

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年7月18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】	上中 徹
【電話番号】	03-6860-6440
【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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出しましたので、平成26年 1月21日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するとともに、併せて原届出書添付書類の訂正を行うため提出するものです。

2【訂正の内容】

(1) 原届出書の下記事項のうち以下に記載した箇所を、＜訂正前＞の内容から＜訂正後＞の内容に訂正します。

_____部分は、訂正部分を示します。

(2) 原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」について、該当箇所を更新します。

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

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

第一部【証券情報】

(5)【申込手数料】

<訂正前>

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。

（略）

<訂正後>

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.7%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。当該手数料には消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）（8%）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

（略）

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

b. 委託会社の概況

<訂正前>

(イ) 資本金の額（平成25年11月末現在）

(略)

(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

<訂正後>

(イ) 資本金の額（平成26年5月末現在）

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成26年5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	東京都千代田区大手町 1 - 5 - 5	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】

(2)【投資対象】

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

<訂正前>

(略)

5. 海外国債マザーファンドの概要

(略)

運用方針	(略)
	<ul style="list-style-type: none"> ・日本を除く、<u>シティグループ世界国債インデックス</u>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。 ・<u>シティグループ世界国債インデックス</u>（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。
	(略)

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・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・ファンドの概要

(略)

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

フランクリン テンブルトン インベストメント マネジメント リミテッド（FTIML社）は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンブルトン インベストメンツ（設立：1947年、運用総資産：約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

(略)

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

<訂正後>

(略)

5. 海外国債マザーファンドの概要

	(略)
運用方針	<p>(略)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・日本を除く、<u>シティ世界国債インデックス</u>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。 ・<u>シティ世界国債インデックス</u>（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。
	(略)

シティ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、Citigroup Index LLCが開発した指数です。

同指数は、Citigroup Index LLC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・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・ファンドの概要

（略）

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（FTIML社）は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンプルトン インベストメンツ（設立：1947年、運用総資産：約91.3兆円）の一員です。FTIML社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

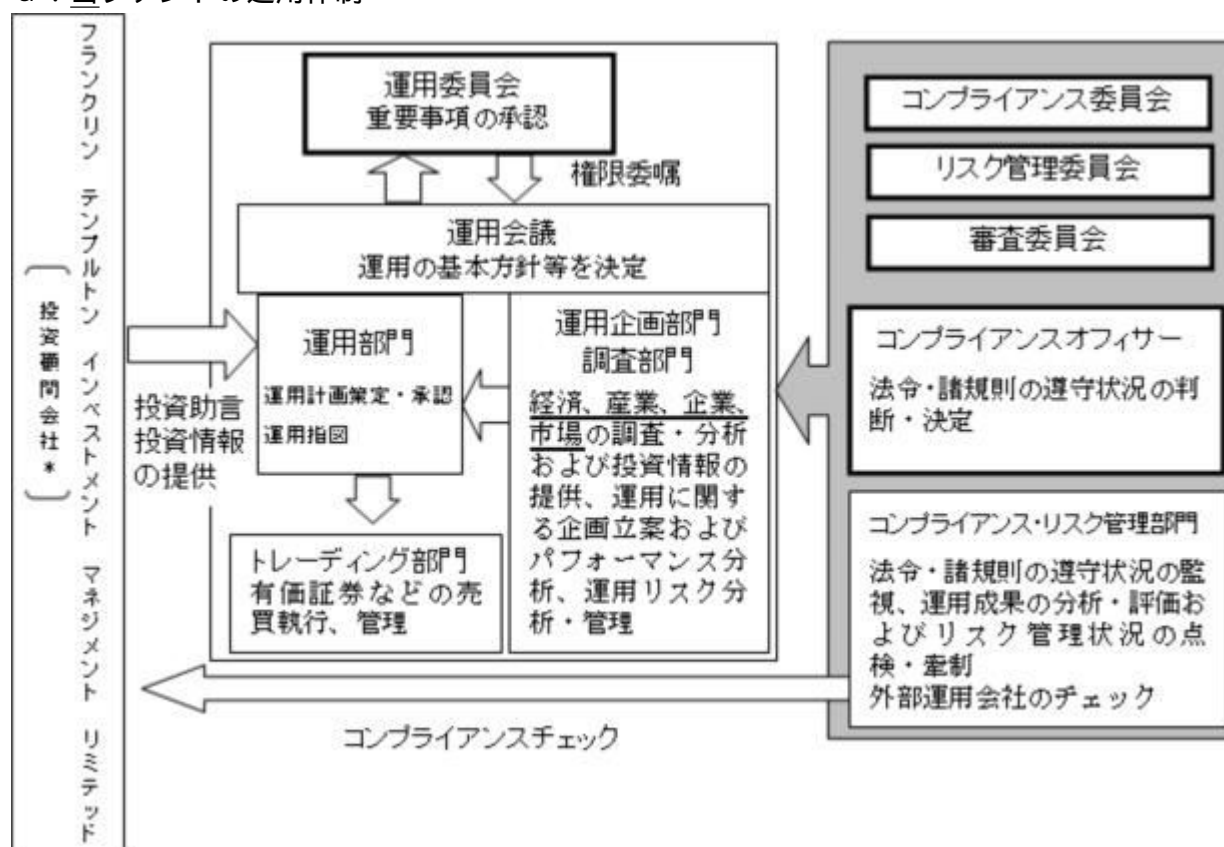
2014年3月末現在、1米ドル＝102.985円で換算

（略）

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成26年7月18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】

<訂正前>

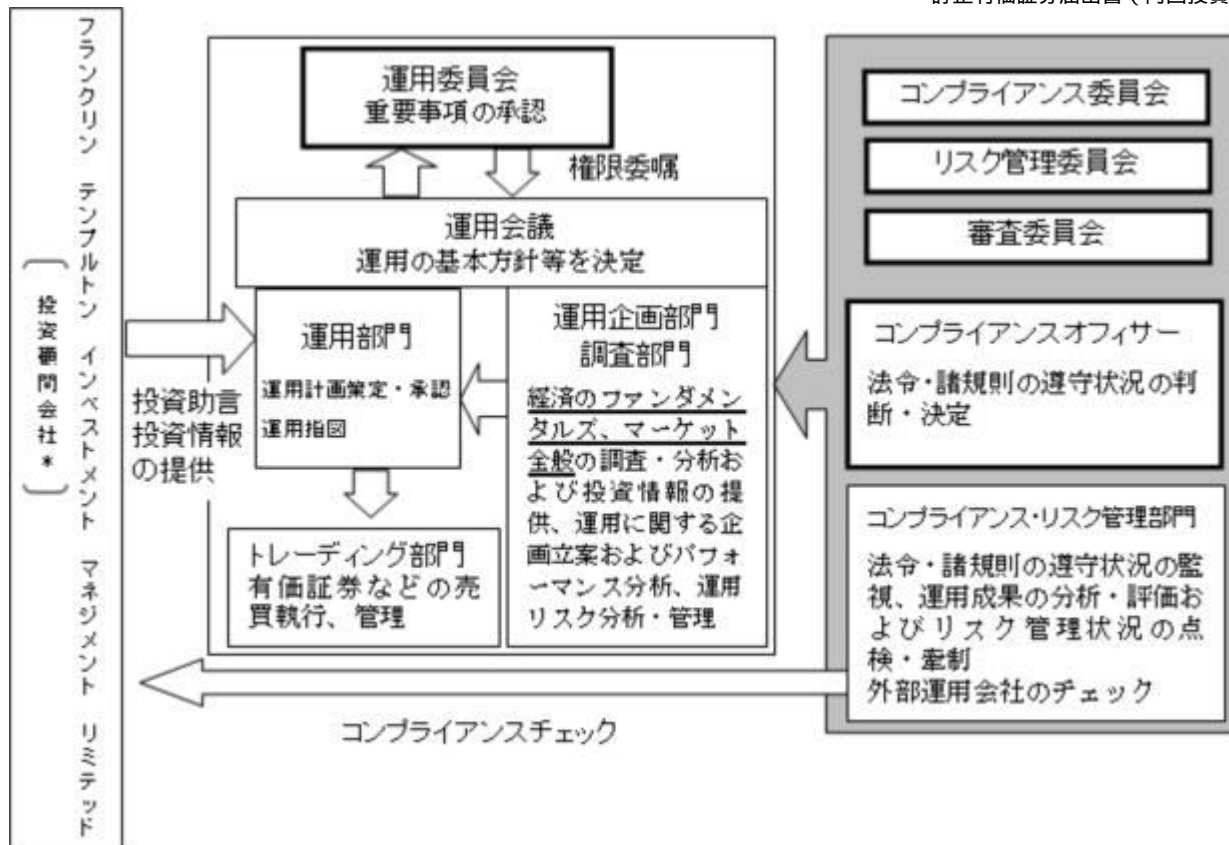
a. 当ファンドの運用体制

* 投資顧問会社は、フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド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。

<訂正後>

a. 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 7月18日現在のものであり、今後変更になることがあります。

3【投資リスク】

(2) リスク管理体制

<訂正前>

(略)

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。

<訂正後>

(略)

上記は平成26年 7月18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】

<訂正前>

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。

(略)

<訂正後>

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.7%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。当該手数料には消費税等（8%）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

(略)

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

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）
	(略)
実質的な負担 ^(注4)	<u>1.07615%</u> ^{*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。

(略)

<訂正後>

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1.026%（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1.10465%（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）
	(略)
実質的な負担 ^(注4)	<u>1.10465%</u> （税抜1.02865%）程度

(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。

（略）

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26年 5月30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	1,096,173,000	13.68
親投資信託受益証券	日本	6,740,284,714	84.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		173,785,839	2.16
純資産総額		8,010,243,553	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26年 5月30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	16,873,794,478	30.40
	カナダ	905,344,177	1.63
	ドイツ	8,697,177,822	15.67
	イタリア	12,048,027,029	21.70
	フランス	9,522,425,557	17.15
	イギリス	6,629,177,237	11.94
	小計	54,675,946,300	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		819,638,369	1.47
純資産総額		55,495,584,669	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26年 5月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	13,515,038,000	95.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		599,278,232	4.24
純資産総額		14,114,316,232	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26年 5月30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	7,019,670,203	52.73
	カナダ	586,381,031	4.40
	モーリシャス	1,470,930	0.01
	パナマ	6,795,227	0.05
	ドイツ	523,752,737	3.93
	イタリア	137,651,469	1.03
	フランス	542,810,820	4.07
	オランダ	211,033,034	1.58
	スペイン	204,092,074	1.53
	ベルギー	69,979,370	0.52
	オーストリア	17,036,269	0.12
	ルクセンブルグ	24,339,155	0.18
	フィンランド	51,956,300	0.39
	アイルランド	115,840,459	0.87
	ポルトガル	10,523,127	0.07
	イギリス	1,176,102,779	8.83
	スイス	568,541,285	4.27
	スウェーデン	183,272,824	1.37
	ノルウェー	42,864,061	0.32
	デンマーク	81,514,666	0.61
	ケイマン諸島	15,700,816	0.11
	リベリア	3,617,825	0.02
	オーストラリア	425,488,892	3.19
	バミューダ諸島	52,296,717	0.39
	ニュージーランド	7,680,060	0.05
	香港	137,753,248	1.03
	シンガポール	83,620,007	0.62
	イスラエル	31,713,445	0.23
	キュラソー	56,286,871	0.42
	ジャージー	66,525,914	0.49
	ガーンジー	3,711,664	0.02
	英ヴァージン諸島	7,655,047	0.05
マン島	2,825,872	0.02	
	小計	12,470,504,198	93.67
投資信託受益証券	シンガポール	2,058,615	0.01

投資証券	アメリカ	205,693,399	1.54
	カナダ	2,856,603	0.02
	フランス	17,473,020	0.13
	オランダ	2,043,447	0.01
	イギリス	18,118,672	0.13
	オーストラリア	31,644,571	0.23
	香港	5,459,114	0.04
	シンガポール	5,514,668	0.04
	小計	288,803,494	2.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		550,722,221	4.13
純資産総額		13,312,088,528	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26年 5月30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	13,907,230,600	79.15
地方債証券	日本	1,284,981,100	7.31
特殊債券	日本	1,441,703,900	8.20
社債券	日本	842,230,000	4.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		93,885,793	0.53
純資産総額		17,570,031,393	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26年 5月30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	1,124,195,710	98.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,474,503	1.53
純資産総額		1,141,670,213	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26年 5月30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	1,123,360,251	98.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,215,179	1.24
純資産総額		1,137,575,430	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26年 5月30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J-REITマザーファンド	860,523,260	1.2736	1,095,962,424	1.3208	1,136,579,121	14.18
2	日本	親投資信託 受益証券	新光米国REITマザーファンド	1,005,949,353	1.1207	1,127,367,439	1.1260	1,132,698,971	14.14
3	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	783,372,885	1.3852	1,085,128,120	1.4428	1,130,250,398	14.11
4	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	692,535,442	1.5965	1,105,632,833	1.6244	1,124,954,571	14.04
5	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	542,067,449	2.0485	1,110,425,169	2.0567	1,114,870,122	13.91
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	934,735,551	1.1767	1,099,903,323	1.1778	1,100,931,531	13.74
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	6.241	1,082,813,500	6.318	1,096,173,000	13.68

(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26年 5月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	13.68
親投資信託受益証券	84.14
合計	97.83

(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26年 5月30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	40,400,000	10,176.29	4,111,223,410	10,176.3248	4,111,235,257	0.2500	2014.12.15	7.40
2	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	12,200,000	15,382.10	1,876,616,595	15,876.1340	1,936,888,360	3.2500	2021.10.25	3.49
3	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	11,300,000	16,250.91	1,836,353,297	17,068.5386	1,928,744,873	4.2500	2023.10.25	3.47
4	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	11,200,000	15,023.66	1,682,650,823	15,585.6410	1,745,591,803	3.0000	2022.04.25	3.14
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,400,000	10,221.02	1,574,037,521	10,454.3014	1,609,962,423	2.7500	2024.02.15	2.90
6	イギリス	国債証券	TSY	9,700,000	16,050.65	1,556,913,640	16,187.2626	1,570,164,473	1.7500	2022.09.07	2.82
7	イギリス	国債証券	TSY	9,400,000	16,372.16	1,538,983,497	16,571.6207	1,557,732,355	2.2500	2023.09.07	2.80
8	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,200,000	14,121.70	1,440,413,691	15,069.6701	1,537,106,360	3.7500	2021.08.01	2.76
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,500,000	10,103.93	1,465,070,549	10,476.5395	1,519,098,238	2.7500	2023.11.15	2.73
10	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9,200,000	14,944.82	1,374,923,980	15,986.7981	1,470,785,426	4.7500	2021.09.01	2.65
11	イギリス	国債証券	TSY	7,700,000	18,891.69	1,454,660,411	18,806.3405	1,448,088,226	3.7500	2021.09.07	2.60
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	8,900,000	14,831.50	1,320,003,927	15,967.4318	1,421,101,439	4.7500	2023.08.01	2.56
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,900,000	9,483.18	1,318,162,888	9,670.4075	1,344,186,643	1.7500	2023.05.15	2.42
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000	15,344.25	1,288,917,441	15,652.0395	1,314,771,318	4.5000	2024.03.01	2.36
15	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,700,000	15,509.99	1,194,269,981	16,689.5145	1,285,092,617	5.5000	2022.11.01	2.31
16	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	8,700,000	13,331.08	1,159,804,509	14,106.8934	1,227,299,727	1.7500	2023.05.25	2.21
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000	15,522.45	1,117,616,624	16,708.8806	1,203,039,410	5.5000	2022.09.01	2.16
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,100,000	9,756.00	1,180,476,243	9,913.4384	1,199,526,051	2.0000	2023.02.15	2.16
19	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	8,100,000	14,076.46	1,140,193,326	14,726.6118	1,192,855,557	2.2500	2022.10.25	2.14
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,400,000	10,055.05	1,146,276,384	10,278.7790	1,171,780,813	2.5000	2023.08.15	2.11
21	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,800,000	15,109.46	1,027,443,309	16,246.8585	1,104,786,378	5.0000	2022.03.01	1.99
22	イギリス	国債証券	TSY	4,500,000	23,974.42	1,078,849,248	23,529.1844	1,058,813,302	8.0000	2021.06.07	1.90
23	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000	14,214.79	1,023,464,937	14,657.4467	1,055,336,169	1.7500	2022.07.04	1.90
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,500,000	14,458.76	939,819,691	15,656.1894	1,017,652,311	4.5000	2023.05.01	1.83
25	イギリス	国債証券	TSY	5,200,000	19,200.32	998,416,854	19,122.6707	994,378,881	4.0000	2022.03.07	1.79
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	9,999.28	969,930,245	10,089.7550	978,706,235	2.0000	2021.11.15	1.76
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	10,144.18	963,697,170	10,210.4762	969,995,245	2.1250	2021.08.15	1.74
28	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000	15,927.31	907,857,023	16,187.3765	922,680,466	3.2500	2021.07.04	1.66
29	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000	14,556.46	873,387,954	14,952.0897	897,125,382	2.0000	2022.01.04	1.61
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000	14,604.08	832,433,005	15,084.8864	859,838,530	3.7500	2021.05.01	1.54

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。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26年5月30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26年 5月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.52
合計	98.52

(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26年 5月30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	109,800	6,140.07	674,180,000	5,761.00	632,557,800	4.48
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	589,900	666.31	393,061,600	573.00	338,012,700	2.39
3	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	38,200	8,732.82	333,593,800	7,345.00	280,579,000	1.98
4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	71,000	4,109.39	291,767,000	3,563.00	252,973,000	1.79
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	58,900	5,241.40	308,718,500	4,105.00	241,784,500	1.71
6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,010,500	231.70	234,139,000	198.00	200,079,000	1.41
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	30,600	5,586.94	170,960,600	6,042.00	184,885,200	1.30
8	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	49,000	3,173.45	155,499,100	3,444.00	168,756,000	1.19
9	日本	株式	キヤノン	電気機器	45,700	3,210.47	146,718,900	3,338.00	152,546,600	1.08
10	日本	株式	ファナック	電気機器	8,800	17,268.21	151,960,300	17,320.00	152,416,000	1.07
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	24,200	6,204.79	150,156,000	6,053.00	146,482,600	1.03
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	31,000	4,780.61	148,199,200	4,607.00	142,817,000	1.01
13	日本	株式	三菱地所	不動産業	54,000	2,869.00	154,926,000	2,471.00	133,434,000	0.94
14	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	32,600	4,265.38	139,051,600	4,068.00	132,616,800	0.93
15	日本	株式	日立製作所	電気機器	190,000	831.94	158,070,000	684.00	129,960,000	0.92
16	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	95,200	1,205.27	114,742,600	1,304.00	124,140,800	0.87
17	日本	株式	三菱商事	卸売業	60,800	1,967.98	119,653,600	2,009.00	122,147,200	0.86
18	日本	株式	三井不動産	不動産業	37,000	3,491.32	129,179,000	3,221.00	119,177,000	0.84
19	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	14,500	7,937.65	115,096,000	7,765.00	112,592,500	0.79
20	日本	株式	三井物産	卸売業	70,400	1,453.55	102,329,920	1,542.00	108,556,800	0.76
21	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	64,200	1,732.29	111,213,600	1,690.00	108,498,000	0.76
22	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	159,200	789.81	125,738,200	669.00	106,504,800	0.75
23	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	110,700	937.57	103,789,700	919.00	101,733,300	0.72
24	日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	349,000	334.65	116,793,000	287.00	100,163,000	0.70
25	日本	株式	パナソニック	電気機器	90,100	1,317.55	118,711,400	1,093.00	98,479,300	0.69
26	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	30,200	3,263.17	98,548,000	3,216.00	97,123,200	0.68

27	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	7,100	11,991.98	85,143,100	13,480.00	95,708,000	0.67
28	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	25,900	3,843.67	99,551,200	3,676.00	95,208,400	0.67
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	79,000	1,286.69	101,649,000	1,181.00	93,299,000	0.66
30	日本	株式	デンソー	輸送用機器	19,500	5,460.06	106,471,200	4,663.00	90,928,500	0.64

(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26年 5月30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	0.51
		建設業	2.52
		食料品	3.91
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.31
		医薬品	4.32
		石油・石炭製品	0.61
		ゴム製品	0.89
		ガラス・土石製品	0.98
		鉄鋼	1.51
		非鉄金属	0.95
		金属製品	0.62
		機械	4.99
		電気機器	11.84
		輸送用機器	11.10
		精密機器	1.31
		その他製品	1.38
		電気・ガス業	2.03
		陸運業	3.83
		海運業	0.33
		空運業	0.49
		倉庫・運輸関連業	0.21
		情報・通信業	6.89
		卸売業	4.39
		小売業	4.09
銀行業	8.74		
証券、商品先物取引業	1.51		
保険業	2.19		
その他金融業	1.30		
不動産業	3.23		

	サービス業	2.52
合計		95.75

（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26年 5月30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	3,642	52,924.19	192,749,922	64,592.7309	235,246,726	1.76
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	17,683	9,426.93	166,696,435	10,295.1081	182,048,398	1.36
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	32,101	3,840.71	123,290,786	4,100.9643	131,645,058	0.98
4	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	11,420	9,561.12	109,188,024	10,243.2615	116,978,047	0.87
5	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO (US)	資本財	40,953	2,749.90	112,616,777	2,718.3883	111,326,160	0.83
6	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	20,256	4,341.89	87,949,498	5,110.4482	103,517,239	0.77
7	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	13,053	7,498.47	97,877,581	7,923.2364	103,422,006	0.77
8	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	7,785	12,320.17	95,912,566	12,435.0512	96,806,874	0.72
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	11,003	8,387.96	92,292,796	8,173.4639	89,932,624	0.67
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	15,216	5,485.57	83,468,488	5,664.4952	86,190,959	0.64
11	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	2,844	28,510.05	81,082,608	30,050.5309	85,463,710	0.64
12	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	9,311	8,036.50	74,827,912	9,152.2159	85,216,283	0.64
13	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	16,736	5,097.23	85,307,281	5,054.5351	84,592,701	0.63
14	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	銀行	75,889	1,181.98	89,699,774	1,067.8695	81,039,551	0.60
15	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	26,234	3,183.99	83,528,825	3,009.1360	78,941,674	0.59
16	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	ソフトウェア・サービス	4,176	18,297.78	76,411,544	18,681.0416	78,012,030	0.58
17	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	21,324	3,575.38	76,241,450	3,597.7474	76,718,366	0.57
18	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	11,827	4,757.68	56,269,176	5,865.7820	69,374,604	0.52
19	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	16,087	4,071.48	65,497,947	4,133.4956	66,495,544	0.49

20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	43,174	1,455.77	62,851,466	1,540.1490	66,494,393	0.49
21	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,120	51,890.92	58,117,831	58,003.1294	64,963,505	0.48
22	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	75,488	811.23	61,238,424	859.8739	64,910,161	0.48
23	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	1,120	51,731.11	57,938,851	56,937.7330	63,770,261	0.47
24	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	14,758	3,513.36	51,850,308	4,290.0519	63,312,587	0.47
25	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	15,627	3,494.93	54,615,404	4,012.8016	62,708,051	0.47
26	フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	8,658	6,058.85	52,457,558	7,154.4275	61,943,034	0.46
27	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	12,277	5,076.90	62,329,106	4,806.4848	59,009,214	0.44
28	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	4,499	11,781.37	53,004,417	13,023.6625	58,593,458	0.44
29	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	食品・飲料・タバコ	6,485	9,089.42	58,944,893	8,983.6942	58,259,257	0.43
30	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	6,757	6,971.84	47,108,742	8,542.4898	57,721,604	0.43

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成26年5月30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26年5月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	10.14
		素材	5.53
		資本財	7.34
		商業・専門サービス	0.94
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.75
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.66
		メディア	2.89
		小売	2.75
		食品・生活必需品小売り	2.07
		食品・飲料・タバコ	5.92
		家庭用品・パーソナル用品	1.70
		ヘルスケア機器・サービス	2.95
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.56
		銀行	9.21
		各種金融	3.82
		保険	4.04
		不動産	0.63
ソフトウェア・サービス	6.32		

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.96
		電気通信サービス	3.21
		公益事業	3.26
		半導体・半導体製造装置	1.45
投資信託受益証券			0.01
投資証券			2.16
合計			95.86

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成26年 5月30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)	290,000,000	100.50	291,458,700	100.33	290,983,100	0.4000	2015.06.20	1.65
2	日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	240,000,000	106.72	256,147,200	106.34	255,232,800	1.4000	2019.09.20	1.45
3	日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	230,000,000	107.01	246,141,400	106.78	245,598,600	1.4000	2020.03.20	1.39
4	日本	国債証券	第273回利付国債(10年)	240,000,000	102.60	246,256,800	101.84	244,420,800	1.5000	2015.09.20	1.39
5	日本	国債証券	第308回利付国債(10年)	220,000,000	106.48	234,259,000	106.38	234,038,200	1.3000	2020.06.20	1.33
6	日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	230,000,000	100.83	231,919,700	100.64	231,492,700	0.5000	2015.12.20	1.31
7	日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	220,000,000	105.28	231,629,200	104.81	230,593,000	1.4000	2018.03.20	1.31
8	日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	230,000,000	100.02	230,067,300	100.18	230,414,000	0.2000	2018.12.20	1.31
9	日本	国債証券	第323回利付国債(10年)	220,000,000	103.42	227,536,600	103.77	228,307,200	0.9000	2022.06.20	1.29
10	日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	210,000,000	106.53	223,729,000	106.72	224,130,900	1.3000	2021.03.20	1.27
11	日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	210,000,000	105.81	222,207,700	106.10	222,810,000	1.2000	2021.06.20	1.26
12	日本	国債証券	第112回利付国債(5年)	220,000,000	100.95	222,102,600	101.04	222,301,200	0.4000	2018.06.20	1.26
13	日本	国債証券	第270回利付国債(10年)	210,000,000	101.93	214,059,300	101.28	212,690,100	1.3000	2015.06.20	1.21
14	日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	200,000,000	100.08	200,170,500	100.45	200,906,000	0.6000	2023.12.20	1.14
15	日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	190,000,000	104.60	198,758,600	103.71	197,064,200	1.9000	2016.06.20	1.12
16	日本	国債証券	第96回利付国債(5年)	190,000,000	100.89	191,698,100	100.75	191,428,800	0.5000	2016.03.20	1.08
17	日本	国債証券	第114回利付国債(5年)	190,000,000	100.52	191,002,000	100.64	191,216,000	0.3000	2018.09.20	1.08
18	日本	国債証券	第92回利付国債(5年)	180,000,000	100.36	180,662,600	100.28	180,513,000	0.3000	2015.09.20	1.02
19	日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	170,000,000	105.20	178,845,900	104.47	177,604,100	1.7000	2017.03.20	1.01
20	日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	170,000,000	104.86	178,266,900	104.09	176,956,400	1.7000	2016.12.20	1.00
21	日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	170,000,000	100.75	171,275,300	100.64	171,093,100	0.4000	2016.06.20	0.97

22	日本	国債証券	第91回利付国債(5年)	170,000,000	100.57	170,974,100	100.41	170,705,500	0.4000	2015.09.20	0.97
23	日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	160,000,000	105.85	169,374,800	105.98	169,572,800	1.2000	2020.12.20	0.96
24	日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	160,000,000	104.48	167,182,400	104.65	167,440,000	1.0000	2020.09.20	0.95
25	日本	国債証券	第276回利付国債(10年)	160,000,000	103.16	165,067,200	102.34	163,758,400	1.6000	2015.12.20	0.93
26	日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	160,000,000	100.54	160,868,600	100.57	160,913,600	0.3000	2017.03.20	0.91
27	日本	国債証券	第318回利付国債(10年)	150,000,000	104.32	156,490,800	104.66	156,994,500	1.0000	2021.09.20	0.89
28	日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	150,000,000	102.44	153,661,600	102.88	154,323,000	0.8000	2022.09.20	0.87
29	日本	国債証券	第277回利付国債(10年)	150,000,000	103.51	155,269,500	102.72	154,084,500	1.6000	2016.03.20	0.87
30	日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	150,000,000	101.92	152,893,600	102.43	153,657,000	0.8000	2023.09.20	0.87

(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26年 5月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.15
地方債証券	7.31
特殊債券	8.20
社債券	4.79
合計	99.46

(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26年 5月30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	193	608,192.91	117,381,231	596,000	115,028,000	10.07
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	171	569,930.26	97,458,074	595,000	101,745,000	8.91
3	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	316	200,530.54	63,367,650	223,900	70,752,400	6.19
4	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	326	151,000	49,226,000	162,900	53,105,400	4.65
5	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	214	193,352.33	41,377,398	222,800	47,679,200	4.17
6	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	178	217,000	38,626,000	251,200	44,713,600	3.91
7	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	113	328,500	37,120,500	365,500	41,301,500	3.61
8	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	68	499,000	33,932,000	552,000	37,536,000	3.28
9	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	269	120,376.53	32,381,286	135,900	36,557,100	3.20
10	日本	投資証券	GLP投資法人	287	101,100	29,015,700	107,800	30,938,600	2.70
11	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	181	175,600	31,783,600	160,800	29,104,800	2.54
12	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	34	824,748.1	28,041,435	854,000	29,036,000	2.54

13	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	54	437,000	23,598,000	516,000	27,864,000	2.44
14	日本	投資証券	野村不動産マスタ-ファンド投資法人	228	100,300	22,868,400	116,100	26,470,800	2.31
15	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	190	136,957.7	26,021,963	137,700	26,163,000	2.29
16	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	114	200,811.34	22,892,492	227,300	25,912,200	2.26
17	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	47	466,533.56	21,927,077	532,000	25,004,000	2.19
18	日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	51	506,000	25,806,000	474,500	24,199,500	2.11
19	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	63	355,500	22,396,500	371,000	23,373,000	2.04
20	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	166	121,701.44	20,202,439	138,500	22,991,000	2.01
21	日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	51	414,245.21	21,126,505	445,000	22,695,000	1.98
22	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	23	903,000	20,769,000	908,000	20,884,000	1.82
23	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	134	120,200	16,106,800	138,900	18,612,600	1.63
24	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	40	377,607.58	15,104,303	437,000	17,480,000	1.53
25	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	359	45,810.69	16,446,037	47,450	17,034,550	1.49
26	日本	投資証券	イオンリート投資法人	130	126,118.69	16,395,429	127,900	16,627,000	1.45
27	日本	投資証券	福岡リート投資法人	95	160,800	15,276,000	173,600	16,492,000	1.44
28	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	204	68,826.26	14,040,557	64,500	13,158,000	1.15
29	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	87	148,967.42	12,960,166	150,000	13,050,000	1.14
30	日本	投資証券	積水ハウス・S I投資法人	130	99,342.43	12,914,516	99,800	12,974,000	1.13

(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26年 5月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.46
合計	98.46

(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26年 5月30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	5,105	15,126.94	77,223,076	16,803.3813	85,781,262	7.54
2	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	6,400	8,032.15	51,405,802	9,086.3707	58,152,773	5.11
3	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	5,400	7,361.20	39,750,483	7,790.2057	42,067,111	3.69
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2,300	17,501.78	40,254,107	17,281.1834	39,746,722	3.49
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	5,800	5,612.64	32,553,362	6,260.2227	36,309,292	3.19
6	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8,000	4,048.10	32,384,809	4,202.6243	33,620,995	2.95
7	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	4,755	6,662.79	31,681,597	6,754.2904	32,116,651	2.82
8	アメリカ	投資証券	HCP INC	7,300	4,327.66	31,591,963	4,230.0726	30,879,530	2.71
9	アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	4,700	6,592.65	30,985,459	6,371.0321	29,943,851	2.63

10	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	9,400	3,060.98	28,773,236	3,178.9081	29,881,737	2.62
11	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	2,735	9,056.88	24,770,593	10,821.7071	29,597,369	2.60
12	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	2,400	11,062.64	26,550,339	12,146.3366	29,151,208	2.56
13	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,042	13,484.18	27,534,700	14,268.9975	29,137,293	2.56
14	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	11,979	1,888.84	22,626,448	2,216.1879	26,547,716	2.33
15	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	8,150	2,138.92	17,432,250	2,404.2590	19,594,711	1.72
16	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	986	16,089.72	15,864,472	18,251.0202	17,995,506	1.58
17	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	1,500	9,612.96	14,419,454	11,080.9400	16,621,410	1.46
18	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	2,301	6,007.08	13,822,313	6,681.0951	15,373,200	1.35
19	アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	12,089	1,243.30	15,030,276	1,254.4844	15,165,462	1.33
20	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	6,500	2,120.62	13,784,079	2,316.8313	15,059,404	1.32
21	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3,392	4,244.30	14,396,683	4,407.9775	14,951,860	1.31
22	アメリカ	投資証券	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	2,900	4,948.80	14,351,546	4,588.9324	13,307,904	1.16
23	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	1,100	10,829.84	11,912,824	12,097.5400	13,307,294	1.16
24	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2,100	5,717.35	12,006,452	5,835.2838	12,254,096	1.07
25	アメリカ	投資証券	UDR INC	4,058	2,542.51	10,317,532	2,796.6665	11,348,873	0.99
26	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,400	6,703.46	9,384,845	7,106.0342	9,948,448	0.87
27	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,800	4,871.54	8,768,785	5,317.8344	9,572,102	0.84
28	アメリカ	投資証券	RAYONIER INC	2,000	5,922.71	11,845,423	4,782.0865	9,564,173	0.84
29	アメリカ	投資証券	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,400	3,822.41	9,173,798	3,925.0925	9,420,222	0.82
30	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	5,200	1,703.82	8,859,872	1,794.2990	9,330,355	0.82

(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26年 5月30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26年 5月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.75
合計	98.75

【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 - 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。

【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26年 5月30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	大阪取引所	東証東証株価指数先物	買建	49	日本円	585,196,450	588,735,000	4.17

(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26年 5月30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	36	米ドル	3,350,438	340,605,527	3,452,220	350,952,685	2.63
	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	164,376	15,416,825	166,660	15,631,041	0.11
	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	464,400	64,240,451	485,850	67,207,630	0.50
	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	134,037	12,697,324	138,275	13,098,790	0.09

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	328,595	55,884,152	343,000	58,334,010	0.43
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	246,706	27,944,388	261,480	29,617,839	0.22
スウェーデン	ストックホルム・オプション取引所	OMXS30 INDEX	買建	2	スウェーデンクローナ	274,840	4,207,800	278,650	4,266,131	0.03

(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26年 5月30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
第15特定期間末	(平成26年 4月21日)	8,104,673,028	8,125,011,741	0.7970	0.7990
	平成25年 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	
	12月末日	8,554,437,366		0.8087	
	平成26年 1月末日	8,242,324,211		0.7880	
	2月末日	8,231,402,223		0.7951	
	3月末日	8,154,333,123		0.7963	
	4月末日	8,026,950,228		0.7994	
	5月末日	8,010,243,553		0.8107	

(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
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年 4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
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年4月21日	4.7

(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
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年 4月21日	25,208,228	996,341,985

(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。

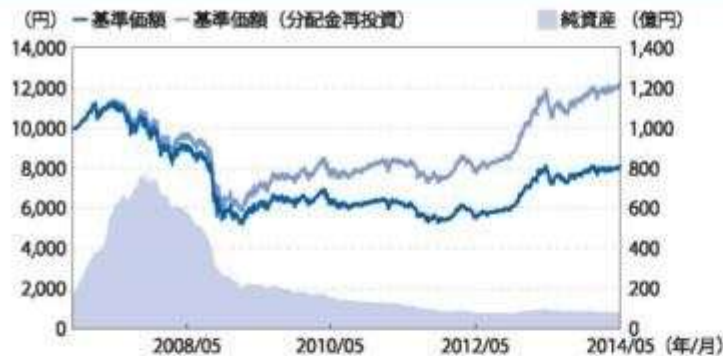
参考情報

運用実績

新光7資産バランスファンド 愛称：七重奏

2014年5月30日現在

<基準価額・純資産の推移> (2006年10月31日～2014年5月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。換金時の費用・税金などは考慮していません。
 ※基準価額(分配金再投資)は、取引日の分配金を当該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>

2014年5月	20円
2014年4月	20円
2014年3月	20円
2014年2月	20円
2014年1月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	2,860円

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

<主要な資産の状況>

組入状況

ファンド名	純資産比率
新光J-REITマザーファンド	14.18%
新光米国REITマザーファンド	14.14%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	14.11%
新光外国株式インデックスマザーファンド	14.04%
海外国債マザーファンド	13.91%
新光日本債券インデックスマザーファンド	13.74%
フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	13.68%
合計	97.83%

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	4.48%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.39%
ソフトバンク	情報・通信業	1.98%
本田技研工業	輸送用機器	1.79%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.71%

※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%	1.65%
第303回利付国債(10年)	2019/09/20	1.400%	1.45%
第306回利付国債(10年)	2020/03/20	1.400%	1.39%
第273回利付国債(10年)	2015/09/20	1.500%	1.39%
第308回利付国債(10年)	2020/06/20	1.300%	1.33%

※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	10.07%
ジャパコリアルエステイト投資法人	8.91%
日本リテールファンド投資法人	6.19%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.65%
日本プロダクトリート投資法人	4.17%

※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、各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

2014年5月30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	1.76%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.36%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.98%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.87%
GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	資本財	0.83%

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

外国債券の組入上位5銘柄(海外国債マザーファンド)

銘柄名	償還日	利率	通貨	純資産比率
US TREASURY N/B	2014/12/15	0.250%	米ドル	7.40%
FRANCE (GOVT OF)	2021/10/25	3.250%	ユーロ	3.49%
FRANCE (GOVT OF)	2023/10/25	4.250%	ユーロ	3.47%
FRANCE (GOVT OF)	2022/04/25	3.000%	ユーロ	3.14%
US TREASURY N/B	2024/02/15	2.750%	米ドル	2.90%

※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。

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

①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	48.4%
ユーロ	11.2%
ブラジルレアル	5.3%
南アフリカランド	3.4%
ウルグアイペソ	3.4%

②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
ナイジェリア	7.4%
ロシア	6.2%
その他(国際機関債)	5.0%
ヨルダン	4.9%
トルコ	4.6%

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

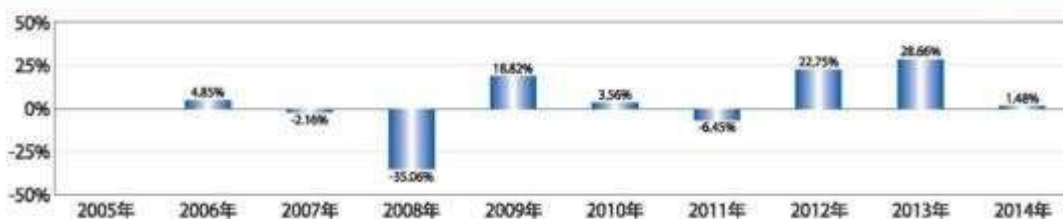
米国REITの組入上位5銘柄(新光米国REITマザーファンド)

銘柄名	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	7.54%
AMERICAN TOWER CORPORATION	5.11%
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3.69%
PUBLIC STORAGE	3.49%
EQUITY RESIDENTIAL	3.19%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

<年間収益率の推移>

暦年ベース



※取引時の分配金を単純に合算して計算しています。
 ※当ファンドにはベンチマークがありません。
 ※2006年については、設定時から12月末までの収益率を記載しています。
 ※2014年については、年初から5月末までの収益率を記載しています。

・当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。
 ・表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。
 ・最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認ください。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5) 【その他】

e. 公告

<訂正前>

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。

<訂正後>

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

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

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

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15期特定期間（平成25年10月22日から平成26年4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14期特定期間末 平成25年10月21日現在	第15期特定期間末 平成26年4月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	239,526,728	190,535,534
投資信託受益証券	1,097,734,500	1,093,744,000
親投資信託受益証券	7,318,365,132	6,857,504,052
未収利息	260	202
流動資産合計	8,655,626,620	8,141,783,788
資産合計	8,655,626,620	8,141,783,788
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	22,280,981	20,338,713
未払解約金	16,966,499	9,516,650
未払受託者報酬	609,929	608,221
未払委託者報酬	6,632,978	6,614,421
その他未払費用	30,410	32,755
流動負債合計	46,520,797	37,110,760
負債合計	46,520,797	37,110,760
純資産の部		
元本等		
元本	11,140,490,610	10,169,356,853
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,531,384,787	2,064,683,825
（分配準備積立金）	194,335,120	205,003,399
元本等合計	8,609,105,823	8,104,673,028
純資産合計	8,609,105,823	8,104,673,028
負債純資産合計	8,655,626,620	8,141,783,788

(2)【損益及び剰余金計算書】

	第14期特定期間		第15期特定期間	
	自	平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自	平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日
営業収益				
受取配当金		93,690,000		80,677,500
受取利息		53,000		46,836
有価証券売買等損益		76,603,820		345,148,420
営業収益合計		17,139,180		425,872,756
営業費用				
受託者報酬		3,664,915		3,505,068
委託者報酬		39,855,914		38,117,572
その他費用		180,970		184,281
営業費用合計		43,701,799		41,806,921
営業利益		26,562,619		384,065,835
経常利益		26,562,619		384,065,835
当期純利益		26,562,619		384,065,835
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		815,542		3,440,780
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,562,350,036		2,531,384,787
剰余金増加額又は欠損金減少額		199,480,615		217,496,231
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		199,480,615		217,496,231
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,297,744		5,313,829
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,297,744		5,313,829
分配金		137,470,545		126,106,495
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,531,384,787		2,064,683,825

(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15期特定期間 自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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10月22日から平成26年 4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14期特定期間末 平成25年10月21日現在	第15期特定期間末 平成26年 4月21日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 11,140,490,610口	1. 特定期間末日における受益権の総数 10,169,356,853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 2,531,384,787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 2,064,683,825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)	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 0.7970円 (1万口当たり純資産額) (7,970円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	第15期特定期間 自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日
分配金の計算過程	<p>第77期（自 平成25年 4月23日 至 平成25年 5月20日） 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） 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） 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83期（自 平成25年10月22日 至 平成25年11月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（24,473,984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（3,409,985円）及び分配準備積立金（192,384,363円）より分配対象収益は220,268,332円（1万口当たり199.94円）であり、うち22,030,364円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第84期（自 平成25年11月21日 至 平成25年12月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（24,437,621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（3,597,243円）及び分配準備積立金（188,632,733円）より分配対象収益は216,667,597円（1万口当たり203.44円）であり、うち21,297,299円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第85期（自 平成25年12月21日 至 平成26年 1月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,322,042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（3,600,303円）及び分配準備積立金（189,796,994円）より分配対象収益は221,719,339円（1万口当たり210.57円）であり、うち21,056,651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> <p>第82期（自 平成25年 9月21日 至 平成25年10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（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>	<p>第86期（自 平成26年 1月21日 至 平成26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（18,184,721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（3,591,893円）及び分配準備積立金（194,898,172円）より分配対象収益は216,674,786円（1万口当たり208.34円）であり、うち20,798,996円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第87期（自 平成26年 2月21日 至 平成26年 3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（22,651,599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（3,584,926円）及び分配準備積立金（190,466,227円）より分配対象収益は216,702,752円（1万口当たり210.53円）であり、うち20,584,472円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第88期（自 平成26年 3月21日 至 平成26年 4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（34,937,291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（3,573,839円）及び分配準備積立金（190,404,821円）より分配対象収益は228,915,951円（1万口当たり225.08円）であり、うち20,338,713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14期特定期間 自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日	第15期特定期間 自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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
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・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>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

第14期特定期間末 平成25年10月21日現在	第15期特定期間末 平成26年 4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>

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。	同左
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。	

（関連当事者との取引に関する注記）

	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	第15期特定期間 自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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14期特定期間末 平成25年10月21日現在	第15期特定期間末 平成26年 4月21日現在
期首元本額	11,938,974,794円	11,140,490,610円
期中追加設定元本額	22,407,208円	25,208,228円
期中一部解約元本額	820,891,392円	996,341,985円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第14期特定期間末 平成25年10月21日現在	第15期特定期間末 平成26年 4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	13,359,500	20,820,000
親投資信託受益証券	55,402,030	141,243,391
合計	42,042,530	162,063,391

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	1,093,744,000	
投資信託受益証券 小計		173,500	1,093,744,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	556,171,822	1,146,214,507	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	783,372,885	1,101,657,288	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	715,179,800	1,138,137,133	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	990,005,798	1,163,652,814	
	新光J-REITマザーファンド	914,259,188	1,138,801,244	
	新光米国REITマザーファンド	1,068,690,983	1,169,041,066	
親投資信託受益証券 小計		5,027,680,476	6,857,504,052	
合計		5,027,853,976	7,951,248,052	

(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」- 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」- R E I T マザーファンド」及び「新光米国 R E I T マザーファンド」の受益証券であります。

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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

「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」は、ケイマン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの平成25年11月30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ますが、独立監査人の監査を受けておりません。

同ファンドの財政状態計算書、包括利益計算書、持分変動計算書、キャッシュ・フロー計算書及び財務書類に対する注記は、同ファンドの受託会社である B N Y メロン ファンド・マネジメント（ケイマン）リミテッドから入手した財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋したものであります。

（1）財政状態計算書（無監査）

2013年11月30日現在

	注記	2013年11月30日現在 (日本円)	2013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(a)	59,271,130,353	57,033,825,945
発行に係る未収入金		2,367,260	1,646,943,740
現金および現金同等物	6	507,514,576	8,730,924,392
その他の債権	10	1,038,432	-
資産合計		59,782,050,621	67,411,694,077
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	7	59,325,244,612	66,979,115,060
負債			
流動負債			
償還に係る未払金		401,531,897	141,861,135
ブローカーに対する債務		-	231,334,913
未払費用	8	55,274,112	59,382,969
負債合計		456,806,009	432,579,017
資本および負債合計		59,782,050,621	67,411,694,077

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

(2) 包括利益計算書（無監査）

2013年11月30日に終了した半年間

	注記	2013年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2012年11月30日に 終了した半年間 (日本円)
収益			
保管受託銀行に預けた預金からの受取利息		40,707	6,859
為替差益純額		100,291,434	110,521,699
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(b)	352,151,053	7,558,789,747
純収益合計		452,483,194	7,669,318,305
費用			
運用報酬	10(a)	122,252,870	89,902,867
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	10(b)	30,372,804	23,246,168
保管受託銀行報酬	10(c)	10,074,135	10,924,322
費用の払戻し	10(d)	(1,038,432)	(3,497,455)
当座借越利息		2,242	85,475
その他の営業費用		3,038,879	16,418,964
営業費用合計		164,702,498	137,080,341
税引前利益		287,780,696	7,532,237,964
源泉税		-	-
当期利益		287,780,696	7,532,237,964
その他の包括利益		-	-
包括利益合計		287,780,696	7,532,237,964

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

(3) 持分変動計算書（無監査）

2013年11月30日に終了した半年間

	注記	2013年11月30日に 終了した半年間	2012年11月30日に 終了した半年間
	受益証券 口数	(日本円)	受益証券 口数
		(日本円)	(日本円)
半年間の期首残高	9,631,135	66,979,115,060	7,781,812
半年間の包括利益合計	-	287,780,696	-
半年間の分配金	9	(5,207,985,180)	-
受益証券の発行	1,425,972	9,242,283,272	1,992,307
受益証券の償還	(1,863,048)	(11,975,949,236)	(1,831,543)
半年間の期末残高	9,194,059	59,325,244,612	7,942,576

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

(4) キャッシュ・フロー計算書（無監査）

2013年11月30日に終了した半年間

注記	2013年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2012年11月30日に 終了した半年間 (日本円)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
包括利益合計	287,780,696	7,532,237,964
- 受取利息	(40,707)	(6,859)
- 当座借越利息	2,242	85,475
運転資本変動前営業キャッシュ・フロー	287,742,231	7,532,316,580
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 融資産の純増加額	(2,237,304,408)	(251,231,632)
- ブローカーに対する債権の増加	-	(34,857,750)
- その他の債権の増加	(1,038,432)	(3,291,050)
- ブローカーに対する債務の減少	(231,334,913)	(228,950,663)
- 未払費用の減少 / 増加	(4,108,857)	16,488,530
営業によるキャッシュ	(2,186,044,379)	7,030,474,015
利息の受取額	40,707	6,859
営業活動による正味キャッシュ収入	(2,186,003,672)	7,030,480,874
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	(5,207,985,180)	(4,186,324,890)
受益証券の発行による収入	10,886,859,752	11,284,223,736
受益証券の償還による支払	(11,716,278,474)	(10,686,353,547)
当座借越利息	(2,242)	(85,475)
財務活動による正味キャッシュ支出	(6,037,406,144)	(3,588,540,176)
現金および現金同等物の純減少 / 増加額	(8,223,409,816)	3,441,940,698
現金および現金同等物の半年間の期首残 高	8,730,924,392	917,164,220
現金および現金同等物の半年間の期末残 高	6 507,514,576	4,359,104,918

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

(5) 財務書類に対する注記（無監査）

2013年11月30日に終了した半年間

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

1 一般的情報

フランクリン・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（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 テンブルトン インベストメント マネジメント リミテッド（以下「投資顧問会社」という。）により管理されている。BNY メロン ファンド マネジメント（ケイマン）リミテッド（以下「受託会社」という。）が当ファンドの受託会社を務め、受託業務および管理事務代行業務を提供している。ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店が当ファンドの副管理事務代行会社に任命されている。ザ バンク オブ ニューヨーク メロン コーポレー

ションは受託会社の持株会社であり、当ファンドの保管受託銀行である。

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

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

2 重要な会計方針の要約

本財務書類の作成に際して適用された主要な会計方針は以下のとおりである。これらの方針は、別途記載がない限り、表示されたすべての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) 次の既存の基準の修正は、2013年6月1日開始会計年度に初めて発効する。それは、当ファンドに重要な影響を及ぼすものではないと見込まれる。

IFRS第7号の修正「開示 - 金融資産と金融負債の相殺」は、ネットティング契約（企業が認識した金融資産および金融負債に関連する相殺の権利を含む。）が企業の財政状態に及ぼす影響または潜在的影響を財務書類の利用者が評価できるように追加の開示を要求している。当該修正は、当ファンドの財務状況または業績に重大な影響を及ぼさなかった。

(b) 2013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32号の修正「金融資産と金融負債の相殺」は、2014年1月1日以後開始年度から発効する。これらの修正は、IAS第32号の相殺基準を明確化するものであり、適用における不一致を取り扱っている。これは、「法的に強制可能な相殺の権利を現在有している」の意味の明確化、および一部の総額決済システムが、純額決済と同等とみなされる場合の明確化を含んでいる。当該修正は、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。

IFRS第9号「金融商品」は、2015年1月1日以後開始する年度から発効し、企業がどのように金融資産および金融負債（一部の混合契約を含む。）を分類および測定するべきかを規定している。当該基準は、IAS第39号の規定に比べて、金融資産の分類および測定のアプローチを改善し簡素化している。金融負債の分類および測定に関するIAS第39号の規定の大半が、そのまま引き継がれた。当該基準は、金融資産の分類に首尾一貫したアプローチを適用し、IAS第39号における金融資産の多数の区分（各々の区分に固有の分類基準があった。）を置き換えている。当ファンドは金融資産および金融負債（長期および短期の双方）を引き続き純損益を通じて公正価値で測定するものとして分類すると予想されることから、当該基準は、当ファンドの財政状態および業績に重要な影響を及ぼさないと見込まれている。

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、リターンを最大化を目指すために、市場リスクのエクスポージャーが取られることになる。しかし、トップダウンによるリスク管理により、国ごとに最大エクスポージャーを設定し（従って安全）、それによって該当リスクを制限することで、該当リスクが各有価証券および各市場に分散されるようにしている。その目的は、当ファンドが目論見書に規定されている投資方針を確実に遵守することによって達成される。

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	カテゴリ 1	カテゴリ 2	カテゴリ 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11月30日の感応度分析は、VaRモデルを使用して実施された。VaRモデルの使用により、リスク変数(市場価格リスク、外国為替リスクおよび金利リスクを含む。)間の相互依存性をより反映することが可能である。

VaRを使用して、信頼水準99%、保有期間1ヶ月として算定された、当ファンドの市場リスクは、以下のとおりである。

	2013年11月30日現在	2013年5月31日現在
VaR (%)	8.145%	7.105%
VaR (金額)	4,832,041,174円	4,758,866,125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、レビュー半年間における月次総利回りの最大値、最小値および中央値に着目することである。

以下の表は、OIP0から導出された当半年間の月次総利回りの中央値、最小値および最大値を受けた資本金および剰余金の変動を説明したものである。

	資本金および剰余金の変動			
	2013年11月30日現在		2013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	-	0.00	-
月次総利回り最小値	(1.65)	(45,158,251)	(1.58)	(46,217,579)
月次総利回り最大値	2.86	78,274,301	4.30	125,782,019
<u>ベネズエラ原油ワラント</u>				
月次総利回り中央値	0.00	-	0.40	7,901,808
月次総利回り最小値	(6.90)	(127,457,941)	(2.42)	(47,805,939)
月次総利回り最大値	3.17	58,556,764	4.60	90,870,794

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11月30日現在						
資産						
純損益を通じて公正 価値で測定する金融 資産	2,684,471,220	2,145,843,785	17,334,992,715	32,521,742,432	4,584,080,201	59,271,130,353
発行に係る未収入金	-	-	-	-	2,367,260	2,367,260
現金および現金同等 物	507,514,576	-	-	-	-	507,514,576
その他の債権	-	-	-	-	1,038,432	1,038,432
資産合計	3,191,985,796	2,145,843,785	17,334,992,715	32,521,742,432	4,587,485,893	59,782,050,621
負債						
償還による未払金	-	-	-	-	401,531,897	401,531,897
未払費用	-	-	-	-	55,274,112	55,274,112
負債合計	-	-	-	-	456,806,009	456,806,009
金利感応度ギャップ 合計	3,191,985,796	2,145,843,785	17,334,992,715	32,521,742,432		

	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	4,939,613,996	5,714,266,800	15,937,289,589	25,542,040,291	4,900,615,269	57,033,825,945
発行に係る未収入 金	-	-	-	-	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
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						
償還による未払金	-	-	-	-	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		

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、2013年11月30日および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11月30日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
資産		
ブラジル・リアル	2,859,781,094	3,207,379,309
コロンビア・ペソ	341,408,654	-
コスタリカ・コロソ	1,428,519,228	1,420,839,628
ドイツ・マルク	1,756,445,181	1,707,953,635
ドミニカ・ペソ	519,554,959	1,261,521,070
ユーロ	3,459,486,907	4,693,392,063
ガーナ・セディ	1,474,440,162	1,548,019,358
インド・ルピー	920,468,431	-
日本円	290,353,426	8,630,903,593
ケニア・シリング	693,147,816	-
メキシコ・ヌエボ・ペソ	2,046,326,837	2,215,182,089
新トルコ・リラ	1,866,482,817	1,962,703,244
ナイジェリア・ナイラ	1,866,933,553	1,769,053,553
ロシア・ルーブル	1,330,245,690	1,393,128,994
セルビア・ディナール	789,466,366	702,603,445
南アフリカ・ランド	1,710,063,246	1,131,367,523
ウガンダ・シリング	838,240,699	741,689,760
ウルグアイ・ペソ	1,906,156,972	2,384,539,746
米ドル	33,684,528,583	32,641,417,067
資産合計	59,782,050,621	67,411,694,077
負債		
日本円	441,152,176	185,693,856
シンガポール・ドル	2,646,142	5,351,339
米ドル	13,007,691	241,533,822
負債合計	456,806,009	432,579,017

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、2013年11月30日および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けが、最低でも、ムーディーズによる評価ではB1またはスタンダード・アンド・プアーズによる評価ではB+であることの確保が含まれている。2013年11月30日現在、当ファンドの有価証券の平均信用格付けは、BB (2013年5月31日：BB-)である。

格付(ムーディーズ/スタンダード・アンド・プアーズ)	2013年11月30日現在	2013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 (%)
Aaa / AAA	6.38	-
Baa1 / BBB+	6.34	5.80
Baa2 / BBB	7.36	7.49
Baa3 / BBB-	15.24	17.09
Ba1 / BB+	2.77	2.23
Ba2 / BB	3.35	3.49
Ba3 / BB-	21.73	25.08
B1 / B+	11.50	7.83
B2 / B	12.92	11.59
B3 / B-	5.51	17.56
Caa1 / CCC+	6.48	0.91
D (スタンダード・アンド・プアーズのみ)	0.42	0.93
	100.00	100.00

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11月30日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
債券	54,687,050,152	52,133,210,676
デリバティブ資産	4,584,080,201	4,900,615,269
発行に係る未収入金	2,367,260	1,646,943,740
現金および現金同等物	507,514,576	8,730,924,392
その他の債権	1,038,432	-
合計	59,782,050,621	67,411,694,077

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11月30日現在

2013年5月31日現在

	（日本円）	（日本円）
Astana Finance 7.875% 08/06/2010	248,365,104	532,706,620
	248,365,104	532,706,620

上記の投資は、不履行となっている支払を2013年11月30日現在の公正価値の考慮に入れている。

3.6 流動性リスク

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

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

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

当ファンドは適宜、店頭で取引されるデリバティブ商品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11月30日現在			
償還に係る未払金	401,531,897	-	401,531,897
未払費用	-	55,274,112	55,274,112
合計	401,531,897	55,274,112	456,806,009
2013年5月31日現在			
償還に係る未払金	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

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、次回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(2013年5月31日：1名)であり、当ファンドの78%(2013年5月31日：80%)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11月30日現在

資産	レベル1 (日本円)	レベル2 (日本円)	レベル3 (日本円)	合計 (日本円)
売買目的金融資産：				
- 債券	-	54,440,459,041	246,591,111	54,687,050,152
- デリバティブ資産	-	4,584,080,201	-	4,584,080,201
資産合計	-	59,024,539,242	246,591,111	59,271,130,353

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

以下の表は、2013年11月30日に終了した半年間に係るレベル3の商品の変動を示したものである。

	債券	債券
	2013年11月30日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
期首残高	1,630,069,312	1,425,767,010
購入	-	1,256,073,958
売却	(674,953,750)	(619,498,858)
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損失合計	(708,524,451)	(432,272,798)
期末残高	246,591,111	1,630,069,312
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半年間末現在保有のレベル3の商品に係る未実現損失の変動額	(752,323,454)	(250,236,437)

以下の表は、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。

2013年11月30日現在	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				
発行に係る未収入金	-	2,367,260	-	2,367,260
現金および現金同等物	507,514,576	-	-	507,514,576
その他の債権	-	1,038,432	-	1,038,432
合計	507,514,576	3,405,692	-	510,920,268

負債				
流動負債				
償還に係る未払金	-	401,531,897	-	401,531,897
ブローカーに対する債務	-	-	-	-
未払費用	-	55,274,112	-	55,274,112
合計	-	456,806,009	-	456,806,009

2013年5月31日現在	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				
発行に係る未収入金	-	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
その他の債権	-	-	-	-
合計	8,730,924,392	1,646,943,740	-	10,377,868,132

負債				
流動負債				
償還に係る未払金	-	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

(a) 投資有価証券明細表 - 内訳

	2013年11月30日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
売買目的保有		
債券	54,687,050,152	52,133,210,676
原油ワラント	4,584,080,201	4,900,615,269
売買目的保有合計	59,271,130,353	57,033,825,945

以下の表は、保有する金融資産の要約である。

	2013年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2013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
Province Del Neuquen 7.875% due 26/04/2021 REGS	-	1,229,324,884
Province of Salta Argentina 9.50% due 16/03/2022 REGS	628,578,305	958,771,413
アルゼンチン合計	628,578,305	2,493,212,736
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
Intl Bank of Azerbaijan (Rubrika Finance) 7.2% due 31/10/2016 series REGS	927,563,249	-
アゼルバイジャン合計	927,563,249	935,208,438
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina 0% due 11/12/2021	1,756,445,181	1,707,953,635
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	1,756,445,181	1,707,953,635
中国		
Bright Food Hong Kong Ltd 3.00% due 21/05/2018 REGS	990,354,740	985,793,403
Franshion Development Ltd 6.75% due 15/04/2021 REGS	558,253,035	569,468,170
中国合計	1,548,607,775	1,555,261,573
コロンビア		
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota 7.00% due 17/01/2023 REGS	341,408,654	-
コロンビア合計	341,408,654	-
コスタリカ		
Republic of Costa Rica 10.58% due 23/09/2015 REGS	992,916,044	986,937,497
Republic of Costa Rica 10.58% due 22/06/2016 REGS	435,603,184	433,902,131
コスタリカ合計	1,428,519,228	1,420,839,628
	2013年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2013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
Dominican Republic 11.70% due 06/06/2014 Series REGS	519,554,959	-
Ege Haina Finance Company 9.50% due 26/04/2017 Series REGS	-	493,009,515
ドミニカ共和国合計	519,554,959	1,754,530,585
エクアドル		
Republic of Ecuador 9.375% due 15/12/2015 Series REGS	-	327,944,500
エクアドル合計	-	327,944,500
エジプト		

Arab Republic of Egypt 6.875% due 30/04/2040 Series REGS エジプト合計	-	191,281,601
	-	191,281,601
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035 エルサルバドル合計	1,820,103,964	1,895,999,498
	1,820,103,964	1,895,999,498
グルジア		
Georgian Oil & Gas Corp 6.875% due 16/05/2017 REGS Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022 Republic of Georgia 6.875% due 12/04/2021 REGS グルジア合計	610,001,232 354,854,496 1,280,784,302 2,245,640,030	829,516,695 384,173,223 1,365,873,646 2,579,563,564
ガーナ		
Ghana Govt 23.00% due 21/08/2017 ガーナ合計	1,474,440,162 1,474,440,162	1,548,019,358 1,548,019,358
ホンジュラス		
Honduras Government 7.50% due 15/03/2024 REGS ホンジュラス合計	359,401,140 359,401,140	371,982,253 371,982,253
ハンガリー		
Hungarian Development Bank 5.875% due 31/05/2016 ハンガリー合計	- -	1,270,231,477 1,270,231,477
	2013年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2013年5月31日現在 公正価値 (日本円)
インド		
Indian Oil Corp Ltd 5.625% due 02/08/2021 REGS インド合計	640,731,065 640,731,065	693,694,983 693,694,983
インドネシア		
Republic of Indonesia 3.375% due 15/04/2023 REGS Republic of Indonesia 5.375% due 17/10/2023 REGS インドネシア合計	619,705,777 682,428,059 1,302,133,836	- - -
イラク		
Republic of Iraq 5.80% due 15/01/2028 イラク合計	1,509,524,623 1,509,524,623	1,317,324,069 1,317,324,069
コートジボワール		
Ivory Coast 2.50% due 31/12/2032 Series REGS コートジボワール合計	- -	398,376,950 398,376,950
ヨルダン		
Dev Inv Jordan Arm Force 6.14% due 16/12/2019 ヨルダン合計	2,335,864,154 2,335,864,154	2,491,745,425 2,491,745,425
カザフスタン		
Astana Finance 7.875% due 08/06/2010(注記 3.5) Kazmunaigaz Finance SUB 11.75% due 23/01/2015 Series REGS カザフスタン合計	248,365,104 - 248,365,104	532,706,620 716,038,842 1,248,745,462
ケニア		
Kenya Treasury Bill due 14/04/2014 Kenya Treasury Bill due 11/08/2014 Kenya Treasury Bond 11.00% 15/09/2025 ケニア合計	164,178,367 158,776,990 370,192,459 693,147,816	- - - -
マケドニア		
Former Yugoslav Republic of Macedonia 4.625% due 08/12/2015 マケドニア合計	938,805,171 938,805,171	855,978,396 855,978,396
メキシコ		
Mexican Bondes Desarroll FRN due 15/01/2015 Series LD Mexican Udibonos 4.00% due 15/11/2040 Index Linked メキシコ合計	433,069,824 1,612,060,018 2,045,129,842	2,201,383,082 - 2,201,383,082
	2013年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2013年5月31日現在 公正価値 (日本円)
モンゴル		

Mongolia Government International Bond 5.125% due 05/12/2022 series REGS	717,038,250	-
モンゴル合計	717,038,250	-
モンテネグロ		
Republic of Montenegro 7.875% due 14/09/2015	947,323,445	916,065,542
モンテネグロ合計	947,323,445	916,065,542
モザンビーク		
Mozambique Ematum Finance 6.305% due 11/09/2020 SINK	1,201,519,570	-
モザンビーク合計	1,201,519,570	-
ナイジェリア		
Nigeria Treasury Bill due 13/06/2013	-	441,596,205
Nigeria Treasury Bill due 01/08/2013	-	209,753,601
Government of Nigeria 16.39% due 27/01/2022	1,293,025,997	591,444,273
Government of Nigeria 10.00% due 23/07/2030	573,907,556	294,707,038
ナイジェリア合計	1,866,933,553	1,537,501,117
パラグアイ		
Republic of Paraguay 4.625% due 25/01/2023 REGS	651,473,677	154,903,158
パラグアイ合計	651,473,677	154,903,158
ロシア		
Federal Grid Co OJSC/Finance Ltd 8.446% due 13/03/2019 REGS	691,960,508	716,565,971
Gaz Capital SA 9.25% due 23/04/2019 series REGS	1,399,662,274	1,163,774,486
RSHB Capital (RUSS AGRIC BK) 6.00% due 03/06/2021 REGS	1,351,936,734	1,000,589,319
RZD Capital Ltd 8.30% due 02/04/2019 REGS	638,285,182	676,563,023
RZD Capital Ltd 5.70% due 05/04/2022 REGS	1,318,903,855	825,962,802
ロシア合計	5,400,748,553	4,383,455,601
ルワンダ		
Republic of Rwanda 6.625% due 02/05/2023 REGS	684,969,542	-
ルワンダ合計	684,969,542	-
セルビア		
Serbia Treasury Bill due 13/09/2013	-	702,603,445
Serbia Treasury Bill due 19/09/2014 series 53W	789,466,366	-
セルビア合計	789,466,366	702,603,445
南アフリカ		
Republic of South Africa 8.00% due 21/12/2018	1,139,339,825	514,160,112
Republic of South Africa 2.25% due 31/01/2038 Index Linked	570,717,781	592,238,800
南アフリカ合計	1,710,057,606	1,106,398,912
	2013年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2013年5月31日現在 公正価値 (日本円)
スリランカ		
National Savings Bank 8.875% due 18/09/2018 REGS	1,088,053,429	-
スリランカ合計	1,088,053,429	-
国際機関		
International Bank Recon & Dev 6.00% due 15/09/2016	2,859,781,094	3,207,379,309
International Finance Corporation 7.75% due 03/12/2016 series GMTN	920,468,431	-
国際機関合計	3,780,249,525	3,207,379,309
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
トリニダード・トバゴ		
Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 Series REGS	2,938,394,107	2,380,374,184
トリニダード・トバゴ合計	2,938,394,107	2,380,374,184
チュニジア		
Banque Cent de Tunisie 4.50% due 22/06/2020 REGS	1,324,993,187	789,704,027
チュニジア合計	1,324,993,187	789,704,027
トルコ		
Turkey Government Bond FRN due 26/02/2014	-	1,329,777,293
Turkey Government Bond FRN due 04/01/2017	513,867,103	538,322,947
Turkey Government Bond 4.00% due 29/04/2015 Index Linked	1,352,615,714	-
Turkiye Halk Bankasi As 3.875% due 05/02/2020 REGS	1,005,567,364	602,703,834
トルコ合計	2,872,050,181	2,470,804,074

ウクライナ

City of KYIV (CSFB) 8.00% due 06/11/2015	357,517,612	378,254,590
State Savings Bank of Ukraine 8.25% due 10/03/2016	1,110,596,128	1,222,074,335
State Savings Bank Of Ukraine 8.875% due 20/03/2018 REGS	556,606,309	641,795,067
Ukraine 9.25% 24/07/2017 REG S	1,189,841,390	1,341,752,536
ウクライナ合計	3,214,561,439	3,583,876,528

ウガンダ

Uganda Treasury Bills 0% due 13/06/2013	-	55,974,454
Uganda Treasury Bills 0% due 12/12/2013	246,591,111	220,141,607
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 01/01/2015	256,848,694	244,387,461
Republic of Uganda Government Bonds 10.75% due 21/05/2015	99,900,867	-
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 21/04/2016	114,333,747	109,968,439
Republic of Uganda Government Bonds 10.75% due 22/02/2018	111,422,073	108,917,460
ウガンダ合計	829,096,492	739,389,421

ウルグアイ

Republica Orient Uruguay 3.70% due 26/06/2037	1,906,156,972	2,384,539,746
ウルグアイ合計	1,906,156,972	2,384,539,746

債券合計

54,687,050,152	52,133,210,676
----------------	----------------

2013年11月30日現在 公正価値 (日本円)	2013年5月31日現在 公正価値 (日本円)
--------------------------------	-------------------------------

原油ワラント

ナイジェリア

Central Bank of Nigeria due 15/11/2020	2,736,863,669	2,925,163,235
ナイジェリア合計	2,736,863,669	2,925,163,235

ベネズエラ

Republic of Venezuela - Oil due 15/04/2020 Series USD	1,847,216,532	1,975,452,034
ベネズエラ合計	1,847,216,532	1,975,452,034

原油ワラント合計

4,584,080,201	4,900,615,269
---------------	---------------

投資ポートフォリオ

59,271,130,353	57,033,825,945
----------------	----------------

(b) 投資有価証券明細表 - 半年間の損益

	2013年11月30日現在 (日本円)	2012年11月30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	2,398,263,253	(533,399,910)
- 未実現の変動額	(2,046,112,200)	8,092,189,657
利益合計	352,151,053	7,558,789,747

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。

原油ワラント

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

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

6 現金および現金同等物

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

	2013年11月30日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
現金および現金同等物	507,514,576	8,730,924,392

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 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。

8 未払費用

	2013年11月30日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
未払運用報酬	39,620,279	43,832,721
未払受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	7,794,483	8,072,278
未払保管受託銀行報酬	5,213,208	2,126,631
その他の未払費用	2,646,142	5,351,339
	<u>55,274,112</u>	<u>59,382,969</u>

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。

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。

当半年間に支払われた分配金は、以下で構成されている。

	権利付最終日	分配金額 (日本円)
2013年11月30日		
受益証券1口当たり分配金90円	2013年6月6日	866,802,150
受益証券1口当たり分配金90円	2013年7月3日	878,482,440
受益証券1口当たり分配金90円	2013年8月5日	874,547,820
受益証券1口当たり分配金90円	2013年9月3日	870,175,440
受益証券1口当たり分配金90円	2013年10月3日	853,929,450
受益証券1口当たり分配金90円	2013年11月5日	864,047,880
		<u>5,207,985,180</u>
2012年11月30日		
受益証券1口当たり分配金90円	2012年6月6日	700,363,080
受益証券1口当たり分配金90円	2012年7月3日	672,773,580
受益証券1口当たり分配金90円	2012年8月3日	695,323,440
受益証券1口当たり分配金90円	2012年9月4日	706,425,210
受益証券1口当たり分配金90円	2012年10月3日	708,391,620
受益証券1口当たり分配金90円	2012年11月5日	703,047,960
		<u>4,186,324,890</u>

10 関連当事者との取引

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

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

(a) 運用報酬

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

(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬

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

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

(c) 保管受託銀行報酬

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

(d) 費用の払戻し

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

以下の表は、当半年間の関連当事者との取引の詳細である。

	費用		債務	
	2013年11月30日現在 (日本円)	2012年11月30日現在 (日本円)	2013年11月30日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
(a) 運用報酬	122,252,870	89,902,867	39,620,279	43,832,721
(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	30,372,804	23,246,168	7,794,483	8,072,278
(c) 保管受託銀行報酬	10,074,135	10,924,322	5,213,208	2,126,631
費用合計	162,699,809	124,073,357	52,627,970	54,031,630
			債権	
(d) 費用 払戻し	(1,038,432)	(3,497,455)	1,038,432	-

11 後発事象

2013年11月30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

	平成25年10月21日現在	平成26年 4月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	-	2,776,408
コール・ローン	664,970,773	659,379,678
国債証券	61,365,491,317	56,056,845,671
未収入金	392,347,253	-
未収利息	521,108,244	583,032,030
前払費用	109,936,005	53,918,418
流動資産合計	63,053,853,592	57,355,952,205
資産合計	63,053,853,592	57,355,952,205
負債の部		
流動負債		
前受金	390,343,605	-
未払解約金	10,000,000	100,000,000
流動負債合計	400,343,605	100,000,000
負債合計	400,343,605	100,000,000
純資産の部		
元本等		
元本	33,171,251,198	27,781,925,943
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	29,482,258,789	29,474,026,262
元本等合計	62,653,509,987	57,255,952,205
純資産合計	62,653,509,987	57,255,952,205
負債純資産合計	63,053,853,592	57,355,952,205

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10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4月21日現在
1. 計算日における受益権の総数 33,171,251,198口	1. 計算日における受益権の総数 27,781,925,943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 1.8888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 2.0609円

平成25年10月21日現在		平成26年 4月21日現在	
(1万口当たり純資産額)	(18,888円)	(1万口当たり純資産額)	(20,609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25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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	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。	同左

区分	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成25年10月21日現在	平成26年 4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 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。	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 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4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	39,142,475,199円	33,171,251,198円
期中追加設定元本額	151,534,847円	15,025,197円
期中一部解約元本額	6,122,758,848円	5,404,350,452円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	20,776,359,308円	17,244,522,120円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	2,301,816,597円	2,026,066,222円

区分	平成25年10月21日現在	平成26年 4月21日現在
新光7資産バランスファンド	626,195,083円	556,171,822円
海外国債ファンド（1年決算型）	21,162,115円	29,789,038円
海外国債ファンド（変額年金）	9,445,718,095円	7,920,944,765円
グローバル・ナビ	- 円	4,431,976円
合計	33,171,251,198円	27,781,925,943円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成25年10月21日現在	平成26年 4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	1,266,832,006	853,277,685
合計	1,266,832,006	853,277,685

(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	40,400,000.00	40,447,343.94	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	6,900,000.00	7,267,640.61	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	9,500,000.00	9,338,203.11	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	2,100,000.00	2,923,593.75	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	9,700,000.00	9,415,820.34	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	7,000,000.00	6,768,125.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	6,300,000.00	5,945,625.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	5,200,000.00	4,837,625.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	8,600,000.00	7,959,031.24	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	12,100,000.00	11,509,179.74	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	13,900,000.00	12,880,304.74	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	1,900,000.00	2,477,273.44	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	11,400,000.00	11,238,796.92	

		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	14,500,000.00	14,564,570.37	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	10,500,000.00	10,520,507.85	
米ドル建小計			160,000,000.00	158,093,641.05 (16,228,312,253)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	2,800,000.00	3,025,400.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	3,100,000.00	3,226,914.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	3,500,000.00	3,263,435.00	
カナダドル建小計			9,400,000.00	9,515,749.00 (886,201,704)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	5,000,000.00	5,127,100.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	5,700,000.00	6,591,480.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-21/09/04	4,800,000.00	5,213,760.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-22/01/04	6,000,000.00	6,391,800.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-22/07/04	7,200,000.00	7,509,600.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	5,400,000.00	5,508,540.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	5,400,000.00	5,479,380.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	5,400,000.00	5,462,100.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	5,400,000.00	5,681,340.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	2,800,000.00	4,032,000.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	3,900,000.00	3,990,480.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/05/01	4,700,000.00	5,103,730.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	10,200,000.00	11,080,260.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-21/09/01	9,200,000.00	10,586,440.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-22/03/01	6,800,000.00	7,922,000.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/09/01	7,200,000.00	8,629,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	7,700,000.00	9,221,520.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	6,500,000.00	7,285,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	8,900,000.00	10,174,480.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	4,000,000.00	5,980,800.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01	8,400,000.00	9,393,720.00	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	5,000,000.00	5,096,000.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	11,600,000.00	13,494,280.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	12,200,000.00	13,779,900.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	11,200,000.00	12,412,960.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	8,100,000.00	8,447,490.00	
		FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	3,600,000.00	5,619,240.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	8,700,000.00	8,693,040.00	
		FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	11,300,000.00	13,700,120.00	
ユーロ建小計			202,300,000.00	227,607,960.00 (32,267,980,489)	
英ポンド	国債証券	TSY-8.0%-21/06/07	4,500,000.00	6,215,895.00	
		TSY-3.75%-21/09/07	7,700,000.00	8,460,606.00	
		TSY-4.0%-22/03/07	5,200,000.00	5,813,808.00	
		TSY-1.75%-22/09/07	9,700,000.00	9,143,511.00	
		TSY-2.25%-23/09/07	9,400,000.00	9,085,006.00	
英ポンド建小計			36,500,000.00	38,718,826.00 (6,674,351,225)	
合計				56,056,845,671 (56,056,845,671)	

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 15銘柄	28.3%	28.9%
カナダドル	債券 3銘柄	1.5%	1.6%
ユーロ	債券 29銘柄	56.4%	57.6%
英ポンド	債券 5銘柄	11.7%	11.9%

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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10月21日現在	平成26年 4月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	576,406,064	655,856,129
株式	14,303,173,200	13,023,623,950
派生商品評価勘定	13,601,600	794,750
未収配当金	103,600,449	129,588,267
未収利息	626	697
前払金	-	14,675,000
流動資産合計	14,996,781,939	13,824,538,793
資産合計	14,996,781,939	13,824,538,793
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	287,350	17,163,000
前受金	8,972,000	-
未払解約金	-	9,900,000
流動負債合計	9,259,350	27,063,000
負債合計	9,259,350	27,063,000
純資産の部		
元本等		
元本	10,407,539,324	9,811,465,885
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,579,983,265	3,986,009,908
元本等合計	14,987,522,589	13,797,475,793
純資産合計	14,987,522,589	13,797,475,793
負債純資産合計	14,996,781,939	13,824,538,793

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10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4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 147,154,700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 137,963,500円
2. 計算日における受益権の総数 10,407,539,324口	2. 計算日における受益権の総数 9,811,465,885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 1.4401円 (1万口当たり純資産額) (14,401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 1.4063円 (1万口当たり純資産額) (14,063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25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスクを有しております。	同左

区分	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日
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・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>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成25年10月21日現在	平成26年 4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ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

平成25年10月21日現在	平成26年 4月21日現在
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。	同左
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。	

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4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	12,075,546,870円	10,407,539,324円
期中追加設定元本額	182,695,893円	244,412,995円
期中一部解約元本額	1,850,703,439円	840,486,434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	541,875,861円	498,106,875円
新光7資産バランスファンド	864,493,408円	783,372,885円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	1,021,424,993円	796,660,298円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	2,419,528,318円	2,398,031,312円
新光ワールドバランスファンドVA(適格機関投資家私募)	2,475,906,263円	2,377,985,161円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	206,339,736円	159,638,394円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	2,125,484,837円	2,038,921,838円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	752,485,908円	739,891,469円
グローバル・ナビ	- 円	18,857,653円
合計	10,407,539,324円	9,811,465,885円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年10月21日現在	平成26年 4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	3,631,608,098	1,081,277,510
合計	3,631,608,098	1,081,277,510

(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10月21日現在				平成26年 4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	654,935,750	-	668,250,000	13,314,250	778,493,250	-	762,125,000	16,368,250
東証東証株価指数先物	654,935,750	-	668,250,000	13,314,250	778,493,250	-	762,125,000	16,368,250
合計	654,935,750	-	668,250,000	13,314,250	778,493,250	-	762,125,000	16,368,250

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	5,000	263.00	1,315,000	
日本水産	10,800	229.00	2,473,200	
マルハニチロ	1,700	1,561.00	2,653,700	
サカタのタネ	1,300	1,415.00	1,839,500	
ホクト	1,000	2,048.00	2,048,000	
住石ホールディングス	1,400	125.00	175,000	
日鉄鉱業	3,000	389.00	1,167,000	
三井松島産業	13,000	153.00	1,989,000	
国際石油開発帝石	42,700	1,501.00	64,092,700	
日本海洋掘削	200	4,185.00	837,000	

石油資源開発	1,300	3,690.00	4,797,000	
ショーボンドホールディングス	800	4,530.00	3,624,000	
ミライト・ホールディングス	2,500	880.00	2,200,000	
安藤・間	5,900	431.00	2,542,900	
東急建設	3,100	442.00	1,370,200	
コムシスホールディングス	4,300	1,714.00	7,370,200	
ミサワホーム	900	1,287.00	1,158,300	
高松コンストラクショングループ	1,100	1,782.00	1,960,200	
東建コーポレーション	300	4,860.00	1,458,000	
大成建設	44,000	476.00	20,944,000	
大林組	26,000	642.00	16,692,000	
清水建設	27,000	537.00	14,499,000	
飛島建設	7,500	151.00	1,132,500	
長谷工コーポレーション	11,700	648.00	7,581,600	
鹿島建設	39,000	388.00	15,132,000	
不動テトラ	9,200	230.00	2,116,000	
鉄建建設	5,000	295.00	1,475,000	
日鉄住金テックスエンジ	1,000	405.00	405,000	
西松建設	12,000	365.00	4,380,000	
三井住友建設	23,600	109.00	2,572,400	
大豊建設	3,000	396.00	1,188,000	
前田建設工業	5,000	734.00	3,670,000	
奥村組	8,000	459.00	3,672,000	
東鉄工業	1,100	1,925.00	2,117,500	
戸田建設	10,000	342.00	3,420,000	
熊谷組	8,000	252.00	2,016,000	
北野建設	4,000	248.00	992,000	
矢作建設工業	1,400	956.00	1,338,400	
大東建託	3,300	10,035.00	33,115,500	
N I P P O	2,000	1,488.00	2,976,000	
東亜道路工業	3,000	431.00	1,293,000	
前田道路	3,000	1,521.00	4,563,000	
日本道路	3,000	501.00	1,503,000	
東亜建設工業	8,000	197.00	1,576,000	
若築建設	6,000	142.00	852,000	
東洋建設	4,000	360.00	1,440,000	
五洋建設	10,500	333.00	3,496,500	
大林道路	1,000	566.00	566,000	
世紀東急工業	6,000	120.00	720,000	
福田組	1,000	469.00	469,000	
住友林業	6,000	1,053.00	6,318,000	
日成ビルド工業	3,000	242.00	726,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	4,000	115.00	460,000	

バコーポレーション	500	417.00	208,500	
パナホーム	3,000	663.00	1,989,000	
大和ハウス工業	24,000	1,714.00	41,136,000	
ライト工業	1,900	927.00	1,761,300	
積水ハウス	23,100	1,263.00	29,175,300	
西部電気工業	3,000	453.00	1,359,000	
中電工	1,300	1,617.00	2,102,100	
関電工	4,000	500.00	2,000,000	
きんでん	6,000	945.00	5,670,000	
住友電設	1,000	1,219.00	1,219,000	
日本電設工業	1,000	1,376.00	1,376,000	
協和エクシオ	3,400	1,358.00	4,617,200	
新日本空調	900	618.00	556,200	
九電工	2,000	823.00	1,646,000	
三機工業	3,000	618.00	1,854,000	
日揮	9,000	3,462.00	31,158,000	
中外炉工業	3,000	214.00	642,000	
太平電業	2,000	632.00	1,264,000	
高砂熱学工業	2,500	979.00	2,447,500	
朝日工業社	1,000	367.00	367,000	
大気社	1,200	2,148.00	2,577,600	
日比谷総合設備	1,100	1,331.00	1,464,100	
東芝プラントシステム	1,400	1,486.00	2,080,400	
東洋エンジニアリング	5,000	454.00	2,270,000	
千代田化工建設	7,000	1,413.00	9,891,000	
新興プランテック	1,800	764.00	1,375,200	
日本製粉	5,000	560.00	2,800,000	
日清製粉グループ本社	8,800	1,165.00	10,252,000	
鳥越製粉	1,300	688.00	894,400	
協同飼料	11,000	109.00	1,199,000	
中部飼料	2,300	602.00	1,384,600	
三井製糖	3,000	421.00	1,263,000	
森永製菓	9,000	225.00	2,025,000	
中村屋	7,000	403.00	2,821,000	
江崎グリコ	3,000	1,321.00	3,963,000	
不二家	10,000	189.00	1,890,000	
山崎製パン	6,000	1,201.00	7,206,000	
モロゾフ	3,000	312.00	936,000	
亀田製菓	500	2,869.00	1,434,500	
カルビー	3,200	2,510.00	8,032,000	
森永乳業	7,000	378.00	2,646,000	
ヤクルト本社	5,100	5,240.00	26,724,000	
明治ホールディングス	2,600	6,310.00	16,406,000	

雪印メグミルク	1,900	1,394.00	2,648,600
プリマハム	2,000	224.00	448,000
日本ハム	6,000	1,735.00	10,410,000
伊藤ハム	5,000	453.00	2,265,000
丸大食品	1,000	302.00	302,000
サッポロホールディングス	14,000	432.00	6,048,000
アサヒグループホールディングス	17,700	2,901.00	51,347,700
キリンホールディングス	38,000	1,421.00	53,998,000
宝ホールディングス	7,000	785.00	5,495,000
オエノンホールディングス	2,000	255.00	510,000
コカ・コーラウエスト	2,700	1,820.00	4,914,000
コカ・コーライーストジャパン	1,800	2,264.00	4,075,200
サントリー食品インターナショナル	4,500	3,490.00	15,705,000
ダイトードリンコ	400	4,245.00	1,698,000
伊藤園	2,400	2,296.00	5,510,400
キーコーヒー	400	1,562.00	624,800
不二製油	2,100	1,399.00	2,937,900
J - オイルミルズ	2,000	276.00	552,000
キッコーマン	7,000	1,992.00	13,944,000
味の素	21,000	1,519.00	31,899,000
キュービー	4,500	1,439.00	6,475,500
ハウス食品グループ本社	3,100	1,677.00	5,198,700
カゴメ	3,400	1,740.00	5,916,000
焼津水産化学工業	1,900	946.00	1,797,400
アリアケジャパン	800	2,479.00	1,983,200
ニチレイ	9,000	482.00	4,338,000
東洋水産	4,000	3,265.00	13,060,000
日清食品ホールディングス	3,400	4,750.00	16,150,000
ロック・フィールド	1,300	1,929.00	2,507,700
日本たばこ産業	48,700	3,220.00	156,814,000
片倉工業	1,500	1,262.00	1,893,000
ゲンゼ	7,000	281.00	1,967,000
東洋紡	35,000	166.00	5,810,000
ユニチカ	22,000	58.00	1,276,000
富士紡ホールディングス	7,000	264.00	1,848,000
日清紡ホールディングス	5,000	846.00	4,230,000
倉敷紡績	8,000	175.00	1,400,000
シキボウ	11,000	116.00	1,276,000
日本毛織	3,000	755.00	2,265,000
ダイトーリミテッド	700	628.00	439,600
帝国繊維	1,200	1,500.00	1,800,000
帝人	34,000	253.00	8,602,000
東レ	60,000	680.00	40,800,000

サカイオーベックス	1,000	181.00	181,000	
住江織物	2,000	306.00	612,000	
日本フェルト	1,700	443.00	753,100	
アツギ	20,000	114.00	2,280,000	
セーレン	2,200	860.00	1,892,000	
小松精練	4,000	509.00	2,036,000	
ワコールホールディングス	5,000	1,002.00	5,010,000	
ホギメディカル	500	5,340.00	2,670,000	
T S Iホールディングス	3,900	679.00	2,648,100	
三陽商会	9,000	293.00	2,637,000	
オンワードホールディングス	5,000	677.00	3,385,000	
ゴールドウイン	3,000	500.00	1,500,000	
デサント	2,000	785.00	1,570,000	
特種東海製紙	3,000	220.00	660,000	
王子ホールディングス	36,000	448.00	16,128,000	
日本製紙	4,200	1,966.00	8,257,200	
三菱製紙	11,000	90.00	990,000	
北越紀州製紙	5,500	489.00	2,689,500	
大王製紙	3,000	1,130.00	3,390,000	
レンゴー	7,000	531.00	3,717,000	
トーモク	6,000	287.00	1,722,000	
ザ・パック	1,200	1,981.00	2,377,200	
クラレ	13,000	1,159.00	15,067,000	
旭化成	51,000	690.00	35,190,000	
昭和電工	55,000	140.00	7,700,000	
住友化学	60,000	387.00	23,220,000	
住友精化	2,000	659.00	1,318,000	
日産化学工業	5,600	1,563.00	8,752,800	
ラサ工業	5,000	131.00	655,000	
クレハ	6,000	501.00	3,006,000	
石原産業	15,000	99.00	1,485,000	
日本曹達	5,000	582.00	2,910,000	
東ソー	22,000	406.00	8,932,000	
トクヤマ	13,000	326.00	4,238,000	
セントラル硝子	8,000	336.00	2,688,000	
東亜合成	10,000	433.00	4,330,000	
ダイソー	7,000	346.00	2,422,000	
電気化学工業	16,000	357.00	5,712,000	
信越化学工業	14,700	6,158.00	90,522,600	
日本カーバイド工業	4,000	219.00	876,000	
堺化学工業	5,000	303.00	1,515,000	
エア・ウォーター	7,000	1,428.00	9,996,000	
大陽日酸	11,000	834.00	9,174,000	

日本パーカライジング	2,000	2,333.00	4,666,000
四国化成工業	2,000	712.00	1,424,000
ステラ ケミファ	700	1,434.00	1,003,800
保土谷化学工業	3,000	201.00	603,000
日本触媒	7,000	1,165.00	8,155,000
大日精化工業	3,000	431.00	1,293,000
カネカ	10,000	610.00	6,100,000
三菱瓦斯化学	13,000	595.00	7,735,000
三井化学	37,000	248.00	9,176,000
J S R	7,500	1,816.00	13,620,000
東京応化工業	1,600	2,343.00	3,748,800
三菱ケミカルホールディングス	51,300	421.00	21,597,300
日本合成化学工業	2,000	718.00	1,436,000
ダイセル	11,000	857.00	9,427,000
住友ベークライト	6,000	398.00	2,388,000
積水化学工業	17,000	1,050.00	17,850,000
日本ゼオン	6,000	965.00	5,790,000
アイカ工業	2,300	2,202.00	5,064,600
宇部興産	41,000	182.00	7,462,000
積水樹脂	1,200	1,359.00	1,630,800
タキロン	3,000	407.00	1,221,000
日立化成	3,500	1,455.00	5,092,500
リケンテクノス	1,000	535.00	535,000
大倉工業	3,000	300.00	900,000
群栄化学工業	3,000	377.00	1,131,000
日本化薬	6,000	1,227.00	7,362,000
日本精化	900	633.00	569,700
A D E K A	3,500	1,115.00	3,902,500
日油	7,000	730.00	5,110,000
花王	21,300	3,660.00	77,958,000
第一工業製薬	2,000	305.00	610,000
三洋化成工業	3,000	647.00	1,941,000
大日本塗料	8,000	157.00	1,256,000
日本ペイント	7,000	1,644.00	11,508,000
関西ペイント	10,000	1,485.00	14,850,000
中国塗料	3,000	643.00	1,929,000
藤倉化成	2,200	578.00	1,271,600
太陽ホールディングス	700	3,060.00	2,142,000
D I C	29,000	274.00	7,946,000
サカタインクス	1,700	902.00	1,533,400
東洋インキ S C ホールディングス	7,000	434.00	3,038,000
富士フイルムホールディングス	18,800	2,752.00	51,737,600
資生堂	14,600	1,850.00	27,010,000

ライオン	9,000	558.00	5,022,000	
高砂香料工業	3,000	518.00	1,554,000	
マンダム	800	3,630.00	2,904,000	
ミルボン	400	3,380.00	1,352,000	
ファンケル	1,900	1,130.00	2,147,000	
コーセー	1,300	3,205.00	4,166,500	
ドクターシーラボ	600	3,310.00	1,986,000	
シーボン	800	2,184.00	1,747,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	800	3,955.00	3,164,000	
コニシ	1,000	1,812.00	1,812,000	
長谷川香料	1,000	1,567.00	1,567,000	
小林製薬	1,300	6,180.00	8,034,000	
日本高純度化学	1,000	2,123.00	2,123,000	
JCU	300	6,270.00	1,881,000	
新田ゼラチン	300	1,020.00	306,000	
アース製薬	600	3,640.00	2,184,000	
イハラケミカル工業	2,000	758.00	1,516,000	
大成ラミック	900	2,502.00	2,251,800	
クミアイ化学工業	2,000	680.00	1,360,000	
日本農薬	2,000	1,479.00	2,958,000	
アキレス	11,000	136.00	1,496,000	
有沢製作所	2,100	496.00	1,041,600	
日東電工	6,800	4,829.00	32,837,200	
レック	1,000	1,064.00	1,064,000	
きもと	1,600	344.00	550,400	
藤森工業	700	2,622.00	1,835,400	
前澤化成工業	2,100	1,050.00	2,205,000	
エフピコ	800	3,150.00	2,520,000	
天馬	300	1,323.00	396,900	
東リ	8,000	197.00	1,576,000	
ニフコ	1,800	2,971.00	5,347,800	
日本バルカー工業	9,000	274.00	2,466,000	
ユニ・チャーム	5,000	5,735.00	28,675,000	
協和発酵キリン	10,000	1,150.00	11,500,000	
武田薬品工業	30,800	4,525.00	139,370,000	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	94,500	1,109.00	104,800,500	
大日本住友製薬	5,800	1,593.00	9,239,400	
塩野義製薬	12,800	1,797.00	23,001,600	
田辺三菱製薬	6,800	1,393.00	9,472,400	
あすか製薬	1,500	900.00	1,350,000	
日本新薬	2,000	1,828.00	3,656,000	
中外製薬	8,200	2,530.00	20,746,000	

科研製薬	3,000	1,718.00	5,154,000	
エーザイ	10,100	3,938.00	39,773,800	
ロート製薬	3,400	1,777.00	6,041,800	
小野薬品工業	3,700	8,170.00	30,229,000	
久光製薬	2,500	4,290.00	10,725,000	
持田製薬	600	7,150.00	4,290,000	
参天製薬	3,000	4,595.00	13,785,000	
扶桑薬品工業	6,000	329.00	1,974,000	
ツムラ	2,400	2,455.00	5,892,000	
日医工	1,900	1,594.00	3,028,600	
キッセイ薬品工業	1,500	2,402.00	3,603,000	
生化学工業	1,700	1,253.00	2,130,100	
栄研化学	1,000	1,572.00	1,572,000	
鳥居薬品	600	2,939.00	1,763,400	
JCRファーマ	200	2,054.00	410,800	
東和薬品	400	4,235.00	1,694,000	
沢井製薬	1,300	6,470.00	8,411,000	
ゼリア新薬工業	1,300	2,152.00	2,797,600	
第一三共	25,900	1,741.00	45,091,900	
キョーリン製薬ホールディングス	2,200	1,912.00	4,206,400	
大幸薬品	600	1,528.00	916,800	
大塚ホールディングス	16,300	2,921.00	47,612,300	
大正製薬ホールディングス	2,000	7,530.00	15,060,000	
日本コークス工業	14,600	121.00	1,766,600	
昭和シェル石油	7,300	986.00	7,197,800	
コスモ石油	23,000	192.00	4,416,000	
ニチレキ	2,000	992.00	1,984,000	
東燃ゼネラル石油	12,000	934.00	11,208,000	
ユシロ化学工業	600	1,019.00	611,400	
富士石油	2,300	288.00	662,400	
出光興産	3,900	2,210.00	8,619,000	
JXホールディングス	91,100	528.00	48,100,800	
横浜ゴム	9,000	925.00	8,325,000	
東洋ゴム工業	7,000	759.00	5,313,000	
ブリヂストン	25,700	3,525.00	90,592,500	
住友ゴム工業	6,400	1,408.00	9,011,200	
ニッタ	800	2,102.00	1,681,600	
東海ゴム工業	1,500	1,037.00	1,555,500	
三ツ星ベルト	4,000	540.00	2,160,000	
バンドー化学	5,000	400.00	2,000,000	
日東紡績	6,000	441.00	2,646,000	
旭硝子	40,000	584.00	23,360,000	
日本板硝子	40,000	141.00	5,640,000	

石塚硝子	1,000	209.00	209,000	
日本山村硝子	8,000	175.00	1,400,000	
日本電気硝子	17,000	543.00	9,231,000	
住友大阪セメント	16,000	424.00	6,784,000	
太平洋セメント	48,000	368.00	17,664,000	
デイ・シイ	1,500	548.00	822,000	
日本ヒューム	2,000	760.00	1,520,000	
日本コンクリート工業	2,000	426.00	852,000	
ジャパンパイル	1,100	856.00	941,600	
東海カーボン	8,000	336.00	2,688,000	
日本カーボン	9,000	191.00	1,719,000	
東洋炭素	800	2,551.00	2,040,800	
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	246.00	2,214,000	
TOTO	12,000	1,457.00	17,484,000	
日本碍子	10,000	2,014.00	20,140,000	
日本特殊陶業	7,000	2,410.00	16,870,000	
MARUWA	100	3,930.00	393,000	
フジミインコーポレーテッド	1,300	1,229.00	1,597,700	
ニチアス	4,000	704.00	2,816,000	
ニチハ	1,000	1,132.00	1,132,000	
新日鐵住金	347,000	276.00	95,772,000	
神戸製鋼所	114,000	131.00	14,934,000	
合同製鐵	2,000	142.00	284,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	20,900	1,953.00	40,817,700	
日新製鋼	3,500	1,083.00	3,790,500	
東京製鐵	4,500	519.00	2,335,500	
共英製鋼	800	1,851.00	1,480,800	
大和工業	1,700	3,120.00	5,304,000	
東京鐵鋼	3,000	401.00	1,203,000	
淀川製鋼所	6,000	411.00	2,466,000	
東洋鋼鈹	2,000	499.00	998,000	
丸一鋼管	2,700	2,583.00	6,974,100	
大同特殊鋼	14,000	502.00	7,028,000	
日本冶金工業	6,500	293.00	1,904,500	
山陽特殊製鋼	4,000	435.00	1,740,000	
愛知製鋼	4,000	404.00	1,616,000	
日立金属	7,000	1,394.00	9,758,000	
大平洋金属	6,000	491.00	2,946,000	
日本電工	6,000	279.00	1,674,000	
栗本鐵工所	6,000	220.00	1,320,000	
三菱製鋼	6,000	216.00	1,296,000	
日本軽金属ホールディングス	18,600	134.00	2,492,400	
三井金属鉱業	21,000	250.00	5,250,000	

東邦亜鉛	5,000	335.00	1,675,000
三菱マテリアル	51,000	293.00	14,943,000
住友金属鉱山	21,000	1,441.00	30,261,000
DOWAホールディングス	9,000	873.00	7,857,000
古河機械金属	14,000	186.00	2,604,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	900	2,025.00	1,822,500
東邦チタニウム	2,300	641.00	1,474,300
UACJ	10,000	381.00	3,810,000
古河電気工業	26,000	239.00	6,214,000
住友電気工業	30,900	1,448.00	44,743,200
フジクラ	13,000	467.00	6,071,000
昭和電線ホールディングス	15,000	101.00	1,515,000
タツタ電線	2,100	510.00	1,071,000
カナレ電気	400	1,498.00	599,200
リョービ	5,000	314.00	1,570,000
アサヒホールディングス	1,200	1,621.00	1,945,200
宮地エンジニアリンググループ	5,000	230.00	1,150,000
トーカロ	400	1,616.00	646,400
SUMCO	5,000	836.00	4,180,000
東洋製罐グループホールディングス	5,800	1,576.00	9,140,800
ホッカンホールディングス	1,000	266.00	266,000
横河ブリッジホールディングス	2,000	1,212.00	2,424,000
三和ホールディングス	7,000	634.00	4,438,000
文化シャッター	3,000	608.00	1,824,000
三協立山	1,100	2,120.00	2,332,000
LIXILグループ	11,400	2,638.00	30,073,200
ノーリツ	1,600	1,783.00	2,852,800
長府製作所	900	2,549.00	2,294,100
リンナイ	1,300	8,540.00	11,102,000
日東精工	1,000	304.00	304,000
岡部	1,600	1,439.00	2,302,400
東プレ	1,600	1,047.00	1,675,200
高周波熱錬	1,900	683.00	1,297,700
東京製綱	10,000	151.00	1,510,000
パイオラックス	400	3,560.00	1,424,000
日本発條	6,500	936.00	6,084,000
日本製鋼所	12,000	442.00	5,304,000
三浦工業	1,200	2,906.00	3,487,200
タクマ	3,000	732.00	2,196,000
ツガミ	3,000	576.00	1,728,000
オークマ	5,000	813.00	4,065,000
東芝機械	4,000	467.00	1,868,000
アマダ	13,000	769.00	9,997,000

アイダエンジニアリング	1,900	944.00	1,793,600
牧野フライス製作所	4,000	671.00	2,684,000
オーエスジー	3,400	1,667.00	5,667,800
旭ダイヤモンド工業	2,100	1,352.00	2,839,200
D M G 森精機	4,300	1,277.00	5,491,100
ディスコ	900	6,330.00	5,697,000
大阪機工	4,000	132.00	528,000
島精機製作所	1,100	1,667.00	1,833,700
日阪製作所	2,000	888.00	1,776,000
やまびこ	500	3,980.00	1,990,000
ナブテスコ	3,700	2,217.00	8,202,900
三井海洋開発	700	2,171.00	1,519,700
S M C	2,300	25,390.00	58,397,000
ホソカワミクロン	3,000	623.00	1,869,000
オイレス工業	800	2,277.00	1,821,600
サトーホールディングス	900	2,321.00	2,088,900
小松製作所	38,300	2,145.00	82,153,500
住友重機械工業	22,000	453.00	9,966,000
日立建機	4,200	1,936.00	8,131,200
日工	2,000	433.00	866,000
井関農機	8,000	267.00	2,136,000
北川鉄工所	7,000	170.00	1,190,000
クボタ	43,000	1,311.00	56,373,000
月島機械	1,000	1,067.00	1,067,000
帝国電機製作所	400	3,095.00	1,238,000
東京機械製作所	2,000	88.00	176,000
新東工業	1,900	728.00	1,383,200
澁谷工業	500	2,690.00	1,345,000
アイチ コーポレーション	700	426.00	298,200
小森コーポレーション	2,000	1,290.00	2,580,000
酒井重工業	4,000	351.00	1,404,000
荏原製作所	18,000	596.00	10,728,000
西島製作所	1,600	1,189.00	1,902,400
ダイキン工業	10,700	6,132.00	65,612,400
トーヨーカネツ	7,000	247.00	1,729,000
栗田工業	4,900	2,130.00	10,437,000
椿本チエイン	4,000	751.00	3,004,000
アネスト岩田	2,000	628.00	1,256,000
ダイフク	3,500	1,223.00	4,280,500
加藤製作所	3,000	577.00	1,731,000
タダノ	3,000	1,273.00	3,819,000
フジテック	2,000	1,185.00	2,370,000
C K D	2,200	951.00	2,092,200

キトー	800	1,971.00	1,576,800
平和	1,700	1,693.00	2,878,100
理想科学工業	700	2,499.00	1,749,300
SANKYO	2,400	4,055.00	9,732,000
日本金銭機械	700	1,872.00	1,310,400
マースエンジニアリング	1,000	1,928.00	1,928,000
ダイコク電機	500	1,856.00	928,000
アマノ	2,200	986.00	2,169,200
JUKI	8,000	212.00	1,696,000
サンデン	4,000	447.00	1,788,000
蛇の目マシン工業	15,000	81.00	1,215,000
マックス	1,000	1,114.00	1,114,000
グローリー	2,300	2,704.00	6,219,200
大和冷機工業	2,000	662.00	1,324,000
セガサミーホールディングス	8,400	2,187.00	18,370,800
日本ピストンリング	9,000	176.00	1,584,000
リケン	3,000	417.00	1,251,000
TPR	900	1,585.00	1,426,500
ホシザキ電機	1,700	4,200.00	7,140,000
大豊工業	300	953.00	285,900
日本精工	17,000	1,127.00	19,159,000
NTN	18,000	375.00	6,750,000
ジェイテクト	8,300	1,481.00	12,292,300
不二越	7,000	686.00	4,802,000
日本トムソン	3,000	470.00	1,410,000
THK	4,900	2,248.00	11,015,200
ユーシン精機	600	2,942.00	1,765,200
イーグル工業	1,000	1,634.00	1,634,000
日本ピラー工業	1,500	739.00	1,108,500
キッツ	3,500	474.00	1,659,000
日立工機	2,100	801.00	1,682,100
マキタ	5,100	5,350.00	27,285,000
日立造船	5,800	482.00	2,795,600
三菱重工業	140,000	569.00	79,660,000
IHI	54,000	410.00	22,140,000
イビデン	4,800	1,962.00	9,417,600
コニカミノルタ	20,500	978.00	20,049,000
ブラザー工業	10,100	1,466.00	14,806,600
ミネベア	11,000	867.00	9,537,000
日立製作所	188,000	756.00	142,128,000
東芝	155,000	427.00	66,185,000
三菱電機	78,000	1,163.00	90,714,000
富士電機	22,000	439.00	9,658,000

安川電機	9,000	1,328.00	11,952,000	
シンフォニアテクノロジー	11,000	157.00	1,727,000	
明電舎	7,000	434.00	3,038,000	
山洋電気	1,000	654.00	654,000	
デンヨー	1,300	1,585.00	2,060,500	
東芝テック	5,000	621.00	3,105,000	
マブチモーター	1,100	6,900.00	7,590,000	
日本電産	8,400	5,980.00	50,232,000	
東光高岳	600	1,619.00	971,400	
ダイヘン	5,000	405.00	2,025,000	
JVCケンウッド	8,300	246.00	2,041,800	
日新電機	3,000	579.00	1,737,000	
大崎電気工業	1,000	619.00	619,000	
オムロン	8,800	4,010.00	35,288,000	
日東工業	1,200	2,120.00	2,544,000	
I D E C	1,600	924.00	1,478,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	15,000	579.00	8,685,000	
メルコホールディングス	300	1,571.00	471,300	
日本電気	108,000	299.00	32,292,000	
富士通	76,000	615.00	46,740,000	
沖電気工業	30,000	208.00	6,240,000	
電気興業	2,000	635.00	1,270,000	
サンケン電気	4,000	733.00	2,932,000	
アイホン	900	1,663.00	1,496,700	
ルネサスエレクトロニクス	4,100	810.00	3,321,000	
セイコーエプソン	5,300	2,840.00	15,052,000	
ワコム	6,200	701.00	4,346,200	
アルバック	1,300	2,063.00	2,681,900	
アクセル	900	1,648.00	1,483,200	
E I Z O	700	2,762.00	1,933,400	
日本信号	2,000	871.00	1,742,000	
能美防災	1,000	1,183.00	1,183,000	
日本無線	4,000	387.00	1,548,000	
パナソニック	89,600	1,123.00	100,620,800	代用有価証券 7,500株
シャープ	57,000	276.00	15,732,000	
アンリツ	4,600	1,151.00	5,294,600	
富士通ゼネラル	2,000	1,065.00	2,130,000	
日立国際電気	2,000	1,182.00	2,364,000	
ソニー	43,000	1,932.00	83,076,000	代用有価証券 3,700株
T D K	4,700	4,615.00	21,690,500	
帝国通信工業	3,000	167.00	501,000	
ミツミ電機	3,000	703.00	2,109,000	

タムラ製作所	6,000	250.00	1,500,000	
アルプス電気	5,700	1,145.00	6,526,500	
パイオニア	10,900	231.00	2,517,900	
日本電波工業	1,300	813.00	1,056,900	
日本トリム	200	5,930.00	1,186,000	
ローランド ディー.ジー.	500	3,735.00	1,867,500	
フォスター電機	800	1,314.00	1,051,200	
クラリオン	7,000	191.00	1,337,000	
S M K	2,000	441.00	882,000	
東光	6,000	326.00	1,956,000	
ホシデン	1,700	479.00	814,300	
ヒロセ電機	1,400	14,500.00	20,300,000	
日本航空電子工業	2,000	1,564.00	3,128,000	
T O A	1,600	1,052.00	1,683,200	
ユニデン	3,000	245.00	735,000	
アルパイン	1,700	1,307.00	2,221,900	
アイコム	800	2,310.00	1,848,000	
船井電機	600	1,090.00	654,000	
横河電機	8,500	1,455.00	12,367,500	
新電元工業	3,000	431.00	1,293,000	
アズビル	2,400	2,372.00	5,692,800	
日本光電工業	1,700	4,235.00	7,199,500	
チノー	5,000	215.00	1,075,000	
堀場製作所	1,400	3,555.00	4,977,000	
アドバンテスト	5,300	1,147.00	6,079,100	
エスベック	1,700	772.00	1,312,400	
キーエンス	1,800	39,925.00	71,865,000	
日置電機	1,100	1,568.00	1,724,800	
シスメックス	6,600	3,165.00	20,889,000	
メガチップス	1,300	1,221.00	1,587,300	
O B A R A G R O U P	500	3,765.00	1,882,500	
コーセル	1,100	1,192.00	1,311,200	
オブテックス	1,000	1,668.00	1,668,000	
千代田インテグレ	300	1,559.00	467,700	
スタンレー電気	5,600	2,341.00	13,109,600	
岩崎電気	6,000	244.00	1,464,000	
ウシオ電機	4,800	1,399.00	6,715,200	
遠藤照明	300	1,792.00	537,600	
日本デジタル研究所	800	1,487.00	1,189,600	
日本電子	4,000	387.00	1,548,000	
カシオ計算機	8,100	1,203.00	9,744,300	
ファナック	8,700	18,485.00	160,819,500	
エンブラス	300	5,560.00	1,668,000	

ローム	4,100	4,790.00	19,639,000	
浜松ホトニクス	3,100	4,580.00	14,198,000	
三井ハイテック	1,900	674.00	1,280,600	
新光電気工業	2,600	708.00	1,840,800	
京セラ	14,000	4,790.00	67,060,000	
太陽誘電	3,800	1,305.00	4,959,000	
村田製作所	8,200	9,053.00	74,234,600	
ユーシン	2,100	662.00	1,390,200	
双葉電子工業	1,500	1,652.00	2,478,000	
北陸電気工業	5,000	134.00	670,000	
ニチコン	2,500	787.00	1,967,500	
日本ケミコン	5,000	322.00	1,610,000	
K O A	1,700	1,096.00	1,863,200	
小糸製作所	4,000	1,982.00	7,928,000	
ミツバ	1,400	1,570.00	2,198,000	
スター精密	1,500	1,287.00	1,930,500	
大日本スクリーン製造	7,000	464.00	3,248,000	
キヤノン電子	700	1,794.00	1,255,800	
キヤノン	45,400	3,224.00	146,369,600	代用有価証券 4,100株
リコー	23,600	1,167.00	27,541,200	
東京エレクトロン	7,000	5,937.00	41,559,000	
トヨタ紡織	2,700	1,075.00	2,902,500	
鬼怒川ゴム工業	2,000	413.00	826,000	
ユニプレス	1,300	1,963.00	2,551,900	
豊田自動織機	7,100	4,650.00	33,015,000	
モリタホールディングス	2,000	842.00	1,684,000	
三櫻工業	800	631.00	504,800	
デンソー	19,400	4,776.00	92,654,400	
東海理化電機製作所	2,100	1,802.00	3,784,200	
三井造船	30,000	214.00	6,420,000	
佐世保重工業	6,000	124.00	744,000	
川崎重工業	61,000	366.00	22,326,000	
名村造船所	1,100	814.00	895,400	
日本車輛製造	3,000	423.00	1,269,000	
日産自動車	110,000	897.00	98,670,000	
いすゞ自動車	45,000	610.00	27,450,000	
トヨタ自動車	109,100	5,570.00	607,687,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	9,800	1,508.00	14,778,400	
三菱自動車工業	18,200	1,079.00	19,637,800	
武蔵精密工業	800	2,117.00	1,693,600	
日産車体	4,000	1,606.00	6,424,000	
新明和工業	3,000	954.00	2,862,000	

極東開発工業	1,400	1,452.00	2,032,800	
日信工業	1,600	1,923.00	3,076,800	
トピー工業	9,000	177.00	1,593,000	
ティラド	5,000	268.00	1,340,000	
曙ブレーキ工業	3,600	517.00	1,861,200	
タチエス	1,200	1,606.00	1,927,200	
NOK	3,800	1,735.00	6,593,000	
フタバ産業	3,900	467.00	1,821,300	
カヤバ工業	7,000	423.00	2,961,000	
大同メタル工業	2,000	1,130.00	2,260,000	
プレス工業	4,000	379.00	1,516,000	
カルソニックカンセイ	5,000	519.00	2,595,000	
太平洋工業	2,500	647.00	1,617,500	
ケーヒン	1,800	1,426.00	2,566,800	
アイシン精機	7,200	3,585.00	25,812,000	
マツダ	117,000	458.00	53,586,000	
ダイハツ工業	8,300	1,784.00	14,807,200	
今仙電機製作所	1,100	1,310.00	1,441,000	
本田技研工業	70,500	3,436.00	242,238,000	代用有価証券 6,000株
スズキ	16,400	2,813.00	46,133,200	
富士重工業	26,700	2,807.00	74,946,900	
ヤマハ発動機	11,900	1,651.00	19,646,900	
ショーワ	1,900	1,078.00	2,048,200	
エクセディ	900	2,729.00	2,456,100	
豊田合成	2,500	1,901.00	4,752,500	
愛三工業	500	795.00	397,500	
ヨロズ	1,100	1,947.00	2,141,700	
エフ・シー・シー	1,300	1,772.00	2,303,600	
シマノ	3,400	10,010.00	34,034,000	
タカタ	1,400	2,440.00	3,416,000	
テイ・エス テック	1,700	2,883.00	4,901,100	
テルモ	12,000	2,120.00	25,440,000	
クリエートメディック	700	945.00	661,500	
日機装	2,500	1,127.00	2,817,500	
島津製作所	10,000	881.00	8,810,000	
東京計器	4,000	285.00	1,140,000	
東京精密	1,400	1,785.00	2,499,000	
マニー	200	4,670.00	934,000	
ニコン	14,600	1,652.00	24,119,200	
トプコン	2,100	1,735.00	3,643,500	
オリンパス	11,700	2,990.00	34,983,000	
理研計器	1,300	972.00	1,263,600	

タムロン	600	2,689.00	1,613,400
HOYA	19,100	3,060.00	58,446,000
シチズンホールディングス	9,600	773.00	7,420,800
セイコーホールディングス	5,000	374.00	1,870,000
ニプロ	4,200	887.00	3,725,400
パラマウントベッドホールディングス	700	3,175.00	2,222,500
SHO-BI	2,500	409.00	1,022,500
前田工織	1,000	1,588.00	1,588,000
バンダイナムコホールディングス	8,600	2,234.00	19,212,400
フランスベッドホールディングス	5,000	184.00	920,000
パイロットコーポレーション	700	3,920.00	2,744,000
トッパン・フォームズ	400	930.00	372,000
フジシールインターナショナル	1,000	3,370.00	3,370,000
タカラトミー	4,200	475.00	1,995,000
アーク	2,800	249.00	697,200
大建工業	8,000	253.00	2,024,000
凸版印刷	22,000	713.00	15,686,000
大日本印刷	24,000	944.00	22,656,000
共同印刷	2,000	275.00	550,000
日本写真印刷	1,300	1,283.00	1,667,900
光村印刷	2,000	258.00	516,000
宝印刷	2,300	805.00	1,851,500
アシックス	7,800	1,955.00	15,249,000
ツツミ	200	2,407.00	481,400
ローランド	1,100	1,432.00	1,575,200
小松ウオール工業	100	1,942.00	194,200
ヤマハ	5,800	1,398.00	8,108,400
クリナップ	400	940.00	376,000
ピジョン	1,300	4,700.00	6,110,000
リンテック	1,900	1,919.00	3,646,100
イトーキ	2,600	772.00	2,007,200
任天堂	4,800	11,250.00	54,000,000
三菱鉛筆	600	2,847.00	1,708,200
タカラスタンダード	3,000	739.00	2,217,000
コクヨ	4,100	750.00	3,075,000
ナカバヤシ	2,000	199.00	398,000
グローブライド	7,000	120.00	840,000
岡村製作所	3,000	831.00	2,493,000
美津濃	4,000	567.00	2,268,000
アデランス	1,300	1,241.00	1,613,300
東京電力	66,500	396.00	26,334,000
中部電力	25,800	1,188.00	30,650,400
関西電力	32,000	934.00	29,888,000

中国電力	10,800	1,299.00	14,029,200
北陸電力	7,700	1,257.00	9,678,900
東北電力	19,600	985.00	19,306,000
四国電力	7,100	1,236.00	8,775,600
九州電力	17,300	1,067.00	18,459,100
北海道電力	7,300	681.00	4,971,300
沖縄電力	500	3,345.00	1,672,500
電源開発	4,900	2,698.00	13,220,200
東京瓦斯	92,000	517.00	47,564,000
大阪瓦斯	81,000	383.00	31,023,000
東邦瓦斯	20,000	505.00	10,100,000
西部瓦斯	9,000	239.00	2,151,000
静岡瓦斯	2,400	607.00	1,456,800
東武鉄道	45,000	497.00	22,365,000
相鉄ホールディングス	13,000	365.00	4,745,000
東京急行電鉄	46,000	636.00	29,256,000
京浜急行電鉄	20,000	834.00	16,680,000
小田急電鉄	25,000	887.00	22,175,000
京王電鉄	22,000	713.00	15,686,000
京成電鉄	12,000	885.00	10,620,000
富士急行	2,000	1,021.00	2,042,000
新京成電鉄	2,000	370.00	740,000
東日本旅客鉄道	14,400	7,508.00	108,115,200
西日本旅客鉄道	7,100	4,013.00	28,492,300
東海旅客鉄道	7,000	11,755.00	82,285,000
西日本鉄道	10,000	381.00	3,810,000
近畿日本鉄道	79,000	353.00	27,887,000
阪急阪神ホールディングス	53,000	549.00	29,097,000
南海電気鉄道	16,000	387.00	6,192,000
京阪電気鉄道	17,000	409.00	6,953,000
神戸電鉄	6,000	345.00	2,070,000
名古屋鉄道	27,000	309.00	8,343,000
山陽電気鉄道	3,000	448.00	1,344,000
日本通運	31,000	491.00	15,221,000
ヤマトホールディングス	14,600	2,090.00	30,514,000
山九	10,000	391.00	3,910,000
丸全昭和運輸	4,000	323.00	1,292,000
センコー	3,000	457.00	1,371,000
日本梱包運輸倉庫	2,400	1,709.00	4,101,600
日本石油輸送	3,000	225.00	675,000
福山通運	5,000	592.00	2,960,000
セイノーホールディングス	6,000	1,033.00	6,198,000
日立物流	1,600	1,557.00	2,491,200

日本郵船	66,000	292.00	19,272,000
商船三井	44,000	355.00	15,620,000
川崎汽船	34,000	213.00	7,242,000
N S ユナイテッド海運	5,000	226.00	1,130,000
飯野海運	3,200	480.00	1,536,000
第一中央汽船	9,000	91.00	819,000
日本航空	6,600	5,110.00	33,726,000
A N A ホールディングス	154,000	223.00	34,342,000
トランコム	300	3,830.00	1,149,000
日新	7,000	290.00	2,030,000
三菱倉庫	5,000	1,466.00	7,330,000
三井倉庫	4,000	396.00	1,584,000
住友倉庫	5,000	508.00	2,540,000
澁澤倉庫	3,000	345.00	1,035,000
東陽倉庫	2,000	252.00	504,000
安田倉庫	600	965.00	579,000
東洋埠頭	2,000	214.00	428,000
上組	9,000	970.00	8,730,000
サンリツ	1,000	528.00	528,000
郵船ロジスティクス	1,000	1,219.00	1,219,000
近鉄エクスプレス	700	4,240.00	2,968,000
N E C ネットエスアイ	800	2,045.00	1,636,000
システナ	700	708.00	495,600
新日鉄住金ソリューションズ	600	2,325.00	1,395,000
コア	1,600	706.00	1,129,600
I T ホールディングス	2,800	1,579.00	4,421,200
グリー	4,000	1,014.00	4,056,000
コーエーテクモホールディングス	1,500	1,249.00	1,873,500
三菱総合研究所	200	2,145.00	429,000
K L a b	300	612.00	183,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	400	1,253.00	501,200
ネクソン	6,400	836.00	5,350,400
ブロードリーフ	800	1,622.00	1,297,600
ダウンゴ	700	3,035.00	2,124,500
G M O ペイメントゲートウェイ	500	3,675.00	1,837,500
インターネットイニシアティブ	1,100	2,530.00	2,783,000
S R A ホールディングス	600	1,480.00	888,000
パナソニック インフォメーションシステム	100	2,688.00	268,800
野村総合研究所	4,400	3,035.00	13,354,000
フジ・メディア・ホールディングス	7,500	1,701.00	12,757,500
オービック	2,700	3,035.00	8,194,500
ヤフー	56,000	480.00	26,880,000

トレンドマイクロ	3,400	3,225.00	10,965,000	
日本オラクル	1,500	4,430.00	6,645,000	
フューチャーアーキテクト	700	593.00	415,100	
C A C Holdings	600	1,017.00	610,200	
オービックビジネスコンサルタント	500	3,555.00	1,777,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	900	4,310.00	3,879,000	
アイティフォー	3,300	425.00	1,402,500	
大塚商会	700	12,000.00	8,400,000	
C I J	2,400	410.00	984,000	
WOWOW	400	3,400.00	1,360,000	
ネットワンシステムズ	3,000	740.00	2,220,000	
アルゴグラフィックス	500	1,629.00	814,500	
マーベラスAQL	1,900	699.00	1,328,100	
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,400	1,832.00	2,564,800	
日本ユニシス	1,900	1,027.00	1,951,300	
兼松エレクトロニクス	1,100	1,341.00	1,475,100	
東京放送ホールディングス	4,200	1,083.00	4,548,600	
日本テレビホールディングス	7,700	1,510.00	11,627,000	
テレビ朝日ホールディングス	2,000	1,757.00	3,514,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	5,900	532.00	3,138,800	
テレビ東京ホールディングス	900	1,599.00	1,439,100	
コネクシオ	1,400	771.00	1,079,400	
日本電信電話	30,400	5,352.00	162,700,800	代用有価証券 3,200株
K D D I	24,000	5,421.00	130,104,000	
光通信	700	8,040.00	5,628,000	
N T T ドコモ	63,700	1,581.00	100,709,700	
G M O インターネット	2,600	887.00	2,306,200	
学研ホールディングス	3,000	276.00	828,000	
ゼンリン	1,700	1,032.00	1,754,400	
K A D O K A W A	700	3,130.00	2,191,000	
松竹	5,000	822.00	4,110,000	
東宝	5,500	1,914.00	10,527,000	
東映	3,000	564.00	1,692,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	5,500	3,870.00	21,285,000	
D T S	700	1,693.00	1,185,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,800	1,755.00	4,914,000	
シーイーシー	1,700	597.00	1,014,900	
カブコン	2,000	1,745.00	3,490,000	
ジャステック	1,100	709.00	779,900	
S C S K	1,800	2,591.00	4,663,800	
T K C	1,300	2,014.00	2,618,200	
富士ソフト	1,000	2,112.00	2,112,000	

N S D	1,600	1,208.00	1,932,800
コナミ	3,500	2,337.00	8,179,500
J B C Cホールディングス	1,100	716.00	787,600
ソフトバンク	38,000	7,722.00	293,436,000
高千穂交易	1,300	1,008.00	1,310,400
双日	51,800	166.00	8,598,800
アルフレッサ ホールディングス	2,300	6,260.00	14,398,000
横浜冷凍	1,900	813.00	1,544,700
アルコニックス	600	2,027.00	1,216,200
あい ホールディングス	1,400	1,690.00	2,366,000
ダイワボウホールディングス	7,000	171.00	1,197,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,500	726.00	1,815,000
U K Cホールディングス	1,000	1,674.00	1,674,000
T O K A Iホールディングス	4,900	351.00	1,719,900
シップヘルスケアホールディングス	1,100	3,630.00	3,993,000
小野建	1,100	1,094.00	1,203,400
エコートレーディング	4,000	700.00	2,800,000
ナガイレーベン	1,000	1,954.00	1,954,000
三菱食品	800	2,272.00	1,817,600
松田産業	300	1,178.00	353,400
メディバルホールディングス	7,700	1,395.00	10,741,500
S P K	300	1,866.00	559,800
アズワン	800	2,687.00	2,149,600
尾家産業	2,400	819.00	1,965,600
ドウシシャ	1,400	1,542.00	2,158,800
黒田電気	1,100	1,666.00	1,832,600
トーメンエレクトロニクス	600	1,641.00	984,600
エクセル	400	1,079.00	431,600
ガリバーインターナショナル	2,600	928.00	2,412,800
進和	400	1,170.00	468,000
マクニカ	700	3,100.00	2,170,000
伊藤忠商事	61,700	1,157.00	71,386,900
丸紅	68,000	686.00	46,648,000
長瀬産業	4,400	1,228.00	5,403,200
豊田通商	8,600	2,639.00	22,695,400
兼松	16,000	156.00	2,496,000
三井物産	71,200	1,466.00	104,379,200
日本紙パルプ商事	1,000	335.00	335,000
日立ハイテクノロジーズ	2,300	2,393.00	5,503,900
カメイ	1,300	744.00	967,200
スターゼン	6,000	277.00	1,662,000
山善	3,000	660.00	1,980,000
住友商事	45,700	1,329.00	60,735,300

三菱商事	60,400	1,834.00	110,773,600	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	2,200	1,420.00	3,124,000	
西華産業	6,000	237.00	1,422,000	
菱洋エレクトロ	1,400	1,288.00	1,803,200	
ユアサ商事	8,000	200.00	1,600,000	
神鋼商事	2,000	200.00	400,000	
阪和興業	8,000	382.00	3,056,000	
カナデン	1,000	711.00	711,000	
菱電商事	2,000	699.00	1,398,000	
フルサト工業	300	1,031.00	309,300	
岩谷産業	9,000	622.00	5,598,000	
すてきナイスグループ	6,000	216.00	1,296,000	
昭光通商	7,000	137.00	959,000	
ニチモウ	2,000	190.00	380,000	
三愛石油	4,000	670.00	2,680,000	
稲畑産業	1,900	985.00	1,871,500	
ワキタ	1,000	1,188.00	1,188,000	
東邦ホールディングス	2,500	1,990.00	4,975,000	
サンゲツ	1,400	2,546.00	3,564,400	
サンリオ	2,000	3,335.00	6,670,000	
リョーサン	1,100	2,122.00	2,334,200	
新光商事	1,200	921.00	1,105,200	
三信電気	1,400	651.00	911,400	
東陽テクニカ	1,700	1,107.00	1,881,900	
モスフードサービス	1,000	2,043.00	2,043,000	
加賀電子	1,100	1,303.00	1,433,300	
立花エレテック	300	1,358.00	407,400	
P a l t a c	1,100	1,231.00	1,354,100	
太平洋興発	3,000	97.00	291,000	
ヤマタネ	11,000	155.00	1,705,000	
日鉄住金物産	5,000	348.00	1,740,000	
トラスコ中山	900	2,282.00	2,053,800	
オートバックスセブン	2,700	1,545.00	4,171,500	
加藤産業	1,100	2,162.00	2,378,200	
イエローハット	800	1,986.00	1,588,800	
杉本商事	1,900	974.00	1,850,600	
因幡電機産業	1,100	3,125.00	3,437,500	
ミスミグループ本社	3,100	2,545.00	7,889,500	
スズケン	3,200	3,695.00	11,824,000	
ローソン	3,200	6,620.00	21,184,000	
サンエー	600	3,010.00	1,806,000	

キリン堂	700	636.00	445,200
カワチ薬品	600	1,851.00	1,110,600
エービーシー・マート	1,100	4,190.00	4,609,000
ハードオフコーポレーション	500	785.00	392,500
アスクル	700	2,692.00	1,884,400
ゲオホールディングス	1,900	925.00	1,757,500
アダストリアホールディングス	600	2,247.00	1,348,200
キャンドウ	300	1,640.00	492,000
パル	600	1,946.00	1,167,600
エディオン	3,500	580.00	2,030,000
ジェイアイエヌ	400	2,825.00	1,130,000
ビックカメラ	2,900	711.00	2,061,900
D C Mホールディングス	3,800	670.00	2,546,000
MonotaRO	1,200	2,300.00	2,760,000
J.フロント リテイリング	18,000	663.00	11,934,000
ドトール・日レスホールディングス	1,400	1,711.00	2,395,400
マツモトキヨシホールディングス	1,600	3,015.00	4,824,000
スタートトゥデイ	2,400	2,316.00	5,558,400
ココカラファイン	800	2,866.00	2,292,800
三越伊勢丹ホールディングス	15,400	1,260.00	19,404,000
ウエルシアホールディングス	300	5,940.00	1,782,000
クリエイトSDホールディングス	500	3,340.00	1,670,000
コスモス薬品	400	10,470.00	4,188,000
セブン&アイ・ホールディングス	32,400	3,826.00	123,962,400
ツルハホールディングス	800	9,850.00	7,880,000
サンマルクホールディングス	400	4,855.00	1,942,000
クスリのアオキ	100	6,770.00	677,000
総合メディカル	200	4,200.00	840,000
カッパ・クリエイトホールディングス	2,500	986.00	2,465,000
良品計画	800	10,790.00	8,632,000
コナカ	1,500	683.00	1,024,500
イオン北海道	500	614.00	307,000
コーナン商事	900	1,019.00	917,100
エコス	700	656.00	459,200
ワタミ	1,400	1,498.00	2,097,200
ドンキホーテホールディングス	2,300	5,290.00	12,167,000
西松屋チェーン	2,300	734.00	1,688,200
ゼンショーホールディングス	2,900	1,039.00	3,013,100
幸楽苑	2,400	1,306.00	3,134,400
サイゼリヤ	1,100	1,169.00	1,285,900
ユナイテッドアローズ	1,000	3,805.00	3,805,000
ハイデイ日高	1,200	2,311.00	2,773,200
京都きもの友禅	2,400	1,010.00	2,424,000

コロワイド	2,500	1,033.00	2,582,500
壱番屋	500	4,270.00	2,135,000
スギホールディングス	1,400	4,365.00	6,111,000
スクロール	2,000	270.00	540,000
ヨンドシーホールディングス	800	1,819.00	1,455,200
ファミリーマート	2,600	4,155.00	10,803,000
木曽路	900	1,856.00	1,670,400
千趣会	2,500	833.00	2,082,500
上新電機	2,000	805.00	1,610,000
日本瓦斯	1,700	1,498.00	2,546,600
ロイヤルホールディングス	1,300	1,478.00	1,921,400
島忠	1,800	2,194.00	3,949,200
チヨダ	900	2,445.00	2,200,500
ライフコーポレーション	200	1,549.00	309,800
カスミ	4,300	701.00	3,014,300
リンガーハット	1,600	1,500.00	2,400,000
AOKIホールディングス	1,300	1,325.00	1,722,500
オークワ	3,000	928.00	2,784,000
コメリ	1,200	2,863.00	3,435,600
青山商事	1,900	2,570.00	4,883,000
しまむら	900	9,100.00	8,190,000
CFSコーポレーション	1,400	452.00	632,800
高島屋	10,000	957.00	9,570,000
松屋	1,600	900.00	1,440,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,000	747.00	3,735,000
ニッセンホールディングス	800	421.00	336,800
パルコ	400	813.00	325,200
丸井グループ	10,100	883.00	8,918,300
アクシアル リテイリング	300	1,574.00	472,200
井筒屋	4,000	71.00	284,000
ダイエー	4,750	287.00	1,363,250
イズミヤ	5,000	472.00	2,360,000
イオン	30,900	1,188.00	36,709,200
ユニーグループ・ホールディングス	7,400	648.00	4,795,200
イズミ	1,700	2,976.00	5,059,200
東武ストア	3,000	263.00	789,000
平和堂	1,600	1,413.00	2,260,800
フジ	900	1,926.00	1,733,400
ヤオコー	400	4,525.00	1,810,000
ゼビオ	900	1,775.00	1,597,500
ケーズホールディングス	1,600	2,894.00	4,630,400
アインファーマシーズ	500	4,590.00	2,295,000
元気寿司	400	1,555.00	622,000

ヤマダ電機	30,600	379.00	11,597,400
アークランドサカモト	400	1,936.00	774,400
ニトリホールディングス	3,100	4,690.00	14,539,000
吉野家ホールディングス	2,100	1,286.00	2,700,600
サガミチェーン	2,000	920.00	1,840,000
関西スーパーマーケット	2,100	791.00	1,661,100
王将フードサービス	300	3,680.00	1,104,000
プレナス	900	2,282.00	2,053,800
ミニストップ	900	1,534.00	1,380,600
アークス	1,300	1,998.00	2,597,400
バロー	1,700	1,296.00	2,203,200
ファーストリテイリング	1,800	33,700.00	60,660,000
サンドラッグ	1,600	4,100.00	6,560,000
ベルーナ	2,200	499.00	1,097,800
島根銀行	1,100	1,296.00	1,425,600
じもとホールディングス	9,300	203.00	1,887,900
新生銀行	67,000	207.00	13,869,000
あおぞら銀行	40,000	297.00	11,880,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	586,000	561.00	328,746,000
りそなホールディングス	73,500	488.00	35,868,000
三井住友トラスト・ホールディングス	152,000	437.00	66,424,000
三井住友フィナンシャルグループ	58,500	4,093.00	239,440,500
第四銀行	10,000	365.00	3,650,000
北越銀行	8,000	205.00	1,640,000
西日本シティ銀行	27,000	232.00	6,264,000
千葉銀行	30,000	639.00	19,170,000
横浜銀行	51,000	502.00	25,602,000
常陽銀行	29,000	488.00	14,152,000
群馬銀行	17,000	535.00	9,095,000
武蔵野銀行	1,200	3,265.00	3,918,000
千葉興業銀行	2,600	670.00	1,742,000
筑波銀行	5,800	374.00	2,169,200
東京都民銀行	1,400	1,034.00	1,447,600
七十七銀行	12,000	455.00	5,460,000
青森銀行	6,000	279.00	1,674,000
秋田銀行	5,000	276.00	1,380,000
山形銀行	5,000	432.00	2,160,000
岩手銀行	500	4,520.00	2,260,000
東邦銀行	7,000	336.00	2,352,000
東北銀行	22,000	146.00	3,212,000
ふくおかフィナンシャルグループ	31,000	420.00	13,020,000
静岡銀行	23,000	974.00	22,402,000
十六銀行	10,000	350.00	3,500,000

スルガ銀行	8,000	1,739.00	13,912,000	
八十二銀行	14,000	561.00	7,854,000	
山梨中央銀行	5,000	441.00	2,205,000	
大垣共立銀行	10,000	275.00	2,750,000	
福井銀行	7,000	244.00	1,708,000	
北國銀行	9,000	336.00	3,024,000	
滋賀銀行	7,000	535.00	3,745,000	
南都銀行	8,000	376.00	3,008,000	
百五銀行	7,000	397.00	2,779,000	
京都銀行	15,000	822.00	12,330,000	
紀陽銀行	3,000	1,203.00	3,609,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	53,000	194.00	10,282,000	
広島銀行	23,000	422.00	9,706,000	
山陰合同銀行	5,000	673.00	3,365,000	
中国銀行	5,800	1,330.00	7,714,000	
鳥取銀行	7,000	179.00	1,253,000	
伊予銀行	8,300	929.00	7,710,700	
百十四銀行	8,000	345.00	2,760,000	
四国銀行	8,000	204.00	1,632,000	
阿波銀行	6,000	527.00	3,162,000	
鹿児島銀行	5,000	640.00	3,200,000	
大分銀行	5,000	372.00	1,860,000	
宮崎銀行	5,000	295.00	1,475,000	
肥後銀行	6,000	528.00	3,168,000	
十八銀行	6,000	223.00	1,338,000	
沖縄銀行	600	4,270.00	2,562,000	
琉球銀行	1,500	1,341.00	2,011,500	
八千代銀行	300	2,684.00	805,200	
セブン銀行	29,000	391.00	11,339,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,001,500	201.00	201,301,500	
高知銀行	2,000	152.00	304,000	
山口フィナンシャルグループ	8,000	932.00	7,456,000	
長野銀行	4,000	182.00	728,000	
名古屋銀行	7,000	377.00	2,639,000	
北洋銀行	11,700	406.00	4,750,200	
愛知銀行	300	4,990.00	1,497,000	
愛媛銀行	3,000	223.00	669,000	
京葉銀行	6,000	433.00	2,598,000	
栃木銀行	4,000	404.00	1,616,000	
東和銀行	17,000	96.00	1,632,000	
福島銀行	22,000	85.00	1,870,000	
トモニホールディングス	5,900	423.00	2,495,700	
フィデアホールディングス	7,400	190.00	1,406,000	

池田泉州ホールディングス	5,800	462.00	2,679,600
F P G	1,100	1,037.00	1,140,700
S B I ホールディングス	9,300	1,211.00	11,262,300
日本アジア投資	7,000	102.00	714,000
ジャフコ	1,100	4,290.00	4,719,000
大和証券グループ本社	77,000	812.00	62,524,000
野村ホールディングス	158,200	622.00	98,400,400
岡三証券グループ	6,000	801.00	4,806,000
丸三証券	2,300	786.00	1,807,800
東洋証券	5,000	318.00	1,590,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	8,200	808.00	6,625,600
水戸証券	4,000	405.00	1,620,000
いちよし証券	1,500	1,373.00	2,059,500
松井証券	3,900	996.00	3,884,400
マネックスグループ	8,400	358.00	3,007,200
カブドットコム証券	3,000	451.00	1,353,000
極東証券	1,000	1,690.00	1,690,000
岩井コスモホールディングス	1,000	1,146.00	1,146,000
N K S J ホールディングス	17,200	2,597.00	44,668,400
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	23,100	2,287.00	52,829,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	7,400	1,658.00	12,269,200
第一生命保険	38,900	1,404.00	54,615,600
東京海上ホールディングス	30,000	3,038.00	91,140,000
T & D ホールディングス	26,500	1,217.00	32,250,500
全国保証	1,800	2,441.00	4,393,800
クレディセゾン	6,300	2,270.00	14,301,000
芙蓉総合リース	800	3,525.00	2,820,000
興銀リース	1,300	2,357.00	3,064,100
東京センチュリーリース	1,800	2,948.00	5,306,400
日本証券金融	3,400	589.00	2,002,600
アイフル	14,100	346.00	4,878,600
ポケットカード	600	715.00	429,000
リコーリース	500	2,602.00	1,301,000
イオンフィナンシャルサービス	4,500	2,571.00	11,569,500
アコム	15,500	390.00	6,045,000
ジャックス	5,000	469.00	2,345,000
オリエントコーポレーション	17,300	230.00	3,979,000
日立キャピタル	1,500	2,497.00	3,745,500
オリックス	47,700	1,457.00	69,498,900
三菱UFJリース	19,600	521.00	10,211,600
日本取引所グループ	11,400	2,227.00	25,387,800
イー・ギャランティ	200	2,242.00	448,400

NECキャピタルソリューション	300	2,015.00	604,500
日本駐車場開発	19,000	111.00	2,109,000
ヒューリック	13,000	1,297.00	16,861,000
野村不動産ホールディングス	5,100	1,917.00	9,776,700
常和ホールディングス	100	3,310.00	331,000
フージャースホールディングス	1,800	568.00	1,022,400
オープンハウス	100	1,694.00	169,400
東急不動産ホールディングス	17,200	767.00	13,192,400
飯田グループホールディングス	3,400	1,588.00	5,399,200
パーク24	4,000	1,870.00	7,480,000
三井不動産	36,000	3,057.00	110,052,000
三菱地所	54,000	2,295.00	123,930,000
平和不動産	1,600	1,580.00	2,528,000
東京建物	16,000	815.00	13,040,000
ダイビル	2,300	1,009.00	2,320,700
京阪神ビルディング	1,700	531.00	902,700
住友不動産	19,000	3,987.00	75,753,000
大京	13,000	205.00	2,665,000
テオーシー	2,700	718.00	1,938,600
レオパレス21	8,900	535.00	4,761,500
フジ住宅	500	629.00	314,500
空港施設	1,200	721.00	865,200
住友不動産販売	600	3,185.00	1,911,000
ゴールドクレスト	600	2,090.00	1,254,000
タカラレーベン	4,100	290.00	1,189,000
サンヨーハウジング名古屋	800	971.00	776,800
イオンモール	5,000	2,405.00	12,025,000
トーセイ	1,600	681.00	1,089,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	4,800	946.00	4,540,800
サンフロンティア不動産	900	1,164.00	1,047,600
日本空港ビルデング	2,700	2,544.00	6,868,800
日本工営	4,000	487.00	1,948,000
ネクスト	1,100	875.00	962,500
日本M&Aセンター	1,200	2,598.00	3,117,600
アコーディア・ゴルフ	3,300	1,236.00	4,078,800
タケエイ	800	977.00	781,600
パソナグループ	700	554.00	387,800
エス・エム・エス	700	1,970.00	1,379,000
テンプホールディングス	1,800	2,665.00	4,797,000
クックパッド	500	2,231.00	1,115,500
総合警備保障	3,000	2,191.00	6,573,000
カカクコム	5,000	1,500.00	7,500,000
新日本科学	800	935.00	748,000

ツクイ	1,700	1,129.00	1,919,300
エムスリー	5,400	1,466.00	7,916,400
ディー・エヌ・エー	4,400	1,821.00	8,012,400
博報堂D Yホールディングス	11,300	770.00	8,701,000
ぐるなび	1,200	1,444.00	1,732,800
一休	900	1,110.00	999,000
P G Mホールディングス	400	1,008.00	403,200
バリューコマース	700	976.00	683,200
J Pホールディングス	1,100	458.00	503,800
イーピーエス	1,600	1,000.00	1,600,000
ケネディクス	9,700	353.00	3,424,100
電通	7,700	4,260.00	32,802,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	2,018.00	1,009,000
みらかホールディングス	2,100	4,305.00	9,040,500
アルプス技研	500	993.00	496,500
サニックス	1,400	1,230.00	1,722,000
オリエンタルランド	2,200	15,870.00	34,914,000
ダスキン	2,200	1,890.00	4,158,000
明光ネットワークジャパン	1,800	1,098.00	1,976,400
ファルコS Dホールディングス	500	1,159.00	579,500
ラウンドワン	2,300	774.00	1,780,200
リゾートトラスト	2,800	1,600.00	4,480,000
ピー・エム・エル	500	3,800.00	1,900,000
もしもしホットライン	1,500	984.00	1,476,000
ユー・エス・エス	9,900	1,472.00	14,572,800
楽天	26,600	1,316.00	35,005,600
リゾートソリューション	2,000	228.00	456,000
リブセンス	600	1,053.00	631,800
リロ・ホールディング	300	5,350.00	1,605,000
エイチ・アイ・エス	700	5,690.00	3,983,000
共立メンテナンス	400	3,405.00	1,362,000
イチネンホールディングス	1,100	745.00	819,500
建設技術研究所	300	1,059.00	317,700
燦ホールディングス	700	1,356.00	949,200
東京テアトル	6,000	142.00	852,000
よみうりランド	2,000	412.00	824,000
東京都競馬	6,000	285.00	1,710,000
常磐興産	5,000	140.00	700,000
カナモト	1,000	3,320.00	3,320,000
東京ドーム	6,000	471.00	2,826,000
西尾レントオール	600	3,735.00	2,241,000
トランス・コスモス	1,100	1,955.00	2,150,500
乃村工藝社	1,700	768.00	1,305,600

藤田観光	4,000	327.00	1,308,000
トーカイ	100	2,598.00	259,800
セコム	8,500	5,953.00	50,600,500
セントラル警備保障	500	999.00	499,500
丹青社	500	401.00	200,500
メイテック	1,100	2,720.00	2,992,000
アサツー ディ・ケイ	1,400	2,226.00	3,116,400
応用地質	1,100	1,400.00	1,540,000
船井総合研究所	2,100	804.00	1,688,400
ベネッセホールディングス	2,700	3,935.00	10,624,500
イオンディライト	800	2,138.00	1,710,400
ナック	200	1,528.00	305,600
ニチイ学館	1,800	935.00	1,683,000
ダイセキ	1,200	1,629.00	1,954,800
ステップ	700	753.00	527,100
合計	12,677,150		13,023,623,950

(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10月21日現在	平成26年 4月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	326,768,441	326,732,559
コール・ローン	12,703,800	12,286,917
株式	12,890,912,083	12,284,157,139
投資信託受益証券	2,051,905	1,870,796
投資証券	280,497,452	280,862,620
派生商品評価勘定	13,260,050	2,282,412
未収入金	80,018	3,152,953
未収配当金	12,687,306	19,183,722
未収利息	13	13
差入委託証拠金	199,729,478	276,206,548

	平成25年10月21日現在	平成26年 4月21日現在
流動資産合計	13,738,690,546	13,206,735,679
資産合計	13,738,690,546	13,206,735,679
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,792	2,234,347
未払金	-	7,188,914
未払解約金	16,000,000	-
流動負債合計	16,003,792	9,423,261
負債合計	16,003,792	9,423,261
純資産の部		
元本等		
元本	9,636,167,385	8,292,700,405
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,086,519,369	4,904,612,013
元本等合計	13,722,686,754	13,197,312,418
純資産合計	13,722,686,754	13,197,312,418
負債純資産合計	13,738,690,546	13,206,735,679

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10月22日 至 平成26年 4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 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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所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 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式及び投資証券 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>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。</p>
----------------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

平成25年10月21日現在		平成26年 4月21日現在	
1. 計算日における受益権の総数	9,636,167,385口	1. 計算日における受益権の総数	8,292,700,405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	1.4241円	1口当たり純資産額	1.5914円
(1万口当たり純資産額)	(14,241円)	(1万口当たり純資産額)	(15,914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25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスク、為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・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>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成25年10月21日現在	平成26年 4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>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4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	10,860,831,302円	9,636,167,385円
期中追加設定元本額	63,062,457円	334,853,184円
期中一部解約元本額	1,287,726,374円	1,678,320,164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	900,021,204円	715,179,800円
新光外国株式インデックスV A	4,187,975,450円	3,726,380,709円
新光世界バランスファンド3 5 V A（適格機関投資家私募）	985,157,221円	849,466,897円
新光ワールドバランスファンドV A（適格機関投資家私募）	836,551,878円	705,663,211円
新光世界バランス3 5 V A T（適格機関投資家私募）	532,695,120円	377,456,738円
ワールドバランスファンド3 0 V A（適格機関投資家私募）	1,431,709,467円	1,229,889,070円
ワールドバランスファンド3 0 V A 2（適格機関投資家私募）	762,057,045円	677,365,670円
グローバル・ナビ	- 円	11,298,310円
合計	9,636,167,385円	8,292,700,405円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年10月21日現在	平成26年 4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	2,427,034,863	495,395,736
投資信託受益証券	13,238	124,720
投資証券	18,192,245	14,392,043
合計	2,445,240,346	509,663,059

(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10月21日現在				平成26年 4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	525,933,934	-	539,129,542	13,195,608	606,776,756	-	606,755,127	21,629
S&P500 EMINI	373,132,763	-	383,132,677	9,999,914	401,321,569	-	400,498,213	823,356
S&P/TSE 601X	13,947,207	-	14,311,862	364,655	15,308,337	-	15,366,450	58,113
DJ EURO ST50	46,675,108	-	48,601,464	1,926,356	74,519,415	-	74,640,487	121,072
LIFFE FTSE	51,666,065	-	52,246,894	580,829	67,929,959	-	68,009,081	79,122
SWISS MKT IX	26,192,078	-	26,294,568	102,490	28,669,704	-	29,009,502	339,798
OMXS30 INDEX	1,918,830	-	1,959,243	40,413	6,188,368	-	6,196,770	8,402
SPI 200	12,401,883	-	12,582,834	180,951	12,839,404	-	13,034,624	195,220
合計	525,933,934	-	539,129,542	13,195,608	606,776,756	-	606,755,127	21,629

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10月21日現在				平成26年 4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								
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	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	2,037	98.96	201,581.52	

APACHE CORP	1,616	85.11	137,537.76
BAKER HUGHES INC	1,874	68.33	128,050.42
CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,782	34.92	62,227.44
CAMERON INTERNATIONAL CORPORATION	963	63.58	61,227.54
CHENIERE ENERGY INC	857	55.28	47,374.96
CHESAPEAKE ENERGY CORP	2,400	28.17	67,608.00
CHEVRON CORP	7,785	123.68	962,848.80
CIMAREX ENERGY CO	400	121.02	48,408.00
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	1,300	18.16	23,608.00
CONCHO RESOURCES INC	425	133.20	56,610.00
CONOCOPHILLIPS	4,711	74.77	352,241.47
CONSOL ENERGY INC	1,001	41.81	41,851.81
CONTINENTAL RESOURCES INC	200	135.31	27,062.00
CORE LABORATORIES NV	200	214.70	42,940.00
DENBURY RESOURCES INC	1,800	17.24	31,032.00
DEVON ENERGY CORPORATION	1,561	70.70	110,362.70
DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC	300	48.40	14,520.00
ENERGEN CORPORATION	300	80.34	24,102.00
ENSCO PLC-CLASS A	945	49.98	47,231.10
EOG RESOURCES INC	2,210	102.45	226,414.50
EQT CORPORATION	610	104.72	63,879.20
EXXON MOBIL CORP	17,683	100.42	1,775,726.86
FMC TECHNOLOGIES INC	1,036	54.80	56,772.80
HALLIBURTON CO	3,433	60.90	209,069.70
HELMERICH & PAYNE INC	434	110.84	48,104.56
HESS CORPORATION	1,307	87.27	114,061.89
HOLLYFRONTIER CORPORATION	900	50.80	45,720.00
KINDER MORGAN INC	2,725	33.77	92,023.25
MARATHON OIL CORP	3,001	36.73	110,226.73
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	1,218	89.91	109,510.38
MURPHY OIL CORPORATION	793	63.94	50,704.42
NABORS INDUSTRIES LTD	1,246	24.81	30,913.26
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,733	82.37	142,747.21
NOBLE CORPORATION PLC	1,108	30.36	33,638.88
NOBLE ENERGY INC	1,454	74.42	108,206.68
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	3,263	96.60	315,205.80
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	500	73.80	36,900.00
ONEOK INC	872	61.03	53,218.16
PEABODY ENERGY CORP	1,300	16.71	21,723.00
PHILLIPS 66	2,305	80.28	185,045.40
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	561	203.31	114,056.91
QEP RESOURCES INC	758	32.32	24,498.56

RANGE RESOURCES CORP	715	92.91	66,430.65
ROWAN COMPANIES PLC	700	30.38	21,266.00
SCHLUMBERGER LIMITED	5,331	99.91	532,620.21
SOUTHWESTERN ENERGY CO	1,424	48.93	69,676.32
SPECTRA ENERGY CORPORATION	2,831	39.34	111,371.54
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	800	31.30	25,040.00
TESORO CORPORATION	571	52.88	30,194.48
VALERO ENERGY CORP	2,293	56.00	128,408.00
WEATHERFORD INTERNATIONAL LIMITED	3,247	18.21	59,127.87
WHITING PETROLEUM CORPORATION	480	74.85	35,928.00
WILLIAMS COS INC	2,766	41.79	115,591.14
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	855	117.94	100,838.70
AIRGAS INC	300	107.94	32,382.00
ALBEMARLE CORPORATION	400	66.68	26,672.00
ALCOA INC	4,523	13.56	61,331.88
ASHLAND INC	300	96.76	29,028.00
AVERY DENNISON CORPORATION	429	50.68	21,741.72
BALL CORPORATION	556	56.24	31,269.44
CELANESE CORP-SERIES A	700	57.57	40,299.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	232	242.34	56,222.88
CROWN HOLDINGS INC	700	46.59	32,613.00
DOW CHEMICAL	4,909	48.72	239,166.48
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	3,749	66.98	251,108.02
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	700	88.58	62,006.00
ECOLAB INC	1,098	107.79	118,353.42
FMC CORPORATION	600	76.75	46,050.00
FREEMONT-MCMORAN COPPER & GOLD INC	4,389	33.01	144,880.89
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	400	95.14	38,056.00
INTERNATIONAL PAPER CO	1,853	45.46	84,237.38
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	1,903	92.11	175,285.33
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	200	125.55	25,110.00
MEADWESTVACO CORPORATION	900	38.24	34,416.00
MONSANTO CO	2,128	112.95	240,357.60
NEWMONT MINING CORP	2,300	23.54	54,142.00
NUCOR CORP	1,288	52.14	67,156.32
OWENS-ILLINOIS INC	683	33.69	23,010.27
PPG INDUSTRIES INC	604	199.46	120,473.84
PRAXAIR INC	1,192	131.86	157,177.12
ROCK-TENN COMPANY-CL A	300	98.97	29,691.00
SEALED AIR CORPORATION	846	32.27	27,300.42
SIGMA-ALDRICH	508	94.07	47,787.56
THE MOSAIC COMPANY	1,300	48.72	63,336.00

THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	364	197.59	71,922.76
VULCAN MATERIALS CO	600	64.75	38,850.00
3M CO	2,589	137.73	356,582.97
AGCO CORPORATION	500	56.63	28,315.00
AMETEK INC	1,033	52.03	53,746.99
B/E AEROSPACE INC	466	85.22	39,712.52
BOEING CO	2,890	127.92	369,688.80
CATERPILLAR INC	2,576	102.83	264,890.08
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	439	86.50	37,973.50
CUMMINS INC	752	146.28	110,002.56
DANAHER CORP	2,399	72.85	174,767.15
DEERE & CO	1,472	93.40	137,484.80
DOVER CORP	722	85.46	61,702.12
EATON CORPORATION PLC	2,004	73.82	147,935.28
EMERSON ELECTRIC CO	2,849	68.44	194,985.56
FASTENAL CO	1,233	50.12	61,797.96
FLOWSERVE CORPORATION	600	79.04	47,424.00
FLUOR CORP	689	77.87	53,652.43
GENERAL DYNAMICS CORP	1,212	109.06	132,180.72
GENERAL ELECTRIC CO(US)	40,953	26.56	1,087,711.68
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	3,017	93.10	280,882.70
ILLINOIS TOOL WORKS	1,707	84.21	143,746.47
INGERSOLL-RAND PLC	1,178	57.82	68,111.96
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	600	63.73	38,238.00
JOY GLOBAL INC	500	61.55	30,775.00
KBR INC	800	26.32	21,056.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	400	117.73	47,092.00
LOCKHEED MARTIN CORP	1,102	160.25	176,595.50
MASCO CORP	1,600	22.06	35,296.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	854	122.00	104,188.00
PACCAR INC	1,433	65.38	93,689.54
PALL CORPORATION	500	86.27	43,135.00
PARKER HANNIFIN CORP	604	125.35	75,711.40
PENTAIR LIMITED	842	79.55	66,981.10
PRECISION CASTPARTS CORP	615	257.18	158,165.70
QUANTA SERVICES INC	896	36.64	32,829.44
RAYTHEON COMPANY	1,293	100.13	129,468.09
ROCKWELL AUTOMATION INC	600	127.02	76,212.00
ROCKWELL COLLINS INC.	600	79.47	47,682.00
ROPER INDUSTRIES INC	434	130.34	56,567.56
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	600	44.75	26,850.00
SPX CORP	200	99.94	19,988.00

STANLEY BLACK & DECKER INC	643	81.92	52,674.56
TEXTRON INC	1,300	39.54	51,402.00
TRANSDIGM GROUP INC	200	181.00	36,200.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	3,528	118.57	418,314.96
WW GRAINGER INC	239	252.15	60,263.85
XYLEM INC	784	35.30	27,675.20
CINTAS CORPORATION	500	57.63	28,815.00
DUN & BRADSTREET CORP	200	105.00	21,000.00
EQUIFAX INC	493	68.61	33,824.73
IHS INC-CLASS A	300	118.54	35,562.00
IRON MOUNTAIN INCORPORATED	779	27.10	21,110.90
MANPOWER GROUP	400	77.10	30,840.00
NIELSEN HOLDINGS NV	1,100	44.83	49,313.00
REPUBLIC SERVICES INC	1,225	34.47	42,225.75
ROBERT HALF INTL INC	607	42.18	25,603.26
STERICYCLE INC	400	111.15	44,460.00
THE ADT CORPORATION	975	30.22	29,464.50
TOWERS WATSON & COMPANY-CL A	297	108.42	32,200.74
TYCO INTERNATIONAL LIMITED	2,022	42.22	85,368.84
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	700	57.60	40,320.00
WASTE MANAGEMENT INC	1,883	42.03	79,142.49
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	674	56.74	38,242.76
CSX CORP	4,309	28.15	121,298.35
DELTA AIR LINES INC	1,000	33.76	33,760.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	900	40.01	36,009.00
FEDEX CORP	1,218	135.55	165,099.90
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,800	28.07	50,526.00
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	400	75.81	30,324.00
KANSAS CITY SOUTHERN	500	101.14	50,570.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,319	96.27	126,980.13
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	705	23.49	16,560.45
UNION PACIFIC CORP	1,864	189.59	353,395.76
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	400	43.55	17,420.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,897	98.00	283,906.00
AUTOLIV INC	400	102.61	41,044.00
BORGWARNER INC	1,000	62.59	62,590.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	1,234	67.20	82,924.80
FORD MOTOR CO	14,895	16.00	238,320.00
GENERAL MOTORS CO	4,943	33.98	167,963.14
HARLEY-DAVIDSON INC	976	66.64	65,040.64
JOHNSON CONTROLS INC	2,773	46.83	129,859.59
TESLA MOTORS INC	362	198.12	71,719.44

TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORPORATION	495	82.33	40,753.35
COACH INC	1,135	49.48	56,159.80
DR HORTON INC	1,176	21.50	25,284.00
FOSSIL GROUP INC	200	109.42	21,884.00
GARMIN LIMITED	474	56.17	26,624.58
HASBRO INC	473	54.61	25,830.53
LEGGETT & PLATT INC	700	32.95	23,065.00
LENNAR CORPORATION-CLASS A	800	38.22	30,576.00
LULULEMON ATHLETICA INC	500	51.71	25,855.00
MATTEL INC	1,507	37.47	56,467.29
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	816	89.93	73,382.88
MOHAWK INDUSTRIES INC	250	134.82	33,705.00
NEWELL RUBBERMAID INC	1,300	29.89	38,857.00
NIKE INC -CL B	2,880	74.03	213,206.40
POLARIS INDUSTRIES INC	300	135.39	40,617.00
PULTEGROUP INC	1,700	18.71	31,807.00
PVH CORPORATION	343	122.59	42,048.37
RALPH LAUREN CORPORATION	256	154.38	39,521.28
TOLL BROTHERS INC	800	34.16	27,328.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	658	53.06	34,913.48
VF CORP	1,487	59.85	88,996.95
WHIRLPOOL CORP	347	153.75	53,351.25
CARNIVAL CORP(US)	1,682	37.32	62,772.24
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	125	519.61	64,951.25
DARDEN RESTAURANTS INC	570	48.47	27,627.90
H&R BLOCK INC	1,300	28.20	36,660.00
INTL GAME TECHNOLOGY	1,103	13.89	15,320.67
LAS VEGAS SANDS CORP	1,659	76.46	126,847.14
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	970	56.25	54,562.50
MCDONALD'S CORP	4,028	100.25	403,807.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,587	23.96	38,024.52
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	650	51.34	33,371.00
STARBUCKS CORP	3,050	70.15	213,957.50
STARWOOD HOTELS & RESORTS	808	77.58	62,684.64
WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	581	71.87	41,756.47
WYNN RESORTS LTD	354	208.00	73,632.00
YUM! BRANDS INC	1,803	76.34	137,641.02
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	900	16.12	14,508.00
CBS CORP-CLASS B	2,367	60.64	143,534.88
CHARTER COMMUNICATION INC-A	300	117.83	35,349.00
COMCAST CORP-CL A	8,646	49.10	424,518.60
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	1,902	48.54	92,323.08

DIRECTV	2,107	75.64	159,373.48
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	400	72.75	29,100.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	650	77.83	50,589.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	1,000	59.47	59,470.00
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	1,785	16.93	30,220.05
LIBERTY GLOBAL PLC-A	964	39.40	37,981.60
LIBERTY GLOBAL PLC-C	2,302	38.50	88,627.00
LIBERTY MEDIA CORPORATION	400	124.76	49,904.00
NEWS CORPRATION-CLASS A	1,900	16.88	32,072.00
OMNICOM GROUP	1,086	71.16	77,279.76
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	400	74.39	29,756.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	14,116	3.14	44,324.24
THE WALT DISNEY CO.	6,757	79.99	540,492.43
TIME WARNER CABLE INC	1,141	135.33	154,411.53
TIME WARNER INC	3,662	65.15	238,579.30
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	6,004	32.52	195,250.08
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	1,921	31.69	60,876.49
VIACOM INC-CLASS B	1,667	84.05	140,111.35
ADVANCE AUTO PARTS INC	300	120.84	36,252.00
AMAZON.COM INC	1,482	324.91	481,516.62
AUTOZONE INC	144	516.16	74,327.04
BED BATH & BEYOND INC	869	63.70	55,355.30
BEST BUY CO INC	1,300	24.48	31,824.00
CARMAX INC	945	44.44	41,995.80
DICK'S SPORTING GOODS INC	457	51.86	23,700.02
DOLLAR GENERAL CORPORATION	1,244	55.43	68,954.92
DOLLAR TREE INC	842	51.09	43,017.78
EXPEDIA INC	485	72.46	35,143.10
FAMILY DOLLAR STORES	500	56.84	28,420.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	500	41.47	20,735.00
GAP INC/THE	1,042	38.58	40,200.36
GENUINE PARTS CO	700	87.32	61,124.00
HOME DEPOT INC	5,700	77.09	439,413.00
KOHL'S CORP	871	54.26	47,260.46
L BRANDS INC	1,100	53.96	59,356.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	1,941	29.52	57,298.32
LKQ CORPORATION	1,269	27.38	34,745.22
LOWE'S COS INC	4,250	46.80	198,900.00
MACY'S INC	1,492	56.83	84,790.36
NETFLIX INC	225	345.74	77,791.50
NORDSTROM INC	685	60.84	41,675.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	453	146.44	66,337.32

PETSMART INC	399	66.80	26,653.20
PRICELINE GROUP INC/THE	208	1,208.36	251,338.88
ROSS STORES INC	877	68.99	60,504.23
SEARS HOLDINGS CORP	169	38.33	6,477.77
STAPLES INC	2,889	12.03	34,754.67
TARGET CORP	2,431	60.00	145,860.00
TIFFANY & CO	518	86.65	44,884.70
TJX COMPANIES INC	2,895	58.70	169,936.50
TRACTOR SUPPLY COMPANY	600	67.25	40,350.00
TRIPADVISOR INC	500	85.68	42,840.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	300	87.79	26,337.00
URBAN OUTFITTERS INC	498	35.62	17,738.76
COSTCO WHOLESALE CORP	1,769	113.50	200,781.50
CVS CAREMARK CORPORATION	4,818	73.74	355,279.32
KROGER CO	2,082	44.28	92,190.96
SAFEWAY INC	1,055	34.12	35,996.60
SYSCO CORP	2,510	36.03	90,435.30
WAL-MART STORES INC	6,589	77.66	511,701.74
WALGREEN CO	3,652	66.75	243,771.00
WHOLE FOODS MARKET INC	1,431	48.13	68,874.03
ALTRIA GROUP INC	8,096	38.45	311,291.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,788	45.04	125,571.52
BEAM INC	594	83.27	49,462.38
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	550	88.92	48,906.00
BUNGE LIMITED	596	80.25	47,829.00
CAMPBELL SOUP COMPANY	825	44.54	36,745.50
COCA-COLA CO/THE	16,087	40.72	655,062.64
COCA-COLA ENTERPRISES INC	1,111	45.19	50,206.09
CONAGRA FOODS INC	1,846	31.34	57,853.64
CONSTELLATION BRANDS INC-A	700	80.78	56,546.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	890	52.54	46,760.60
GENERAL MILLS INC	2,567	52.09	133,715.03
HERSHEY CO/THE	627	100.61	63,082.47
HORMEL FOODS CORPORATION	700	47.78	33,446.00
KELLOGG COMPANY	1,073	66.34	71,182.82
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	535	98.38	52,633.30
KRAFT FOODS GROUP INC	2,519	56.91	143,356.29
LORILLARD INC	1,491	54.52	81,289.32
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	485	70.98	34,425.30
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	900	84.45	76,005.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	700	58.31	40,817.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	6,744	34.65	233,679.60

MONSTER BEVERAGE CORPORATION	602	67.55	40,665.10
PEPSICO INC	6,208	85.55	531,094.40
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	6,485	83.15	539,227.75
REYNOLDS AMERICAN INC	1,428	54.90	78,397.20
THE JM SMUCKER COMPANY	426	96.70	41,194.20
TYSON FOODS INC-CL A	1,234	42.65	52,630.10
AVON PRODUCTS INC	2,200	14.51	31,922.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	586	69.18	40,539.48
CLOROX COMPANY	600	90.84	54,504.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,745	66.94	250,690.30
ENERGIZER HOLDINGS INC	300	98.39	29,517.00
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	1,008	72.15	72,727.20
HERBALIFE LIMITED	400	55.10	22,040.00
KIMBERLY-CLARK CORP	1,545	112.54	173,874.30
PROCTER & GAMBLE CO	11,003	81.76	899,605.28
ABBOTT LABORATORIES	6,259	38.93	243,662.87
AETNA INC	1,551	67.77	105,111.27
AMERISOURCEBERGEN CORP	976	64.68	63,127.68
BARD (C.R.) INC	342	139.49	47,705.58
BAXTER INTERNATIONAL INC.	2,295	72.81	167,098.95
BECTON DICKINSON & CO	821	113.16	92,904.36
BOSTON SCIENTIFIC CORP	5,679	13.65	77,518.35
CARDINAL HEALTH INC	1,382	68.13	94,155.66
CAREFUSION CORPORATION	855	38.50	32,917.50
CERNER CORPORATION	1,250	54.00	67,500.00
CIGNA CORP	1,196	75.64	90,465.44
COVIDIEN PLC	1,831	69.86	127,913.66
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	800	69.51	55,608.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	700	45.19	31,633.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	491	81.29	39,913.39
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	3,262	72.29	235,809.98
HCA HOLDINGS INC	1,300	49.01	63,713.00
HENRY SCHEIN INC	400	113.87	45,548.00
HOLOGIC INC	1,300	20.79	27,027.00
HUMANA INC	631	104.74	66,090.94
INTUITIVE SURGICAL INC	154	411.99	63,446.46
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	400	101.31	40,524.00
MCKESSON CORP	930	170.98	159,011.40
MEDTRONIC INC	4,038	58.55	236,424.90
OMNICARE INC	452	57.82	26,134.64
PATTERSON COMPANIES INC	500	41.04	20,520.00
QUEST DIAGNOSTICS	664	59.48	39,494.72

RESMED INC	700	47.44	33,208.00
ST JUDE MEDICAL INC	1,256	62.49	78,487.44
STRYKER CORP	1,279	78.78	100,759.62
UNITEDHEALTH GROUP INC	4,075	75.78	308,803.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	413	74.65	30,830.45
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	500	80.28	40,140.00
WELLPOINT INC	1,196	92.00	110,032.00
ZIMMER HOLDINGS INC	717	90.99	65,239.83
ABBVIE INC	6,439	48.55	312,613.45
ACTAVIS PLC	733	197.39	144,686.87
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,447	54.65	79,078.55
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	827	149.80	123,884.60
ALLERGAN INC	1,203	133.92	161,105.76
AMGEN INC	3,053	115.46	352,499.38
BIOGEN IDEC INC	956	290.54	277,756.24
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	592	60.89	36,046.88
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,665	49.46	329,650.90
CELGENE CORP	1,668	141.51	236,038.68
ELI LILLY & CO	4,104	60.43	248,004.72
FOREST LABORATORIES INC	981	89.58	87,877.98
GILEAD SCIENCES INC	6,207	70.00	434,490.00
HOSPIRA INC	800	42.84	34,272.00
ILLUMINA INC	529	135.45	71,653.05
JOHNSON & JOHNSON	11,420	98.96	1,130,123.20
MERCK & CO. INC.	11,827	56.47	667,870.69
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	136	233.50	31,756.00
MYLAN INC	1,670	46.92	78,356.40
PERRIGO CO PLC	562	141.99	79,798.38
PFIZER INC	26,234	30.25	793,578.50
PHARMACYCLICS INC	283	89.75	25,399.25
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	327	296.74	97,033.98
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,463	119.30	174,535.90
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,000	64.17	64,170.00
WATERS CORP	400	111.15	44,460.00
ZOETIS INC	2,187	28.60	62,548.20
BANK OF AMERICA CORPORATION	43,174	16.15	697,260.10
BB&T CORPORATION	2,977	37.93	112,917.61
CIT GROUP INC	835	46.42	38,760.70
CITIGROUP INC	12,277	48.22	591,996.94
COMERICA INC	809	48.46	39,204.14
FIFTH THIRD BANCORP	3,724	20.95	78,017.80
FIRST REPUBLIC BANK/CA	400	52.08	20,832.00

HUDSON CITY BANCORP INC	2,300	9.90	22,770.00
JPMORGAN CHASE & CO	15,216	55.22	840,227.52
KEYCORP	3,630	13.56	49,222.80
M & T BANK CORP	500	121.54	60,770.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	2,200	16.25	35,750.00
OCWEN FINANCIAL CORPORATION	525	39.01	20,480.25
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	1,460	14.54	21,228.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,154	83.77	180,440.58
REGIONS FINANCIAL CORP	5,576	10.22	56,986.72
SUNTRUST BANKS INC	2,170	37.95	82,351.50
US BANCORP	7,392	40.25	297,528.00
WELLS FARGO & COMPANY	20,256	48.93	991,126.08
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	240	186.64	44,793.60
AMERICAN EXPRESS CO	3,903	86.22	336,516.66
AMERIPRISE FINANCIAL INC	787	106.03	83,445.61
BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	4,649	33.76	156,950.24
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	4,499	127.18	572,182.82
BLACKROCK INC	541	308.38	166,833.58
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,334	74.89	174,793.26
CME GROUP INC	1,343	69.30	93,069.90
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,046	56.86	116,335.56
EATON VANCE CORPORATION	529	37.00	19,573.00
FRANKLIN RESOURCES INC	1,746	53.70	93,760.20
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,743	157.44	274,417.92
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP INC	487	198.27	96,557.49
INVESCO LIMITED	1,937	35.22	68,221.14
LEGG MASON INC	486	45.66	22,190.76
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,400	26.08	36,512.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	1,086	76.67	83,263.62
MOODY'S CORP	868	78.85	68,441.80
MORGAN STANLEY	5,924	30.76	182,222.24
NASDAQ OMX GROUP INC	600	35.01	21,006.00
NORTHERN TRUST CORP	1,000	59.39	59,390.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	600	50.21	30,126.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	587	31.44	18,455.28
SLM CORPORATION	1,908	25.93	49,474.44
STATE STREET CORP	1,777	65.53	116,446.81
T ROWE PRICE GROUP INC	1,100	80.63	88,693.00
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	963	31.78	30,604.14
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	4,890	27.04	132,225.60
ACE LIMITED	1,376	100.94	138,893.44
AFLAC INC	1,967	63.05	124,019.35

ALLEGHANY CORPORATION	76	409.17	31,096.92
ALLSTATE CORP	1,960	55.77	109,309.20
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	5,662	50.82	287,742.84
AON PLC	1,158	82.14	95,118.12
ARCH CAPITAL GROUP LTD	584	57.38	33,509.92
ASSURANT INC	294	65.95	19,389.30
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	450	46.35	20,857.50
CHUBB CORP	1,019	90.81	92,535.39
CINCINNATI FINANCIAL CORP	700	48.77	34,139.00
EVEREST RE GROUP LTD	200	158.41	31,682.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-A	1,100	31.29	34,419.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,891	34.67	65,560.97
LINCOLN NATIONAL CORP	1,062	48.07	51,050.34
LOEWS CORPORATION	1,440	43.95	63,288.00
MARSH & MCLENNAN COS	2,221	48.27	107,207.67
METLIFE INC	3,944	51.20	201,932.80
PARTNERRE LTD	200	102.67	20,534.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,300	45.20	58,760.00
PROGRESSIVE CORP	2,415	23.96	57,863.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,866	80.92	150,996.72
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	200	101.32	20,264.00
TORCHMARK CORPORATION	350	78.48	27,468.00
TRAVELERS COS INC/THE	1,474	86.68	127,766.32
UNUM GROUP	1,153	33.92	39,109.76
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	732	42.25	30,927.00
WR BERKLEY CORP	500	41.39	20,695.00
XL GROUP PLC	1,145	31.23	35,758.35
CBRE GROUP INC	1,140	26.96	30,734.40
REALOGY HOLDINGS CORPORATION	600	42.02	25,212.00
ACCENTURE PLC	2,573	78.90	203,009.70
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,910	19.69	37,607.90
ADOBE SYSTEMS INC	2,018	64.04	129,232.72
AKAMAI TECHNOLOGIES	800	54.30	43,440.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	200	245.06	49,012.00
ANSYS INC	400	75.81	30,324.00
AUTODESK INC	941	48.49	45,629.09
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,949	76.31	148,728.19
BLACKHAWK NETWORK HOLDINGS INC	173	24.56	4,248.88
CA INC	1,349	30.41	41,023.09
CITRIX SYSTEMS INC	787	56.00	44,072.00
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	2,449	49.55	121,347.95
COMPUTER SCIENCES CORP	646	61.08	39,457.68

EBAY INC	4,716	54.97	259,238.52
ELECTRONIC ARTS INC	1,251	27.57	34,490.07
EQUINIX INC	200	178.97	35,794.00
FACEBOOK INC-A	7,469	58.94	440,222.86
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,280	52.68	67,430.40
FISERV INC	1,044	57.58	60,113.52
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	316	114.96	36,327.36
GOOGLE INC-CL A	1,120	543.34	608,540.80
GOOGLE INC-CL C	1,120	536.10	600,432.00
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	4,176	190.01	793,481.76
INTUIT INC	1,096	74.03	81,136.88
LEIDOS HOLDINGS INC	375	37.36	14,010.00
LINKEDIN CORPORATION-A	418	175.42	73,325.56
MASTERCARD INC.-CLASS A	4,219	74.13	312,754.47
MICROSOFT CORP	32,101	40.01	1,284,361.01
NETSUITE INC	152	82.65	12,562.80
NUANCE COMMUNICATIONS INC	1,400	16.16	22,624.00
ORACLE CORPORATION	14,758	40.08	591,500.64
PAYCHEX INC	1,439	40.93	58,898.27
RACKSPACE HOSTING INC	600	31.49	18,894.00
RED HAT INC	828	50.55	41,855.40
SALESFORCE COM INC	2,394	56.10	134,303.40
SERVICENOW INC	560	53.26	29,825.60
SYMANTEC CORP	2,958	20.71	61,260.18
SYNOPSYS INC	700	37.52	26,264.00
TERADATA CORPORATION	800	46.99	37,592.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	746	29.44	21,962.24
VANTIV INC-CLASS A	561	29.58	16,594.38
VERISIGN INC	555	50.66	28,116.30
VISA INC-CLASS A SHARES	2,048	207.95	425,881.60
VMWARE INC-CLASS A	400	103.17	41,268.00
WESTERN UNION COMPANY	2,334	15.25	35,593.50
WORKDAY INC-CLASS A	301	79.80	24,019.80
XEROX CORPORATION	5,121	11.43	58,533.03
YAHOO! INC	3,901	36.38	141,918.38
AMPHENOL CORPORATION-CL A	696	94.12	65,507.52
APPLE INC	3,642	524.94	1,911,831.48
ARROW ELECTRONICS INC	500	59.42	29,710.00
AVNET INC	600	46.13	27,678.00
CISCO SYSTEMS INC	21,642	23.21	502,310.82
CORNING INC	6,176	21.04	129,943.04
EMC CORP/MASSACHUSETTS	8,330	26.62	221,744.60

F5 NETWORKS INC	328	108.40	35,555.20
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	2,460	9.42	23,173.20
FLIR SYSTEMS INC	573	35.70	20,456.10
HARRIS CORPORATION	500	72.22	36,110.00
HEWLETT-PACKARD COMPANY	7,779	31.93	248,383.47
JUNIPER NETWORKS INC	2,143	25.17	53,939.31
MOTOROLA SOLUTIONS INC	942	63.15	59,487.30
NETAPP INC	1,487	35.87	53,338.69
QUALCOMM INC	6,838	81.32	556,066.16
SANDISK CORP	954	82.99	79,172.46
SEAGATE TECHNOLOGY	1,404	55.57	78,020.28
TE CONNECTIVITY LIMITED	1,661	61.07	101,437.27
TRIMBLE NAVIGATION LIMITED	1,086	39.50	42,897.00
WESTERN DIGITAL CORPORATION	862	91.05	78,485.10
AT&T INC	21,324	36.04	768,516.96
CENTURYLINK INC	2,393	34.43	82,390.99
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	4,219	5.89	24,849.91
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	659	38.49	25,364.91
SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	520	91.17	47,408.40
SPRINT CORPORATION	4,152	8.52	35,375.04
T-MOBILE US INC	850	30.40	25,840.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	16,736	47.60	796,633.60
WINDSTREAM HOLDINGS INC	2,593	8.82	22,870.26
AES CORP	2,757	14.26	39,314.82
ALLIANT ENERGY CORP	469	57.73	27,075.37
AMEREN CORPORATION	1,061	40.99	43,490.39
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,972	51.73	102,011.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	800	45.67	36,536.00
CALPINE CORPORATION	1,700	21.37	36,329.00
CENTERPOINT ENERGY INC	1,781	24.61	43,830.41
CMS ENERGY CORPORATION	1,129	29.78	33,621.62
CONSOLIDATED EDISON INC	1,300	56.50	73,450.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	2,349	70.67	166,003.83
DTE ENERGY COMPANY	800	76.62	61,296.00
DUKE ENERGY CORPORATION	2,858	72.57	207,405.06
EDISON INTERNATIONAL	1,309	56.38	73,801.42
ENERGY CORP	780	71.26	55,582.80
EXELON CORP	3,622	36.06	130,609.32
FIRSTENERGY CORP	1,829	33.61	61,472.69
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	400	61.37	24,548.00
MDU RESOURCES GROUP INC	800	35.08	28,064.00
NEXTERA ENERGY INC	1,796	96.59	173,475.64

NISOURCE INC	1,367	35.92	49,102.64
NORTHEAST UTILITIES	1,331	45.93	61,132.83
NRG ENERGY INC	1,366	32.21	43,998.86
OGE ENERGY CORPORATION	803	36.45	29,269.35
P G & E CORPORATION	1,819	44.87	81,618.53
PEPCO HOLDINGS INC	1,300	21.34	27,742.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	465	55.94	26,012.10
PPL CORPORATION	2,700	33.14	89,478.00
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	2,048	39.43	80,752.64
SCANA CORPORATION	600	52.69	31,614.00
SEMPRA ENERGY	940	97.13	91,302.20
SOUTHERN CO	3,569	45.12	161,033.28
WISCONSIN ENERGY CORPORATION	1,000	47.61	47,610.00
XCEL ENERGY INC	2,176	31.33	68,174.08
ALTERA CORPORATION	1,351	34.46	46,555.46
ANALOG DEVICES INC	1,359	52.85	71,823.15
APPLIED MATERIALS INC	4,874	18.99	92,557.26
AVAGO TECHNOLOGIES LIMITED	1,044	60.89	63,569.16
BROADCOM CORP-CL A	2,097	30.10	63,119.70
CREE INC	600	56.54	33,924.00
INTEL CORP	20,121	27.04	544,071.84
KLA-TENCOR CORPORATION	675	66.11	44,624.25
LAM RESEARCH CORP	700	52.74	36,918.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	948	46.37	43,958.76
LSI CORPORATION	2,700	11.09	29,943.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,900	15.61	29,659.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	1,300	32.08	41,704.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	900	47.33	42,597.00
MICRON TECHNOLOGY INC	4,258	23.91	101,808.78
NVIDIA CORP	2,301	18.56	42,706.56
TEXAS INSTRUMENTS INC	4,431	45.83	203,072.73
XILINX INC	1,126	52.18	58,754.68
米ドル 建小計	1,260,612		70,426,577.74 (7,229,288,205)
カナダドル			
ALTAGAS LIMITED	600	47.55	28,530.00
ARC RESOURCES LIMITED	1,319	33.02	43,553.38
ATHABASCA OIL CORPORATION	2,000	8.28	16,560.00
BAYTEX ENERGY CORPORATION	525	46.44	24,381.00
CAMECO CORP (CA)	1,672	25.11	41,983.92
CANADIAN NATURAL RESOURCES	4,395	44.75	196,676.25
CANADIAN OIL SANDS LIMITED	2,300	23.83	54,809.00
CENOVUS ENERGY INC	3,196	32.22	102,975.12

CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,593	44.50	70,888.50
ENBRIDGE INC	3,185	51.75	164,823.75
ENCANA CORP	2,996	25.78	77,236.88
ENERPLUS CORP	853	24.13	20,582.89
HUSKY ENERGY INC	1,600	36.29	58,064.00
IMPERIAL OIL LTD	1,297	52.01	67,456.97
INTER PIPELINE LIMITED	1,290	29.24	37,719.60
KEYERA CORP	400	71.57	28,628.00
MEG ENERGY CORPORATION	585	38.41	22,469.85
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	1,299	22.03	28,616.97
PEMBINA PIPELINE CORPORATION	1,267	43.01	54,493.67
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	2,500	7.04	17,600.00
PENN WEST PETROLEUM LIMITED	2,500	10.32	25,800.00
PEYTO EXPLORATION & DEVELOPMENT CORP	700	40.15	28,105.00
SUNCOR ENERGY INC	6,027	40.47	243,912.69
TALISMAN ENERGY INC	4,375	12.01	52,543.75
TOURMALINE OIL CORPORATION	800	55.47	44,376.00
TRANSCANADA CORPORATION	2,862	51.30	146,820.60
VERMILION ENERGY INC	500	71.80	35,900.00
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	731	31.26	22,851.06
AGRIUM INC	624	102.56	63,997.44
BARRICK GOLD CORP	4,916	19.81	97,385.96
ELDORADO GOLD CORPORATION	3,500	6.36	22,260.00
FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	2,500	21.05	52,625.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	621	50.95	31,639.95
GOLDCORP INC	3,434	26.01	89,318.34
KINROSS GOLD CORP	4,830	4.46	21,541.80
METHANEX CORPORATION	434	69.73	30,262.82
NEW GOLD INC	2,400	5.48	13,152.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	3,494	38.45	134,344.30
SILVER WHEATON CORPORATION	1,509	24.07	36,321.63
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	2,397	24.31	58,271.07
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	1,800	4.22	7,596.00
YAMANA GOLD INC	3,600	8.76	31,536.00
BOMBARDIER INC 'B'	6,312	4.01	25,311.12
CAE INC	1,104	14.86	16,405.44
FINNING INTERNATIONAL INC	900	29.31	26,379.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	641	47.19	30,248.79
CANADIAN NATL RAILWAY CO	3,406	62.45	212,704.70
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	741	163.21	120,938.61
MAGNA INTERNATIONAL INC	905	108.06	97,794.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	600	55.17	33,102.00

TIM HORTONS INC(CA)	660	62.29	41,111.40
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,691	26.56	44,912.96
THOMSON REUTERS CORP(CA)	1,633	38.35	62,625.55
CANADIAN TIRE CORP -CL A	326	106.84	34,829.84
DOLLARAMA INC	300	88.56	26,568.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	605	89.10	53,905.50
EMPIRE COMPANY LIMITED A	250	65.30	16,325.00
GEORGE WESTON LIMITED	200	81.64	16,328.00
LOBLAW COMPANIES LTD	1,144	46.36	53,035.84
METRO INC	371	65.70	24,374.70
SAPUTO INC	600	55.05	33,030.00
CATAMARAN CORPORATION	835	43.04	35,938.40
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	1,284	134.45	172,633.80
BANK OF MONTREAL	2,607	76.22	198,705.54
BANK OF NOVA SCOTIA	4,893	65.50	320,491.50
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,692	96.41	163,125.72
NATIONAL BANK OF CANADA	1,400	45.59	63,826.00
ROYAL BANK OF CANADA	5,833	73.42	428,258.86
TORONTO-DOMINION BANK(CA)	7,462	51.78	386,382.36
CI FINANCIAL CORPORATION	683	35.07	23,952.81
IGM FINANCIAL INC	500	53.15	26,575.00
ONEX CORPORATION	400	62.08	24,832.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	88	472.79	41,605.52
GREAT-WEST LIFECO INC	1,400	30.11	42,154.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	500	43.88	21,940.00
INTACT FINANCIAL CORPORATION	600	70.22	42,132.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	7,460	20.66	154,123.60
POWER CORP OF CANADA	1,529	30.52	46,665.08
POWER FINANCIAL CORP	1,200	34.19	41,028.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	2,650	36.85	97,652.50
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,235	46.35	103,592.25
FIRST CAPITAL REALTY INC	500	17.92	8,960.00
CGI GROUP INC -CL A	877	36.33	31,861.41
OPEN TEXT CORPORATION	600	51.60	30,960.00
BLACKBERRY LIMITED	2,400	7.87	18,888.00
BCE INC	1,036	48.96	50,722.56
BELL ALIANT INC	500	27.01	13,505.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,583	44.27	70,079.41
TELUS CORPORATION	944	38.42	36,268.48
ATCO LIMITED	400	54.57	21,828.00
CANADIAN UTILITIES LTD A	600	41.00	24,600.00

	FORTIS INC	1,000	32.01	32,010.00
	TRANSALTA CORP	1,600	13.13	21,008.00
	カナダドル 建小計	169,106		6,214,847.71 (578,788,767)
ユーロ	CGG	978	11.50	11,247.00
	ENI SPA	10,297	18.81	193,686.57
	FUGRO NV-CVA	345	45.46	15,685.42
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,322	12.59	16,650.59
	KONINKLIJKE VOPAK NV	307	41.08	12,613.09
	NESTE OIL OYJ	628	14.77	9,275.56
	OMV AG	644	31.75	20,447.00
	REPSOL SA	3,519	18.79	66,122.01
	SAIPEM	1,158	18.75	21,712.50
	TECHNIP S.A.	430	76.44	32,869.20
	TENARIS SA	2,065	16.10	33,246.50
	TOTAL SA	8,658	49.28	426,666.24
	AIR LIQUIDE SA	1,263	98.74	124,708.62
	AKZO NOBEL	1,014	53.55	54,299.70
	ARCELORMITTAL	4,370	11.71	51,172.70
	ARKEMA	308	76.61	23,595.88
	BASF SE	3,718	79.36	295,060.48
	CRH PLC(IE)	3,085	20.88	64,430.22
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	177	71.11	12,586.47
	HEIDELBERGCEMENT AG	615	61.75	37,976.25
	IMERYS SA	148	61.53	9,106.44
	K+S AG	727	23.30	16,939.10
	KONINKLIJKE DSM NV	674	49.62	33,443.88
	LAFARGE SA	756	65.86	49,790.16
	LANXESS AG	430	54.12	23,271.60
	LINDE AG	751	142.85	107,280.35
	SOLVAY SA	251	112.75	28,300.25
	STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	2,327	7.49	17,440.86
	THYSSENKRUPP AG	1,890	19.87	37,563.75
	UMICORE	482	37.62	18,132.84
	UPM-KYMMENE OYJ	2,142	11.51	24,654.42
	VOESTALPINE AG	549	31.04	17,040.96
	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	708	29.93	21,190.44
	AIRBUS GROUP NV	2,376	51.33	121,960.08
	ALSTOM	944	22.58	21,320.24
	ANDRITZ AG	376	43.66	16,416.16
	BOSKALIS WESTMINSTER NV	342	40.04	13,693.68

BOUYGUES SA	905	29.46	26,661.30
BRENTAG AG	225	129.75	29,193.75
CNH INDUSTRIAL NV	4,424	8.11	35,878.64
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,684	44.10	74,264.40
FERROVIAL SA	1,633	15.67	25,597.27
FINMECCANICA SPA	1,770	6.50	11,513.85
GEA GROUP AG	740	32.04	23,709.60
HOCHTIEF AG	174	65.55	11,405.70
KONE OYJ-B	1,366	30.45	41,594.70
KONINKLIJKE PHILIPS NV	3,796	24.93	94,653.26
LEGRAND SA	1,072	45.49	48,765.28
MAN SE	176	92.97	16,362.72
METSO OYJ	559	29.14	16,289.26
OCI NV	445	31.44	13,993.02
OSRAM LICHT AG	396	44.04	17,439.84
PRYSMIAN SPA	862	18.90	16,291.80
REXEL SA	1,041	18.61	19,373.01
SAFRAN SA	1,148	49.66	57,009.68
SCHNEIDER ELECTRIC SA	2,223	65.78	146,228.94
SIEMENS AG-REG	3,209	97.42	312,620.78
THALES SA	471	45.82	21,583.57
VALLOUREC SA	520	41.36	21,507.20
VINCI SA	2,026	54.10	109,606.60
WARTSILA OYJ-B SHARES	719	39.62	28,486.78
ZARDOYA OTIS SA	738	12.32	9,092.16
ZODIAC AEROSPACE	835	24.72	20,641.20
BUREAU VERITAS SA	1,082	22.16	23,977.12
EDENRED	958	23.74	22,747.71
RANDSTAD HOLDING NV	602	40.97	24,666.95
SOCIETE BIC SA	117	96.00	11,232.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,558	15.83	24,670.93
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	145	89.24	12,939.80
ATLANTIA SPA	1,710	18.50	31,635.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,189	18.70	22,240.24
DEUTSCHE POST AG-REG	3,670	26.60	97,622.00
FRAPORT AG	208	52.10	10,836.80
GROUPE EUROTUNNEL SA	2,405	9.28	22,340.04
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	4,795	4.93	23,639.35
TNT EXPRESS NV	1,979	6.68	13,223.67
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,340	92.12	123,440.80
BMW-PFD	236	68.75	16,225.00
CONTINENTAL AG	465	172.40	80,166.00

DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	3,897	67.29	262,229.13
FIAT SPA	3,696	8.76	32,376.96
MICHELIN (CGDE)-B	792	91.40	72,388.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	580	28.25	16,385.00
PIRELLI & C SPA	1,006	12.23	12,303.38
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	620	80.26	49,761.20
RENAULT SA	811	73.37	59,503.07
VALEO SA	343	100.65	34,522.95
VOLKSWAGEN AG	134	191.25	25,627.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	585	195.75	114,513.75
ADIDAS AG	885	75.57	66,879.45
CHRISTIAN DIOR SA	231	146.00	33,726.00
HUGO BOSS AG-ORD	134	98.58	13,209.72
KERING	320	149.65	47,888.00
LUXOTTICA GROUP SPA	706	40.71	28,741.26
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	1,028	142.70	146,695.60
ACCOR SA	673	35.37	23,807.37
SODEXO	382	79.02	30,185.64
AXEL SPRINGER SE	194	42.54	8,252.76
EUTELSAT COMMUNICATIONS	687	24.47	16,814.32
JC DECAUX SA	326	29.99	9,778.37
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	105	97.39	10,225.95
LAGARDERE S.C.A.	487	29.34	14,291.01
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	846	31.10	26,314.83
PUBLICIS GROUPE	792	63.89	50,600.88
REED ELSEVIER NV(NL)	2,810	15.00	42,150.00
RTL GROUP SA	176	83.54	14,703.04
SES	1,382	25.94	35,855.99
SKY DEUTSCHLAND AG	1,994	6.13	12,223.22
TELENET GROUP HOLDING NV	226	43.11	9,742.86
WOLTERS KLUWER NV-CVA	1,277	20.67	26,395.59
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	883	106.15	93,730.45
CARREFOUR SA	2,602	28.81	74,976.63
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	276	89.03	24,572.28
COLRUYT SA	392	39.92	15,650.60
DELHAIZE GROUP	447	51.38	22,966.86
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	3,160	6.18	19,541.44
JERONIMO MARTINS SGPS SA	1,138	12.91	14,691.58
KONINKLIJKE AHOLD NV	3,766	13.99	52,705.17
METRO AG	567	28.16	15,966.72
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	3,253	78.52	255,425.56

DANONE	2,299	52.71	121,180.29
HEINEKEN HOLDING NV	494	47.27	23,353.85
HEINEKEN NV	974	51.48	50,141.52
KERRY GROUP PLC-A	653	54.70	35,719.10
PERNOD-RICARD SA	898	85.65	76,913.70
REMY COINTREAU SA	144	60.87	8,765.28
SUEDZUCKER AG	402	14.84	5,965.68
UNILEVER NV-CVA	6,594	30.54	201,380.76
BEIERSDORF AG	441	70.88	31,258.08
HENKEL AG & CO KGAA	568	71.42	40,566.56
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	779	77.18	60,123.22
L'OREAL	979	121.35	118,801.65
CELESIO AG	192	25.07	4,814.40
ESSILOR INTERNATIONAL SA	895	72.11	64,538.45
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	943	49.08	46,282.44
FRESENIUS SE & CO KGAA	529	107.10	56,655.90
BAYER AG	3,347	93.59	313,245.73
GRIFOLS SA	604	36.78	22,215.12
MERCK KGAA	283	115.00	32,545.00
ORION OYJ-CLASS B	501	21.84	10,941.84
QIAGEN NV	1,222	14.96	18,281.12
SANOFI	4,837	75.48	365,096.76
UCB SA	465	57.82	26,886.30
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	31,043	0.23	7,372.71
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	23,420	8.82	206,775.18
BANCO DE SABADELL SA	14,829	2.26	33,617.34
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	1.29	9,913.96
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	1,382	15.40	21,282.80
BANCO POPULAR ESPANOL SA	6,483	5.43	35,228.62
BANCO SANTANDER SA	46,942	7.06	331,598.28
BANK OF IRELAND	105,431	0.27	29,415.24
BANKIA SA	16,317	1.50	24,540.76
BNP PARIBAS	4,030	54.49	219,594.70
CAIXABANK	7,782	4.57	35,625.99
COMMERZBANK AG	4,232	13.03	55,164.12
CREDIT AGRICOLE SA	4,370	11.37	49,708.75
ERSTE GROUP BANK AG	1,091	24.60	26,838.60
INTESA SANPAOLO	47,060	2.42	114,261.68
KBC GROEP NV	1,013	44.03	44,607.45
NATIXIS SA	4,535	5.24	23,799.68
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	315	23.14	7,290.67
SOCIETE GENERALE	2,909	43.19	125,654.25

UNICREDIT SPA	17,575	6.49	114,149.62
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	4,196	7.00	29,372.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,127	31.89	131,610.03
DEUTSCHE BOERSE AG	781	53.32	41,642.92
EURAZEO	153	63.11	9,655.83
EXOR SPA	362	32.05	11,602.10
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	395	74.83	29,557.85
ING GROEP NV-CVA	15,541	10.04	156,109.34
MEDIOBANCA SPA	2,531	8.01	20,285.96
WENDEL	158	107.50	16,985.00
AEGON NV	7,333	6.35	46,623.21
AGEAS	938	30.70	28,796.60
ALLIANZ SE-REG	1,848	119.05	220,004.40
ASSICURAZIONI GENERALI	4,938	16.36	80,785.68
AXA	7,266	18.47	134,239.35
CNP ASSURANCES	1,009	15.71	15,851.39
DELTA LLOYD NV	611	18.56	11,340.16
HANNOVER RUECK SE	312	66.05	20,607.60
MAPFRE SA	5,115	2.98	15,278.50
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	726	165.40	120,080.40
SAMPO OYJ-A SHS	1,772	36.95	65,475.40
SCOR SE	752	25.54	19,209.84
UNIPOLSAI SPA	3,801	2.68	10,201.88
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG	198	36.50	7,227.99
DEUTSCHE WOHNEN AG	1,353	15.53	21,012.09
IMMOFINANZ AG	4,809	3.22	15,523.45
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	1,609	29.22	47,014.98
ATOS	284	60.50	17,182.00
CAP GEMINI SA	606	51.55	31,239.30
DASSAULT SYSTEMES SA	311	86.47	26,892.17
GEMALTO NV	335	84.59	28,337.65
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
SAP AG	3,730	57.73	215,332.90
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	450	31.22	14,051.25
ALCATEL-LUCENT	12,658	2.82	35,695.56
NOKIA OYJ	15,159	5.31	80,570.08
BELGACOM SA	665	22.50	14,962.50
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	11,711	11.39	133,388.29
ELISA OYJ	696	19.69	13,704.24
ILIAD SA	113	193.30	21,842.90
KONINKLIJKE KPN NV	13,544	2.46	33,413.04

	ORANGE	7,505	10.93	82,067.17
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	3,244	2.99	9,699.56
	TELECOM ITALIA SPA	44,009	0.85	37,649.69
	TELECOM ITALIA-RSP	25,484	0.69	17,609.44
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,396	5.72	7,994.89
	TELEFONICA SA	16,579	11.80	195,632.20
	TELEKOM AUSTRIA AG	1,383	6.91	9,562.06
	VIVENDI	4,878	20.14	98,267.31
	ZIGGO NV	731	31.20	22,807.20
	E.ON SE	7,290	13.73	100,091.70
	ELECTRICITE DE FRANCE	1,023	29.00	29,667.00
	ENAGAS SA	955	22.27	21,272.62
	ENEL GREEN POWER SPA	8,572	2.03	17,469.73
	ENEL SPA	26,644	4.08	108,814.09
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	8,124	3.36	27,329.13
	FORTUM OYJ	2,100	15.70	32,970.00
	GAS NATURAL SDG SA	1,607	20.31	32,646.20
	GDF SUEZ	5,612	19.94	111,903.28
	IBERDROLA SA	20,468	4.84	99,208.39
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	438	58.75	25,732.50
	RWE AG	2,070	27.15	56,210.85
	SNAM SPA	8,740	4.24	37,110.04
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	1,187	14.62	17,353.94
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	6,593	3.87	25,554.46
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,506	14.34	21,603.57
	ASML HOLDING NV	1,447	59.08	85,488.76
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,572	8.40	38,445.94
	STMICROELECTRONICS NV	2,695	6.44	17,371.97
	ユーロ 建小計	897,181		12,483,638.49 (1,769,805,428)
英bond	AMEC PLC	1,485	11.90	17,671.50
	BG GROUP PLC	13,799	11.34	156,480.66
	BP PLC	75,488	4.82	363,889.90
	PETROFAC LIMITED	1,271	14.04	17,844.84
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	15,627	22.44	350,669.88
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	10,035	23.93	240,137.55
	TULLOW OIL PLC	4,135	8.67	35,871.12
	ANGLO AMERICAN PLC	5,896	15.47	91,211.12
	ANTOFAGASTA PLC	1,725	8.28	14,291.62
	BHP BILLITON PLC(UK)	8,549	19.13	163,542.37
	CRODA INTERNATIONAL PLC	699	25.76	18,006.24
	FRESNILLO PLC	778	8.68	6,753.04

GLENCORE XSTRATA PLC	42,950	3.14	134,927.42
JOHNSON MATTHEY PLC	867	31.91	27,665.97
RANDGOLD RESOURCES LIMITED	355	47.18	16,748.90
REXAM PLC	3,874	5.02	19,447.48
RIO TINTO PLC(UK)	5,146	32.88	169,226.21
BAE SYSTEMS PLC	13,659	3.89	53,147.16
BUNZL PLC	1,455	16.08	23,396.40
COBHAM PLC	5,575	2.93	16,373.77
IMI PLC	1,169	14.93	17,453.17
MEGGITT PLC	3,845	4.73	18,186.85
MELROSE INDUSTRIES PLC	5,249	2.81	14,791.68
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	7,611	10.46	79,611.06
SMITHS GROUP PLC	1,723	12.54	21,606.42
THE WEIR GROUP PLC	901	25.63	23,092.63
TRAVIS PERKINS PLC	992	18.03	17,885.76
WOLSELEY PLC	1,075	32.95	35,421.25
AGGREKO PLC	1,138	15.16	17,252.08
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	1,531	12.16	18,616.96
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC-RIGHTS	588	4.21	2,475.48
CAPITA PLC	2,782	10.78	29,989.96
EXPERIAN PLC	4,393	10.81	47,488.33
G4S PLC	7,292	2.42	17,653.93
INTERTEK GROUP PLC	788	29.23	23,033.24
SERCO GROUP PLC	2,111	4.05	8,555.88
ROYAL MAIL PLC	2,744	5.09	13,966.96
GKN PLC	6,923	3.91	27,068.93
BURBERRY GROUP PLC	1,938	14.40	27,907.20
PERSIMMON PLC	1,514	12.92	19,560.88
CARNIVAL PLC(UK)	803	22.35	17,947.05
COMPASS GROUP PLC	7,647	9.19	70,314.16
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,149	19.22	22,083.78
TUI TRAVEL PLC	2,190	4.22	9,241.80
WHITBREAD PLC	763	40.55	30,939.65
WILLIAM HILL PLC	4,313	3.22	13,892.17
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	4,376	8.90	38,946.40
ITV PLC	16,337	1.86	30,419.49
PEARSON PLC	3,461	10.62	36,755.82
REED ELSEVIER PLC(UK)	4,979	8.84	44,039.25
WPP PLC	5,444	12.62	68,703.28
ASOS PLC	229	46.13	10,563.77
KINGFISHER PLC	10,378	4.17	43,276.26
MARKS & SPENCER GROUP PLC	7,067	4.34	30,706.11

NEXT PLC	688	64.90	44,651.20
SAINSBURY (J) PLC	5,225	3.14	16,406.50
TESCO PLC	32,724	2.89	94,801.42
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	9,695	2.01	19,525.73
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,442	27.11	39,092.62
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	7,646	34.07	260,499.22
COCA-COLA HBC AG-CDI	875	15.19	13,291.25
DIAGEO PLC	10,160	18.29	185,826.40
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	3,913	25.11	98,255.43
SABMILLER PLC	3,897	30.68	119,579.44
TATE & LYLE PLC	2,284	6.54	14,948.78
UNILEVER PLC	5,195	26.17	135,953.15
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,622	49.15	128,871.30
SMITH & NEPHEW PLC	3,931	8.66	34,042.46
ASTRAZENECA PLC	5,082	37.81	192,175.83
GLAXOSMITHKLINE PLC	19,679	15.59	306,795.61
SHIRE PLC	2,481	29.25	72,569.25
BARCLAYS PLC	61,924	2.46	152,642.66
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	75,889	6.17	468,538.68
LLOYDS BANKING GROUP PLC	202,216	0.74	150,206.04
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	9,437	3.02	28,584.67
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	9,822	13.25	130,190.61
3I GROUP PLC	3,933	3.79	14,917.86
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	4,362	4.36	19,053.21
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,045	12.03	12,571.35
ICAP PLC	2,839	4.00	11,373.03
INVESTEC PLC	2,446	5.05	12,352.30
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	911	18.39	16,753.29
SCHRODERS PLC	508	25.59	12,999.72
ADMIRAL GROUP PLC	1,060	13.50	14,310.00
AVIVA PLC	11,928	5.09	60,713.52
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	4,124	2.39	9,876.98
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	25,872	2.10	54,512.30
OLD MUTUAL PLC	19,822	2.01	39,881.86
PRUDENTIAL PLC	10,359	13.24	137,153.16
RESOLUTION LIMITED	6,946	2.89	20,094.77
RSA INSURANCE GROUP PLC	15,463	0.94	14,643.46
STANDARD LIFE PLC	10,393	3.78	39,285.54
SAGE GROUP PLC (THE)	4,839	4.03	19,501.17
BT GROUP PLC	32,008	3.69	118,269.56
INMARSAT PLC	2,315	7.36	17,038.40
VODAFONE GROUP PLC	107,002	2.14	229,144.78

	CENTRICA PLC	21,763	3.45	75,082.35
	NATIONAL GRID PLC	15,099	8.24	124,415.76
	SEVERN TRENT PLC	967	17.82	17,231.94
	SSE PLC	3,911	15.02	58,743.22
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,884	7.69	22,192.38
	ARM HOLDINGS PLC	5,668	9.76	55,348.02
	英債券 建小計	1,134,105		6,821,658.97 (1,175,917,573)
スイスフラン	TRANSOCEAN LIMITED(CHF)	1,460	35.33	51,581.80
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	50	337.00	16,850.00
	GIVAUDAN-REG	36	1,379.00	49,644.00
	HOLCIM LTD-REG	968	79.00	76,472.00
	SIKA AG-BR	9	3,500.00	31,500.00
	SYNGENTA AG(CH)	377	348.50	131,384.50
	ABB LIMITED-REG	8,901	22.73	202,319.73
	GEBERIT AG-REG	165	280.30	46,249.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	131	129.30	16,938.30
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	202	131.60	26,583.20
	SULZER AG-REG	124	133.50	16,554.00
	ADECCO SA-REG	560	72.00	40,320.00
	SGS SA-REG	24	2,154.00	51,696.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	228	119.10	27,154.80
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	2,113	88.05	186,049.65
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	184	106.60	19,614.40
	THE SWATCH GROUP AG-B	135	564.50	76,207.50
	ARYZTA AG	381	78.15	29,775.15
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	14	1,138.00	15,932.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	3	4,214.00	12,642.00
	NESTLE SA-REGISTERED	13,053	67.25	877,814.25
	SONOVA HOLDING AG-REG	204	124.00	25,296.00
	ACTELION LTD-REG	432	85.85	37,087.20
	LONZA GROUP AG-REG	274	85.30	23,372.20
	NOVARTIS AG-REG SHS	9,311	74.70	695,531.70
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,844	254.90	724,935.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	6,135	27.49	168,651.15
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	1,058	40.58	42,933.64
	PARGESA HOLDING SA-BR	140	78.90	11,046.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	73	233.70	17,060.10
	UBS AG-REGISTERED	14,773	17.87	263,993.51
	BALOISE HOLDING AG-REG	192	107.80	20,697.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	158	218.40	34,507.20
	SWISS RE LIMITED	1,489	73.60	109,590.40

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	603	249.50	150,448.50	
	SWISS PRIME SITE AG-REG	230	76.00	17,480.00	
	SWISSCOM AG-REG	99	524.00	51,876.00	
	スイスフラン 建小計	67,133		4,397,789.58 (511,067,127)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	973	134.40	130,771.20	
	BOLIDEN AB	1,414	96.30	136,168.20	
	ALFA LAVAL AB	1,273	178.10	226,721.30	
	ASSA ABLOY AB-B	1,461	331.90	484,905.90	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,718	190.20	516,963.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,580	176.80	279,344.00	
	SANDVIK AB	4,663	93.10	434,125.30	
	SCANIA AB-B SHS	1,351	183.10	247,368.10	
	SKANSKA AB-B SHS	1,607	143.70	230,925.90	
	SKF AB-B SHARES	1,602	161.70	259,043.40	
	VOLVO AB-B SHS	6,178	102.90	635,716.20	
	SECURITAS AB-B SHS	1,534	76.80	117,811.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,202	149.60	179,819.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,282	46.12	105,245.84	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	3,843	271.20	1,042,221.60	
	SWEDISH MATCH AB	854	216.00	184,464.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	2,565	181.50	465,547.50	
	ELEKTA AB-B SHS	1,905	84.95	161,829.75	
	GETINGE AB-B SHS	980	179.10	175,518.00	
	NORDEA BANK AB	12,295	90.10	1,107,779.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	6,424	86.05	552,785.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	2,020	323.90	654,278.00	
	SWEDBANK AB-A SHARES	3,830	168.60	645,738.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	521	128.00	66,688.00	
	INVESTOR AB-B SHS	1,844	235.20	433,708.80	
	KINNEVIK INVESTMENT AB	1,008	222.50	224,280.00	
ERICSSON LM-B SHS	12,319	84.55	1,041,571.45		
HEXAGON AB-B SHS	1,160	206.90	240,004.00		
MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	313	644.00	201,572.00		
TELE2 AB-B SHS	1,347	78.65	105,941.55		
TELIASONERA AB	10,071	44.47	447,857.37		
	スウェーデンクローナ 建小計	93,137		11,736,714.06 (182,623,270)	
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	998	93.70	93,512.60	
	SEADRILL LIMITED	1,642	201.70	331,191.40	
	STATOIL ASA	4,720	174.30	822,696.00	
	SUBSEA 7 SA	1,319	105.00	138,495.00	

	NORSK HYDRO ASA	5,880	30.26	177,928.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	733	272.30	199,595.90	
	ORKLA ASA	3,342	48.64	162,554.88	
	DNB ASA	3,956	99.90	395,204.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	918	121.90	111,904.20	
	TELENOR ASA	2,985	127.90	381,781.50	
	ノルウェークローネ 建小計	26,493		2,814,864.68 (48,218,631)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	956	240.40	229,822.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	10	11,840.00	118,400.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	25	12,390.00	309,750.00	
	DSV A/S	761	174.20	132,566.20	
	CARLSBERG AS-B	468	536.50	251,082.00	
	COLOPLAST A/S	510	418.20	213,282.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	129	470.50	60,694.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	8,060	235.60	1,898,936.00	
	DANSKE BANK A/S	2,654	149.50	396,773.00	
	TRYG A/S	139	498.20	69,249.80	
	TDC A/S	3,613	49.39	178,446.07	
	デンマーククローネ 建小計	17,325		3,859,001.97 (73,282,447)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	763	21.69	16,549.47	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	4,457	14.67	65,384.19	
	SANTOS LTD	4,232	13.42	56,793.44	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,787	40.00	111,480.00	
	WORLEYPARSONS LIMITED	1,163	16.60	19,305.80	
	ALUMINA LIMITED	10,661	1.37	14,658.87	
	AMCOR LTD	5,277	10.03	52,928.31	
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	13,000	38.10	495,300.00	
	BORAL LIMITED	3,385	5.83	19,734.55	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	6,584	5.33	35,092.72	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	2,164	9.10	19,692.40	
	INCITEC PIVOT LIMITED	6,593	2.84	18,724.12	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	2,088	13.63	28,459.44	
	NEWCREST MINING LIMITED	3,236	10.24	33,136.64	
	ORICA LTD	1,674	21.50	35,991.00	
	RIO TINTO LIMITED(AU)	1,843	63.37	116,790.91	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	939	19.82	18,610.98	
	ALS LIMITED	1,925	7.40	14,245.00	
	BRAMBLES LTD	6,812	9.34	63,624.08	
SEEK LIMITED	1,604	16.74	26,850.96		
ASCIANO LIMITED	5,042	5.37	27,075.54		

AURIZON HOLDINGS LIMITED	9,390	5.14	48,264.60	
QANTAS AIRWAYS LTD	5,737	1.20	6,913.08	
SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	2,300	4.11	9,453.00	
TOLL HOLDINGS LIMITED	3,221	5.25	16,910.25	
TRANSURBAN GROUP	6,172	7.26	44,808.72	
CROWN RESORTS LIMITED	1,752	16.40	28,732.80	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	4,748	2.79	13,246.92	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	335	54.49	18,254.15	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	4,748	3.66	17,377.68	
TATTS GROUP LTD	8,275	3.00	24,825.00	
REA GROUP LIMITED	240	46.41	11,138.40	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	2,150	3.34	7,181.00	
METCASH LTD	5,329	2.75	14,654.75	
WESFARMERS LIMITED	4,628	42.98	198,911.44	
WOOLWORTHS LIMITED	5,078	37.09	188,343.02	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	2,955	9.41	27,806.55	
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	3,941	3.71	14,621.11	
COCHLEAR LIMITED	330	57.46	18,961.80	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	555	44.84	24,886.20	
SONIC HEALTHCARE LTD	1,942	17.61	34,198.62	
CSL LIMITED	1,971	67.68	133,397.28	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	11,106	33.88	376,271.28	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	1,454	12.95	18,829.30	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	2,107	11.25	23,703.75	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	6,525	77.57	506,144.25	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	9,510	35.36	336,273.60	
WESTPAC BANKING CORPORATION	12,585	34.94	439,719.90	
ASX LTD	847	35.22	29,831.34	
MACQUARIE GROUP LIMITED	1,262	55.97	70,634.14	
AMP LIMITED	12,878	5.18	66,708.04	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	9,093	5.60	50,920.80	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	5,339	11.87	63,373.93	
SUNCORP GROUP LIMITED	5,208	12.83	66,818.64	
LEND LEASE GROUP	2,312	12.92	29,871.04	
COMPUTERSHARE LIMITED	2,298	12.15	27,920.70	
TELSTRA CORPORATION	19,047	5.13	97,711.11	
AGL ENERGY LIMITED	2,695	15.54	41,880.30	
APA GROUP	3,655	6.52	23,830.60	
SP AUSNET	11,580	1.35	15,633.00	
オーストラリアドル 建小計	281,527		4,479,390.51 (429,080,816)	
FLETCHER BUILDING LIMITED	3,001	9.62	28,869.62	

ニュージーランドドル	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	4,307	4.00	17,228.00	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	1,697	8.30	14,085.10	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND(NZ)	7,947	2.63	20,900.61	
	CONTACT ENERGY LIMITED	1,604	5.58	8,950.32	
ニュージーランドドル 建小計		18,556		90,033.65	(7,935,565)
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS LIMITED	3,500	27.20	95,200.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	8,629	107.90	931,069.10	
	NWS HOLDINGS LIMITED	6,500	13.14	85,410.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	6,000	15.04	90,240.00	
	MTR CORPORATION	7,500	29.20	219,000.00	
	LI & FUNG LIMITED	26,000	12.00	312,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	4,000	26.10	104,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	8,537	68.20	582,223.40	
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	4,155	29.75	123,611.25	
	SANDS CHINA LIMITED	10,574	61.10	646,071.40	
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	8,000	12.96	103,680.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	9,000	22.80	205,200.00	
	WYNN MACAU LIMITED	6,299	32.15	202,512.85	
	BANK OF EAST ASIA	5,267	32.25	169,860.75	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	16,184	22.65	366,567.60	
	HANG SENG BANK LTD	3,500	126.30	442,050.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	10,000	8.44	84,400.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	4,466	144.30	644,443.80	
	AIA GROUP LIMITED	48,751	39.05	1,903,726.55	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	6,000	136.90	821,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	11,000	23.70	260,700.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,500	46.40	208,800.00	
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	3,000	34.30	102,900.00	
	KERRY PROPERTIES LIMITED	4,000	26.65	106,600.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	16,562	8.13	134,649.06	
	SINO LAND CO	12,576	11.96	150,408.96	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	7,000	99.70	697,900.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	3,000	91.30	273,900.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	7,200	23.50	169,200.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	7,000	56.25	393,750.00	
	WHEELLOCK AND COMPANY LTD	4,000	33.45	133,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	14,000	8.17	114,380.00	
PCCW LIMITED	16,884	3.99	67,367.16		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	3,000	51.10	153,300.00		
CLP HOLDINGS LTD	7,735	61.75	477,636.25		
HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	26,080	17.84	465,267.20		

	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	6,067	69.55	421,959.85	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	1,100	82.90	91,190.00	
	香港ドル 建小計	357,566		12,556,775.18 (166,251,703)	
シンガポールドル	KEPPEL CORPORATION LIMITED	5,900	10.99	64,841.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	22,636	1.25	28,408.18	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	4,000	5.40	21,600.00	
	SEMBCORP MARINE LIMITED	5,000	4.10	20,500.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	6,000	3.95	23,700.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	14,000	1.09	15,260.00	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	10,000	2.05	20,500.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,000	10.29	20,580.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	26,000	1.31	34,190.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	8,000	4.13	33,040.00	
	OLAM INTERNATIONAL LIMITED	6,000	2.23	13,380.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	31,000	0.61	18,910.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	10,000	3.45	34,500.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	7,000	16.90	118,300.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	10,000	9.65	96,500.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	5,000	22.07	110,350.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	4,000	6.97	27,880.00	
	CAPITALAND LTD	13,000	3.18	41,340.00	
	CAPITAMALLS ASIA LIMITED	8,000	2.19	17,520.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	2,000	10.42	20,840.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	13,000	2.76	35,880.00	
KEPPEL LAND LIMITED	4,000	3.57	14,280.00		
UOL GROUP LIMITED	2,000	6.34	12,680.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	32,000	3.71	118,720.00		
STARHUB LIMITED	3,000	4.15	12,450.00		
	シンガポールドル 建小計	253,536		976,149.18 (80,005,186)	
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LIMITED	31	1,415.00	43,865.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	2,517	30.98	77,976.66	
	THE ISRAEL CORPORATION LIMITED	19	1,986.00	37,734.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	3,449	173.30	597,711.70	
	BANK HAPOLIM BM	4,613	19.48	89,861.24	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	6,133	13.69	83,960.77	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	987	46.01	45,411.87	
	NICE SYSTEMS LIMITED	300	156.50	46,950.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	9,340	6.17	57,627.80	
	イスラエルシュケル 建小計	27,389		1,081,099.04 (31,892,421)	

合 計	4,603,666		12,284,157,139 (12,284,157,139)
-----	-----------	--	------------------------------------

(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	18,225.00	
	投資信託受益証券 小計		27,000	18,225.00 (1,870,796)	
	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORPORATION	1,622	35,489.36	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	3,150	41,863.50	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	1,670	138,025.50	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	4,006	45,067.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	538	71,898.32	
		BOSTON PROPERTIES INC	619	72,689.17	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	400	27,132.00	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	1,400	103,488.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	600	32,082.00	
		DUKE REALTY CORP	1,375	23,732.50	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,497	86,077.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	249	41,804.61	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	300	34,584.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	2,368	54,014.08	
		HCP INC	1,847	74,858.91	
		HEALTH CARE REIT INC	1,252	77,548.88	
		HOST HOTELS & RESORTS	3,280	68,814.40	
		KIMCO REALTY CORP	1,792	40,230.40	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	600	22,572.00	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	800	34,104.00	
		PROLOGIS INC	2,181	90,053.49	
		PUBLIC STORAGE	592	101,989.76	
		RAYONIER INC	533	23,750.48	
		REALTY INCOME CORP	900	37,701.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	400	20,936.00	
		SIMON PROPERTY GROUP	1,256	213,344.16	
		SL GREEN REALTY CORPORATION	400	40,596.00	
		THE MACERICH COMPANY	569	37,315.02	
	UDR INC	1,200	30,516.00		
	VENTAS INC	1,240	80,761.20		

		VORNADO REALTY TRUST	736	73,982.72
		WEYERHAEUSER COMPANY	2,547	70,984.89
	投資証券	小計	41,919	1,948,007.35 (199,962,954)
米ドル	建小計		68,919	1,966,232.35 (201,833,750)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	600	14,196.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	597	16,459.29
カナダドル	建小計		1,197	30,655.29 (2,854,927)
ユーロ	投資証券	CORIO NV	404	14,024.86
		FONCIERE DES REGIONS	119	8,402.59
		GECINA SA	108	10,798.92
		ICADE	121	9,085.89
		KLEPIERRE	404	12,928.00
		UNIBAIL-RODAMCO SE	411	78,213.30
ユーロ	建小計		1,567	133,453.56 (18,919,711)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	3,857	25,957.61
		HAMMERSON PLC	2,886	16,406.91
		INTU PROPERTIES PLC	3,843	10,971.76
		LAND SECURITIES GROUP PLC	3,434	35,953.98
		SEGRO PLC	3,635	12,297.20
英ポンド	建小計		17,655	101,587.46 (17,511,646)
オーストラリアドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	8,528	16,842.80
		DEXUS PROPERTY GROUP	23,762	26,257.01
		FEDERATION CENTRES	8,228	19,582.64
		GOODMAN GROUP	6,957	34,089.30
		GPT GROUP	7,306	27,981.98
		MIRVAC GROUP	17,706	31,162.56
		STOCKLAND	9,333	35,278.74
		WESTFIELD GROUP	8,711	92,772.15
		WESTFIELD RETAIL TRUST	13,103	41,012.39
オーストラリアドル	建小計		103,634	324,979.57 (31,129,793)
香港ドル	投資証券	THE LINK REIT	10,107	386,592.75
香港ドル	建小計		10,107	386,592.75 (5,118,488)
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	19,620.00
		CAPITAMALL TRUST	10,000	20,100.00
			33,000	65,460.00

シンガポールドル建小計		(5,365,101)	
合計		282,733,416	(282,733,416)

(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

- 1.小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
- 2.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。
- 3.外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 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 579銘柄	54.8%			57.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 32銘柄			1.5%	1.6%
カナダドル	株式 93銘柄	4.4%			4.6%
	投資証券 2銘柄			0.0%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	13.4%			14.1%
	投資証券 6銘柄			0.1%	0.2%
英ポンド	株式 102銘柄	8.9%			9.4%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	3.9%			4.1%
スウェーデンクロー ナ	株式 31銘柄	1.4%			1.5%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.4%			0.4%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	0.6%			0.6%
オーストラリアドル	株式 60銘柄	3.3%			3.4%
	投資証券 9銘柄			0.2%	0.2%
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 38銘柄	1.3%			1.3%
	投資証券 1銘柄			0.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 25銘柄	0.6%			0.6%
	投資証券 3銘柄			0.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	0.2%			0.3%

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

新光日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年10月21日現在	平成26年 4月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,336,842	24,889,279
国債証券	13,926,793,400	13,998,984,000
地方債証券	1,286,212,500	1,284,962,200
特殊債券	1,462,388,500	1,442,122,800
社債券	840,920,000	842,110,000
未収利息	45,079,279	44,254,334
前払費用	737,465	1,002,407
流動資産合計	17,577,467,986	17,638,325,020
資産合計	17,577,467,986	17,638,325,020
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	2,400,000
流動負債合計	-	2,400,000
負債合計	-	2,400,000
純資産の部		
元本等		
元本	15,057,742,796	15,004,175,198
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,519,725,190	2,631,749,822
元本等合計	17,577,467,986	17,635,925,020
純資産合計	17,577,467,986	17,635,925,020
負債純資産合計	17,577,467,986	17,638,325,020

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10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4月21日現在
1. 計算日における受益権の総数	1. 計算日における受益権の総数

	15,057,742,796円		15,004,175,198円
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	1.1673円	1口当たり純資産額	1.1754円
(1万口当たり純資産額)	(11,673円)	(1万口当たり純資産額)	(11,754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25年4月23日 至平成25年10月21日	自平成25年10月22日 至平成26年4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	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。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成25年10月21日現在	平成26年 4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</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4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	14,777,050,461円	15,057,742,796円
期中追加設定元本額	904,153,559円	619,993,188円
期中一部解約元本額	623,461,224円	673,560,786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）	111,719,326円	107,188,279円
新光7資産バランスファンド	1,015,710,537円	990,005,798円
日本債券ファンド	342,031,211円	356,760,517円
新光日本債券インデックスVA	2,994,953,157円	3,077,410,646円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,293,017,043円	2,335,966,811円

新光ワールドバランスファンドV A（適格機関投資家私募）	2,993,986,101円	2,917,277,082円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	500,435,341円	401,995,100円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	3,332,973,253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）	1,472,916,827円	1,472,916,827円
グローバル・ナビ	- 円	11,680,885円
合計	15,057,742,796円	15,004,175,198円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年10月21日現在	平成26年 4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	125,646,700	12,873,700
地方債証券	375,200	1,278,500
特殊債券	543,100	705,900
社債券	4,000	1,597,000
合計	124,724,400	13,261,100

(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89回利付国債（5年）	290,000,000	291,090,400	
	第91回利付国債（5年）	170,000,000	170,765,000	

第9 2 回利付国債(5年)	190,000,000	190,589,000	
第9 3 回利付国債(5年)	230,000,000	231,582,400	
第9 5 回利付国債(5年)	30,000,000	30,294,000	
第9 6 回利付国債(5年)	240,000,000	241,896,000	
第9 7 回利付国債(5年)	180,000,000	181,200,600	
第9 9 回利付国債(5年)	100,000,000	100,733,000	
第1 0 1 回利付国債(5年)	150,000,000	151,192,500	
第1 0 3 回利付国債(5年)	180,000,000	181,017,000	
第1 0 5 回利付国債(5年)	140,000,000	140,396,200	
第1 0 6 回利付国債(5年)	60,000,000	60,162,600	
第1 0 7 回利付国債(5年)	100,000,000	100,255,000	
第1 0 9 回利付国債(5年)	130,000,000	129,797,200	
第1 1 2 回利付国債(5年)	220,000,000	222,272,600	
第1 1 4 回利付国債(5年)	190,000,000	191,122,900	
第1 1 6 回利付国債(5年)	230,000,000	230,264,500	
第1 1 7 回利付国債(5年)	20,000,000	20,014,400	
第1 回利付国債(40年)	20,000,000	23,491,200	
第2 回利付国債(40年)	20,000,000	22,461,200	
第3 回利付国債(40年)	30,000,000	33,682,200	
第4 回利付国債(40年)	40,000,000	44,891,600	
第5 回利付国債(40年)	50,000,000	53,334,500	
第6 回利付国債(40年)	30,000,000	31,113,600	
第2 7 0 回利付国債(10年)	210,000,000	212,977,800	
第2 7 1 回利付国債(10年)	10,000,000	10,130,200	
第2 7 2 回利付国債(10年)	10,000,000	10,185,300	
第2 7 3 回利付国債(10年)	240,000,000	244,785,600	
第2 7 6 回利付国債(10年)	160,000,000	164,017,600	
第2 7 7 回利付国債(10年)	150,000,000	154,326,000	
第2 8 0 回利付国債(10年)	190,000,000	197,430,900	
第2 8 2 回利付国債(10年)	80,000,000	83,098,400	
第2 8 3 回利付国債(10年)	60,000,000	62,467,800	
第2 8 4 回利付国債(10年)	170,000,000	177,238,600	
第2 8 5 回利付国債(10年)	170,000,000	177,882,900	
第2 8 6 回利付国債(10年)	100,000,000	105,353,000	
第2 8 8 回利付国債(10年)	60,000,000	63,241,800	
第2 8 9 回利付国債(10年)	130,000,000	136,537,700	
第2 9 0 回利付国債(10年)	220,000,000	230,769,000	
第2 9 1 回利付国債(10年)	40,000,000	41,802,800	
第2 9 3 回利付国債(10年)	130,000,000	138,893,300	
第2 9 6 回利付国債(10年)	110,000,000	116,430,600	
第2 9 7 回利付国債(10年)	110,000,000	116,228,200	
第2 9 9 回利付国債(10年)	80,000,000	84,378,400	
第3 0 0 回利付国債(10年)	80,000,000	85,156,800	

第301回利付国債(10年)	130,000,000	138,771,100	
第303回利付国債(10年)	240,000,000	255,552,000	
第305回利付国債(10年)	30,000,000	31,837,800	
第306回利付国債(10年)	230,000,000	245,824,000	
第308回利付国債(10年)	220,000,000	234,152,600	
第309回利付国債(10年)	10,000,000	10,521,900	
第310回利付国債(10年)	160,000,000	167,412,800	
第311回利付国債(10年)	20,000,000	20,674,400	
第312回利付国債(10年)	180,000,000	190,702,800	
第313回利付国債(10年)	210,000,000	223,906,200	
第315回利付国債(10年)	230,000,000	243,652,800	
第317回利付国債(10年)	40,000,000	42,075,600	
第318回利付国債(10年)	150,000,000	156,702,000	
第319回利付国債(10年)	90,000,000	94,646,700	
第320回利付国債(10年)	90,000,000	93,978,000	
第321回利付国債(10年)	60,000,000	62,614,800	
第322回利付国債(10年)	50,000,000	51,797,000	
第323回利付国債(10年)	230,000,000	238,144,300	
第325回利付国債(10年)	150,000,000	153,942,000	
第326回利付国債(10年)	50,000,000	50,830,000	
第327回利付国債(10年)	80,000,000	82,025,600	
第328回利付国債(10年)	10,000,000	10,068,100	
第329回利付国債(10年)	120,000,000	122,775,600	
第330回利付国債(10年)	150,000,000	153,286,500	
第332回利付国債(10年)	200,000,000	200,364,000	
第333回利付国債(10年)	10,000,000	10,000,000	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	23,029,800	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	23,147,200	
第10回利付国債(30年)	30,000,000	28,547,700	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	20,969,600	
第12回利付国債(30年)	20,000,000	22,255,600	
第13回利付国債(30年)	30,000,000	32,800,200	
第15回利付国債(30年)	40,000,000	47,028,400	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	57,781,000	
第19回利付国債(30年)	30,000,000	34,101,000	
第20回利付国債(30年)	10,000,000	11,725,100	
第21回利付国債(30年)	30,000,000	34,062,600	
第22回利付国債(30年)	20,000,000	23,432,800	
第23回利付国債(30年)	30,000,000	35,135,100	
第24回利付国債(30年)	40,000,000	46,866,000	
第26回利付国債(30年)	50,000,000	57,622,500	
第27回利付国債(30年)	30,000,000	35,167,200	
第28回利付国債(30年)	40,000,000	46,956,000	

第29回利付国債（30年）	50,000,000	57,782,500	
第30回利付国債（30年）	50,000,000	56,840,500	
第31回利付国債（30年）	50,000,000	55,873,500	
第32回利付国債（30年）	60,000,000	68,317,800	
第33回利付国債（30年）	60,000,000	64,515,600	
第34回利付国債（30年）	70,000,000	78,267,700	
第35回利付国債（30年）	70,000,000	75,263,300	
第36回利付国債（30年）	70,000,000	75,256,300	
第37回利付国債（30年）	70,000,000	73,669,400	
第38回利付国債（30年）	60,000,000	61,701,000	
第39回利付国債（30年）	30,000,000	31,507,500	
第40回利付国債（30年）	30,000,000	30,799,500	
第41回利付国債（30年）	20,000,000	20,059,200	
第42回利付国債（30年）	20,000,000	20,039,600	
第45回利付国債（20年）	30,000,000	33,823,200	
第47回利付国債（20年）	60,000,000	67,342,800	
第48回利付国債（20年）	60,000,000	68,689,800	
第50回利付国債（20年）	30,000,000	33,228,000	
第51回利付国債（20年）	10,000,000	11,156,600	
第52回利付国債（20年）	30,000,000	33,732,600	
第53回利付国債（20年）	30,000,000	33,815,700	
第55回利付国債（20年）	30,000,000	33,641,400	
第57回利付国債（20年）	30,000,000	33,462,900	
第58回利付国債（20年）	30,000,000	33,498,000	
第59回利付国債（20年）	40,000,000	44,075,600	
第61回利付国債（20年）	30,000,000	31,239,000	
第63回利付国債（20年）	30,000,000	33,357,000	
第64回利付国債（20年）	20,000,000	22,446,000	
第65回利付国債（20年）	90,000,000	101,144,700	
第69回利付国債（20年）	40,000,000	45,760,000	
第70回利付国債（20年）	30,000,000	35,254,800	
第72回利付国債（20年）	30,000,000	34,409,400	
第76回利付国債（20年）	60,000,000	67,707,000	
第78回利付国債（20年）	40,000,000	45,202,000	
第81回利付国債（20年）	40,000,000	45,639,200	
第84回利付国債（20年）	80,000,000	91,309,600	
第85回利付国債（20年）	60,000,000	69,193,800	
第88回利付国債（20年）	60,000,000	70,638,000	
第90回利付国債（20年）	70,000,000	81,616,500	
第92回利付国債（20年）	70,000,000	80,786,300	
第94回利付国債（20年）	50,000,000	57,671,500	
第95回利付国債（20年）	70,000,000	82,500,600	
第97回利付国債（20年）	70,000,000	81,671,100	

第99回利付国債（20年）	70,000,000	80,708,600	
第100回利付国債（20年）	70,000,000	81,549,300	
第103回利付国債（20年）	70,000,000	82,462,100	
第105回利付国債（20年）	70,000,000	80,560,900	
第108回利付国債（20年）	90,000,000	101,001,600	
第111回利付国債（20年）	80,000,000	93,004,000	
第113回利付国債（20年）	70,000,000	80,281,600	
第114回利付国債（20年）	10,000,000	11,458,300	
第116回利付国債（20年）	90,000,000	104,248,800	
第118回利付国債（20年）	100,000,000	112,657,000	
第121回利付国債（20年）	90,000,000	99,938,700	
第123回利付国債（20年）	100,000,000	113,839,000	
第125回利付国債（20年）	80,000,000	92,150,400	
第128回利付国債（20年）	90,000,000	99,316,800	
第130回利付国債（20年）	80,000,000	86,849,600	
第132回利付国債（20年）	80,000,000	85,392,800	
第134回利付国債（20年）	90,000,000	97,171,200	
第137回利付国債（20年）	90,000,000	95,499,000	
第140回利付国債（20年）	90,000,000	95,135,400	
第141回利付国債（20年）	100,000,000	105,373,000	
第143回利付国債（20年）	90,000,000	93,038,400	
第145回利付国債（20年）	80,000,000	83,815,200	
第146回利付国債（20年）	70,000,000	73,149,300	
第147回利付国債（20年）	100,000,000	102,530,000	
第148回利付国債（20年）	20,000,000	20,107,800	
国債証券 小計	13,200,000,000	13,998,984,000	
地方債証券			
第18回東京都公募公債（20年）	100,000,000	115,730,000	
第654回東京都公募公債	100,000,000	105,190,000	
第678回東京都公募公債	80,000,000	85,080,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	31,536,000	
第164回神奈川県公募公債	100,000,000	106,610,000	
第87回大阪府公募公債（5年）	50,000,000	50,055,000	
第302回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	42,004,000	
平成17年度第8回兵庫県公募公債	10,000,000	10,178,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	10,000,000	10,408,000	
平成20年度第1回愛知県公募公債（10年）	48,000,000	51,211,200	
平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	67,465,200	
平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	100,690,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,470,000	
第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,910,000	
第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	52,260,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	39,000,000	40,723,800	
第12回す号名古屋市公募公債	30,000,000	30,894,000	

	第485回名古屋市公募公債（10年）	30,000,000	30,072,000	
	平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	31,722,000	
	平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,663,000	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,090,000	
地方債証券 小計		1,226,000,000	1,284,962,200	
特殊債券	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,470,000	
	第33回日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,110,000	
	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	105,310,000	
	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	113,930,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,630,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,320,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,660,000	
	第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,400,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	106,635,800	
	第188回政府保証中小企業債券	100,000,000	104,020,000	
	第2回成田国際空港社債	100,000,000	102,350,000	
	い第736号商工債券	70,000,000	70,469,000	
	い第759号農林債	20,000,000	20,098,000	
	第274回信金中金債（5年）	100,000,000	100,390,000	
第13回中日本高速道路社債（財投機関債）	100,000,000	106,330,000		
特殊債券 小計		1,391,000,000	1,442,122,800	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	101,530,000	
	第30回新日鐵住金社債	100,000,000	109,710,000	
	第1回日本電産社債	100,000,000	100,420,000	
	第8回トヨタ自動車社債	100,000,000	108,040,000	
	第30回住友商事社債	100,000,000	102,780,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,850,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	107,050,000	
	第524回東京電力社債	100,000,000	98,730,000	
社債券 小計		800,000,000	842,110,000	
合計		16,617,000,000	17,568,179,000	

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。

貸借対照表

(単位：円)

	平成25年10月21日現在	平成26年 4月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,972,725	9,304,583
投資証券	1,206,649,200	1,129,538,280
未収配当金	8,119,693	8,199,011
未収利息	10	9
流動資産合計	1,224,741,628	1,147,041,883
資産合計	1,224,741,628	1,147,041,883
負債の部		
流動負債		
未払金	-	3,714,808
流動負債合計	-	3,714,808
負債合計	-	3,714,808
純資産の部		
元本等		
元本	1,004,866,979	917,907,152
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	219,874,649	225,419,923
元本等合計	1,224,741,628	1,143,327,075
純資産合計	1,224,741,628	1,143,327,075
負債純資産合計	1,224,741,628	1,147,041,883

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10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4月21日現在
1. 計算日における受益権の総数 1,004,866,979口	1. 計算日における受益権の総数 917,907,152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 1.2188円 (1万口当たり純資産額) (12,188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 1.2456円 (1万口当たり純資産額) (12,456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25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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・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。	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成25年10月21日現在	平成26年 4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25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4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	1,089,586,634円	1,004,866,979円
期中追加設定元本額	- 円	3,647,964円
期中一部解約元本額	84,719,655円	90,607,791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	1,004,866,979円	914,259,188円
グローバル・ナビ	- 円	3,647,964円
合計	1,004,866,979円	917,907,152円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年10月21日現在	平成26年 4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	328,010,157	4,598,696
合計	328,010,157	4,598,696

(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	68	24,072,000	
	M I Dリート投資法人	27	6,196,500	
	森ヒルズリート投資法人	204	27,988,800	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	24	13,368,000	
	産業ファンド投資法人	24	20,136,000	
	大和ハウスリート投資法人	43	18,339,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	191	43,108,700	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	36	8,060,400	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	37	30,821,000	
	G L P 投資法人	308	30,522,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	15	10,785,000	
	日本プロロジスリート投資法人	230	49,335,000	
	野村不動産マスタ - ファンド投資法人	245	26,043,500	
	星野リゾート・リート投資法人	3	2,448,000	
	S I A 不動産投資法人	11	4,147,000	
	イオンリート投資法人	140	17,724,000	
	ヒューリックリート投資法人	87	12,006,000	
	日本ビルファンド投資法人	208	116,688,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	182	97,006,000	
	日本リテールファンド投資法人	339	69,054,300	
	オリックス不動産投資法人	287	36,075,900	
	日本プライムリアルティ投資法人	121	42,531,500	
	プレミア投資法人	32	12,768,000	
	東急リアル・エステート投資法人	144	18,532,800	
	グローバル・ワン不動産投資法人	28	8,694,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	55	24,640,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	350	53,585,000		
森トラスト総合リート投資法人	194	28,944,800		
インヴィンシブル投資法人	212	3,782,080		

フロンティア不動産投資法人	73	38,617,000	
平和不動産リート投資法人	130	10,660,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	122	27,877,000	
福岡リート投資法人	101	16,240,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	49	25,676,000	
積水ハウス・S I投資法人	117	11,091,600	
いちご不動産投資法人	151	9,467,700	
大和証券オフィス投資法人	58	30,740,000	
阪急リート投資法人	15	8,010,000	
スタートアップリート投資法人	21	3,645,600	
トップリート投資法人	26	11,843,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	55	22,990,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	385	17,979,500	
日本賃貸住宅投資法人	217	13,692,700	
ジャパンエクセレント投資法人	178	23,602,800	
合計	5,543	1,129,538,280	

(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10月21日現在	平成26年 4月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	7,198,673	11,874,798
コール・ローン	2,775,423	4,324,092
投資証券	1,192,122,673	1,156,417,903
未収配当金	841,417	951,816
未収利息	3	4
流動資産合計	1,202,938,189	1,173,568,613
資産合計	1,202,938,189	1,173,568,613
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		

	平成25年10月21日現在	平成26年 4月21日現在
元本	1,191,174,643	1,072,870,103
剰余金		
剰余金又は欠損金()	7,366,654	100,698,510
元本等合計	1,198,541,297	1,173,568,613
純資産合計	1,198,541,297	1,173,568,613
負債純資産合計	1,202,938,189	1,173,568,613

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10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4月21日現在
1. 計算日における受益権の総数 1,191,174,643口	1. 計算日における受益権の総数 1,072,870,103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 1.0062円 (1万口当たり純資産額) (10,062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 1.0939円 (1万口当たり純資産額) (10,939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25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左
2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、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・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>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成25年10月21日現在	平成26年 4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ん。</p> <p>2.時価の算定方法</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>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25年 4月23日 至 平成25年10月21日	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4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10月21日現在	平成26年 4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	1,288,574,079円	1,191,174,643円
期中追加設定元本額	- 円	4,179,120円
期中一部解約元本額	97,399,436円	122,483,660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	1,191,174,643円	1,068,690,983円
グローバル・ナビ	- 円	4,179,120円
合計	1,191,174,643円	1,072,870,103円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成25年10月21日現在	平成26年 4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	71,705,861	26,370,747
合計	71,705,861	26,370,747

(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	923	24,957.92	
		AGREE REALTY CORPORATION	200	5,952.00	
		ALEXANDER'S INC	40	14,112.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	1,200	87,936.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	600	19,950.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,800	67,248.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	2,300	36,800.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	12,889	171,294.81	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	300	5,181.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	6,800	562,020.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	2,475	73,334.25	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	400	4,008.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	240	3,712.80	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,200	12,552.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	1,000	16,700.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,242	299,620.88	
		AVIV REIT INC	200	5,058.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	3,300	67,452.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,600	305,318.00	
		BRANDYWINE REALTY	2,700	39,447.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	700	14,910.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,500	101,745.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	1,100	9,504.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	2,884	51,075.64			

CEDAR REALTY TRUST INC	1,400	8,456.00	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	4,100	31,570.00	
CHATHAM LODGING TRUST	400	8,244.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	900	23,850.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	2,100	57,204.00	
COMMONWEALTH REIT	2,075	53,493.50	
CORESITE REALTY CORPORATION	400	12,264.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,400	37,268.00	
CORRECTIONS CORPORATION OF AMERICA	1,900	61,845.00	
COUSINS PROPERTIES INC	3,162	36,837.30	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	5,700	421,344.00	
CUBESMART	2,400	44,112.00	
CYRUSONE INC	300	6,012.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	5,400	42,714.00	
DDR CORPORATION	5,197	88,193.09	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3,352	40,391.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,200	117,634.00	
DOUGLAS EMMETT INC	2,300	62,790.00	
DUKE REALTY CORP	5,600	96,656.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	1,100	26,653.00	
EASTGROUP PROPERTIES	500	32,025.00	
EDUCATION REALTY TRUST	2,100	21,210.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	1,300	19,669.00	
EPR PROPERTIES	900	48,699.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	1,300	53,066.00	
EQUITY ONE INC	1,000	22,250.00	
EQUITY RESIDENTIAL	6,100	350,750.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,086	182,328.54	
EXCEL TRUST INC	800	10,120.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,900	94,943.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT	1,100	126,808.00	
FELCOR LODGING TRUST	2,100	19,173.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY	1,900	36,309.00	
FIRST POTOMAC REALTY	1,000	13,000.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES	1,500	18,645.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	8,650	197,306.50	
GETTY REALTY CORP	400	7,540.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	300	5,226.00	
GLIMCHER REALTY TRUST	2,600	26,078.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	900	23,139.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	1,100	5,797.00	

HCP INC	7,700	312,081.00
HEALTH CARE REIT INC	4,900	303,506.00
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,600	39,856.00
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	4,100	47,437.00
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,100	17,949.00
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,500	58,140.00
HOME PROPERTIES INC	1,000	59,680.00
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2,600	77,818.00
HOST HOTELS & RESORTS	12,779	268,103.42
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	800	18,328.00
INLAND REAL ESTATE CORP	1,600	16,832.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,800	15,786.00
KILROY REALTY CORP	1,400	82,222.00
KIMCO REALTY CORP	7,000	157,150.00
KITE REALTY GROUP TRUST	2,200	13,090.00
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,800	58,140.00
LEXINGTON REALTY TRUST	3,954	43,098.60
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,500	94,050.00
LTC PROPERTIES INC	600	22,878.00
MACK-CALI REALTY CORP	1,500	30,420.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,900	38,686.00
MID-AMERICA APARTMENT	1,276	86,959.40
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	700	6,601.00
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	500	30,345.00
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,100	71,715.00
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,100	72,198.00
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	200	4,482.00
PARKWAY PROPERTIES INC	1,100	20,460.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,100	37,763.00
PENN REAL ESTATE INVESTMENT	1,100	19,338.00
PHYSICIANS REALTY TRUST	400	5,352.00
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	2,600	45,214.00
PLUM CREEK TIMBER COMPANY	3,000	127,890.00
POST PROPERTIES INC	900	44,973.00
POTLATCH CORPORATION	600	22,584.00
PROLOGIS INC	8,500	350,965.00
PS BUSINESS PARKS INC/CA	300	25,425.00
PUBLIC STORAGE	2,400	413,472.00
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1,100	17,941.00
RAYONIER INC	2,200	98,032.00
REALTY INCOME CORP	3,492	146,279.88

REGENCY CENTERS CORPORATION	1,600	83,744.00
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	1,200	18,912.00
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	3,200	45,344.00
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	300	4,248.00
RLJ LODGING TRUST	2,100	54,579.00
ROUSE PROPERTIES INC	420	7,085.40
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	800	36,984.00
SABRA HEALTH CARE REIT INC	600	17,676.00
SAUL CENTERS INC	200	9,182.00
SELECT INCOME REIT	500	15,025.00
SENIOR HOUSING PROPERTIES	3,200	72,128.00
SILVER BAY REALTY TRUST CORPORATION	600	8,892.00
SIMON PROPERTY GROUP	5,405	918,093.30
SL GREEN REALTY CORPORATION	1,600	162,384.00
SOVRAN SELF STORAGE INC	500	37,540.00
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	6,047	64,219.14
STAG INDUSTRIAL INC	800	19,624.00
STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL	700	18,046.00
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	3,000	31,350.00
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,400	12,768.00
SUN COMMUNITIES INC	600	26,340.00
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	3,275	45,227.75
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,600	56,864.00
TAUBMAN CENTERS INC	1,100	79,255.00
TERRENO REALTY CORP	400	7,268.00
THE GEO GROUP INC	1,200	39,336.00
THE MACERICH COMPANY	2,401	157,457.58
UDR INC	4,258	108,280.94
UMH PROPERTIES INC	300	2,964.00
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	200	8,536.00
URSTADT BIDDLE-CL A	400	8,272.00
VENTAS INC	5,055	329,232.15
VORNADO REALTY TRUST	2,835	284,974.20
WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,100	26,587.00
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1,900	58,482.00
WEYERHAEUSER COMPANY	10,000	278,700.00
WHITESTONE REIT	300	4,203.00
WINTHROP REALTY TRUST INC	620	7,037.00
WP CAREY INC	1,400	84,056.00
米ドル建小計	315,632	11,265,639.59 (1,156,417,903)
		1,156,417,903

合計	(1,156,417,903)
----	-----------------

(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

- 1.小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
- 2.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。
- 3.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 145銘柄	98.5%	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26年 5月30日現在)

資産総額	8,027,385,362円
負債総額	17,141,809円
純資産総額(-)	8,010,243,553円
発行済口数	9,880,149,365口
1口当たり純資産額(/)	0.8107円
(1万口当たり純資産額)	(8,107円)

(参考)海外国債マザーファンド

(平成26年 5月30日現在)

資産総額	55,495,584,669円
------	-----------------

負債総額	円
純資産総額（ - ）	55,495,584,669円
発行済口数	26,983,043,749口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0567円
（1万口当たり純資産額）	（20,567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26年 5月30日現在）

資産総額	14,141,711,160円
負債総額	27,394,928円
純資産総額（ - ）	14,114,316,232円
発行済口数	9,782,502,992口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4428円
（1万口当たり純資産額）	（14,428円）

（参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

（平成26年 5月30日現在）

資産総額	13,319,546,231円
負債総額	7,457,703円
純資産総額（ - ）	13,312,088,528円
発行済口数	8,195,197,012口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6244円
（1万口当たり純資産額）	（16,244円）

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

（平成26年 5月30日現在）

資産総額	17,575,121,393円
負債総額	5,090,000円
純資産総額（ - ）	17,570,031,393円
発行済口数	14,917,168,252口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1778円
（1万口当たり純資産額）	（11,778円）

（参考）新光J - R E I Tマザーファンド

（平成26年 5月30日現在）

資産総額	1,144,274,081円
負債総額	2,603,868円
純資産総額（ - ）	1,141,670,213円
発行済口数	864,373,881口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3208円
（1万口当たり純資産額）	（13,208円）

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成26年 5月30日現在）

資産総額	1,137,575,430円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	1,137,575,430円
発行済口数	1,010,289,171口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1260円
（1万口当たり純資産額）	（11,260円）

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

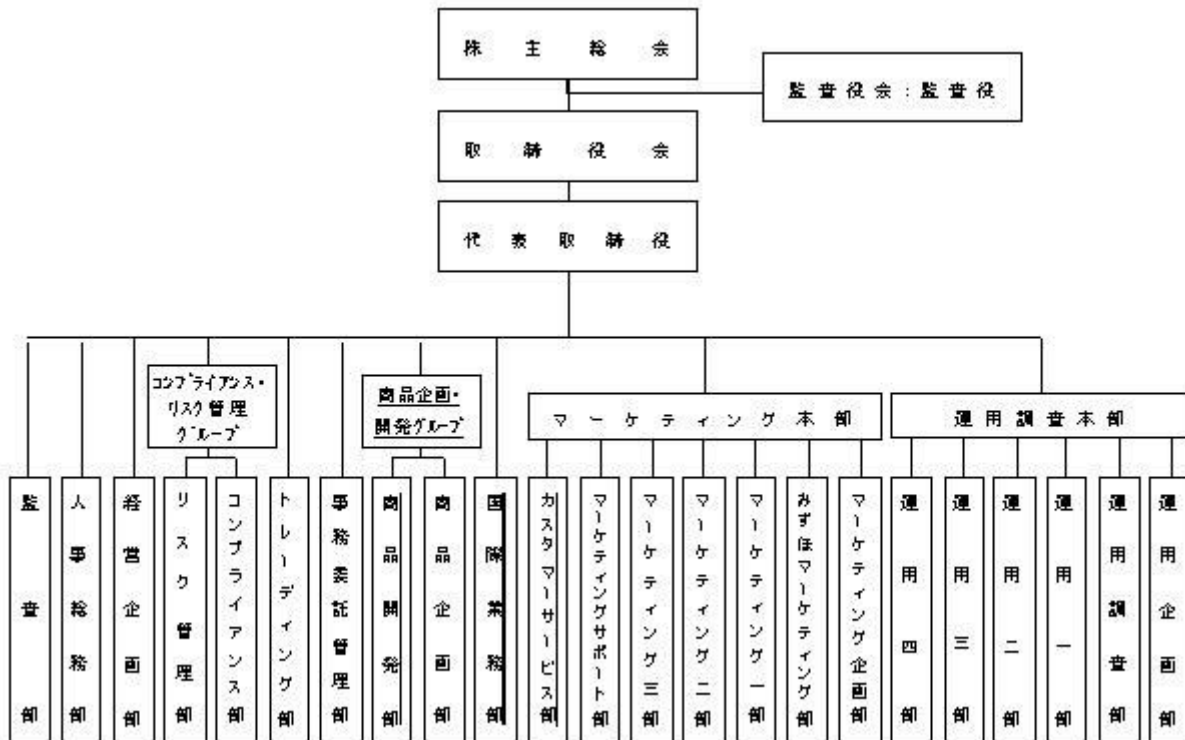
1【委託会社等の概況】

<訂正前>

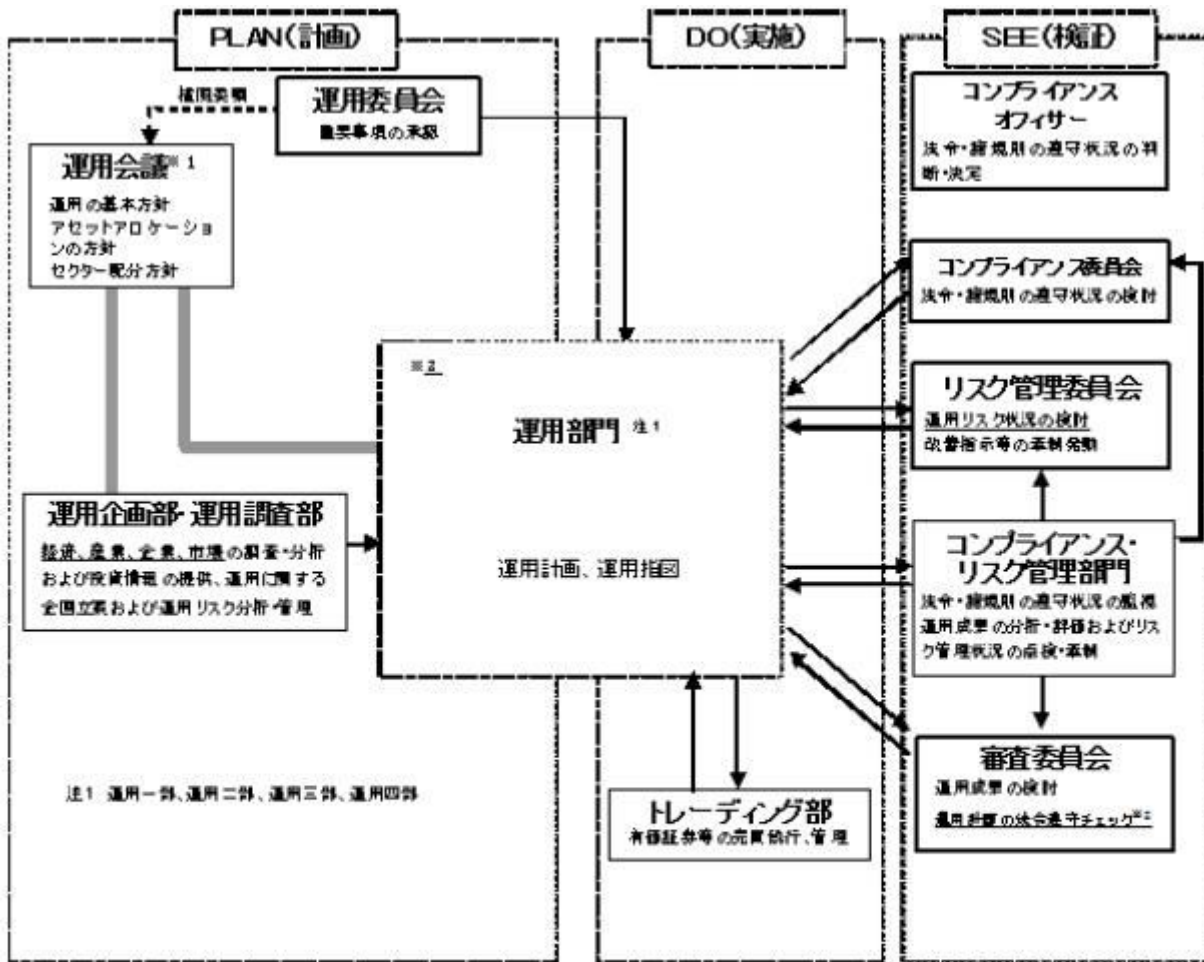
a. 資本金の額（平成25年11月末現在）

（略）

（ロ）組織図



（ハ）投資運用の意思決定機構



実績の矢印は情報の流れを示します。

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

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

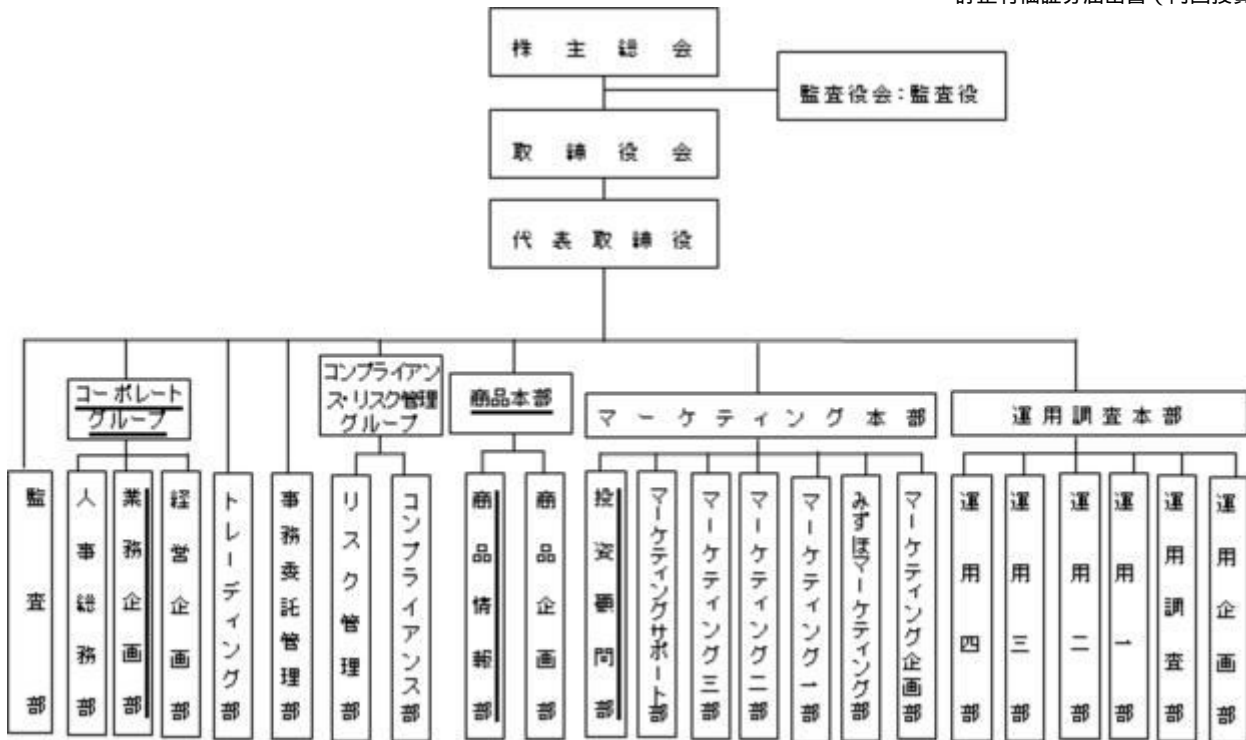
※3 運用部門において、運用計画および運用指図の承認は各々の上位職者が行います。

<訂正後>

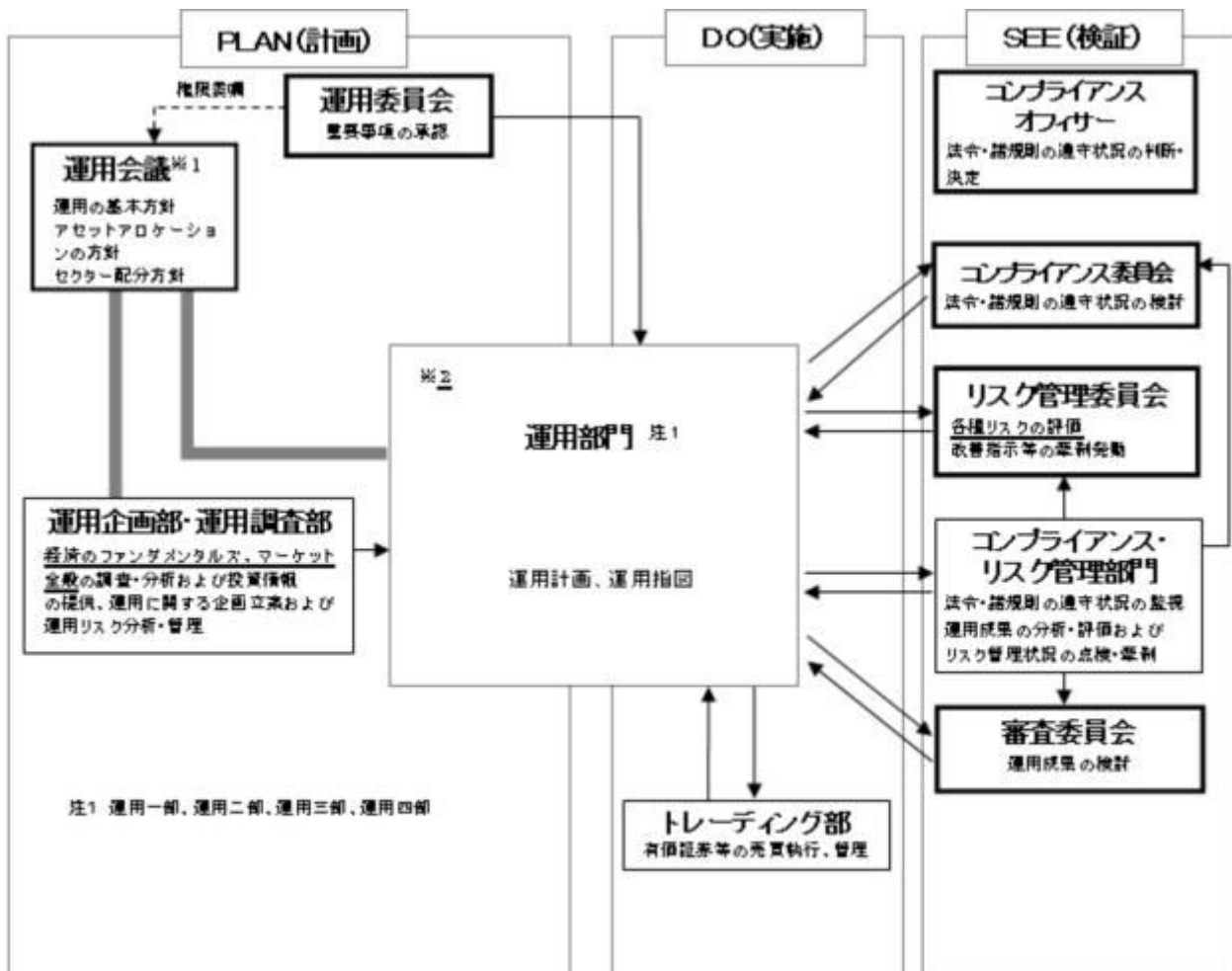
a. 資本金の額（平成26年5月末現在）

（略）

（口）組織図



(八) 投資運用の意思決定機構



実績の矢印は情報の流れを示します。

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

(略)

平成25年11月29日現在、委託者が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は以下のとおりです。

(平成25年11月29日現在)

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	240	3,353,695
株式投資信託（合計）	211	2,661,678
単位型	7	64,848
追加型	204	2,596,829
公社債投資信託（合計）	29	692,016
単位型	2	973
追加型	27	691,043

<訂正後>

(略)

平成26年5月30日現在、委託者が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は以下のとおりです。

(平成26年5月30日現在)

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	268	3,595,197
株式投資信託（合計）	240	2,958,225
単位型	25	159,399
追加型	215	2,798,825
公社債投資信託（合計）	28	636,971
単位型	1	776
追加型	27	636,195

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	10,766,270	13,492,111
有価証券	5,259,693	3,291,156
貯蔵品	1,062	5,188
立替金	30,280	15,778
前払金	25,483	38,614
前払費用	20,286	16,530
未収委託者報酬	1,891,689	2,654,090
未収運用受託報酬	86,074	117,049
未収収益	13,810	6,509
繰延税金資産	192,202	283,616
流動資産合計	18,286,853	19,920,646
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 15,051	2 12,380
構築物（純額）	2 1,886	2 1,650
器具・備品（純額）	2 95,877	2 99,960
リース資産（純額）	2 680	2 340
有形固定資産合計	113,496	114,332
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	3 39,774	3 74,851
ソフトウェア仮勘定	-	11,885
無形固定資産合計	39,866	86,827
投資その他の資産		
投資有価証券	2,929,683	3,213,218
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	125,515	124,152
長期繰延税金資産	8,695	63,925
前払年金費用	410,271	374,562
その他	10,632	6,632
投資その他の資産合計	3,561,898	3,859,590
固定資産合計	3,715,261	4,060,749
資産合計	22,002,115	23,981,396

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	18,156	21,303
リース債務	1,206	810
未払金		
未払収益分配金	336	177
未払償還金	14,470	10,100
未払手数料	1 964,634	1 1,296,830
その他未払金	195,035	513,148
未払金合計	1,174,476	1,820,257
未払費用	402,634	548,430
未払法人税等	471,902	1,462,380
賞与引当金	299,000	362,800
役員賞与引当金	45,500	44,200
流動負債合計	2,412,875	4,260,181
固定負債		
長期リース債務	1,156	345
退職給付引当金	168,209	172,959
役員退職慰労引当金	80,416	31,708
執行役員退職慰労引当金	99,750	102,083
固定負債合計	349,532	307,096
負債合計	2,762,408	4,567,278
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	10,000,000	8,900,000
繰越利益剰余金	1,559,003	2,889,165
利益剰余金合計	11,919,497	12,149,658
自己株式	72,415	72,415
株主資本合計	19,133,081	19,363,242
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	106,625	50,874
評価・換算差額等合計	106,625	50,874
純資産合計	19,239,706	19,414,117
負債純資産合計	22,002,115	23,981,396

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)		(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		19,893,907		29,107,010
運用受託報酬		170,563		261,777
営業収益合計		20,064,471		29,368,787
営業費用				
支払手数料	1	10,580,803	1	15,428,327
広告宣伝費		213,908		336,593
公告費		1,919		2,919
調査費				
調査費		275,599		339,210
委託調査費		2,855,086		4,188,805
図書費		5,332		4,862
調査費合計		3,136,017		4,532,878
委託計算費		533,813		1,151,067
営業雑経費				
通信費		37,161		37,016
印刷費		132,025		160,606
協会費		14,855		14,992
諸会費		3,088		3,153
その他		23,541		27,521
営業雑経費合計		210,672		243,290
営業費用合計		14,677,134		21,695,077
一般管理費				
給料				
役員報酬		93,516		89,886
給料・手当		1,395,728		1,326,658
賞与		221,930		332,688
給料合計		1,711,175		1,749,233
交際費		9,782		9,349
寄付金		2,465		3,066
旅費交通費		81,050		78,321
租税公課		52,119		65,510
不動産賃借料		211,739		205,792
賞与引当金繰入		299,000		362,800
役員賞与引当金繰入		45,500		44,200
役員退職慰労引当金繰入		28,335		39,756

退職給付費用	195,268	182,850
減価償却費	88,183	63,615
諸経費	533,744	585,445
一般管理費合計	3,258,364	3,389,942
営業利益	2,128,972	4,283,768

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	157,357	143,049
有価証券利息	12,764	6,052
受取利息	22,364	14,495
時効成立分配金・償還金	3,608	4,450
雑益	26,471	20,588
営業外収益合計	222,565	188,635
営業外費用		
支払利息	222	59
時効成立後支払分配金・償還金	1,339	1,557
雑損	22	8,673
営業外費用合計	1,585	10,290
経常利益	2,349,952	4,462,113
特別利益		
貸倒引当金戻入	1,982	-
投資有価証券売却益	146,334	158,386
特別利益合計	148,316	158,386
特別損失		
固定資産除却損	2 101	2 3,210
ゴルフ会員権売却損	-	2,795
投資有価証券売却損	37,198	42,388
投資有価証券評価損	49,352	10,974
減損損失	4,291	-
特別損失合計	90,943	59,368
税引前当期純利益	2,407,325	4,561,131
法人税、住民税及び事業税	983,713	1,905,519
法人税等調整額	129,642	113,958
法人税等合計	854,070	1,791,560
当期純利益	1,553,255	2,769,571

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別途 積立金	繰越 利益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	11,118,000	1,427,158
当期変動額					
別途積立金取崩				1,118,000	1,118,000
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					1,553,255
自己株式の取得					
自己株式の処分					
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	1,118,000	131,845
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	10,000,000	1,559,003

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自己 株式	株主 資本 合計	その他有価証券 評価差額金	
	利益 剰余金 合計				
当期首残高	12,905,651	6,827	20,184,823	209,840	19,974,983
当期変動額					
別途積立金取崩			-		-
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	1,553,255		1,553,255		1,553,255
自己株式の取得		65,588	65,588		65,588
自己株式の処分			-		-
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				316,465	316,465
当期変動額合計	986,154	65,588	1,051,742	316,465	735,276
当期末残高	11,919,497	72,415	19,133,081	106,625	19,239,706

当事業年度（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	
				別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	10,000,000	1,559,003
当期変動額					
別途積立金取崩				1,100,000	1,100,000
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					2,769,571
自己株式の取得					
自己株式の処分					
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	1,100,000	1,330,161
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	利益剰余金合計				
当期首残高	11,919,497	72,415	19,133,081	106,625	19,239,706
当期変動額					
別途積立金取崩			-		-
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	2,769,571		2,769,571		2,769,571
自己株式の取得			-		-
自己株式の処分			-		-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				55,750	55,750
当期変動額合計	230,161	-	230,161	55,750	174,410
当期末残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 関連会社株式

総平均法による原価法

(2) 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

(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計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、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。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における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按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

(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

本会計基準等は、財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものです。

適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首より適用予定です。

当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中です。

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
未払手数料	572,094千円	760,018千円

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	578,691千円	599,157千円

3. 無形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
無形固定資産の減価償却累計額	238,992千円	252,073千円

（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24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
支払手数料	6,343,293千円	8,738,779千円

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24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
--	--	--

建物	- 千円	3,204千円
器具・備品	101千円	5千円
計	101千円	3,210千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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)	9,386	-	-	9,386

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25年12月19日 臨時株主総会	普通 株式	2,539,409	1,400	平成25年11月15日	平成25年12月20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。

（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およ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25年3月31日)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	10,766,270	10,766,270	-
(2) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的債券	500,129	500,400	270
其他有価証券	7,490,195	7,490,195	-
(3) 未収委託者報酬	1,891,689	1,891,689	-

当事業年度(平成26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	13,492,111	13,492,111	-
(2) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的債券	-	-	-
其他有価証券	6,305,322	6,305,322	-
(3) 未収委託者報酬	2,654,090	2,654,090	-

(注)1. 金融商品の時価の算定方法及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、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

(単位:千円)

区分	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
非上場株式	276,151	276,151

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注)3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成25年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	10,766,163	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的債券	500,000	-	-	-
其他有価証券	4,258,263	357,062	1,056,875	-
(3) 未収委託者報酬	1,891,689	-	-	-

当事業年度（平成26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	13,491,981	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的債券	-	-	-	-
其他有価証券	3,291,156	380,080	1,261,941	269,692
(3) 未収委託者報酬	2,654,090	-	-	-

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度（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

当事業年度（平成26年3月31日）

該当事項はありません。

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。

当事業年度(平成26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	1,920,996	1,709,935	211,061	
小計	1,920,996	1,709,935	211,061	
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	4,384,326	4,516,340	132,014	
小計	4,384,326	4,516,340	132,014	
合計		6,305,322	6,226,275	79,047

(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

当事業年度（平成26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	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	1,209,919	158,386	42,388
合計	1,209,919	158,386	42,388

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10,974千円（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。

（退職給付関係）

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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25年3月31日)
(1)退職給付債務(千円)	1,281,738
(2)年金資産(千円)	1,018,974
(3)未積立退職給付債務(1)+(2)(千円)	262,764
(4)未認識数理計算上の差異(千円)	547,641
(5)未認識過去勤務債務(債務の減額)(千円)	42,815
(6)貸借対照表計上額純額(3)+(4)+(5)(千円)	242,061
(7)前払年金費用(千円)	410,271
(8)退職給付引当金(6)-(7)(千円)	168,209

3．退職給付費用に関する事項

	前事業年度

	(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)	108,925
(2)利息費用(千円)	17,431
(3)期待運用収益(減算)(千円)	17,533
(4)数理計算上の差異の費用処理額(千円)	86,570
(5)過去勤務債務の費用処理額(千円)	16,055
(6)小計(1)+(2)-(3)+(4)+(5)(千円)	179,338
(7)その他(千円)(注2)	15,930
(8)退職給付費用(6)+(7)(千円)	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(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
(2)割引率	1.5%
(3)期待運用収益率	2.0%
(4)過去勤務債務の処理年数	10年
(5)数理計算上の差異の処理年数	10年

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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. 確定給付制度

(単位:千円)

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	1,281,738
勤務費用	80,449
利息費用	19,226
数理計算上の差異の発生額	91,561
退職給付の支払額	48,235
過去勤務費用の発生額	-
退職給付債務の期末残高	1,424,739

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	1,018,974
期待運用収益	20,379
数理計算上の差異の発生額	70,810
事業主からの拠出額	78,919
退職給付の支払額	32,029

年金資産の期末残高	1,157,054
-----------	-----------

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

積立型制度の退職給付債務	1,187,071
年金資産	1,157,054
	30,017
非積立型制度の退職給付債務	237,668
未積立退職給付債務	267,685
未認識数理計算上の差異	496,048
未認識過去勤務費用	26,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	201,603
退職給付引当金	172,959
前払年金費用	374,562
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	201,603

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用(注1)	110,782
利息費用	19,226
期待運用収益	20,379
数理計算上の差異の費用処理額	72,344
過去勤務費用の費用処理額	16,055
確定給付制度に係わる退職給付費用	165,917

(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(30,333千円)については

「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

株式	41.3%
債券	25.6%
共同運用資産	18.3%
生命保険一般勘定	11.2%
現金及び預金	3.3%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
長期期待運用収益率	2.0%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、16,933千円でありました。

（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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	130,944千円	145,054千円
減価償却超過額	796	1,076
退職給付引当金	95,500	98,025
役員退職慰労引当金	28,660	11,300
投資有価証券評価損	17,589	12,705
非上場株式評価損	28,430	28,430
未払事業税	42,964	103,536
その他	63,091	109,079
繰延税金資産小計	407,976	509,208
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	407,976	509,208
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	60,857	28,172
前払年金費用	146,220	133,494
繰延税金負債合計	207,078	161,666
繰延税金資産の純額	200,897	347,542

(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	192,202千円	283,616千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	8,695	63,925

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
法定実効税率	38.01%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
(調整)		
役員給与永久に損金算入されない項目	0.55	
交際費等永久に損金算入されない項目	0.36	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.51	
住民税均等割	0.16	
評価性引当額の増減	3.18	
その他	0.09	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.48	

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第十号)が平成26年3月31日に公布され平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないことになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は19,567千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。

(セグメント情報等)

セグメント情報

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)及び

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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24年4月1日 至 平成25年3月31日)及び

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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 7.74	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	8,738,779	未払手数料	760,018

（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
							計算委託料支払	91,562	その他未払金	8,536

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	ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,472
							メールシステムサービス料支払	36,000	その他未払金	3,150

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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	175,003	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	105,424	その他未払金	8,030
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,472
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,230
							IT関連業務支援	4,145	その他未払金	1,648

(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24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)

1株当たり純資産額	10,607円02銭	10,703円18銭
1株当たり当期純利益金額	854円62銭	1,526円89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いません。

(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24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益金額(千円)	1,553,255	2,769,571
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)	1,553,255	2,769,571
期中平均株式数(千株)	1,817	1,813

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

5【その他】

b. 訴訟事件その他の重要事項

<訂正前>

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。

<訂正後>

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 三井住友信託銀行株式会社(「受託者」)

a. 資本金の額

平成25年11月末現在、342,037百万円

(略)

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

a . 資本金の額

平成25年11月末現在、300万ポンド

(略)

(3) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額及び事業の内容は以下の「販売会社一覧表」のとおりです。

販売会社一覧表

(平成25年11月末現在)

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
(略)		
丸福証券株式会社	852	同上
(略)		

<訂正後>

(1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a . 資本金の額

平成26年5月末現在、342,037百万円

(略)

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

a . 資本金の額

平成26年5月末現在、300万ポンド

(略)

(3) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額及び事業の内容は以下の「販売会社一覧表」のとおりです。

販売会社一覧表

(平成26年5月末現在)

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
(略)		
岡三にいがた証券株式会社	852	同上
(略)		

独立監査人の監査報告書

平成26年5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 業務執行社員	公認会計士 伊藤 志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 福村 寛

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10月22日から平成26年4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26年4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26年6月20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26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。