媛銀行	2,000	245.00	490,000
みなと銀行	2,000	172.00	344,000
京葉銀行	7,000	514.00	3,598,000
関西アーバン銀行	9,000	121.00	1,089,000
栃木銀行	4,000	398.00	1,592,000
東和銀行	16,000	94.00	1,504,000
福島銀行	20,000	86.00	1,720,000
トモニホールディングス	6,400	384.00	2,457,600
フィデアホールディングス	9,500	200.00	1,900,000
池田泉州ホールディングス	6,900	497.00	3,429,300
F P G	700	1,220.00	854,000
S B Iホールディングス	10,600	1,243.00	13,175,800
日本アジア投資	7,000	109.00	763,000
ジャフコ	1,100	5,120.00	5,632,000
大和証券グループ本社	83,000	883.00	73,289,000
野村ホールディングス	171,200	754.00	129,084,800
岡三証券グループ	7,000	884.00	6,188,000
丸三証券	2,600	817.00	2,124,200
東洋証券	5,000	355.00	1,775,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	9,600	833.00	7,996,800
光世証券	2,000	271.00	542,000
水戸証券	3,000	499.00	1,497,000
いちよし証券	1,900	1,448.00	2,751,200
松井証券	5,000	1,088.00	5,440,000
マネックスグループ	9,100	389.00	3,539,900
カブドットコム証券	3,200	540.00	1,728,000
極東証券	1,100	1,764.00	1,940,400
岩井コスモホールディングス	1,100	1,397.00	1,536,700
N K S Jホールディングス	18,600	2,540.00	47,244,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	25,000	2,568.00	64,200,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	8,000	1,813.00	14,504,000
第一生命保険	44,800	1,360.00	60,928,000
東京海上ホールディングス	32,400	3,180.00	103,032,000
T & Dホールディングス	28,700	1,231.00	35,329,700
全国保証	900	4,300.00	3,870,000
クレディセゾン	7,300	2,714.00	19,812,200

芙蓉総合リース	800	3,960.00	3,168,000
興銀リース	1,400	2,598.00	3,637,200
東京センチュリーリース	2,000	3,110.00	6,220,000
日本証券金融	3,600	752.00	2,707,200
アイフル	14,000	492.00	6,888,000
ポケットカード	700	881.00	616,700
リコーリース	600	2,744.00	1,646,400
イオンフィナンシャルサービス	3,100	3,135.00	9,718,500
アコム	16,800	392.00	6,585,600
ジャックス	5,000	487.00	2,435,000
オリエントコーポレーション	18,500	257.00	4,754,500
日立キャピタル	1,600	2,420.00	3,872,000
オリックス	50,100	1,655.00	82,915,500
三菱UFJリース	21,200	535.00	11,342,000
日本取引所グループ	10,500	2,284.00	23,982,000
イー・ギャランティ	300	2,535.00	760,500
NECキャピタルソリューション	500	2,507.00	1,253,500
日本駐車場開発	175	7,560.00	1,323,000
ヒューリック	14,100	1,625.00	22,912,500
野村不動産ホールディングス	4,000	2,505.00	10,020,000
フージャースホールディングス	1,400	828.00	1,159,200
東急不動産ホールディングス	21,800	1,056.00	23,020,800
パーク24	4,400	1,947.00	8,566,800
三井不動産	39,000	3,425.00	133,575,000
三菱地所	59,000	2,927.00	172,693,000
平和不動産	1,600	1,832.00	2,931,200
東京建物	17,000	958.00	16,286,000
ダイビル	2,200	1,305.00	2,871,000
京阪神ビルディング	2,300	569.00	1,308,700
住友不動産	20,000	4,905.00	98,100,000
大京	13,000	307.00	3,991,000
テオーシー	2,900	856.00	2,482,400
東京楽天地	1,000	496.00	496,000
レオパレス21	8,000	709.00	5,672,000
フジ住宅	1,700	694.00	1,179,800
空港施設	500	896.00	448,000
住友不動産販売	600	3,450.00	2,070,000
ゴールドクレスト	700	2,804.00	1,962,800
東栄住宅	800	2,516.00	2,012,800
飯田産業	900	2,193.00	1,973,700
アーネストワン	1,400	2,531.00	3,543,400
タカラレーベン	3,800	350.00	1,330,000

サンヨーハウジング名古屋	200	1,185.00	237,000
イオンモール	4,700	2,728.00	12,821,600
タクトホーム	7	235,700.00	1,649,900
トーセイ	1,500	850.00	1,275,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	5,200	1,360.00	7,072,000
サンフロンティア不動産	1,100	1,258.00	1,383,800
日本空港ビルデング	2,900	2,473.00	7,171,700
日本工営	5,000	453.00	2,265,000
日本M&Aセンター	500	7,940.00	3,970,000
アコーディア・ゴルフ	3,900	1,144.00	4,461,600
パソナグループ	4	86,900.00	347,600
エス・エム・エス	900	2,410.00	2,169,000
テンプホールディングス	1,200	2,585.00	3,102,000
クックパッド	500	3,425.00	1,712,500
シミックホールディングス	100	1,358.00	135,800
総合警備保障	3,200	1,951.00	6,243,200
カカクコム	4,800	2,202.00	10,569,600
新日本科学	700	1,530.00	1,071,000
ツクイ	1,400	1,084.00	1,517,600
エムスリー	21	266,100.00	5,588,100
ディー・エヌ・エー	4,400	2,075.00	9,130,000
博報堂D Yホールディングス	12,300	766.00	9,421,800
ぐるなび	1,200	2,275.00	2,730,000
一休	4	159,600.00	638,400
P G Mホールディングス	1,600	954.00	1,526,400
J Pホールディングス	2,300	456.00	1,048,800
イーピーエス	13	94,400.00	1,227,200
アミューズ	300	1,909.00	572,700
ケネディクス	9,100	568.00	5,168,800
電通	8,300	3,785.00	31,415,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	400	2,030.00	812,000
みらかホールディングス	2,300	4,375.00	10,062,500
サニックス	1,300	1,074.00	1,396,200
オリエンタルランド	2,600	16,040.00	41,704,000
ダスキン	2,400	2,000.00	4,800,000
明光ネットワークジャパン	1,600	1,199.00	1,918,400
ファルコSDホールディングス	800	1,327.00	1,061,600
ラウンドワン	2,800	571.00	1,598,800
リゾートトラスト	1,500	3,600.00	5,400,000
ビー・エム・エル	500	3,330.00	1,665,000
もしもしホットライン	1,500	1,155.00	1,732,500
リソー教育	1,200	668.00	801,600

ユー・エス・エス	9,900	1,431.00	14,166,900	
テー・オー・ダブリュー	1,400	568.00	795,200	
リブセンス	200	4,775.00	955,000	
リロ・ホールディング	300	4,615.00	1,384,500	
エイチ・アイ・エス	700	5,690.00	3,983,000	
共立メンテナンス	400	3,785.00	1,514,000	
イチネンホールディングス	1,700	693.00	1,178,100	
東京テアトル	3,000	166.00	498,000	
よみうりランド	2,000	817.00	1,634,000	
東京都競馬	7,000	445.00	3,115,000	
常磐興産	6,000	167.00	1,002,000	
カナモト	1,000	2,714.00	2,714,000	
東京ドーム	7,000	751.00	5,257,000	
トランス・コスモス	1,200	1,734.00	2,080,800	
乃村工藝社	2,000	891.00	1,782,000	
藤田観光	3,000	433.00	1,299,000	
トーカイ	700	2,638.00	1,846,600	
白洋舎	7,000	237.00	1,659,000	
セコム	9,200	6,170.00	56,764,000	
セントラル警備保障	1,500	934.00	1,401,000	
メイテック	1,300	2,699.00	3,508,700	
アサツー ディ・ケイ	1,600	2,705.00	4,328,000	
応用地質	800	1,727.00	1,381,600	
船井総合研究所	2,400	792.00	1,900,800	
ベネッセホールディングス	2,700	3,570.00	9,639,000	
イオンディライト	900	1,922.00	1,729,800	
ナック	400	1,699.00	679,600	
ニチイ学館	1,700	975.00	1,657,500	
ダイセキ	1,300	2,046.00	2,659,800	
合 計	13,395,924		14,303,173,200	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

新光外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	662,933,089	326,768,441
コール・ローン	31,248,475	12,703,800
株式	12,602,152,123	12,890,912,083
投資信託受益証券	2,181,532	2,051,905
投資証券	316,161,342	280,497,452
派生商品評価勘定	210,776	13,260,050
未収入金	266,966	80,018
未収配当金	22,902,740	12,687,306
未収利息	40	13
差入委託証拠金	149,907,870	199,729,478
流動資産合計	13,787,964,953	13,738,690,546
資産合計		
	13,787,964,953	13,738,690,546
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,872,367	3,792
未払解約金	-	16,000,000
流動負債合計	9,872,367	16,003,792
負債合計		
	9,872,367	16,003,792
純資産の部		
元本等		
元本	10,860,831,302	9,636,167,385
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,917,261,284	4,086,519,369
元本等合計	13,778,092,586	13,722,686,754
純資産合計		
	13,778,092,586	13,722,686,754
負債純資産合計		
	13,787,964,953	13,738,690,546

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25年 4月23日 至 平成25年10月21日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 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。</p> <p>投資証券</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
1. 計算日における受益権の総数 <div style="text-align: right;">10,860,831,302口</div>	1. 計算日における受益権の総数 <div style="text-align: right;">9,636,167,385口</div>
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2686円 (1万口当たり純資産額) (12,686円)	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.4241円 (1万口当たり純資産額) (14,241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10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左

2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。株価指数先物取引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。</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>	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、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>
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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>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。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21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	12,866,406,115円	10,860,831,302円
期中追加設定元本額	96,542,776円	63,062,457円
期中一部解約元本額	2,102,117,589円	1,287,726,374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	1,022,290,872円	900,021,204円
新光外国株式インデックスVA	4,586,391,308円	4,187,975,450円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	1,059,331,099円	985,157,221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）	1,034,807,364円	836,551,878円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	669,771,252円	532,695,120円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,622,297,727円	1,431,709,467円

ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	865,941,680円	762,057,045円
合計	10,860,831,302円	9,636,167,385円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21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	1,166,553,978	2,427,034,863
投資信託受益証券	107,730	13,238
投資証券	36,140,735	18,192,245
合計	1,202,802,443	2,445,240,346

(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25年 4月22日現在				平成25年10月21日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	853,514,118	-	843,766,423	9,747,695	525,933,934	-	539,129,542	13,195,608
S&P500 EMINI	549,501,354	-	548,024,505	1,476,849	373,132,763	-	383,132,677	9,999,914
S&P/TSE 601X	42,631,077	-	40,078,206	2,552,871	13,947,207	-	14,311,862	364,655
DJ EURO ST50	92,000,061	-	88,459,843	3,540,218	46,675,108	-	48,601,464	1,926,356
LIFFE FTSE	96,085,928	-	94,517,212	1,568,716	51,666,065	-	52,246,894	580,829
SWISS MKT IX	40,829,683	-	40,530,447	299,236	26,192,078	-	26,294,568	102,490
OMXS30 INDEX	6,961,262	-	6,920,312	40,950	1,918,830	-	1,959,243	40,413
SPI 200	25,504,753	-	25,235,898	268,855	12,401,883	-	12,582,834	180,951
合計	853,514,118	-	843,766,423	9,747,695	525,933,934	-	539,129,542	13,195,608

時価の算定方法

先物取引

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

種類	平成25年 4月22日現在				平成25年10月21日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	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	-	-	-	-	14,985,408	-	14,984,940	468
米ドル	-	-	-	-	10,002,120	-	10,001,100	1,020
カナダドル	-	-	-	-	856,809	-	857,250	441
ユーロ	-	-	-	-	1,875,426	-	1,877,400	1,974
英ポンド	-	-	-	-	1,424,853	-	1,426,230	1,377
スウェーデンクローナ	-	-	-	-	826,200	-	822,960	3,240
合計	20,834,960	-	20,810,520	24,440	14,985,408	-	14,984,940	468

時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	2,400	97.42	233,808.00	
	APACHE CORP	1,900	91.26	173,394.00	
	BAKER HUGHES INC	2,200	55.55	122,210.00	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	2,000	36.12	72,240.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORPORATION	1,200	65.11	78,132.00	
	CHENIERE ENERGY INC	1,000	39.03	39,030.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	2,700	28.25	76,275.00	
	CHEVRON CORP	9,200	119.65	1,100,780.00	
	CIMAREX ENERGY CO	400	110.43	44,172.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	1,300	22.94	29,822.00	
	CONCHO RESOURCES INC	500	120.72	60,360.00	
	CONOCOPHILLIPS	5,500	73.43	403,865.00	
	CONSOL ENERGY INC	1,200	38.00	45,600.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC	200	121.00	24,200.00	
	CORE LABORATORIES NV	200	196.99	39,398.00	
	DENBURY RESOURCES INC	1,800	19.01	34,218.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,800	63.21	113,778.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC	300	63.15	18,945.00	
	ENERGEN CORPORATION	300	85.08	25,524.00	
	ENSCO PLC-CLASS A	1,100	55.04	60,544.00	
	EOG RESOURCES INC	1,300	183.79	238,927.00	
	EQT CORPORATION	700	89.62	62,734.00	
	EXXON MOBIL CORP	20,966	87.55	1,835,573.30	
	FMC TECHNOLOGIES INC	1,200	59.34	71,208.00	
	HALLIBURTON CO	4,000	52.47	209,880.00	
	HELMERICH & PAYNE INC	500	76.76	38,380.00	
	HESS CORPORATION	1,500	84.06	126,090.00	
	HOLLYFRONTIER CORPORATION	900	44.92	40,428.00	
	KINDER MORGAN INC	3,193	35.33	112,808.69	
	MARATHON OIL CORP	3,500	35.28	123,480.00	
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	1,550	70.74	109,647.00		

MURPHY OIL CORPORATION	900	62.44	56,196.00
NABORS INDUSTRIES LTD	1,600	17.80	28,480.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	2,004	82.16	164,648.64
NOBLE CORPORATION	1,300	37.98	49,374.00
NOBLE ENERGY INC	1,800	72.56	130,608.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	3,800	98.29	373,502.00
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	500	86.27	43,135.00
PEABODY ENERGY CORP	1,300	18.50	24,050.00
PHILLIPS 66	2,850	63.48	180,918.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	600	224.95	134,970.00
QEP RESOURCES INC	1,000	31.22	31,220.00
RANGE RESOURCES CORP	800	77.84	62,272.00
ROWAN COMPANIES PLC	700	36.64	25,648.00
SCHLUMBERGER LIMITED	6,332	93.99	595,144.68
SOUTHWESTERN ENERGY CO	1,800	36.47	65,646.00
SPECTRA ENERGY CORPORATION	3,334	35.31	117,723.54
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	800	27.30	21,840.00
TESORO CORPORATION	700	49.13	34,391.00
VALERO ENERGY CORP	2,700	39.10	105,570.00
WEATHERFORD INTERNATIONAL LIMITED	3,800	16.40	62,320.00
WHITING PETROLEUM CORPORATION	600	67.00	40,200.00
WILLIAMS COS INC	3,300	36.24	119,592.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,000	110.19	110,190.00
AIRGAS INC	300	111.58	33,474.00
ALBEMARLE CORPORATION	400	67.30	26,920.00
ALCOA INC	5,200	8.63	44,876.00
ASHLAND INC	400	91.52	36,608.00
AVERY DENNISON CORPORATION	600	44.64	26,784.00
BALL CORPORATION	700	46.17	32,319.00
CELANESE CORP-SERIES A	900	53.98	48,582.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	300	215.16	64,548.00
CROWN HOLDINGS INC	700	40.29	28,203.00
DOW CHEMICAL	5,700	41.31	235,467.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	4,400	59.62	262,328.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	700	81.61	57,127.00
ECOLAB INC	1,300	103.51	134,563.00
FMC CORPORATION	600	73.41	44,046.00
FREEMPORT-MCMORAN COPPER & GOLD INC	4,943	34.89	172,461.27
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	400	82.34	32,936.00
INTERNATIONAL PAPER CO	2,000	45.47	90,940.00
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	2,000	77.91	155,820.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	200	97.51	19,502.00

MEADWESTVACO CORPORATION	900	38.68	34,812.00
MONSANTO CO	2,500	105.74	264,350.00
NEWMONT MINING CORP	2,600	26.92	69,992.00
NUCOR CORP	1,600	51.09	81,744.00
OWENS-ILLINOIS INC	900	30.53	27,477.00
PPG INDUSTRIES INC	700	175.77	123,039.00
PRAXAIR INC	1,400	124.94	174,916.00
ROCK-TENN COMPANY-CL A	300	108.52	32,556.00
SEALED AIR CORPORATION	1,100	27.93	30,723.00
SIGMA-ALDRICH	600	83.78	50,268.00
THE MOSAIC COMPANY	1,500	46.61	69,915.00
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	400	184.56	73,824.00
VULCAN MATERIALS CO	600	52.08	31,248.00
3M CO	3,100	122.84	380,804.00
AGCO CORPORATION	500	64.20	32,100.00
AMETEK INC	1,175	46.07	54,132.25
BOEING CO	3,400	122.52	416,568.00
CATERPILLAR INC	3,100	87.34	270,754.00
CUMMINS INC	900	136.44	122,796.00
DANAHER CORP	2,900	72.00	208,800.00
DEERE & CO	1,700	84.19	143,123.00
DOVER CORP	800	88.93	71,144.00
EATON CORPORATION PLC	2,274	68.73	156,292.02
EMERSON ELECTRIC CO	3,500	65.64	229,740.00
FASTENAL CO	1,400	49.20	68,880.00
FLOWSERVE CORPORATION	600	64.28	38,568.00
FLUOR CORP	800	77.19	61,752.00
GENERAL DYNAMICS CORP	1,400	88.40	123,760.00
GENERAL ELECTRIC CO(US)	48,900	25.55	1,249,395.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	3,500	84.58	296,030.00
ILLINOIS TOOL WORKS	2,000	77.42	154,840.00
INGERSOLL-RAND PLC	1,522	66.85	101,745.70
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	600	59.62	35,772.00
JOY GLOBAL INC	500	54.20	27,100.00
KBR INC	800	35.65	28,520.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	400	94.77	37,908.00
LOCKHEED MARTIN CORP	1,300	128.90	167,570.00
MASCO CORP	2,000	19.98	39,960.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,100	101.59	111,749.00
PACCAR INC	1,800	57.58	103,644.00
PALL CORPORATION	500	78.60	39,300.00
PARKER HANNIFIN CORP	650	112.41	73,066.50

PENTAIR LIMITED	959	65.24	62,565.16
PRECISION CASTPARTS CORP	700	243.34	170,338.00
QUANTA SERVICES INC	1,100	28.75	31,625.00
RAYTHEON COMPANY	1,500	76.86	115,290.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	700	110.42	77,294.00
ROCKWELL COLLINS INC.	600	70.54	42,324.00
ROPER INDUSTRIES INC	500	132.07	66,035.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	600	39.72	23,832.00
SPX CORP	200	85.37	17,074.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	737	77.16	56,866.92
TEXTRON INC	1,300	28.25	36,725.00
TRANSDIGM GROUP INC	200	140.13	28,026.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	4,100	107.74	441,734.00
WW GRAINGER INC	300	264.30	79,290.00
XYLEM INC	1,000	27.83	27,830.00
CINTAS CORPORATION	500	53.15	26,575.00
DUN & BRADSTREET CORP	200	106.57	21,314.00
EQUIFAX INC	600	62.17	37,302.00
IHS INC-CLASS A	300	113.03	33,909.00
IRON MOUNTAIN INCORPORATED	779	26.50	20,643.50
MANPOWER GROUP	400	79.31	31,724.00
NIELSEN HOLDINGS NV	1,100	38.44	42,284.00
REPUBLIC SERVICES INC	1,430	33.12	47,361.60
ROBERT HALF INTL INC	800	40.93	32,744.00
STERICYCLE INC	400	118.78	47,512.00
THE ADT CORPORATION	975	40.99	39,965.25
TYCO INTERNATIONAL LIMITED	2,250	35.96	80,910.00
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	700	68.69	48,083.00
WASTE MANAGEMENT INC	2,100	42.45	89,145.00
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	800	60.21	48,168.00
CSX CORP	5,000	25.70	128,500.00
DELTA AIR LINES INC	1,000	25.01	25,010.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	1,100	43.91	48,301.00
FEDEX CORP	1,400	126.44	177,016.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,800	23.66	42,588.00
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	400	75.80	30,320.00
KANSAS CITY SOUTHERN	500	117.35	58,675.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,500	79.89	119,835.00
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	1,000	16.07	16,070.00
UNION PACIFIC CORP	2,200	152.10	334,620.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	400	30.92	12,368.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3,400	93.00	316,200.00

AUTOLIV INC	500	93.21	46,605.00
BORGWARNER INC	500	105.66	52,830.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	1,500	60.00	90,000.00
FORD MOTOR CO	17,300	17.53	303,269.00
GENERAL MOTORS CO	3,700	35.89	132,793.00
HARLEY-DAVIDSON INC	1,100	65.75	72,325.00
JOHNSON CONTROLS INC	3,200	43.11	137,952.00
TESLA MOTORS INC	400	183.40	73,360.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORPORATION	600	78.51	47,106.00
COACH INC	1,300	53.87	70,031.00
DR HORTON INC	1,500	19.02	28,530.00
FOSSIL GROUP INC	200	121.75	24,350.00
GARMIN LIMITED	600	48.86	29,316.00
HASBRO INC	600	47.24	28,344.00
LEGGETT & PLATT INC	700	29.30	20,510.00
LENNAR CORPORATION-CLASS A	800	35.04	28,032.00
LULULEMON ATHLETICA INC	500	72.75	36,375.00
MATTEL INC	1,700	42.69	72,573.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	900	75.24	67,716.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	300	124.28	37,284.00
NEWELL RUBBERMAID INC	1,600	29.02	46,432.00
NIKE INC -CL B	3,500	75.93	265,755.00
POLARIS INDUSTRIES INC	300	134.74	40,422.00
PULTEGROUP INC	1,700	16.58	28,186.00
PVH CORPORATION	400	122.42	48,968.00
RALPH LAUREN CORPORATION	300	163.90	49,170.00
TOLL BROTHERS INC	800	32.29	25,832.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	400	85.29	34,116.00
VF CORP	400	204.30	81,720.00
WHIRLPOOL CORP	400	133.43	53,372.00
CARNIVAL CORP(US)	1,900	32.74	62,206.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	100	509.74	50,974.00
DARDEN RESTAURANTS INC	700	52.07	36,449.00
H&R BLOCK INC	1,300	29.25	38,025.00
INTL GAME TECHNOLOGY	1,500	18.62	27,930.00
LAS VEGAS SANDS CORP	1,900	72.52	137,788.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	1,326	43.50	57,681.00
MCDONALD'S CORP	4,700	95.20	447,440.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,900	20.69	39,311.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	800	39.28	31,424.00
STARBUCKS CORP	3,500	79.31	277,585.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	900	70.61	63,549.00

WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	700	64.21	44,947.00
WYNN RESORTS LTD	400	171.92	68,768.00
YUM! BRANDS INC	2,100	66.68	140,028.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	900	15.66	14,094.00
CBS CORP-CLASS B	2,650	59.20	156,880.00
CHARTER COMMUNICATION INC-A	300	137.31	41,193.00
COMCAST CORP-CL A	10,100	47.06	475,306.00
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	2,300	45.58	104,834.00
DIRECTV	2,500	61.66	154,150.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	400	75.48	30,192.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	750	82.47	61,852.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	1,000	49.13	49,130.00
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	2,200	16.04	35,288.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	861	77.35	66,598.35
LIBERTY GLOBAL PLC-C	669	73.50	49,171.50
LIBERTY MEDIA CORPORATION	400	154.96	61,984.00
NEWS CORPRATION-CLASS A	1,900	16.85	32,015.00
OMNICOM GROUP	1,300	65.66	85,358.00
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	400	79.15	31,660.00
SIRIUS XM RADIO INC	16,400	4.05	66,420.00
THE WALT DISNEY CO.	8,100	67.15	543,915.00
TIME WARNER CABLE INC	1,401	118.20	165,598.20
TIME WARNER INC	4,433	68.73	304,680.09
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	7,200	34.26	246,672.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	2,200	34.21	75,262.00
VIACOM INC-CLASS B	2,050	83.64	171,462.00
ADVANCE AUTO PARTS INC	300	98.70	29,610.00
AMAZON.COM INC	1,700	329.00	559,300.00
AUTOZONE INC	200	432.11	86,422.00
BED BATH & BEYOND INC	1,000	76.35	76,350.00
BEST BUY CO INC	1,300	42.97	55,861.00
CARMAX INC	1,100	48.74	53,614.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	600	52.57	31,542.00
DOLLAR GENERAL CORPORATION	1,600	58.89	94,224.00
DOLLAR TREE INC	1,100	59.24	65,164.00
EXPEDIA INC	600	48.43	29,058.00
FAMILY DOLLAR STORES	500	69.56	34,780.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	700	53.88	37,716.00
GAP INC/THE	1,400	37.22	52,108.00
GENUINE PARTS CO	700	78.65	55,055.00
HOME DEPOT INC	6,900	74.69	515,361.00
J.C. PENNEY CO INC	800	7.00	5,600.00

KOHL'S CORP	1,000	53.93	53,930.00
L BRANDS INC	1,300	59.23	76,999.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	2,525	27.10	68,427.50
LKQ CORPORATION	1,500	33.19	49,785.00
LOWE'S COS INC	5,100	47.66	243,066.00
MACY'S INC	1,800	44.39	79,902.00
NETFLIX INC	200	333.50	66,700.00
NORDSTROM INC	800	58.74	46,992.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	500	133.93	66,965.00
PETSMART INC	500	72.20	36,100.00
PRICELINE COM INC	200	1,048.25	209,650.00
ROSS STORES INC	1,000	74.30	74,300.00
SEARS HOLDINGS CORP	300	56.37	16,911.00
STAPLES INC	3,400	15.91	54,094.00
TARGET CORP	3,000	64.67	194,010.00
TIFFANY & CO	600	78.14	46,884.00
TJX COMPANIES INC	3,400	57.77	196,418.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	600	67.22	40,332.00
TRIPADVISOR INC	600	71.87	43,122.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	300	126.21	37,863.00
URBAN OUTFITTERS INC	700	37.01	25,907.00
COSTCO WHOLESALE CORP	2,100	117.64	247,044.00
CVS CAREMARK CORPORATION	5,772	61.01	352,149.72
KROGER CO	2,300	42.38	97,474.00
SAFEWAY INC	1,300	33.36	43,368.00
SYSCO CORP	3,000	32.07	96,210.00
WAL-MART STORES INC	7,800	75.71	590,538.00
WALGREEN CO	4,400	58.59	257,796.00
WHOLE FOODS MARKET INC	1,800	63.85	114,930.00
ALTRIA GROUP INC	9,500	35.86	340,670.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3,200	38.02	121,664.00
BEAM INC	700	69.83	48,881.00
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	550	72.61	39,935.50
BUNGE LIMITED	700	80.79	56,553.00
CAMPBELL SOUP COMPANY	1,000	41.59	41,590.00
COCA-COLA CO/THE	19,000	38.78	736,820.00
COCA-COLA ENTERPRISES INC	1,300	42.19	54,847.00
CONAGRA FOODS INC	2,100	31.17	65,457.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	900	64.33	57,897.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	1,039	45.01	46,765.39
GENERAL MILLS INC	3,000	49.19	147,570.00
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS INC	600	64.41	38,646.00

HERSHEY CO/THE	700	96.03	67,221.00
HORMEL FOODS CORPORATION	700	43.06	30,142.00
KELLOGG COMPANY	1,200	61.45	73,740.00
KRAFT FOODS GROUP INC	2,914	53.70	156,481.80
LORILLARD INC	1,800	47.73	85,914.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	600	67.92	40,752.00
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	1,000	78.81	78,810.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	700	52.62	36,834.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	8,044	32.45	261,027.80
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	700	57.72	40,404.00
PEPSICO INC	7,286	83.01	604,810.86
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	7,700	86.93	669,361.00
REYNOLDS AMERICAN INC	1,600	50.59	80,944.00
THE JM SMUCKER COMPANY	500	107.88	53,940.00
TYSON FOODS INC-CL A	1,500	28.45	42,675.00
AVON PRODUCTS INC	2,200	21.44	47,168.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	700	62.82	43,974.00
CLOROX COMPANY	600	85.75	51,450.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	4,400	62.81	276,364.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	300	93.45	28,035.00
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	1,100	72.05	79,255.00
HERBALIFE LIMITED	400	65.25	26,100.00
KIMBERLY-CLARK CORP	1,800	99.18	178,524.00
PROCTER & GAMBLE CO	12,992	79.41	1,031,694.72
ABBOTT LABORATORIES	7,400	37.29	275,946.00
AETNA INC	1,871	63.43	118,677.53
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,100	64.61	71,071.00
BARD (C.R.) INC	400	124.50	49,800.00
BAXTER INTERNATIONAL INC.	2,600	66.00	171,600.00
BECTON DICKINSON & CO	900	104.81	94,329.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	6,403	12.28	78,628.84
CARDINAL HEALTH INC	1,600	55.92	89,472.00
CAREFUSION CORPORATION	1,050	39.24	41,202.00
CERNER CORPORATION	1,600	57.77	92,432.00
CIGNA CORP	1,300	74.95	97,435.00
COVIDIEN PLC	2,250	63.27	142,357.50
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	800	58.06	46,448.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	700	45.69	31,983.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	600	77.20	46,320.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	4,025	63.76	256,634.00
HCA HOLDINGS INC	1,300	48.54	63,102.00
HENRY SCHEIN INC	400	111.49	44,596.00

HOLOGIC INC	1,300	22.28	28,964.00
HUMANA INC	700	91.23	63,861.00
INTUITIVE SURGICAL INC	200	375.99	75,198.00
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	400	100.20	40,080.00
MCKESSON CORP	1,100	141.45	155,595.00
MEDTRONIC INC	4,800	56.59	271,632.00
OMNICARE INC	600	57.12	34,272.00
PATTERSON COMPANIES INC	500	41.48	20,740.00
QUEST DIAGNOSTICS	800	57.92	46,336.00
RESMED INC	700	56.22	39,354.00
ST JUDE MEDICAL INC	1,400	56.84	79,576.00
STRYKER CORP	1,500	73.46	110,190.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	4,800	68.76	330,048.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	500	78.64	39,320.00
WELLPOINT INC	1,400	86.38	120,932.00
ZIMMER HOLDINGS INC	800	88.95	71,160.00
ABBVIE INC	7,500	48.33	362,475.00
ACTAVIS PLC	744	146.92	109,308.48
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,600	52.99	84,784.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	900	108.43	97,587.00
ALLERGAN INC	1,400	90.74	127,036.00
AMGEN INC	3,500	114.89	402,115.00
BIOGEN IDEC INC	1,100	244.91	269,401.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	700	66.36	46,452.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	7,800	49.72	387,816.00
CELGENE CORP	2,000	160.55	321,100.00
ELI LILLY & CO	4,800	49.56	237,888.00
FOREST LABORATORIES INC	1,200	44.44	53,328.00
GILEAD SCIENCES INC	7,200	68.23	491,256.00
HOSPIRA INC	800	41.62	33,296.00
ILLUMINA INC	600	81.43	48,858.00
JOHNSON & JOHNSON	13,324	91.63	1,220,878.12
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	831	75.15	62,449.65
MERCK & CO. INC.	14,331	46.61	667,967.91
MYLAN INC	1,900	38.56	73,264.00
PERRIGO COMPANY	400	132.65	53,060.00
PFIZER INC	31,026	30.51	946,603.26
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	400	303.56	121,424.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,700	96.12	163,404.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,000	77.06	77,060.00
WATERS CORP	400	106.48	42,592.00
ZOETIS INC	2,500	33.22	83,050.00

BB&T CORPORATION	3,500	33.60	117,600.00
CIT GROUP INC	1,000	51.01	51,010.00
COMERICA INC	1,000	42.06	42,060.00
FIFTH THIRD BANCORP	4,100	19.27	79,007.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	400	49.78	19,912.00
HUDSON CITY BANCORP INC	2,300	9.30	21,390.00
KEYCORP	4,800	12.60	60,480.00
M & T BANK CORP	500	114.80	57,400.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	2,200	15.82	34,804.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	2,000	14.37	28,740.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,500	75.04	187,600.00
REGIONS FINANCIAL CORP	7,317	10.11	73,974.87
SUNTRUST BANKS INC	2,600	34.67	90,142.00
US BANCORP	8,700	37.92	329,904.00
WELLS FARGO & COMPANY	23,788	42.68	1,015,271.84
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	200	198.55	39,710.00
AMERICAN EXPRESS CO	4,700	80.52	378,444.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,040	99.75	103,740.00
BANK OF AMERICA CORP	50,998	14.63	746,100.74
BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	5,707	31.48	179,656.36
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	5,100	116.97	596,547.00
BLACKROCK INC	600	301.66	180,996.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,900	71.60	207,640.00
CITIGROUP INC	14,420	51.15	737,583.00
CME GROUP INC	1,455	76.85	111,816.75
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,400	53.95	129,480.00
EATON VANCE CORPORATION	700	40.16	28,112.00
FRANKLIN RESOURCES INC	2,100	53.85	113,085.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,100	158.69	333,249.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	300	198.22	59,466.00
INVESCO LIMITED	2,180	32.77	71,438.60
JPMORGAN CHASE & CO	17,900	54.30	971,970.00
LEGG MASON INC	700	36.75	25,725.00
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,400	28.70	40,180.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	1,300	68.93	89,609.00
MOODY'S CORP	1,000	73.21	73,210.00
MORGAN STANLEY	7,000	29.69	207,830.00
NASDAQ OMX GROUP INC	600	34.15	20,490.00
NORTHERN TRUST CORP	1,200	56.52	67,824.00
NYSE EURONEXT	1,100	45.00	49,500.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	600	43.92	26,352.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	800	32.27	25,816.00

SLM CORPORATION	2,200	25.79	56,738.00
STATE STREET CORP	2,162	69.77	150,842.74
T ROWE PRICE GROUP INC	1,200	76.84	92,208.00
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	1,200	28.67	34,404.00
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	5,600	23.77	133,112.00
ACE LIMITED	1,600	96.97	155,152.00
AFLAC INC	2,300	65.78	151,294.00
ALLEGHANY CORPORATION	100	408.82	40,882.00
ALLSTATE CORP	2,300	53.87	123,901.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	6,575	52.30	343,872.50
AON PLC	1,400	75.39	105,546.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	700	56.95	39,865.00
ASSURANT INC	400	59.33	23,732.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	600	46.78	28,068.00
CHUBB CORP	1,200	92.71	111,252.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	700	49.99	34,993.00
EVEREST RE GROUP LTD	200	152.96	30,592.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-A	1,100	26.37	29,007.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	2,100	34.00	71,400.00
LINCOLN NATIONAL CORP	1,400	45.46	63,644.00
LOEWS CORPORATION	1,600	49.07	78,512.00
MARSH & MCLENNAN COS	2,600	45.53	118,378.00
METLIFE INC	4,500	49.45	222,525.00
PARTNERRE LTD	200	94.95	18,990.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,500	46.36	69,540.00
PROGRESSIVE CORP	2,700	27.14	73,278.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,200	82.53	181,566.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	200	92.89	18,578.00
TORCHMARK CORPORATION	350	75.02	26,257.00
TRAVELERS COS INC/THE	1,800	86.58	155,844.00
UNUM GROUP	1,400	31.92	44,688.00
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	900	45.09	40,581.00
WR BERKLEY CORP	500	44.40	22,200.00
XL GROUP PLC	1,400	32.08	44,912.00
CBRE GROUP INC	1,400	22.87	32,018.00
REALOGY HOLDINGS CORPORATION	600	43.33	25,998.00
ACCENTURE PLC	3,100	72.88	225,928.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,300	17.59	40,457.00
ADOBE SYSTEMS INC	2,400	52.63	126,312.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	800	52.15	41,720.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	200	231.08	46,216.00
ANSYS INC	400	86.38	34,552.00

AUTODESK INC	1,100	40.28	44,308.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2,300	74.20	170,660.00
CA INC	1,600	30.10	48,160.00
CITRIX SYSTEMS INC	900	57.33	51,597.00
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	1,400	85.79	120,106.00
COMPUTER SCIENCES CORP	800	52.55	42,040.00
EBAY INC	5,500	52.18	286,990.00
ELECTRONIC ARTS INC	1,500	25.03	37,545.00
EQUINIX INC	200	166.84	33,368.00
FACEBOOK INC-A	7,900	54.22	428,338.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,480	47.36	70,092.80
FISERV INC	600	104.69	62,814.00
GOOGLE INC-CL A	1,300	1,011.65	1,315,145.00
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	5,000	173.78	868,900.00
INTUIT INC	1,400	68.75	96,250.00
LEIDOS HOLDINGS INC	375	46.78	17,542.50
LINKEDIN CORPORATION-A	500	250.21	125,105.00
MASTERCARD INC.-CLASS A	500	715.19	357,595.00
MICROSOFT CORP	37,500	34.99	1,312,125.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	1,400	17.16	24,024.00
ORACLE CORPORATION	17,800	32.90	585,620.00
PAYCHEX INC	1,600	41.64	66,624.00
RACKSPACE HOSTING INC	600	49.70	29,820.00
RED HAT INC	1,000	43.29	43,290.00
SALESFORCE COM INC	2,600	54.10	140,660.00
SCIENCE APPLICATIONS INTERNATIONAL CORP	214	33.56	7,181.84
SYMANTEC CORP	3,300	25.39	83,787.00
SYNOPSYS INC	700	38.19	26,733.00
TERADATA CORPORATION	800	42.64	34,112.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,000	30.32	30,320.00
VERISIGN INC	700	53.08	37,156.00
VISA INC-CLASS A SHARES	2,400	200.45	481,080.00
VMWARE INC-CLASS A	400	81.43	32,572.00
WESTERN UNION COMPANY	2,800	18.66	52,248.00
YAHOO! INC	4,600	33.45	153,870.00
AMPHENOL CORPORATION-CL A	800	82.33	65,864.00
APPLE INC	4,400	508.95	2,239,380.00
ARROW ELECTRONICS INC	500	49.84	24,920.00
AVNET INC	600	41.97	25,182.00
CISCO SYSTEMS INC	25,300	22.98	581,394.00
CORNING INC	7,200	15.00	108,000.00
DELL INC	7,600	13.83	105,108.00

EMC CORP/MASSACHUSETTS	9,900	25.08	248,292.00
F5 NETWORKS INC	400	87.81	35,124.00
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	3,200	9.21	29,472.00
FLIR SYSTEMS INC	800	29.43	23,544.00
HARRIS CORPORATION	500	59.50	29,750.00
HEWLETT-PACKARD COMPANY	9,200	23.48	216,016.00
JUNIPER NETWORKS INC	2,500	20.82	52,050.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,271	60.81	77,289.51
NETAPP INC	1,700	41.37	70,329.00
QUALCOMM INC	8,200	68.44	561,208.00
SANDISK CORP	1,300	68.73	89,349.00
SEAGATE TECHNOLOGY	1,600	50.04	80,064.00
TE CONNECTIVITY LIMITED	1,950	53.57	104,461.50
TRIMBLE NAVIGATION LIMITED	1,300	30.11	39,143.00
WESTERN DIGITAL CORPORATION	1,100	71.77	78,947.00
XEROX CORP	5,841	10.91	63,725.31
AT&T INC	25,419	34.61	879,751.59
CENTURYLINK INC	2,926	33.01	96,587.26
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	1,400	75.96	106,344.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	5,632	4.47	25,175.04
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	900	28.05	25,245.00
SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	600	84.69	50,814.00
SPRINT CORPORATION	4,800	6.40	30,720.00
T-MOBILE US INC	850	27.69	23,536.50
VERIZON COMMUNICATIONS INC	13,500	50.01	675,135.00
WINDSTREAM HOLDINGS INC	3,600	8.60	30,960.00
AES CORP	3,300	14.21	46,893.00
ALLIANT ENERGY CORP	600	51.19	30,714.00
AMEREN CORPORATION	1,300	35.88	46,644.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	2,300	44.82	103,086.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	800	41.73	33,384.00
CALPINE CORPORATION	1,700	19.95	33,915.00
CENTERPOINT ENERGY INC	2,100	24.60	51,660.00
CMS ENERGY CORPORATION	1,400	27.32	38,248.00
CONSOLIDATED EDISON INC	1,500	56.86	85,290.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	2,700	63.68	171,936.00
DTE ENERGY COMPANY	800	67.21	53,768.00
DUKE ENERGY CORPORATION	3,297	70.08	231,053.76
EDISON INTERNATIONAL	1,500	48.38	72,570.00
ENERGY CORP	900	66.35	59,715.00
EXELON CORP	4,202	28.75	120,807.50
FIRSTENERGY CORP	2,067	37.94	78,421.98

INTEGRYS ENERGY GROUP INC	400	57.39	22,956.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	800	29.65	23,720.00	
NEXTERA ENERGY INC	2,000	83.54	167,080.00	
NISOURCE INC	1,600	31.68	50,688.00	
NORTHEAST UTILITIES	1,518	42.34	64,272.12	
NRG ENERGY INC	1,600	29.30	46,880.00	
OGE ENERGY CORPORATION	1,000	36.37	36,370.00	
ONEOK INC	1,000	54.96	54,960.00	
P G & E CORPORATION	2,200	41.22	90,684.00	
PEPCO HOLDINGS INC	1,300	18.98	24,674.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	600	56.93	34,158.00	
PPL CORPORATION	3,000	30.30	90,900.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	2,600	33.91	88,166.00	
SCANA CORPORATION	600	46.58	27,948.00	
SEMPRA ENERGY	1,100	90.43	99,473.00	
SOUTHERN CO	4,100	41.94	171,954.00	
WISCONSIN ENERGY CORPORATION	1,200	41.71	50,052.00	
XCEL ENERGY INC	2,500	28.60	71,500.00	
ALTERA CORPORATION	1,600	37.48	59,968.00	
ANALOG DEVICES INC	1,500	47.66	71,490.00	
APPLIED MATERIALS INC	5,900	18.05	106,495.00	
AVAGO TECHNOLOGIES LIMITED	1,200	46.06	55,272.00	
BROADCOM CORP-CL A	2,600	27.16	70,616.00	
CREE INC	600	73.86	44,316.00	
INTEL CORP	23,500	23.87	560,945.00	
KLA-TENCOR CORPORATION	800	64.46	51,568.00	
LAM RESEARCH CORP	900	53.85	48,465.00	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	1,100	39.27	43,197.00	
LSI CORPORATION	2,700	7.99	21,573.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,900	11.75	22,325.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	1,600	29.97	47,952.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	900	40.30	36,270.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	5,300	17.03	90,259.00	
NVIDIA CORP	2,700	15.81	42,687.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	5,200	40.72	211,744.00	
XILINX INC	1,300	45.50	59,150.00	
米ドル 建小計	1,456,874		76,436,568.85 (7,495,369,941)	
カナダドル				
ALTAGAS LIMITED	600	35.69	21,414.00	
ARC RESOURCES LIMITED	1,600	27.34	43,744.00	
ATHABASCA OIL CORPORATION	2,000	6.27	12,540.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	700	43.83	30,681.00	

BONAVISTA ENERGY CORP	1,000	12.80	12,800.00
CAMECO CORP (CA)	2,000	18.87	37,740.00
CANADIAN NATURAL RESOURCES	5,400	33.78	182,412.00
CANADIAN OIL SANDS LIMITED	2,300	20.59	47,357.00
CENOVUS ENERGY INC	3,800	31.04	117,952.00
CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,800	40.17	72,306.00
ENBRIDGE INC	3,700	43.43	160,691.00
ENCANA CORP	3,800	18.42	69,996.00
ENERPLUS CORP	1,200	17.79	21,348.00
HUSKY ENERGY INC	1,600	29.85	47,760.00
IMPERIAL OIL LTD	1,500	46.25	69,375.00
KEYERA CORP	400	58.14	23,256.00
MEG ENERGY CORPORATION	800	35.31	28,248.00
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	1,700	22.79	38,743.00
PEMBINA PIPELINE CORPORATION	1,500	33.68	50,520.00
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	2,500	6.63	16,575.00
PENN WEST PETROLEUM LIMITED	2,500	11.94	29,850.00
PEYTO EXPLORATION & DEVELOPMENT CORP	700	31.15	21,805.00
SUNCOR ENERGY INC	7,148	37.73	269,694.04
TALISMAN ENERGY INC	5,100	12.53	63,903.00
TOURMALINE OIL CORPORATION	800	39.91	31,928.00
TRANSCANADA CORPORATION	3,300	46.02	151,866.00
VERMILION ENERGY INC	500	57.89	28,945.00
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	1,000	25.66	25,660.00
AGRIUM INC	700	89.29	62,503.00
BARRICK GOLD CORP	4,700	19.07	89,629.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	3,500	6.27	21,945.00
FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	2,500	18.99	47,475.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	800	44.14	35,312.00
GOLDCORP INC	3,807	25.05	95,365.35
KINROSS GOLD CORP	6,356	5.01	31,843.56
NEW GOLD INC	2,400	6.00	14,400.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	4,100	33.11	135,751.00
SILVER WHEATON CORPORATION	1,800	23.73	42,714.00
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	2,745	28.26	77,573.70
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	1,800	4.59	8,262.00
YAMANA GOLD INC	3,600	9.65	34,740.00
BOMBARDIER INC 'B'	8,300	5.08	42,164.00
CAE INC	1,700	11.20	19,040.00
FINNING INTERNATIONAL INC	900	24.52	22,068.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	800	42.59	34,072.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,000	109.84	219,680.00

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	800	135.37	108,296.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,100	88.81	97,691.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	600	48.56	29,136.00
TIM HORTONS INC(CA)	800	61.28	49,024.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	2,000	24.95	49,900.00
THOMSON REUTERS CORP(CA)	1,900	36.01	68,419.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	400	94.65	37,860.00
DOLLARAMA INC	300	86.72	26,016.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	700	69.50	48,650.00
EMPIRE COMPANY LIMITED A	100	75.29	7,529.00
GEORGE WESTON LIMITED	200	84.41	16,882.00
LOBLAW COMPANIES LTD	500	47.50	23,750.00
METRO INC	500	66.44	33,220.00
SHOPPERS DRUG MART CORP	1,000	60.84	60,840.00
SAPUTO INC	600	51.61	30,966.00
CATAMARAN CORPORATION	1,000	51.48	51,480.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	1,500	116.25	174,375.00
BANK OF MONTREAL	3,200	71.76	229,632.00
BANK OF NOVA SCOTIA	5,800	61.56	357,048.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,900	83.98	159,562.00
NATIONAL BANK OF CANADA	800	87.25	69,800.00
ROYAL BANK OF CANADA	6,800	69.53	472,804.00
TORONTO-DOMINION BANK(CA)	4,438	93.00	412,734.00
CI FINANCIAL CORPORATION	900	33.14	29,826.00
IGM FINANCIAL INC	500	48.95	24,475.00
ONEX CORPORATION	400	54.04	21,616.00
GREAT-WEST LIFECO INC	1,400	30.76	43,064.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	500	46.29	23,145.00
INTACT FINANCIAL CORPORATION	600	64.57	38,742.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	8,900	18.00	160,200.00
POWER CORP OF CANADA	1,800	29.18	52,524.00
POWER FINANCIAL CORP	1,200	32.90	39,480.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	2,900	34.23	99,267.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,675	41.14	110,049.50
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	1,350	19.59	26,446.50
FIRST CAPITAL REALTY INC	500	17.70	8,850.00
CGI GROUP INC -CL A	1,100	37.08	40,788.00
OPEN TEXT CORPORATION	300	77.09	23,127.00
BLACKBERRY LIMITED	2,400	8.64	20,736.00
BCE INC	1,200	45.01	54,012.00
BELL ALIANT INC	500	26.88	13,440.00

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,800	46.39	83,502.00	
	TELUS CORPORATION	1,200	35.29	42,348.00	
	ATCO LIMITED	400	47.14	18,856.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	600	36.86	22,116.00	
	FORTIS INC	1,000	32.01	32,010.00	
	TRANSALTA CORP	1,600	13.96	22,336.00	
	カナダドル 建小計	186,119		6,430,216.65 (612,542,438)	
ユーロ	CGG	978	16.35	15,990.30	
	ENI SPA	12,027	17.77	213,719.79	
	FUGRO NV-CVA	345	44.57	15,378.37	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,322	12.67	16,749.74	
	KONINKLIJKE VOPAK NV	427	43.88	18,736.76	
	NESTE OIL OYJ	628	15.27	9,589.56	
	OMV AG	832	34.81	28,966.08	
	REPSOL SA	4,309	19.37	83,465.33	
	SAIPEM	1,497	15.53	23,248.41	
	TECHNIP S.A.	508	87.67	44,536.36	
	TENARIS SA	2,441	17.37	42,400.17	
	TOTAL SA	10,113	44.79	453,011.83	
	AIR LIQUIDE SA	1,474	101.70	149,905.80	
	AKZO NOBEL	1,231	48.42	59,611.17	
	ARCELORMITTAL	4,995	11.70	58,441.50	
	ARKEMA	308	85.00	26,180.00	
	BASF SE	4,342	73.51	319,180.42	
	CRH PLC(IE)	3,448	18.12	62,477.76	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	177	61.73	10,926.21	
	HEIDELBERGCEMENT AG	727	58.00	42,166.00	
	IMERYS SA	247	54.29	13,409.63	
	K+S AG	943	18.75	17,681.25	
	KONINKLIJKE DSM NV	771	53.99	41,626.29	
	LAFARGE SA	965	50.40	48,636.00	
	LANXESS AG	430	50.95	21,908.50	
	LINDE AG	907	142.10	128,884.70	
	SOLVAY SA	296	116.00	34,336.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	3,115	6.89	21,477.92	
	THYSSENKRUPP AG	1,890	18.94	35,806.05	
	UMICORE	644	35.95	23,155.02	
	UPM-KYMMENE OYJ	2,579	11.01	28,394.79	
	VOESTALPINE AG	549	35.42	19,445.58	
	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	708	24.85	17,593.80	

ALSTOM	1,195	26.50	31,667.50
ANDRITZ AG	376	43.23	16,254.48
BOSKALIS WESTMINSTER NV	485	33.91	16,448.77
BOUYGUES SA	905	29.45	26,656.77
BRENTAG AG	266	120.85	32,146.10
CNH INDUSTRIAL NV	4,424	8.93	39,528.44
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,991	37.87	75,409.12
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE & SPACE CO	2,751	48.96	134,688.96
FERROVIAL SA	2,017	13.69	27,622.81
FINMECCANICA SPA	2,733	5.73	15,660.09
GEA GROUP AG	896	31.98	28,654.08
HOCHTIEF AG	174	64.98	11,306.52
KONE OYJ-B	778	66.30	51,581.40
KONINKLIJKE PHILIPS NV	4,688	24.42	114,504.40
LEGRAND SA	1,225	40.79	49,967.75
MAN SE	176	88.49	15,574.24
METSO OYJ	776	27.88	21,634.88
OCI NV	445	26.65	11,859.25
OSRAM LICHT AG	396	35.91	14,222.34
PRYSMIAN SPA	1,151	18.33	21,097.83
REXEL SA	1,041	18.50	19,263.70
SAFRAN SA	1,296	45.66	59,181.84
SCHNEIDER ELECTRIC SA	2,495	62.20	155,189.00
SIEMENS AG-REG	3,749	90.92	340,859.08
THALES SA	471	43.86	20,658.06
VALLOUREC SA	520	43.21	22,471.80
VINCI SA	2,271	46.78	106,248.73
WARTSILA OYJ-B SHARES	867	31.55	27,353.85
ZARDOYA OTIS SA	1,200	12.37	14,844.00
ZODIAC AEROSPACE	167	118.75	19,831.25
BUREAU VERITAS SA	1,082	21.78	23,571.37
EDENRED	958	24.62	23,590.75
RANDSTAD HOLDING NV	602	41.85	25,193.70
SOCIETE BIC SA	174	85.08	14,803.92
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,895	15.90	30,130.50
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	145	79.44	11,518.80
ATLANTIA SPA	1,710	16.23	27,753.30
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,189	14.83	17,638.81
DEUTSCHE POST AG-REG	4,441	24.02	106,672.82
FRAPORT AG	208	56.02	11,652.16
GROUPE EUROTUNNEL SA	3,168	7.09	22,489.63
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	4,795	4.24	20,335.59

TNT EXPRESS NV	1,979	6.60	13,079.21
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,622	82.03	133,052.66
BMW-PFD	317	62.10	19,685.70
CONTINENTAL AG	539	136.35	73,492.65
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	4,548	58.30	265,148.40
FIAT SPA	4,524	6.08	27,505.92
MICHELIN (CGDE)-B	863	80.74	69,678.62
NOKIAN RENKAAT OYJ	580	35.52	20,601.60
PIRELLI & C SPA	1,444	10.20	14,728.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	791	63.96	50,592.36
RENAULT SA	994	68.39	67,979.66
VOLKSWAGEN AG	167	171.20	28,590.40
VOLKSWAGEN AG-PFD	708	176.50	124,962.00
ADIDAS AG	1,025	83.70	85,792.50
CHRISTIAN DIOR SA	273	145.05	39,598.65
HUGO BOSS AG-ORD	134	95.51	12,798.34
KERING	358	172.10	61,611.80
LUXOTTICA GROUP SPA	851	38.67	32,908.17
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	1,200	141.00	169,200.00
ACCOR SA	835	33.61	28,064.35
OPAP SA	1,094	10.00	10,940.00
SODEXO	462	72.40	33,448.80
AXEL SPRINGER AG	194	44.75	8,682.47
EUTELSAT COMMUNICATIONS	687	22.10	15,182.70
JC DECAUX SA	326	28.79	9,385.54
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	105	91.50	9,607.50
LAGARDERE S.C.A.	717	25.95	18,606.15
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	587	33.88	19,887.56
PUBLICIS GROUPE	892	59.53	53,100.76
REED ELSEVIER NV(NL)	3,560	14.84	52,848.20
SES	1,663	21.13	35,147.50
TELENET GROUP HOLDING NV	366	39.15	14,328.90
WOLTERS KLUWER NV-CVA	1,560	20.11	31,379.40
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	1,069	118.35	126,516.15
CARREFOUR SA	2,850	27.36	77,990.25
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	276	84.85	23,418.60
COLRUYT SA	392	41.85	16,405.20
DELHAIZE GROUP	576	45.31	26,098.56
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	3,160	6.95	21,965.16
JERONIMO MARTINS SGPS SA	1,138	14.60	16,614.80
KESKO OYJ-B SHS	359	22.06	7,919.54

KONINKLIJKE AHOLD NV	5,038	13.58	68,416.04
METRO AG	733	34.50	25,288.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	3,799	74.98	284,849.02
DANONE	2,703	53.57	144,799.71
HEINEKEN HOLDING NV	494	47.95	23,689.77
HEINEKEN NV	1,089	52.64	57,324.96
KERRY GROUP PLC-A	772	45.46	35,095.12
PERNOD-RICARD SA	1,040	89.26	92,830.40
REMY COINTREAU SA	144	74.75	10,764.00
SUEDZUCKER AG	402	23.02	9,256.05
UNILEVER NV-CVA	7,702	28.87	222,356.74
BEIERSDORF AG	521	69.61	36,266.81
HENKEL AG & CO KGAA	671	65.42	43,896.82
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	842	75.72	63,756.24
L'OREAL	1,143	127.50	145,732.50
CELESIO AG	440	20.28	8,923.20
ESSILOR INTERNATIONAL SA	964	79.32	76,464.48
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	1,093	48.52	53,032.36
FRESENIUS SE & CO KGAA	644	93.70	60,342.80
BAYER AG	3,910	90.49	353,815.90
ELAN CORPORATION PLC	2,611	11.83	30,888.13
GRIFOLS SA	731	29.05	21,235.55
MERCK KGAA	334	119.00	39,746.00
ORION OYJ-CLASS B	501	18.68	9,358.68
QIAGEN NV	1,222	15.35	18,757.70
SANOFI	5,634	73.26	412,746.84
UCB SA	569	46.76	26,606.44
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	31,043	0.23	7,217.49
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	26,156	9.33	244,061.63
BANCO DE SABADELL SA	14,697	1.88	27,630.36
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	12,234	0.99	12,136.12
BANCO POPULAR ESPANOL SA	6,483	4.00	25,970.89
BANCO SANTANDER SA	52,655	6.77	356,684.97
BANK OF IRELAND	105,431	0.26	27,622.92
BANKIA SA	20,149	1.09	22,083.30
BNP PARIBAS	4,699	54.30	255,155.70
CAIXABANK	5,828	3.79	22,099.77
COMMERZBANK AG	4,836	9.85	47,673.28
CREDIT AGRICOLE SA	4,994	9.14	45,650.15
ERSTE GROUP BANK AG	1,311	24.66	32,335.81
INTESA SANPAOLO	54,967	1.81	99,765.10
KBC GROEP NV	1,146	39.36	45,106.56

NATIXIS SA	4,535	3.95	17,913.25
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	315	25.50	8,034.07
SOCIETE GENERALE	3,440	42.48	146,131.20
UNICREDIT SPA	20,939	5.62	117,677.18
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	4,196	5.03	21,126.86
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,820	37.09	178,773.80
DEUTSCHE BOERSE AG	998	58.46	58,343.08
EURAZEO	153	54.20	8,292.60
EXOR SPA	362	29.68	10,744.16
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	395	65.00	25,675.00
ING GROEP NV-CVA	18,112	9.45	171,158.40
MEDIOBANCA SPA	2,531	6.35	16,084.50
POHJOLA BANK PLC	716	12.90	9,236.40
WENDEL	158	101.80	16,084.40
AEGON NV	9,174	5.98	54,860.52
AGEAS	1,131	32.18	36,395.58
ALLIANZ SE-REG	2,156	123.30	265,834.80
ASSICURAZIONI GENERALI	5,719	17.05	97,508.95
AXA	8,775	18.83	165,233.25
CNP ASSURANCES	1,009	13.62	13,742.58
DELTA LLOYD NV	611	15.62	9,543.82
HANNOVER RUECK SE	312	57.24	17,858.88
MAPFRE SA	5,115	2.96	15,150.63
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	878	146.25	128,407.50
SAMPO OYJ-A SHS	1,981	35.53	70,384.93
SCOR SE	752	24.91	18,736.08
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG	198	40.76	8,070.48
IMMOFINANZ AG	4,809	3.30	15,903.36
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	1,771	26.39	46,745.54
ATOS	284	59.45	16,883.80
CAP GEMINI SA	719	48.06	34,555.14
DASSAULT SYSTEMES SA	311	85.94	26,727.34
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
SAP AG	4,356	53.51	233,089.56
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	604	29.88	18,050.54
GEMALTO NV	409	85.12	34,814.08
NOKIA OYJ	17,706	5.27	93,310.62
BELGACOM SA	923	22.04	20,347.53
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	13,758	11.67	160,624.65
ELISA OYJ	696	18.62	12,959.52
HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,225	9.08	11,123.00

	ILIAD SA	113	169.85	19,193.05
	KONINKLIJKE KPN NV	16,100	2.23	36,031.80
	ORANGE	8,767	10.41	91,308.30
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	3,244	3.66	11,892.50
	TELECOM ITALIA SPA	53,084	0.74	39,733.37
	TELECOM ITALIA-RSP	34,061	0.58	19,755.38
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,396	5.84	8,163.80
	TELEFONICA SA	19,365	13.03	252,325.95
	TELEKOM AUSTRIA AG	1,383	6.32	8,743.32
	VIVENDI	5,638	19.32	108,954.35
	ZIGGO NV	731	30.99	22,657.34
	ACCIONA SA	173	44.47	7,694.17
	E.ON SE	8,821	13.64	120,362.54
	ELECTRICITE DE FRANCE	1,242	25.70	31,919.40
	ENAGAS SA	955	19.17	18,307.35
	ENEL GREEN POWER SPA	8,572	1.71	14,683.83
	ENEL SPA	31,121	3.24	100,832.04
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	9,865	2.67	26,408.60
	FORTUM OYJ	2,100	16.81	35,301.00
	GAS NATURAL SDG SA	1,980	17.38	34,412.40
	GDF SUEZ	6,500	18.56	120,640.00
	IBERDROLA SA	22,463	4.60	103,442.11
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	530	45.89	24,324.35
	RWE AG	2,314	27.20	62,940.80
	RWE AG-NON VTG PFD	362	25.41	9,200.23
	SNAM SPA	8,740	3.87	33,858.76
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	1,586	12.55	19,912.23
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	8,169	3.55	28,999.95
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,918	13.47	25,835.46
	VERBUND AG	511	17.71	9,052.36
	ASML HOLDING NV	1,690	67.40	113,906.00
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	5,293	7.21	38,204.87
	STMICROELECTRONICS NV	3,603	6.33	22,817.79
	ユーロ 建小計	995,067		13,694,708.80 (1,836,597,397)
英債券	AMEC PLC	1,485	11.04	16,394.40
	BG GROUP PLC	16,092	12.33	198,414.36
	BP PLC	89,773	4.47	401,689.28
	PETROFAC LIMITED	1,271	14.15	17,984.65
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	17,956	20.67	371,240.30
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	12,099	21.64	261,882.85
	TULLOW OIL PLC	4,691	9.89	46,393.99

ANGLO AMERICAN PLC	6,824	15.32	104,543.68
ANTOFAGASTA PLC	2,283	8.99	20,524.17
BHP BILLITON PLC(UK)	9,986	18.61	185,889.39
CRODA INTERNATIONAL PLC	699	25.38	17,740.62
FRESNILLO PLC	1,218	9.88	12,039.93
GLENCORE XSTRATA PLC	50,166	3.34	168,005.93
JOHNSON MATTHEY PLC	1,004	29.73	29,848.92
RANDGOLD RESOURCES LIMITED	452	44.63	20,172.76
REXAM PLC	3,874	4.92	19,071.70
RIO TINTO PLC(UK)	6,010	32.20	193,522.00
VEDANTA RESOURCES PLC	457	10.39	4,748.23
BAE SYSTEMS PLC	15,908	4.44	70,774.69
BUNZL PLC	1,817	13.57	24,656.69
COBHAM PLC	5,575	2.80	15,626.72
IMI PLC	1,662	15.37	25,544.94
INVENSYS PLC	3,679	5.01	18,431.79
MEGGITT PLC	3,845	5.45	20,974.47
MELROSE INDUSTRIES PLC	6,204	3.06	19,021.46
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	9,209	10.92	100,562.28
SMITHS GROUP PLC	2,032	14.02	28,488.64
THE WEIR GROUP PLC	1,098	22.93	25,177.14
TRAVIS PERKINS PLC	1,224	17.91	21,921.84
WOLSELEY PLC	1,416	32.60	46,161.60
AGGREKO PLC	1,387	14.54	20,166.98
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	1,862	12.07	22,474.34
CAPITA PLC	3,210	9.61	30,848.10
EXPERIAN PLC	4,773	12.00	57,276.00
G4S PLC	7,292	2.42	17,646.64
INTERTEK GROUP PLC	788	32.32	25,468.16
SERCO GROUP PLC	3,025	5.28	15,987.12
GKN PLC	7,997	3.70	29,644.87
BURBERRY GROUP PLC	2,284	15.27	34,876.68
PERSIMMON PLC	1,514	12.30	18,622.20
CARNIVAL PLC(UK)	1,031	20.92	21,568.52
COMPASS GROUP PLC	8,963	8.86	79,456.99
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,391	18.56	25,816.96
TUI TRAVEL PLC	2,190	3.79	8,302.29
WHITBREAD PLC	878	33.51	29,421.78
WILLIAM HILL PLC	4,313	4.03	17,402.95
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	4,901	9.28	45,481.28
ITV PLC	19,207	1.95	37,472.85
PEARSON PLC	3,865	13.36	51,636.40

REED ELSEVIER PLC(UK)	5,615	8.53	47,924.02
WPP PLC	6,193	12.86	79,641.98
KINGFISHER PLC	11,858	3.85	45,677.01
MARKS & SPENCER GROUP PLC	8,312	4.95	41,152.71
NEXT PLC	790	51.60	40,764.00
SAINSBURY (J) PLC	6,344	3.95	25,058.80
TESCO PLC	38,199	3.69	141,011.60
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	11,587	2.82	32,733.27
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,841	20.62	37,961.42
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	9,069	33.22	301,272.18
COCA-COLA HBC AG-CDI	1,139	17.61	20,057.79
DIAGEO PLC	11,868	19.89	236,113.86
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	4,605	22.79	104,947.95
SABMILLER PLC	4,546	31.58	143,562.68
TATE & LYLE PLC	2,284	7.71	17,621.06
UNILEVER PLC	6,068	24.66	149,636.88
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3,058	45.02	137,671.16
SMITH & NEPHEW PLC	4,433	7.88	34,932.04
ASTRAZENECA PLC	5,920	31.49	186,450.40
GLAXOSMITHKLINE PLC	23,289	15.78	367,616.86
SHIRE PLC	2,730	25.37	69,260.10
BARCLAYS PLC	72,231	2.77	200,693.83
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	88,063	6.79	597,947.77
LLOYDS BANKING GROUP PLC	218,557	0.76	167,196.10
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	10,982	3.72	40,929.91
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	11,445	14.90	170,587.72
3I GROUP PLC	5,021	3.70	18,577.70
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	5,546	4.15	23,015.90
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,045	11.37	11,881.65
ICAP PLC	2,839	3.73	10,615.02
INVESTEC PLC	3,511	4.30	15,118.36
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	911	16.50	15,031.50
SCHRODERS PLC	508	26.16	13,289.28
ADMIRAL GROUP PLC	1,060	12.08	12,804.80
AVIVA PLC	13,932	4.41	61,537.64
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	4,124	2.18	9,015.06
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	27,964	2.07	57,969.37
OLD MUTUAL PLC	25,290	2.00	50,706.45
PRUDENTIAL PLC	12,100	12.64	152,944.00
RESOLUTION LIMITED	6,946	3.46	24,081.78
RSA INSURANCE GROUP PLC	20,077	1.21	24,293.17
STANDARD LIFE PLC	12,188	3.59	43,828.04

	SAGE GROUP PLC (THE)	5,959	3.29	19,622.98
	BT GROUP PLC	37,259	3.65	136,032.60
	INMARSAT PLC	2,315	7.27	16,830.05
	VODAFONE GROUP PLC	230,140	2.27	524,028.78
	CENTRICA PLC	25,456	3.62	92,328.91
	NATIONAL GRID PLC	17,340	7.60	131,870.70
	SEVERN TRENT PLC	1,232	18.28	22,520.96
	SSE PLC	4,694	14.51	68,109.94
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	3,525	7.10	25,027.50
	ARM HOLDINGS PLC	6,608	10.14	67,005.12
	英ボンド 建小計	1,409,496		8,183,530.89 (1,296,925,975)
スイスフラン	TRANSOCEAN LIMITED(CHF)	1,797	41.50	74,575.50
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	50	331.50	16,575.00
	GIVAUDAN-REG	43	1,260.00	54,180.00
	HOLCIM LTD-REG	1,082	65.25	70,600.50
	SIKA AG-BR	11	2,660.00	29,260.00
	SYNGENTA AG(CH)	456	359.50	163,932.00
	ABB LIMITED-REG	10,397	21.30	221,456.10
	GEBERIT AG-REG	191	243.50	46,508.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	131	128.00	16,768.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	251	127.30	31,952.30
	SULZER AG-REG	124	135.70	16,826.80
	ADECCO SA-REG	649	66.00	42,834.00
	SGS SA-REG	28	2,099.00	58,772.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	279	111.60	31,136.40
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	2,468	93.10	229,770.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	245	101.90	24,965.50
	THE SWATCH GROUP AG-B	146	581.00	84,826.00
	ARYZTA AG	493	65.35	32,217.55
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	14	916.00	12,824.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	5	3,850.00	19,250.00
	NESTLE SA-REGISTERED	15,246	64.80	987,940.80
	SONOVA HOLDING AG-REG	259	114.90	29,759.10
	ACTELION LTD-REG	528	64.60	34,108.80
	LONZA GROUP AG-REG	274	76.60	20,988.40
	NOVARTIS AG-REG SHS	10,875	67.60	735,150.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,322	242.10	804,256.20
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	19	495.00	9,405.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	7,084	30.00	212,520.00
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	1,058	44.44	47,017.52
	PARGESA HOLDING SA-BR	140	70.40	9,856.00

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	101	226.90	22,916.90
	UBS AG-REGISTERED	17,234	19.09	328,997.06
	BALOISE HOLDING AG-REG	246	108.10	26,592.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	158	180.50	28,519.00
	SWISS RE LIMITED	1,725	78.10	134,722.50
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	726	241.90	175,619.40
	SWISS PRIME SITE AG-REG	316	70.50	22,278.00
	SWISSCOM AG-REG	114	465.50	53,067.00
	スイスフラン 建小計	78,285		4,962,945.23 (538,826,963)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,351	136.80	184,816.80
	BOLIDEN AB	1,414	92.05	130,158.70
	ALFA LAVAL AB	1,572	152.90	240,358.80
	ASSA ABLOY AB-B	1,636	296.60	485,237.60
	ATLAS COPCO AB-A SHS	3,357	188.60	633,130.20
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,845	170.60	314,757.00
	SANDVIK AB	5,187	88.30	458,012.10
	SCANIA AB-B SHS	1,600	136.80	218,880.00
	SKANSKA AB-B SHS	1,964	124.10	243,732.40
	SKF AB-B SHARES	1,920	173.70	333,504.00
	VOLVO AB-B SHS	7,368	93.75	690,750.00
	SECURITAS AB-B SHS	1,534	74.05	113,592.70
	ELECTROLUX AB-SER B	1,202	170.40	204,820.80
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,282	43.00	98,126.00
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	4,650	276.70	1,286,655.00
	SWEDISH MATCH AB	1,065	220.40	234,726.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	2,855	173.50	495,342.50
	ELEKTA AB-B SHS	1,905	102.30	194,881.50
	GETINGE AB-B SHS	980	205.90	201,782.00
	NORDEA BANK AB	13,908	81.50	1,133,502.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	7,721	74.80	577,530.80
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	2,358	285.10	672,265.80
	SWEDBANK AB-A SHARES	4,527	161.20	729,752.40
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	903	119.20	107,637.60
	INVESTOR AB-B SHS	2,354	209.20	492,456.80
	KINNEVIK INVESTMENT AB	1,008	234.50	236,376.00
RATOS AB-B SHS	1,301	58.50	76,108.50	
ERICSSON LM-B SHS	14,388	84.45	1,215,066.60	
HEXAGON AB-B SHS	1,160	181.20	210,192.00	
MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	313	559.00	174,967.00	
TELE2 AB-B SHS	1,929	84.70	163,386.30	
TELIASONERA AB	11,191	52.80	590,884.80	

スウェーデンクローナ 建小計		108,748		13,143,390.70 (200,436,708)
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	998	81.20	81,037.60
	SEADRILL LIMITED	1,819	275.70	501,498.30
	STATOIL ASA	5,466	138.00	754,308.00
	SUBSEA 7 SA	1,319	128.60	169,623.40
	NORSK HYDRO ASA	5,880	25.29	148,705.20
	YARA INTERNATIONAL ASA	905	247.10	223,625.50
	ORKLA ASA	4,362	44.55	194,327.10
	DNB ASA	5,051	96.65	488,179.15
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,359	101.80	138,346.20
	TELENOR ASA	3,319	148.00	491,212.00
ノルウェークローネ 建小計		30,478		3,190,862.45 (52,904,499)
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	3	49,720.00	149,160.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	6	52,950.00	317,700.00
	DSV A/S	972	154.80	150,465.60
	CARLSBERG AS-B	553	583.50	322,675.50
	COLOPLAST A/S	644	320.10	206,144.40
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	129	519.00	66,951.00
	NOVO NORDISK A/S-B	1,883	947.00	1,783,201.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,152	208.20	239,846.40
	DANSKE BANK A/S	3,389	124.20	420,913.80
	TRYG A/S	139	520.50	72,349.50
	TDC A/S	3,613	49.84	180,071.92
デンマーククローネ 建小計		12,483		3,909,479.12 (70,292,434)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	763	18.60	14,191.80
	ORIGIN ENERGY LIMITED	5,653	14.53	82,138.09
	SANTOS LTD	4,968	14.75	73,278.00
	WHITEHAVEN COAL LIMITED	2,945	1.75	5,153.75
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	3,228	38.16	123,180.48
	WORLEYPARSONS LIMITED	1,163	22.42	26,074.46
	ALUMINA LIMITED	16,916	0.98	16,662.26
	AMCOR LTD	6,237	10.54	65,737.98
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	15,185	35.75	542,863.75
	BORAL LIMITED	5,014	4.94	24,769.16
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	8,044	5.30	42,633.20
	ILUKA RESOURCES LIMITED	2,164	9.82	21,250.48
	INCITEC PIVOT LIMITED	9,206	2.69	24,764.14
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	2,088	10.76	22,466.88
NEWCREST MINING LIMITED	3,959	10.68	42,282.12	

ORICA LTD	2,067	20.17	41,691.39
RIO TINTO LIMITED(AU)	2,134	63.45	135,402.30
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	939	17.32	16,263.48
ALS LIMITED	1,925	10.12	19,481.00
BRAMBLES LTD	7,625	9.53	72,666.25
SEEK LIMITED	1,604	12.44	19,953.76
ASCIANO LIMITED	5,042	6.03	30,403.26
AURIZON HOLDINGS LIMITED	9,390	4.65	43,663.50
QANTAS AIRWAYS LTD	5,737	1.43	8,203.91
SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	962	3.99	3,838.38
TOLL HOLDINGS LIMITED	3,221	5.73	18,456.33
TRANSURBAN GROUP	7,435	7.05	52,416.75
CROWN LTD	2,319	16.75	38,843.25
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	4,748	2.67	12,677.16
FLIGHT CENTRE LIMITED	335	51.20	17,152.00
TABCORP HOLDINGS LIMITED	4,748	3.46	16,428.08
TATTS GROUP LTD	8,275	3.11	25,735.25
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	4,511	3.20	14,435.20
METCASH LTD	5,329	3.24	17,265.96
WESFARMERS LIMITED	4,931	41.99	207,052.69
WOOLWORTHS LIMITED	6,087	33.96	206,714.52
COCA-COLA AMATIL LIMITED	2,955	12.57	37,144.35
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	3,941	4.70	18,522.70
COCHLEAR LIMITED	330	58.08	19,166.40
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	742	36.85	27,342.70
SONIC HEALTHCARE LTD	1,942	15.70	30,489.40
CSL LIMITED	2,440	68.42	166,944.80
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	12,973	31.86	413,319.78
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	2,107	10.47	22,060.29
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	7,621	74.17	565,249.57
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	11,078	35.98	398,586.44
WESTPAC BANKING CORPORATION	14,674	34.00	498,916.00
ASX LTD	1,063	35.03	37,236.89
MACQUARIE GROUP LIMITED	1,527	50.17	76,609.59
AMP LIMITED	15,147	4.67	70,736.49
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	10,746	5.85	62,864.10
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	5,982	14.59	87,277.38
SUNCORP GROUP LIMITED	6,650	13.09	87,048.50
LEND LEASE GROUP	3,076	10.73	33,005.48
COMPUTERSHARE LIMITED	2,298	10.15	23,324.70
TELSTRA CORPORATION	20,590	5.03	103,567.70
AGL ENERGY LIMITED	2,695	15.53	41,853.35

	APA GROUP	5,038	6.01	30,278.38	
	SP AUSNET	11,580	1.23	14,301.30	
	オーストラリアドル 建小計	324,092		5,012,037.26 (474,088,604)	
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	3,354	9.50	31,863.00	
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	4,786	3.30	15,793.80	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	2,982	3.94	11,749.08	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND(NZ)	11,825	2.28	26,961.00	
	CONTACT ENERGY LIMITED	2,496	5.15	12,854.40	
	ニュージーランドドル 建小計	25,443		99,221.28 (8,250,249)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS LIMITED	3,500	26.40	92,400.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	10,000	96.80	968,000.00	
	NWS HOLDINGS LIMITED	6,500	11.92	77,480.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	6,000	15.04	90,240.00	
	MTR CORPORATION	7,500	29.95	224,625.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LIMITED	1,000	43.35	43,350.00	
	LI & FUNG LIMITED	32,000	10.78	344,960.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	4,000	21.20	84,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	11,000	59.80	657,800.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	6,000	29.55	177,300.00	
	SANDS CHINA LIMITED	12,000	58.00	696,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	8,000	13.24	105,920.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	9,000	26.40	237,600.00	
	WYNN MACAU LIMITED	8,000	31.60	252,800.00	
	BANK OF EAST ASIA	6,900	32.90	227,010.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	19,000	25.30	480,700.00	
	HANG SENG BANK LTD	4,000	128.40	513,600.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	10,000	8.86	88,600.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	5,600	125.90	705,040.00	
	AIA GROUP LIMITED	57,000	40.05	2,282,850.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	7,000	124.00	868,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	11,000	25.50	280,500.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,500	46.05	207,225.00	
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	3,000	36.05	108,150.00	
	KERRY PROPERTIES LIMITED	4,000	33.65	134,600.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	22,000	10.98	241,560.00	
	SINO LAND CO	18,000	11.00	198,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	8,000	102.20	817,600.00		
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	3,000	90.65	271,950.00		
SWIRE PROPERTIES LIMITED	7,200	22.30	160,560.00		
WHARF HOLDINGS LTD	7,000	69.25	484,750.00		

	WHEELLOCK AND COMPANY LTD	4,000	39.50	158,000.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	3,500	34.10	119,350.00	
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	14,000	7.20	100,800.00	
	PCCW LIMITED	32,000	3.64	116,480.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	3,000	54.35	163,050.00	
	CLP HOLDINGS LTD	9,000	62.05	558,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	29,475	18.22	537,034.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	7,000	66.30	464,100.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	1,100	76.70	84,370.00	
	香港ドル 建小計	424,775		14,425,604.50 (182,483,896)	
シンガポールドル	KEPPEL CORPORATION LIMITED	6,900	10.87	75,003.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	22,636	0.99	22,522.82	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	6,000	5.36	32,160.00	
	SEBACORP MARINE LIMITED	5,000	4.62	23,100.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	9,000	4.20	37,800.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	14,000	1.18	16,520.00	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	10,000	1.91	19,100.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,000	10.32	30,960.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	32,000	1.47	47,040.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	8,000	4.22	33,760.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	1,000	36.81	36,810.00	
	OLAM INTERNATIONAL LIMITED	10,000	1.45	14,550.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	48,000	0.53	25,440.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	10,000	3.31	33,100.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	8,000	16.56	132,480.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	12,000	10.42	125,040.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	6,000	20.70	124,200.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	4,000	7.41	29,640.00	
	CAPITALAND LTD	13,000	3.18	41,340.00	
	CAPITAMALLS ASIA LIMITED	8,000	1.98	15,840.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	2,000	10.47	20,940.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	13,000	3.10	40,300.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	4,000	3.69	14,760.00	
	UOL GROUP LIMITED	2,000	6.46	12,920.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	39,000	3.69	143,910.00	
	STARHUB LIMITED	3,000	4.47	13,410.00	
	シンガポールドル 建小計	299,536		1,162,645.82 (92,000,163)	
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LIMITED	31	1,166.00	36,146.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	2,517	30.20	76,013.40	
	THE ISRAEL CORPORATION LIMITED	19	1,827.00	34,713.00	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	4,245	140.50	596,422.50
BANK HAPOALIM BM	6,228	18.80	117,086.40
BANK LEUMI LE-ISRAEL	6,133	13.28	81,446.24
MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	987	39.90	39,381.30
NICE SYSTEMS LIMITED	300	143.40	43,020.00
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	9,340	6.74	63,016.98
イスラエルシュケル 建小計	29,800		1,087,245.82 (30,192,816)
合 計	5,381,196		12,890,912,083 (12,890,912,083)

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

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資信託受益証券	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	27,000	20,925.00	
	投資信託受益証券 小計		27,000	20,925.00 (2,051,905)	
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORPORATION	2,000	46,980.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	1,900	150,119.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	4,700	55,789.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	618	81,971.52	
		BOSTON PROPERTIES INC	700	76,174.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	400	26,376.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	600	33,744.00	
		DUKE REALTY CORP	1,800	30,168.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,700	93,857.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	300	31,959.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	2,368	49,822.72	
		HCP INC	2,100	89,397.00	
		HEALTH CARE REIT INC	1,400	90,790.00	
		HOST HOTELS & RESORTS	3,728	69,266.24	
		KIMCO REALTY CORP	2,200	45,892.00	
		LIBERTY PROPERTY	600	22,560.00	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	800	39,056.00	
		PROLOGIS INC	2,440	97,160.80	
		PUBLIC STORAGE	700	120,512.00	
		RAYONIER INC	700	40,782.00	
REALTY INCOME CORP	900	37,674.00			
REGENCY CENTERS CORPORATION	400	20,640.00			
SIMON PROPERTY GROUP	1,489	235,276.89			
SL GREEN REALTY CORPORATION	400	37,884.00			

		THE MACERICH COMPANY	700	41,363.00	
		UDR INC	1,200	30,012.00	
		VENTAS INC	1,400	91,756.00	
		VORNADO REALTY TRUST	837	74,568.33	
		WEYERHAEUSER COMPANY	2,798	84,247.78	
	投資証券	小計	41,878	1,945,798.28	(190,804,979)
米ドル建	小計		68,878	1,966,723.28	(192,856,884)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	600	12,990.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	900	23,067.00	
カナダドル建	小計		1,500	36,057.00	(3,434,789)
ユーロ	投資証券	CORIO NV	404	13,224.94	
		FONCIERE DES REGIONS	198	12,622.50	
		GECINA SA	108	10,578.60	
		ICADE	121	8,290.92	
		KLEPIERRE	564	18,273.60	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	477	91,917.90	
ユーロ建	小計		1,872	154,908.46	(20,774,773)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	4,590	27,907.20	
		HAMMERSON PLC	3,684	19,377.84	
		INTU PROPERTIES PLC	3,843	12,743.38	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	4,030	39,433.55	
		SEGRO PLC	3,635	12,184.52	
英ポンド建	小計		19,782	111,646.49	(17,693,735)
オーストラリアドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	12,602	25,456.04	
		DEXUS PROPERTY GROUP	23,762	25,662.96	
		FEDERATION CENTRES	8,228	19,171.24	
		GOODMAN GROUP	8,796	44,155.92	
		GPT GROUP	7,306	27,178.32	
		MIRVAC GROUP	17,706	31,516.68	
		STOCKLAND	11,385	45,540.00	
		WESTFIELD GROUP	10,367	114,451.68	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	16,400	51,168.00	
オーストラリアドル建	小計		116,552	384,300.84	(36,351,016)
香港ドル	投資証券	THE LINK REIT	11,500	445,050.00	
香港ドル建	小計		11,500	445,050.00	(5,629,882)

シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,000	25,740.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	12,000	17,280.00	
		CAPITAMALL TRUST	15,000	29,700.00	
		KEPPEL REIT	552	681.72	
シンガポールドル建小計			38,552	73,401.72 (5,808,278)	
合計				282,549,357 (282,549,357)	

(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 合計金額に 対する比率
米ドル	株式 571銘柄	54.6%			56.9%
	投資信託受益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 29銘柄			1.4%	1.4%
カナダドル	株式 93銘柄	4.5%			4.6%
	投資証券 2銘柄			0.0%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	13.4%			13.9%
	投資証券 6銘柄			0.2%	0.2%
英ポンド	株式 101銘柄	9.5%			9.8%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.9%			4.1%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	1.5%			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 59銘柄	3.5%			3.6%
	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			0.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 26銘柄	0.7%			0.7%
	投資証券 4銘柄			0.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	0.2%			0.2%

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

新光日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	47,736,656	15,336,842
国債証券	13,614,633,800	13,926,793,400
地方債証券	1,250,488,500	1,286,212,500
特殊債券	1,475,243,400	1,462,388,500
社債券	743,780,000	840,920,000
未収利息	44,956,208	45,079,279
前払費用	1,957,382	737,465
流動資産合計	17,178,795,946	17,577,467,986
資産合計	17,178,795,946	17,577,467,986
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	14,777,050,461	15,057,742,796
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,379,456,185	2,519,725,190
元本等合計	17,156,506,646	17,577,467,986
純資産合計	17,156,506,646	17,577,467,986
負債純資産合計	17,178,795,946	17,577,467,986

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25年 4月23日 至 平成25年10月21日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

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25年 4月22日現在		平成25年10月21日現在	
1. 計算日における受益権の総数	14,777,050,461口	1. 計算日における受益権の総数	15,057,742,796口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額		2. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1610円	1口当たり純資産額	1.1673円
(1万口当たり純資産額)	(11,610円)	(1万口当たり純資産額)	(11,673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10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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>	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、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>
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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
<p>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。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21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	13,887,186,265円	14,777,050,461円
期中追加設定元本額	1,450,612,728円	904,153,559円
期中一部解約元本額	560,748,532円	623,461,224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）	106,774,641円	111,719,326円
新光7資産バランスファンド	998,898,224円	1,015,710,537円
日本債券ファンド	281,142,371円	342,031,211円
新光日本債券インデックスVA	2,840,278,176円	2,994,953,157円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,275,158,485円	2,293,017,043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）	3,054,878,711円	2,993,986,101円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	552,220,776円	500,435,341円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	3,246,825,617円	3,332,973,253円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,420,873,460円	1,472,916,827円
合計	14,777,050,461円	15,057,742,796円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21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	126,547,600	125,646,700
地方債証券	1,995,900	375,200
特殊債券	169,700	543,100
社債券	2,860,000	4,000
合計	131,573,200	124,724,400

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第87回利付国債(5年)	190,000,000	190,934,800	
	第88回利付国債(5年)	200,000,000	201,192,000	
	第89回利付国債(5年)	310,000,000	311,639,900	
	第91回利付国債(5年)	170,000,000	171,003,000	
	第92回利付国債(5年)	150,000,000	150,600,000	
	第93回利付国債(5年)	50,000,000	50,430,500	
	第95回利付国債(5年)	30,000,000	30,356,100	
	第96回利付国債(5年)	120,000,000	121,136,400	
	第97回利付国債(5年)	190,000,000	191,434,500	
	第99回利付国債(5年)	100,000,000	100,797,000	
	第101回利付国債(5年)	170,000,000	171,416,100	

第103回利付国債(5年)	160,000,000	160,840,000
第105回利付国債(5年)	170,000,000	170,277,100
第106回利付国債(5年)	60,000,000	60,081,000
第107回利付国債(5年)	140,000,000	140,144,200
第109回利付国債(5年)	130,000,000	129,516,400
第112回利付国債(5年)	240,000,000	242,270,400
第114回利付国債(5年)	40,000,000	40,184,400
第1回利付国債(40年)	20,000,000	23,841,200
第2回利付国債(40年)	20,000,000	22,789,400
第3回利付国債(40年)	30,000,000	34,180,200
第4回利付国債(40年)	40,000,000	45,562,800
第5回利付国債(40年)	50,000,000	54,113,500
第6回利付国債(40年)	10,000,000	10,521,600
第265回利付国債(10年)	100,000,000	101,650,000
第266回利付国債(10年)	100,000,000	101,534,000
第267回利付国債(10年)	100,000,000	101,418,000
第268回利付国債(10年)	90,000,000	91,800,000
第269回利付国債(10年)	250,000,000	254,297,500
第270回利付国債(10年)	210,000,000	214,223,100
第272回利付国債(10年)	10,000,000	10,249,700
第273回利付国債(10年)	240,000,000	246,448,800
第276回利付国債(10年)	160,000,000	165,187,200
第277回利付国債(10年)	150,000,000	155,380,500
第280回利付国債(10年)	190,000,000	198,985,100
第282回利付国債(10年)	80,000,000	83,664,800
第283回利付国債(10年)	60,000,000	62,922,600
第284回利付国債(10年)	140,000,000	146,914,600
第285回利付国債(10年)	190,000,000	200,045,300
第286回利付国債(10年)	100,000,000	106,002,000
第288回利付国債(10年)	50,000,000	52,991,500
第289回利付国債(10年)	150,000,000	158,238,000
第290回利付国債(10年)	220,000,000	231,730,400
第291回利付国債(10年)	40,000,000	41,958,000
第293回利付国債(10年)	130,000,000	139,661,600
第296回利付国債(10年)	110,000,000	116,980,600
第297回利付国債(10年)	120,000,000	127,384,800
第299回利付国債(10年)	80,000,000	84,683,200
第300回利付国債(10年)	80,000,000	85,538,400
第301回利付国債(10年)	130,000,000	139,297,600
第303回利付国債(10年)	230,000,000	245,474,400
第305回利付国債(10年)	50,000,000	53,119,500
第306回利付国債(10年)	230,000,000	245,975,800

第308回利付国債(10年)	220,000,000	234,053,600	
第309回利付国債(10年)	10,000,000	10,505,000	
第310回利付国債(10年)	160,000,000	167,016,000	
第311回利付国債(10年)	20,000,000	20,607,000	
第312回利付国債(10年)	180,000,000	190,220,400	
第313回利付国債(10年)	230,000,000	244,536,000	
第315回利付国債(10年)	210,000,000	221,739,000	
第317回利付国債(10年)	40,000,000	41,937,600	
第318回利付国債(10年)	160,000,000	166,465,600	
第319回利付国債(10年)	120,000,000	125,791,200	
第320回利付国債(10年)	70,000,000	72,800,700	
第321回利付国債(10年)	70,000,000	72,764,300	
第322回利付国債(10年)	50,000,000	51,571,500	
第323回利付国債(10年)	240,000,000	247,248,000	
第325回利付国債(10年)	140,000,000	142,910,600	
第326回利付国債(10年)	70,000,000	70,760,900	
第327回利付国債(10年)	50,000,000	50,978,500	
第328回利付国債(10年)	90,000,000	90,039,600	
第329回利付国債(10年)	100,000,000	101,779,000	
第330回利付国債(10年)	50,000,000	50,840,000	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	22,672,000	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	22,838,200	
第10回利付国債(30年)	30,000,000	28,069,500	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	20,701,400	
第12回利付国債(30年)	20,000,000	22,025,400	
第13回利付国債(30年)	30,000,000	32,497,800	
第15回利付国債(30年)	40,000,000	46,825,200	
第17回利付国債(30年)	40,000,000	46,115,200	
第19回利付国債(30年)	50,000,000	56,817,000	
第20回利付国債(30年)	10,000,000	11,736,100	
第21回利付国債(30年)	30,000,000	34,104,600	
第22回利付国債(30年)	20,000,000	23,511,600	
第23回利付国債(30年)	30,000,000	35,281,800	
第24回利付国債(30年)	40,000,000	47,060,800	
第26回利付国債(30年)	40,000,000	46,356,800	
第27回利付国債(30年)	50,000,000	59,058,500	
第28回利付国債(30年)	40,000,000	47,357,600	
第29回利付国債(30年)	50,000,000	58,265,500	
第30回利付国債(30年)	50,000,000	57,305,000	
第31回利付国債(30年)	50,000,000	56,320,000	
第32回利付国債(30年)	60,000,000	68,947,800	
第33回利付国債(30年)	60,000,000	65,127,000	

第34回利付国債(30年)	70,000,000	79,055,900	
第35回利付国債(30年)	70,000,000	75,914,300	
第36回利付国債(30年)	70,000,000	75,912,900	
第37回利付国債(30年)	70,000,000	74,297,300	
第38回利付国債(30年)	60,000,000	62,274,600	
第39回利付国債(30年)	20,000,000	21,206,800	
第45回利付国債(20年)	30,000,000	34,012,800	
第47回利付国債(20年)	60,000,000	67,559,400	
第48回利付国債(20年)	60,000,000	68,916,000	
第50回利付国債(20年)	30,000,000	33,226,800	
第51回利付国債(20年)	10,000,000	11,156,000	
第52回利付国債(20年)	30,000,000	33,768,900	
第53回利付国債(20年)	30,000,000	33,842,100	
第55回利付国債(20年)	30,000,000	33,658,200	
第57回利付国債(20年)	30,000,000	33,443,400	
第58回利付国債(20年)	30,000,000	33,510,900	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	44,030,000	
第61回利付国債(20年)	30,000,000	31,109,700	
第63回利付国債(20年)	30,000,000	33,347,100	
第64回利付国債(20年)	20,000,000	22,452,800	
第65回利付国債(20年)	90,000,000	101,202,300	
第69回利付国債(20年)	40,000,000	45,831,200	
第70回利付国債(20年)	30,000,000	35,355,900	
第72回利付国債(20年)	30,000,000	34,466,400	
第76回利付国債(20年)	40,000,000	45,165,200	
第78回利付国債(20年)	40,000,000	45,197,600	
第81回利付国債(20年)	50,000,000	57,051,000	
第84回利付国債(20年)	80,000,000	91,295,200	
第85回利付国債(20年)	70,000,000	80,724,700	
第88回利付国債(20年)	60,000,000	70,628,400	
第90回利付国債(20年)	70,000,000	81,514,300	
第92回利付国債(20年)	70,000,000	80,593,800	
第94回利付国債(20年)	70,000,000	80,529,400	
第95回利付国債(20年)	70,000,000	82,219,200	
第97回利付国債(20年)	70,000,000	81,249,000	
第99回利付国債(20年)	70,000,000	80,246,600	
第100回利付国債(20年)	70,000,000	81,087,300	
第103回利付国債(20年)	70,000,000	81,946,900	
第105回利付国債(20年)	70,000,000	79,938,600	
第108回利付国債(20年)	50,000,000	55,630,500	
第111回利付国債(20年)	80,000,000	91,999,200	
第113回利付国債(20年)	90,000,000	101,978,100	

	第114回利付国債(20年)	10,000,000	11,309,900
	第116回利付国債(20年)	90,000,000	102,899,700
	第118回利付国債(20年)	100,000,000	111,106,000
	第121回利付国債(20年)	90,000,000	98,371,800
	第123回利付国債(20年)	100,000,000	112,088,000
	第125回利付国債(20年)	80,000,000	90,734,400
	第128回利付国債(20年)	90,000,000	97,684,200
	第130回利付国債(20年)	80,000,000	85,376,800
	第132回利付国債(20年)	80,000,000	83,899,200
	第134回利付国債(20年)	100,000,000	106,242,000
	第137回利付国債(20年)	90,000,000	93,924,000
	第140回利付国債(20年)	90,000,000	93,686,400
	第141回利付国債(20年)	80,000,000	83,123,200
	第143回利付国債(20年)	90,000,000	91,835,100
	第145回利付国債(20年)	80,000,000	82,742,400
	第146回利付国債(20年)	20,000,000	20,644,800
国債証券 小計		13,130,000,000	13,926,793,400
地方債証券	第18回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,540,000
	第654回東京都公募公債	100,000,000	105,660,000
	第678回東京都公募公債	80,000,000	85,216,000
	平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	31,710,000
	第164回神奈川県公募公債	100,000,000	107,000,000
	第87回大阪府公募公債(5年)	50,000,000	49,900,000
	第277回大阪府公募公債(10年)	30,000,000	30,558,000
	第302回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	42,216,000
	平成17年度第8回兵庫県公募公債	10,000,000	10,238,000
	平成18年度第2回静岡県公募公債	10,000,000	10,491,000
	平成20年度第1回愛知県公募公債(10年)	48,000,000	51,460,800
	平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	67,168,200
	平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	100,180,000
	第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,160,000
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,360,000
	第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	52,080,000
	平成18年度第3回大阪市公募公債	39,000,000	41,047,500
	第12回す号名古屋市公募公債	30,000,000	31,107,000
	平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	31,875,000
	平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,715,000
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,530,000
地方債証券 小計		1,226,000,000	1,286,212,500
特殊債券	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,110,000
	第33回日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,810,000

	第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,690,000	
	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	112,270,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,850,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,900,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,270,000	
	第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,000,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	107,312,500	
	第188回政府保証中小企業債券	100,000,000	104,760,000	
	第2回成田国際空港社債	100,000,000	103,000,000	
	い第736号商工債券	70,000,000	70,504,000	
	い第715号農林債券	40,000,000	40,252,000	
	第274回信金中金債（5年）	100,000,000	100,230,000	
	第13回中日本高速道路社債（財投機関債）	100,000,000	106,430,000	
	特殊債券 小計	1,411,000,000	1,462,388,500	
社債券	第30回新日鐵住金社債	100,000,000	110,800,000	
	第1回日本電産社債	100,000,000	100,090,000	
	第8回トヨタ自動車社債	100,000,000	108,740,000	
	第30回住友商事社債	100,000,000	103,450,000	
	第112回三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	100,610,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,910,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	107,680,000	
	第524回東京電力社債	100,000,000	95,640,000	
	社債券 小計	800,000,000	840,920,000	
	合計	16,567,000,000	17,516,314,400	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,784,392	9,972,725

	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
投資証券	1,399,838,220	1,206,649,200
未収配当金	8,555,105	8,119,693
未収利息	10	10
流動資産合計	1,416,177,727	1,224,741,628
資産合計	1,416,177,727	1,224,741,628
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	1,089,586,634	1,004,866,979
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	326,591,093	219,874,649
元本等合計	1,416,177,727	1,224,741,628
純資産合計	1,416,177,727	1,224,741,628
負債純資産合計	1,416,177,727	1,224,741,628

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25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
1. 計算日における受益権の総数 1,089,586,634口	1. 計算日における受益権の総数 1,004,866,979口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2997円 (1万口当たり純資産額) (12,997円)	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2188円 (1万口当たり純資産額) (12,188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10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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。	コンプライアンス・リスク管理部門、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。
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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 2.時価の算定方法	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。	同左
--	----

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21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	1,257,021,193円	1,089,586,634円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	167,434,559円	84,719,655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	1,089,586,634円	1,004,866,979円
合計	1,089,586,634円	1,004,866,979円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21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	482,763,745	328,010,157
合計	482,763,745	328,010,157

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	39	27,729,000	
	M I Dリート投資法人	31	7,052,500	
	森ヒルズリート投資法人	47	32,195,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	26	14,664,000	
	産業ファンド投資法人	27	24,381,000	
	大和ハウスリート投資法人	21	15,624,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	212	46,004,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	35	7,486,500	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	35	28,980,000	
	G L P投資法人	355	35,890,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	12	8,340,000	
	日本プロロジスリート投資法人	48	46,320,000	
	野村不動産マスタ - ファンド投資法人	280	28,084,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1	581,000	
	日本ビルファンド投資法人	118	143,724,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	102	116,586,000	
	日本リテールファンド投資法人	399	79,999,500	
	オリックス不動産投資法人	272	32,585,600	
	日本プライムリアルティ投資法人	141	46,318,500	
	プレミア投資法人	34	14,314,000	
	東急リアル・エステート投資法人	32	19,232,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	17	10,013,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	64	32,384,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	407	61,457,000	
	森トラスト総合リート投資法人	43	37,754,000	
	インヴィンシブル投資法人	230	3,079,700	
	フロンティア不動産投資法人	42	41,916,000	
	平和不動産リート投資法人	136	10,730,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	28	28,084,000	
	福岡リート投資法人	24	19,296,000	
ケネディクス不動産投資法人	49	23,030,000		
積水ハウス・S I投資法人	27	13,459,500		
いちご不動産投資法人	151	9,664,000		
大和証券オフィス投資法人	68	29,716,000		

阪急リート投資法人	18	10,350,000	
スタートプロシード投資法人	25	4,507,500	
トップリート投資法人	26	12,298,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	60	24,870,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	417	19,098,600	
日本賃貸住宅投資法人	227	15,708,400	
ジャパンエクセレント投資法人	38	23,142,000	
合計	4,364	1,206,649,200	

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	5,433,321	7,198,673
コール・ローン	3,481,120	2,775,423
投資証券	1,357,852,178	1,192,122,673
未収配当金	1,180,134	841,417
未収利息	4	3
流動資産合計	1,367,946,757	1,202,938,189
資産合計	1,367,946,757	1,202,938,189
負債の部		
流動負債		
未払金	-	4,396,892
流動負債合計	-	4,396,892
負債合計	-	4,396,892
純資産の部		
元本等		
元本	1,288,574,079	1,191,174,643
剰余金		
剰余金又は欠損金()	79,372,678	7,366,654
元本等合計	1,367,946,757	1,198,541,297
純資産合計	1,367,946,757	1,198,541,297
負債純資産合計	1,367,946,757	1,202,938,189

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25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
1. 計算日における受益権の総数 1,288,574,079口	1. 計算日における受益権の総数 1,191,174,643口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0616円 (1万口当たり純資産額) (10,616円)	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0062円 (1万口当たり純資産額) (10,062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10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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>	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、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>
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25年 4月22日現在	平成25年10月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成24年10月23日 至 平成25年 4月22日	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21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25年 4月22日現在	平成25年10月21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	1,450,564,933円	1,288,574,079円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	161,990,854円	97,399,436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	1,288,574,079円	1,191,174,643円
合計	1,288,574,079円	1,191,174,643円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年 4月22日現在	平成25年10月21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	149,135,675	71,705,861
合計	149,135,675	71,705,861

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	1,023	26,700.30	
		AGREE REALTY CORPORATION	300	9,366.00	
		ALEXANDER'S INC	100	31,802.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	1,400	92,414.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	700	23,233.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2,100	77,154.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	900	14,274.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	3,800	50,730.00	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	300	5,220.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	8,000	632,080.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	2,975	87,286.50	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	400	4,192.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,200	16,368.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	1,000	15,330.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,642	350,434.88	
		AVIV REIT INC	200	4,804.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	3,900	76,362.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,100	337,342.00	
		BRANDYWINE REALTY	3,000	41,250.00	
		BRE PROPERTIES -CL A	1,500	79,830.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,700	112,098.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	1,400	14,462.00	
		CAPLEASE INC	1,500	12,720.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,384	68,018.40	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,400	7,868.00	
		CHAMBERS STREET PROPERTIES	4,700	42,488.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	400	7,872.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	1,000	24,020.00	
		COLE REAL ESTATE INVESTMENTS INC	9,400	119,568.00	
		COMMONWEALTH REIT	2,375	59,327.50	
CORESITE REALTY CORPORATION	400	13,624.00			

CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,600	38,144.00	
CORRECTIONS CORPORATION OF AMERICA	2,200	82,500.00	
COUSINS PROPERTIES INC	3,462	38,739.78	
CUBESMART	2,700	52,596.00	
CYRUSONE INC	400	8,060.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	6,000	46,440.00	
DDR CORPORATION	6,097	101,880.87	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3,952	46,040.80	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,600	146,224.00	
DOUGLAS EMMETT INC	2,700	67,770.00	
DUKE REALTY CORP	6,600	110,616.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	1,300	33,527.00	
EASTGROUP PROPERTIES	600	38,694.00	
EDUCATION REALTY TRUST	2,400	22,416.00	
EPR PROPERTIES	900	44,442.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	1,500	54,975.00	
EQUITY ONE INC	1,200	28,464.00	
EQUITY RESIDENTIAL	7,200	397,512.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	800	128,040.00	
EXCEL TRUST INC	1,000	12,330.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,100	101,703.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT	1,300	138,489.00	
FELCOR LODGING TRUST	2,600	17,888.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY	2,100	38,661.00	
FIRST POTOMAC REALTY	1,200	15,348.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES	1,700	22,440.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	11,150	234,596.00	
GETTY REALTY CORP	500	9,925.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	300	5,685.00	
GLIMCHER REALTY TRUST	3,000	31,500.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	1,100	27,544.00	
HCP INC	9,100	387,387.00	
HEALTH CARE REIT INC	5,700	369,645.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,800	43,164.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	3,500	39,690.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,500	20,580.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,700	64,209.00	
HOME PROPERTIES INC	1,100	66,781.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2,800	84,448.00	
HOST HOTELS & RESORTS	14,979	278,309.82	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	900	18,675.00	
INLAND REAL ESTATE CORP	1,600	17,024.00	

INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,100	18,921.00	
KILROY REALTY CORP	1,500	79,440.00	
KIMCO REALTY CORP	8,200	171,052.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	1,900	11,799.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,900	58,026.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	4,454	50,820.14	
LIBERTY PROPERTY	2,900	109,040.00	
LTC PROPERTIES INC	700	27,314.00	
MACK-CALI REALTY CORP	1,800	39,780.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,200	41,536.00	
MID-AMERICA APARTMENT	1,476	96,368.04	
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	900	8,208.00	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	500	30,735.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,400	80,472.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,300	76,176.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	300	6,408.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	900	16,587.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,200	35,424.00	
PENN REAL ESTATE INVESTMENT	1,300	25,090.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	200	2,560.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	3,400	61,608.00	
PLUM CREEK TIMBER COMPANY	3,300	161,106.00	
POST PROPERTIES INC	1,100	50,743.00	
POTLATCH CORPORATION	800	34,896.00	
PROLOGIS INC	10,000	398,200.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	400	31,832.00	
PUBLIC STORAGE	2,900	499,264.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1,200	18,852.00	
RAYONIER INC	2,500	145,650.00	
REALTY INCOME CORP	3,992	167,105.12	
REGENCY CENTERS CORPORATION	1,800	92,880.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	1,400	20,370.00	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	3,900	55,107.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	300	4,104.00	
RLJ LODGING TRUST	2,500	61,125.00	
ROUSE PROPERTIES INC	420	8,614.20	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,100	40,150.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	800	20,360.00	
SAUL CENTERS INC	300	14,550.00	
SELECT INCOME REIT	600	16,428.00	
SENIOR HOUSING PROPERTIES	3,800	93,100.00	

SILVER BAY REALTY TRUST CORPORATION	700	11,193.00
SIMON PROPERTY GROUP	6,205	980,452.05
SL GREEN REALTY CORPORATION	1,800	170,478.00
SOVRAN SELF STORAGE INC	600	46,800.00
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7,147	68,611.20
STAG INDUSTRIAL INC	900	18,765.00
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	3,500	31,675.00
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,300	11,895.00
SUN COMMUNITIES INC	700	30,940.00
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	3,375	45,731.25
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,900	66,177.00
TAUBMAN CENTERS INC	1,300	92,066.00
TERRENO REALTY CORP	300	5,469.00
THE GEO GROUP INC	1,400	50,498.00
THE MACERICH COMPANY	2,801	165,511.09
UDR INC	5,058	126,500.58
UMH PROPERTIES INC	300	3,144.00
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	300	13,266.00
URSTADT BIDDLE-CL A	500	10,030.00
VENTAS INC	5,955	390,290.70
VORNADO REALTY TRUST	3,335	297,115.15
WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,300	35,282.00
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	2,200	68,486.00
WEYERHAEUSER COMPANY	11,700	352,287.00
WHITESTONE REIT	300	4,173.00
WINTHROP REALTY TRUST INC	620	7,055.60
WP CAREY INC	1,200	80,040.00
米ドル建小計	348,477	12,157,073.97 (1,192,122,673)
合計		1,192,122,673 (1,192,122,673)

(注)券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 141銘柄	99.5%	100.0%

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

新光7資産バランスファンド

(平成25年11月29日現在)

資産総額	8,628,320,504円
負債総額	30,287,278円
純資産総額(-)	8,598,033,226円
発行済口数	10,894,525,040口
1口当たり純資産額(/)	0.7892円
(1万口当たり純資産額)	(7,892円)

(参考) 海外国債マザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産総額	63,187,677,408円
負債総額	117,930,400円
純資産総額(-)	63,069,747,008円
発行済口数	31,870,623,025口
1口当たり純資産額(/)	1.9789円
(1万口当たり純資産額)	(19,789円)

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産総額	14,948,205,205円
負債総額	2,200,000円
純資産総額(-)	14,946,005,205円
発行済口数	9,994,654,200口
1口当たり純資産額(/)	1.4954円
(1万口当たり純資産額)	(14,954円)

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成25年11月29日現在)

資産総額	14,346,358,082円
負債総額	91,449,582円

純資産総額（ - ）	14,254,908,500円
発行済口数	9,360,629,040口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5229円
（1万口当たり純資産額）	（15,229円）

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

（平成25年11月29日現在）

資産総額	17,597,685,208円
負債総額	90,000円
純資産総額（ - ）	17,597,595,208円
発行済口数	15,046,621,191口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1695円
（1万口当たり純資産額）	（11,695円）

（参考）新光J-REITマザーファンド

（平成25年11月29日現在）

資産総額	1,226,700,451円
負債総額	5,224,070円
純資産総額（ - ）	1,221,476,381円
発行済口数	1,004,866,979口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2156円
（1万口当たり純資産額）	（12,156円）

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成25年11月29日現在）

資産総額	1,188,669,671円
負債総額	53,881円
純資産総額（ - ）	1,188,615,790円
発行済口数	1,191,174,643口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9979円
（1万口当たり純資産額）	（9,979円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

委託者は、このファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受

益証券を発行しません。

(1) 投資信託受益証券の名義書換等

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に支払います。

(8) 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a．資本金の額（平成25年11月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株

直近5ヵ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

b．委託会社の機構

(イ) 株主総会において、15名以内の取締役が選任されます。

取締役の選任は、発行済株式総数のうち議決権のある株式数の3分の1以上に当たる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとし、補欠選任により選出された取締役の任期は、前任者の残任期間とします。

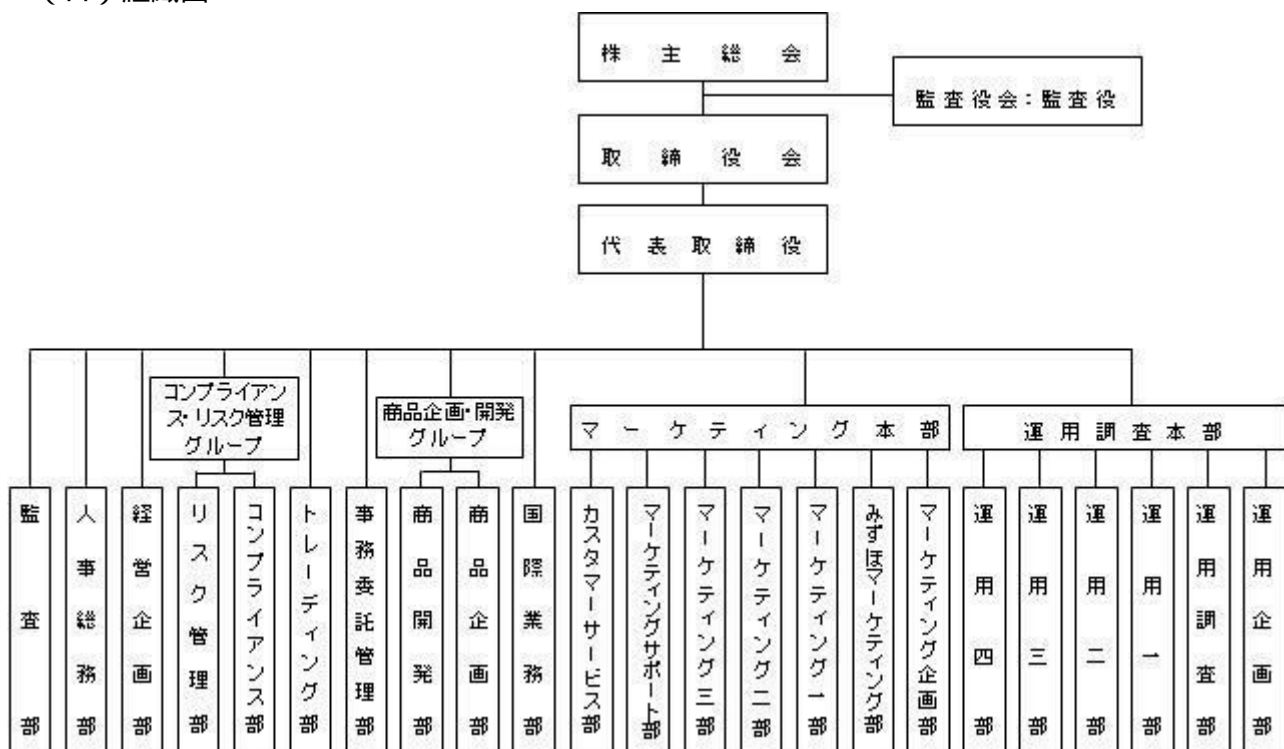
取締役会の決議により、取締役の中から会長1名、社長1名、副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

取締役会の決議をもって代表取締役3名以内を決定します。

代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

取締役会は、法令または定款に定めある事項のほか、当会社の重要な業務執行に関する事項を決定します。

(ロ) 組織図



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。

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条および第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

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、第53期事業年度（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。

第54期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

1．財務諸表

（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		当事業年度	
	(自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)		(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の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 (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)
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、通常の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の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスク及び為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、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
その他有価証券	9,472,598	9,472,598	-
(3) 未収委託者報酬	1,805,198	1,805,198	-
(4) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されて いないもの	24	24	-

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
その他有価証券	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 その他有価証券」には含めておりません。

(注) 3 . 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24年3月31日）

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

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	-	-	-
その他有価証券	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	47,307	63,091
繰延税金資産小計	494,801	407,976
評価性引当額	76,506	-
繰延税金資産合計	418,294	407,976
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	607	-
繰延税金負債合計	168,628	207,078
繰延税金資産の純額	249,665	200,897

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

（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 当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	1,006,734 7,038,413	短期貸付金 未払手数料	- 598,017

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

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

2. 中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成25年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	14,066,472
有価証券	3,396,540
貯蔵品	4,224
未収委託者報酬	2,254,580
未収運用受託報酬	116,216
繰延税金資産	213,024
その他	221,082
流動資産合計	20,272,141

固定資産

有形固定資産		
建物（純額）		15,641
構築物（純額）		1,768
器具・備品（純額）		80,007
リース資産（純額）		510
有形固定資産合計	1	97,928
無形固定資産		
ソフトウェア		35,726
ソフトウェア仮勘定		4,725
その他		91
無形固定資産合計		40,542
投資その他の資産		
投資有価証券		2,781,291
長期繰延税金資産		68,931
前払年金費用		392,831
その他		136,017
投資その他の資産合計		3,379,072
固定資産合計		3,517,543
資産合計		23,789,684

(単位：千円)

当中間会計期間

(平成25年9月30日)

負債の部

流動負債

リース債務		796
未払金		
未払収益分配金		311
未払償還金		14,162
未払手数料		1,136,139
その他未払金		120,254
未払金合計		1,270,867
未払法人税等		875,366
未払消費税等	2	140,804
賞与引当金		295,000
役員賞与引当金		27,300
その他		456,495
流動負債合計		3,066,630

固定負債

長期リース債務		754
退職給付引当金		165,887
役員退職慰労引当金		18,708
執行役員退職慰労引当金		87,583
固定負債合計		272,933

負債合計

3,339,564

純資産の部

株主資本

資本金		4,524,300
資本剰余金		

資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
別途積立金	10,000,000
繰越利益剰余金	2,905,856
利益剰余金合計	13,266,350
自己株式	72,415
株主資本合計	20,479,934
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	29,813
評価・換算差額等合計	29,813
純資産合計	20,450,120
負債純資産合計	23,789,684

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 平成25年4月 1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		14,085,010
運用受託報酬		140,209
営業収益合計		14,225,219
営業費用及び一般管理費	1	12,211,901
営業利益		2,013,318
営業外収益		
受取配当金		66,708
有価証券利息		3,744
受取利息		7,979
時効成立分配金・償還金		339
その他		9,142
営業外収益合計		87,915
営業外費用		
支払利息		35
時効成立後支払分配金・償還金		1,382
その他		1,261
営業外費用合計		2,679
経常利益		2,098,554
特別利益		
投資有価証券売却益		158,020
特別利益合計		158,020
特別損失		
固定資産除却損		5
投資有価証券売却損		42,388
特別損失合計		42,393
税引前中間純利益		2,214,180

法人税、住民税及び事業税	871,937
法人税等調整額	4,610
法人税等合計	867,327
中間純利益	1,346,853

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 平成25年4月 1日 至 平成25年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	4,524,300
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	4,524,300
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	2,761,700
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	360,493
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	360,493
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	10,000,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	10,000,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	1,559,003
当中間期変動額	
剰余金の配当	-
中間純利益	1,346,853
当中間期変動額合計	1,346,853
当中間期末残高	2,905,856
利益剰余金合計	
当期首残高	11,919,497
当中間期変動額	
剰余金の配当	-
中間純利益	1,346,853
当中間期変動額合計	1,346,853
当中間期末残高	13,266,350

(単位：千円)

当中間会計期間	
(自 平成25年4月 1日 至 平成25年9月30日)	
自己株式	
当期首残高	72,415
当中間期変動額	
自己株式の取得	-
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	72,415
株主資本合計	
当期首残高	19,133,081
当中間期変動額	
剰余金の配当	-
中間純利益	1,346,853
自己株式の取得	-
当中間期変動額合計	1,346,853
当中間期末残高	20,479,934
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	106,625
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間 期変動額（純額）	136,439
当中間期変動額合計	136,439
当中間期末残高	29,813
純資産合計	
当期首残高	19,239,706
当中間期変動額	
剰余金の配当	-
中間純利益	1,346,853
自己株式の取得	-
株主資本以外の項目の当中間期 変動額（純額）	136,439
当中間期変動額合計	1,210,413
当中間期末残高	20,450,120

重要な会計方針

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

 関連会社株式

 総平均法による原価法

 その他有価証券

 時価のあるもの

 当中間会計期間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日以後に取得した建物（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

(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、支給見込額の当中間会計期間末日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、支給見込額の当中間会計期間末日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、当事業年度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、当中間会計期間末日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一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

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

(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、規程に基づく当中間会計期間末日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、規程に基づく当中間会計期間末日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、当中間会計期間末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．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

- 1．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

	当中間会計期間 (平成25年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	504,543千円

2．消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

- 1．減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
有形固定資産	21,972千円
無形固定資産	5,676千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30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	当中間会計期間末
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	当中間会計期間末
普通株式（株）	9,386	-	-	9,386

3．配当に関する事項

(1)配当金支払額

該当事項はありません。

(2)基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（リース取引関係）

当中間会計期間（平成25年9月30日）

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）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、含まれておりません（（注）2．参照）。

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	14,066,472	14,066,472	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	5,901,679	5,901,679	-
(3) 未収委託者報酬	2,254,580	2,254,580	-

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、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	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	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。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成25年9月30日）

1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 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。

2．其他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3) その他	1,490,890	1,343,749	147,141
	小計	1,490,890	1,343,749	147,141
中間貸借対照表計上額 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	- 4,410,788	- 4,603,333	- 192,544
	小計	4,410,788	4,603,333	192,544
	合計	5,901,679	5,947,083	45,403

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額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「其他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

該当事項はありません。

関連情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30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、中間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、中間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

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成25年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額 (算定上の基礎)	11,274円34銭
純資産の部の合計額(千円)	20,450,120

普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	20,450,120
普通株式の発行済株式数(株)	1,823,250
普通株式の自己株式数(株)	9,386
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	742円53銭
中間純利益金額(千円)	1,346,853
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	1,346,853
普通株式の期中平均株式数(株)	1,813,864

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

(重要な後発事象)

当社は、平成25年12月19日開催の臨時株主総会において、将来の事業展開や市況変動に備えるために適正な内部留保を維持しつつ、利益配分については株主の皆様へ安定的かつ可能な範囲で高水準の配当を実施していくことを基本的な考え方としており、次のとおり剰余金の処分を行うことを決議いたしました。

1. 剰余金の処分に関する事項

(1) 減少する剰余金の項目とその額	
別途積立金	1,100,000千円
(2) 増加する剰余金の項目とその額	
繰越利益剰余金	1,100,000千円

2. 株主配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	2,539,409千円
1株当たり配当額	1,400円
基準日	平成25年11月15日
効力発生日	平成25年12月20日

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引

業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）（５）において同じ。）または子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

- （４）委託者の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- （５）上記（３）（４）に掲げるもののほか、委託者の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

a．定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

b．訴訟事件その他の重要事項

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、「委託会社等の経理状況 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25年12月19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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a．資本金の額

平成25年11月末現在、342,037百万円

b．事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

（２）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11月末現在、300万ポンド

b．事業の内容

英国籍の法人であり、内外の有価証券等にかかる投資顧問業務を営んでいます。

（３）販売会社

販売会社の名称、資本金の額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11月末現在）

名 称	資本金の額 （単位：百万円）	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
大山日ノ丸証券株式会社	215	同上

岡安証券株式会社	650	同上
丸福証券株式会社	852	同上
三豊証券株式会社	300	同上
永和証券株式会社	500	同上
六和証券株式会社	204	同上
西村証券株式会社	500	同上
八幡証券株式会社	2,000	同上
いちよし証券株式会社	14,577	同上
上光証券株式会社	500	同上
あかつき証券株式会社	2,541	同上
楽天証券株式会社	7,495	同上
株式会社SBI証券	47,937	同上
SMBCD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。

2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

- (1) 委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理
- (2) 投資信託財産の計算
- (3) その他上記業務に付随する一切の業務

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

「販売会社」は以下の業務を行います。

- (1) 募集・販売の取り扱い
- (2) 受益者に対する一部解約事務
- (3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い
- (4) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付
- (6) 受益者に対する運用報告書の交付
- (7) 所得税および地方税の源泉徴収
- (8) その他上記業務に付随する一切の業務

3【資本関係】

(1) みずほ証券株式会社は、委託者の株式の76.5%を所有しています。

(2) 委託者は、三豊証券株式会社の株式の4.5%を所有しています。

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

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

- 業務の概要 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- 再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託事務の一部（投資信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙などに委託会社の名称、ロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、ファンドの形態などを記載することがあります。また、以下の内容を記載することがあります。
- ・ 交付目論見書または請求目論見書である旨
 - ・ 金融商品取引法上の目論見書である旨
 - ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号
 - ・ 詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
 - ・ 目論見書の使用開始日
 - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
 - ・ ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に投資者の意向を確認する旨
 - ・ 投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
 - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載
- (2) 目論見書は別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (3) 目論見書は電子媒体などとして使用される他、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (4) 本書の記載内容について、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に記載された運用実績のデータは、随時更新される場合があります。
- (6) 請求目論見書にファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成25年11月26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25年4月23日から平成25年10月21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10月21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](#)

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

- () 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。

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月27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25年4月1日から平成26年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、新光投信株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成25年12月19日開催の臨時株主総会において、別途積立金の減少及び剰余金の処分を決議し、平成25年12月20日にその効力が発生した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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

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

2. 中間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。