

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年1月20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27年1月21日から平成28年1月20日まで) 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

新光7資産バランスファンド

愛称として「七重奏」という名称を用いることがあります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

（イ）追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

（ロ）当初元本は1口当たり1円です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

（イ）発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

（５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.7%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。商品および投資

環境の説明・情報提供、購入の事務手続きなどの対価として販売会社にお支払いいただきます。当該手数料には消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）（8%）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

（6）【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

（7）【申込期間】

平成27年 1月21日から平成28年 1月20日までです。

なお、申込期間は原則として更新されます。

（8）【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所（販売会社）については、下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

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

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

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

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

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

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

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



b. ファンドの特色

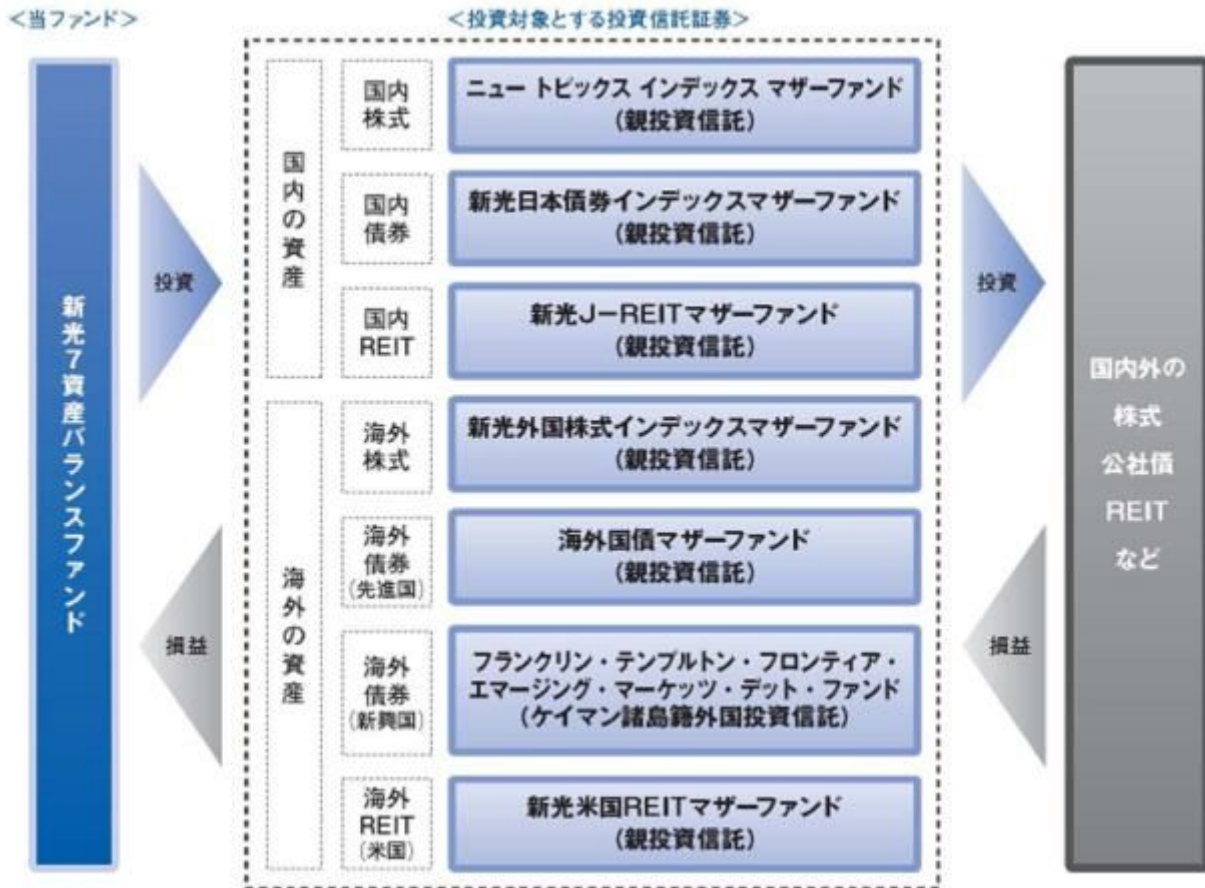
1. 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産（株式、公社債、不動産投資信託証券）にバランスよく分散投資します。

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

投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とします。

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

フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドへの投資にあたっては、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 リミテッドから投資助言および情報提供を受けます。



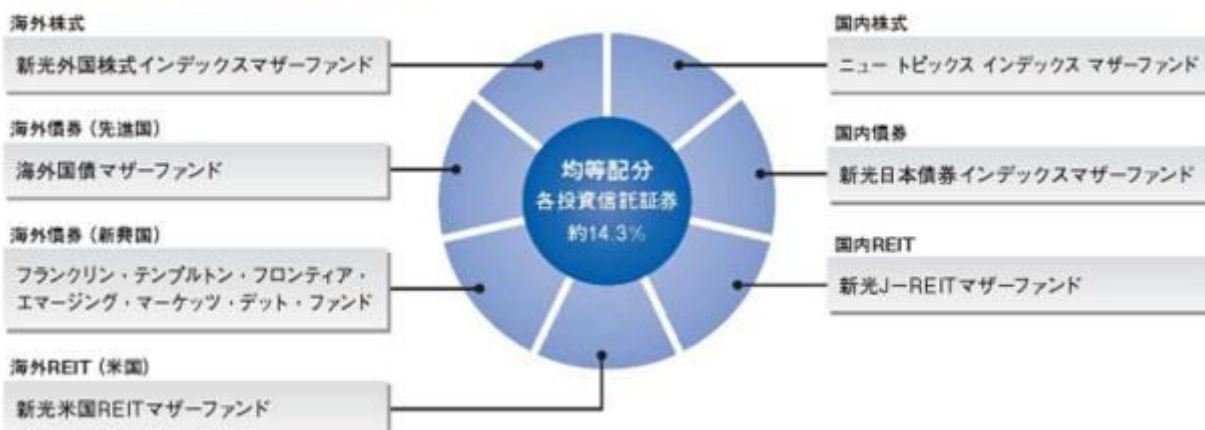
2. 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。 基本投資配分比率は均等とします。

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

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

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

<基本投資配分比率のイメージ図>



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

主な投資制限

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

分配方針

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



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

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

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

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

運用状況により分配金額は変動します。

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

収益分配金に関する留意事項

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



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

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

分配金と基準価額の関係（イメージ）



分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

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

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

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

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

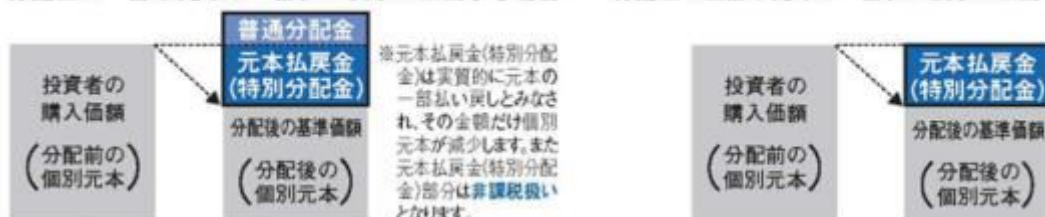
A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

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

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

分配金の一部が元本の一部払い戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払い戻しに相当する場合



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

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

c. 信託金限度額

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成18年9月29日

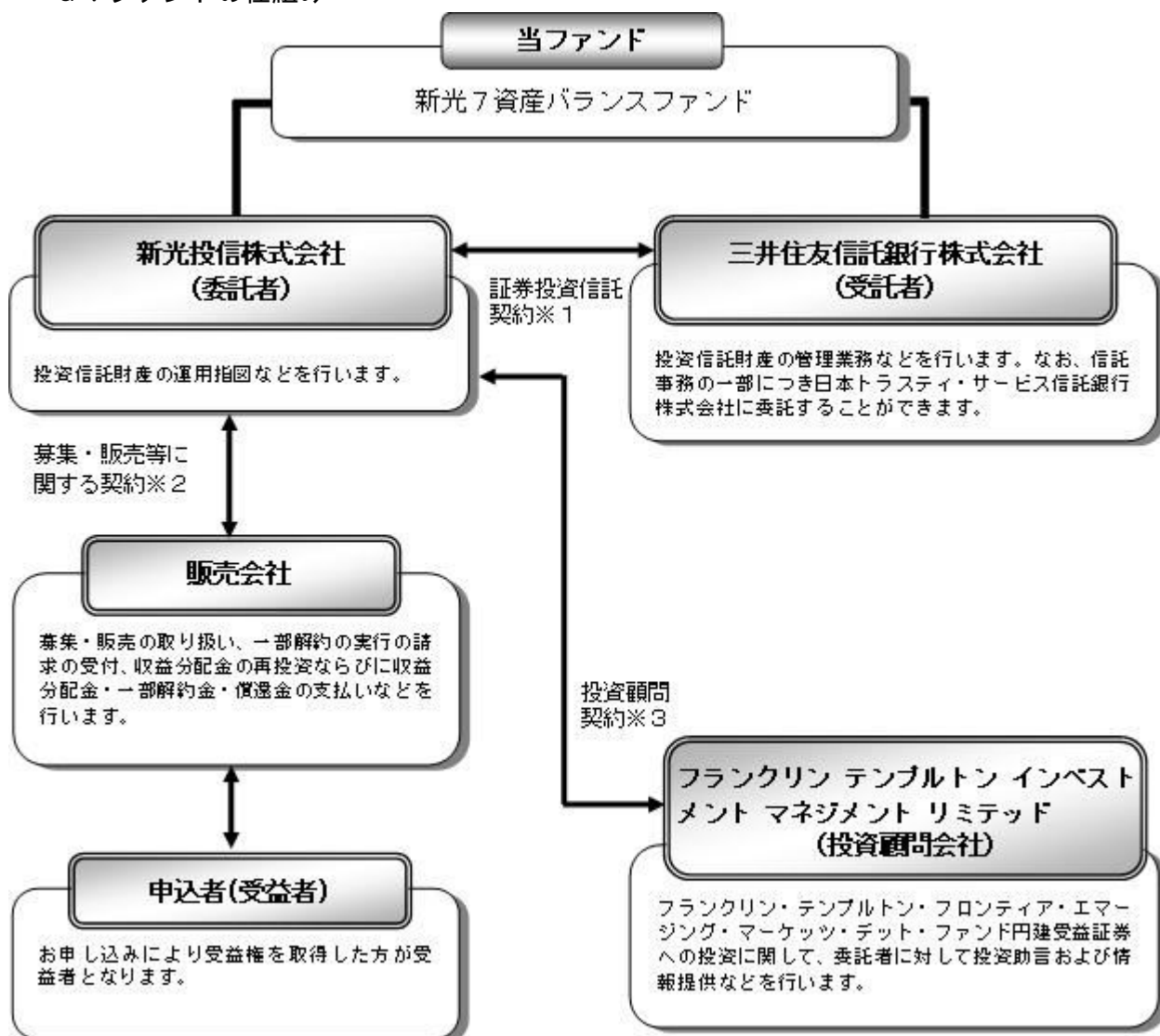
関東財務局長に対して有価証券届出書提出

平成18年10月31日

投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み



1 証券投資信託契約

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

2 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結してお

り、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



b. 委託会社の概況

(イ) 資本金の額（平成26年10月末現在）

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

(ロ) 委託会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

（平成26年10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】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

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

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

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

内国証券投資信託（親投資信託）	ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光J - R E I Tマザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	海外国債マザーファンド受益証券
ケイマン諸島籍外国投資信託	フランクリン・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 円建受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光米国 R E I Tマザーファンド受益証券

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

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

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

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

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

(ハ) 主な投資制限

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の50%未満とします。

（２）【投資対象】

a．投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

b．運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

8．コマーシャル・ペーパー

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

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

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、第1号に掲げる外国投資信託の受益証券および第2号から第7号に掲げる証券投資

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

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

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

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

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

1. ニュー トピックス インデックス マザーファンドの概要

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

東証株価指数について

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

2. 新光日本債券インデックスマザーファンドの概要

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

NOMURA - BPI総合について

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

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

3. 新光J-REITマザーファンドの概要

ファンド名	新光J-REITマザーファンド
-------	-----------------

形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・不動産投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 ・不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができるものとします。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成18年10月31日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

東証REIT指数（配当込み）について

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

4．新光外国株式インデックスマザーファンドの概要

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
-------	---------------------

形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成17年8月17日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

5．海外国債マザーファンドの概要

ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。 ・日本を除く、シティ世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。 ・シティ世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。 ・債券ポートフォリオは、日本を除くG7構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国）が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。 ・運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。 <ul style="list-style-type: none"> ・通貨アロケーション ・イールドカーブ戦略 ・セクターアロケーション ・デュレーション調整 ・外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得したものに限りません。 ・外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月4日
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成13年11月5日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

シティ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・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの概要

ファンド名	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 （以下、当概要において「ファンド」といいます。）
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・単一発行体または単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・クレジットリンク債への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・発行体格付けにおいて、ムーディーズ社またはスタンダード・アンド・プアーズ社のソブリン信用格付けがC a a 1またはC C C +以下の証券または無格付けの証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。 ・ファンドにおける証券の平均信用格付けは、ムーディーズ社またはスタンダード・アンド・プアーズ社の格付けにおいてB 1またはB +以上とします。 ・ファンドにおける証券の平均デュレーションは、8年以下とします。
信託期間	150年
決算日	毎年5月31日
収益分配方針	<p>受託会社は毎月3日（休業日の場合は翌営業日）に受益者に分配金を支払います。当該月次分配にかかわらず、投資顧問会社および管理会社からの通知により受託会社は分配を行う場合があります。</p> <p>分配はネット・インカム収益とネット実現損益の合計の範囲内で行うことができますが、受益者の利益にかなうと判断される場合には純資産から分配を行うこともできます。</p>
信託報酬等	<p>運用報酬 : 純資産総額に対し0.40%</p> <p>その他報酬 : 純資産総額に対し0.15%（上限）</p> <p>その他報酬には、受託会社報酬、管理事務代行会社報酬、保管受託銀行報酬、監査報酬、法的費用が含まれます。</p>
信託設定日	平成18年3月8日
関係法人	<p>受託会社兼管理事務代行会社：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</p> <p>副管理事務代行会社：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店</p> <p>保管受託銀行：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン</p> <p>管理会社：フランクリン テンプルトン インターナショナル サービスーズ エス エー アール エル</p> <p>投資顧問会社：フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド</p>

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（F T I M L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98.5兆円）の一員です。F T I M L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9月末現在、1米ドル=109.565円で換算

7. 新光米国R E I Tマザーファンドの概要

ファンド名	新光米国R E I Tマザーファンド
形態	親投資信託

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

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

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

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

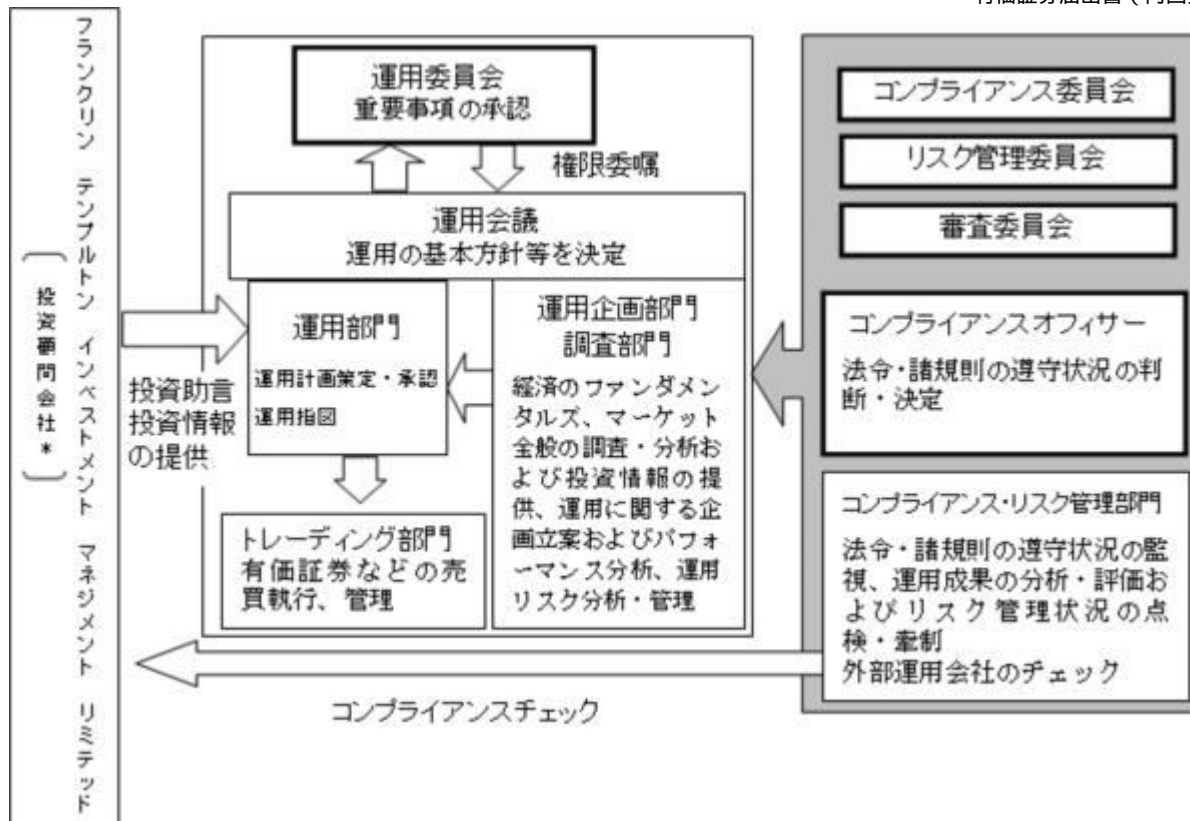
FTSE^(R)は、London Stock Exchange PlcおよびThe Financial Times Limitedの登録商標であり、許諾のもとにFTSEにより使用されます。NAREIT^(R)は、全米不動産投資信託協会の登録商標です。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成27年1月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

（3）【運用体制】

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。

上記運用体制は、今後変更になることがあります。

PLAN

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

DO

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

SEE

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

< 受託者に対する管理体制 >

投資信託財産の管理業務を通じ、受託者の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を

総合的に検証しています。また、受託者より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

b．運用体制に関する社内規則

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

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

(4)【分配方針】

a．収益分配は原則として、毎月20日（該当日が休業日の場合は翌営業日。）の決算時に以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- 1．分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 2．分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 3．上記2．にかかわらず、上記2．にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。
- 4．留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

b．投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1．分配金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

c．毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

d．「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払われます。

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

(5)【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

c．公社債の借り入れ

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

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

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

(ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d．同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

e．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

f．外国為替予約の指図

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

g．資金の借り入れ

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

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

h．受託者の自己または利害関係人等との取引

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

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

i . デリバティブ取引等に係る投資制限

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

（1）ファンドのもつリスク

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

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

a . 資産配分リスク

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

b . 株価変動リスク

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

c . REITの価格変動リスク

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

d . 為替変動リスク

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

また、当ファンドは新興国通貨建証券に実質的な投資を行うことから、為替変動リスクが相対的に高くなる可能性があります。

e . カントリーリスク

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

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

f．金利変動リスク

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

g．信用リスク

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

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

h．流動性リスク

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

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

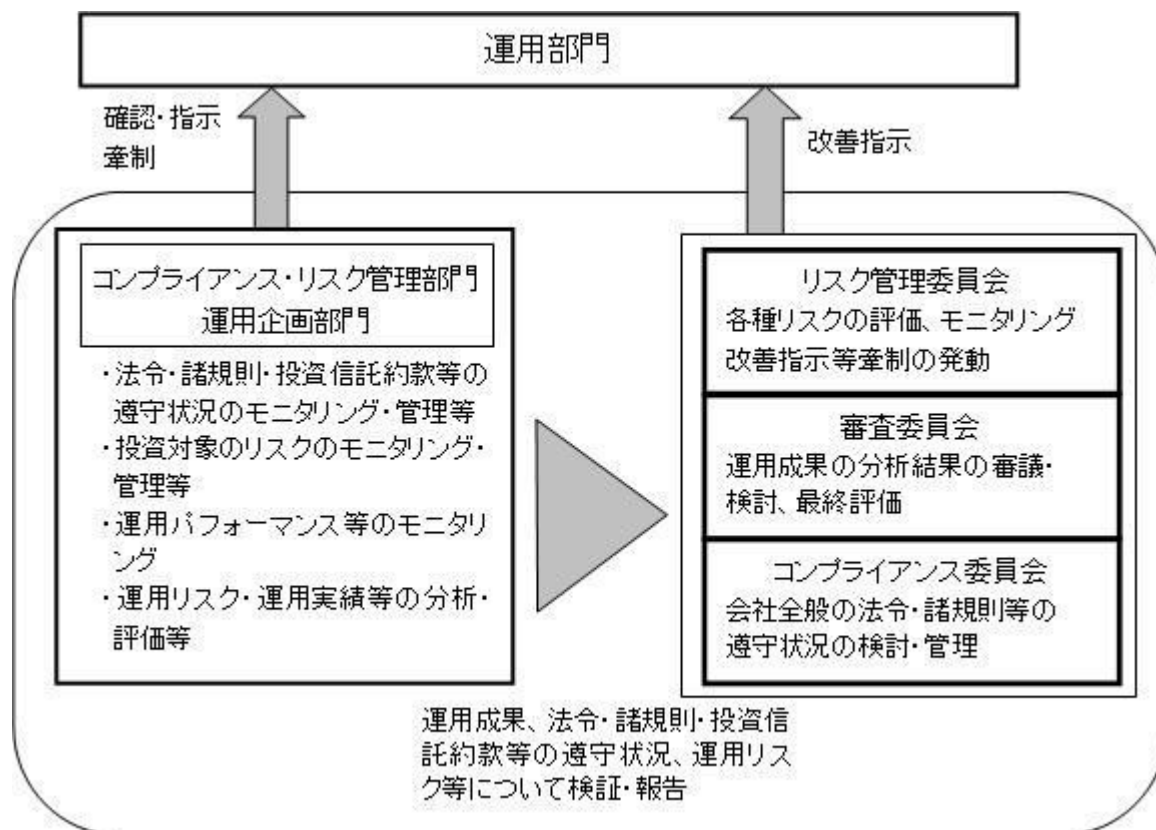
i．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- (ロ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ハ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ニ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。
- (ホ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ヘ) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (ト) 投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券（ベビーファンド）が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券（ベビーファンド）の価額が変動する可能性があります。

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

（２）リスク管理体制

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



上記リスク管理体制は、今後変更になることがあります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



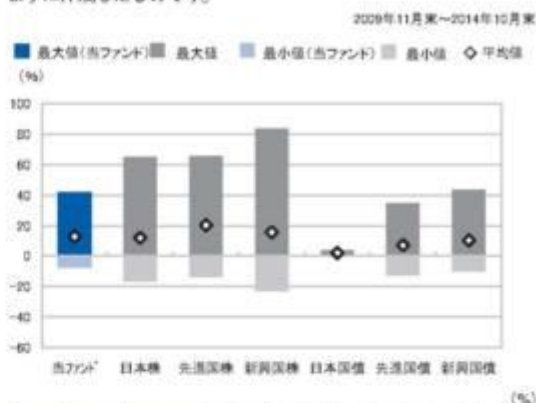
2009年11月 2010年10月 2011年10月 2012年10月 2013年10月 2014年10月

※分配金再投資基準価額は、2009年11月末の基準価額を10,000として指数化しております。
※年間騰落率は、2009年11月から2014年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

分配金再投資基準価額は、取引時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。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	42.1	65.0	65.7	83.9	4.1	34.9
最小値	-17.2	-17.0	-13.6	-22.8	0.4	-12.7
平均値	12.9	12.1	20.3	15.7	2.3	7.1

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※2009年11月から2014年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
※決算日に対応した数値とは異なります。
※当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債・・・NOMURA-BPI国債
先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債・・・JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

各資産クラスの騰落率について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の慰謝について、当社の責任を負いません。

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Incが開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Incに帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Incが開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Incに帰属します。

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建て外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の指標が日々公表されています。なお、NOMURA-BPIに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.7%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。商品および投資環境の説明・情報提供、購入の事務手続きなどの対価として販売会社にお支払いいただきます。当該手数料には消費税等（8%）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

a．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

b．信託財産留保額

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

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

（3）【信託報酬等】

日々のファンド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、投資対象とする投資信託証券の信託報酬を含めた実質的な信託報酬の総額は、ファンド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。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< ファンド・オブ・ファンズの信託報酬の配分 >

販売会社別 純資産額 (注1)	300億円未満 の部分	300億円以上 500億円未満の部分	500億円以上 の部分	
-----------------------	----------------	-----------------------	----------------	--

委託者 (注2)	年率0.42% (税抜)	年率0.37% (税抜)	年率0.32% (税抜)	委託した資金の運用、基準 価額の算出などの対価
販売会社	年率0.45% (税抜)	年率0.50% (税抜)	年率0.55% (税抜)	購入後の情報提供、運用報 告書など各種書類の送付、 分配金・償還金・換金代金 支払などの事務手続きなど の対価
受託者	年率0.08% (税抜)			運用財産の管理、委託者か らの指図の実行などの対価
投資対象とする 投資信託証券	年率0.07865%			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・ファンドの組入比率を 14.3%として概算したも の です。親投資信託の信託報 酬はありません。
実質的な負担 (注3)	年率1.10465% (税抜1.02865%) 程度			

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

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

(注3) 概算の数値です。実際の信託報酬は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。

(4) 【その他の手数料等】

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

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

b. 証券取引に伴う手数料・税金等、当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委
託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税等およ
び資産を外国で保管する場合の費用についても投資信託財産が負担します。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

a. 個人の受益者の場合

(イ) 収益分配金の取り扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、配当所得として課税され、
20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収され
ます。なお、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。確定申告を行い、総合課税

(配当控除の適用はありません。) ・ 申告分離課税のいずれかを選択することもできます。また、特定口座(源泉徴収あり)の利用も可能です。

(ロ) 一部解約金・償還金の取り扱い

一部解約時および償還時の譲渡益(解約価額または償還価額から取得費(申込手数料(税込))を含みます。)を控除した額)については、譲渡所得とみなされ、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座(源泉徴収あり)の利用も可能です。

(ハ) 損益通算について

一部解約時、償還時に生じた損失(譲渡損)は、確定申告を行うことにより上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得の金額(申告分離課税を選択したものに限りま)から差し引くこと(損益通算)ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。一部解約時、償還時に生じた差益(譲渡益)は、上場株式等の譲渡損と損益通算ができます。

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合 >

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

b. 法人の受益者の場合

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

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

なお、益金不算入制度は適用されません。

c. 個別元本について

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

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

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

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

d. 収益分配金の課税について

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

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

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

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

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

新光7資産バランスファンド

(平成26年10月31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	1,093,223,500	13.73
親投資信託受益証券	日本	6,682,521,890	83.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		182,577,724	2.29
純資産総額		7,958,323,114	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10月31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	19,845,494,480	37.80
	カナダ	937,116,101	1.78
	ドイツ	10,391,117,672	19.79
	イタリア	6,485,336,520	12.35
	フランス	9,400,761,474	17.90
	イギリス	4,444,139,722	8.46

	小計	51,503,965,969	98.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		986,298,253	1.87
純資産総額		52,490,264,222	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10月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	13,836,237,140	94.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		747,669,201	5.12
純資産総額		14,583,906,341	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10月31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	7,242,630,059	55.75
	カナダ	539,831,936	4.15
	モーリシャス	1,353,336	0.01
	パナマ	6,493,018	0.04
	ドイツ	454,345,439	3.49
	イタリア	116,818,439	0.89
	フランス	463,216,771	3.56
	オランダ	198,561,162	1.52
	スペイン	183,099,459	1.40
	ベルギー	68,055,812	0.52
	オーストリア	11,523,500	0.08
	ルクセンブルグ	20,905,916	0.16
	フィンランド	49,462,327	0.38
	アイルランド	130,326,132	1.00
	ポルトガル	8,592,114	0.06
	イギリス	1,032,540,951	7.94
	スイス	517,304,887	3.98
	スウェーデン	160,348,445	1.23
	ノルウェー	37,664,207	0.28
	デンマーク	85,034,722	0.65
ケイマン諸島	13,280,705	0.10	

	リベリア	5,561,579	0.04
	オーストラリア	374,532,164	2.88
	バミューダ諸島	47,827,643	0.36
	ニュージーランド	8,070,309	0.06
	香港	145,038,760	1.11
	シンガポール	83,367,833	0.64
	イスラエル	33,290,390	0.25
	キュラソー	52,632,364	0.40
	ジャージー	64,046,208	0.49
	ガーンジー	2,941,336	0.02
	英ヴァージン諸島	6,950,350	0.05
	マン島	2,348,008	0.01
	小計	12,167,996,281	93.67
投資信託受益証券	シンガポール	1,948,438	0.01
投資証券	アメリカ	222,958,837	1.71
	カナダ	2,845,605	0.02
	フランス	15,891,561	0.12
	オランダ	1,418,877	0.01
	イギリス	17,668,539	0.13
	オーストラリア	29,953,647	0.23
	香港	5,887,538	0.04
	シンガポール	4,627,578	0.03
	小計	301,252,182	2.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		517,948,682	3.98
純資産総額		12,989,145,583	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10月31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	14,135,077,000	79.49
地方債証券	日本	1,278,935,100	7.19
特殊債券	日本	1,446,464,100	8.13
社債券	日本	844,050,000	4.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		76,343,517	0.42
純資産総額		17,780,869,717	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10月31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	1,117,713,500	98.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,516,256	1.45
純資産総額		1,134,229,756	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10月31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	1,158,788,573	98.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,940,678	1.01
純資産総額		1,170,729,251	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10月31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	新光米国REITマザーファンド	893,747,978	1.2138	1,084,831,295	1.2913	1,154,096,763	14.50
2	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	706,846,977	1.4818	1,047,405,850	1.6142	1,140,992,390	14.33
3	日本	親投資信託 受益証券	新光J-REITマザーファンド	765,275,608	1.3941	1,066,870,725	1.4665	1,122,276,679	14.10
4	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	920,382,291	1.1899	1,095,162,888	1.1933	1,098,292,187	13.80
5	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	631,083,609	1.6240	1,024,879,781	1.7325	1,093,352,352	13.73
6	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	6,106	1,059,391,000	6,301	1,093,223,500	13.73
7	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	492,165,560	2.1540	1,060,124,617	2.1812	1,073,511,519	13.48

(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10月31日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	13.73
親投資信託受益証券	83.96
合計	97.70

(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10月31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	43,000,000	10,948.38	4,707,807,097	10,945.9590	4,706,762,397	0.2500	2015.09.15	8.96
2	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	10,900,000	15,323.30	1,670,240,728	16,208.0360	1,766,675,924	3.2500	2021.10.25	3.36
3	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	9,900,000	16,188.63	1,602,675,045	17,612.2180	1,743,609,582	4.2500	2023.10.25	3.32
4	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000	19,684.60	1,653,506,572	19,941.0380	1,675,047,192	4.7500	2028.07.04	3.19
5	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	10,200,000	14,966.07	1,526,539,305	15,997.2020	1,631,714,604	3.0000	2022.04.25	3.10
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,800,000	11,333.38	1,564,007,048	11,403.8203	1,573,727,203	2.6250	2020.11.15	2.99
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	12,001.30	1,560,169,044	12,056.4434	1,567,337,647	3.6250	2021.02.15	2.98
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,700,000	11,354.92	1,555,624,601	11,423.4673	1,565,015,032	2.6250	2020.08.15	2.98
9	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,300,000	14,448.99	1,343,756,976	15,054.6500	1,400,082,450	1.7500	2022.07.04	2.66
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,500,000	11,712.32	1,346,917,465	11,724.1523	1,348,277,521	3.1250	2021.05.15	2.56
11	イギリス	国債証券	TSY	7,600,000	16,811.03	1,277,638,951	17,690.6325	1,344,488,074	2.2500	2023.09.07	2.56
12	イギリス	国債証券	TSY	7,800,000	16,510.27	1,287,801,218	17,207.0984	1,342,153,676	1.7500	2022.09.07	2.55
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,300,000	10,430.01	1,282,891,346	10,544.4762	1,296,970,579	1.7500	2023.05.15	2.47
14	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	8,400,000	14,390.45	1,208,798,136	15,164.8900	1,273,850,760	2.2500	2024.05.25	2.42
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,800,000	10,678.16	1,260,023,055	10,791.3455	1,273,378,771	2.0000	2023.02.15	2.42
16	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,500,000	14,022.52	1,051,689,600	15,229.6560	1,142,224,200	2.2500	2022.10.25	2.17
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,200,000	11,068.53	1,128,991,024	11,180.8692	1,140,448,665	2.5000	2023.08.15	2.17
18	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,700,000	13,279.32	1,022,507,832	14,653.6520	1,128,331,204	1.7500	2023.05.25	2.14
19	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000	14,469.98	1,012,898,762	15,316.4700	1,072,152,900	2.0000	2023.08.15	2.04
20	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000	14,350.41	1,004,528,928	14,984.3720	1,048,906,040	1.7500	2024.02.15	1.99
21	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000	14,140.98	989,868,662	14,774.9160	1,034,244,120	1.5000	2022.09.04	1.97
22	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000	14,031.91	982,234,266	14,762.5140	1,033,375,980	1.5000	2023.02.15	1.96
23	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000	14,001.09	980,076,869	14,750.1120	1,032,507,840	1.5000	2023.05.15	1.96
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	10,754.44	1,010,917,525	10,929.7289	1,027,394,521	2.0000	2021.11.15	1.95
25	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000	14,325.22	1,002,765,639	14,652.2740	1,025,659,180	1.5000	2024.05.15	1.95

26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,200,000	10,910.30	1,003,747,778	11,028.8183	1,014,651,284	2.1250	2021.08.15	1.93
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000	14,772.99	842,060,937	16,494.6600	940,195,620	4.7500	2023.08.01	1.79
28	イギリス	国債証券	TSY	5,000,000	18,105.06	905,253,271	18,306.5963	915,329,815	2.7500	2024.09.07	1.74
29	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000	15,284.77	825,377,904	16,220.4380	875,903,652	4.5000	2024.03.01	1.66
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	10,209.24	847,366,959	10,514.5786	872,710,027	1.6250	2022.11.15	1.66

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成26年10月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別投資比率

(平成26年10月31日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.12
合計	98.12

(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10月31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	98,500	6,140.07	604,796,895	6,498.00	640,053,000	4.38
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	565,500	663.83	375,396,875	632.20	357,509,100	2.45
3	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	37,300	8,674.94	323,575,524	7,939.00	296,124,700	2.03
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	53,300	5,241.40	279,366,620	4,399.50	234,493,350	1.60
5	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	64,300	4,109.39	264,233,777	3,479.00	223,699,700	1.53
6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	973,600	229.96	223,896,545	200.00	194,720,000	1.33
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	27,600	5,586.94	154,199,544	6,892.00	190,219,200	1.30
8	日本	株式	KDDI	情報・通信業	23,900	6,254.97	149,493,933	7,225.00	172,677,500	1.18
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	44,300	3,173.45	140,583,835	3,766.00	166,833,800	1.14
10	日本	株式	日立製作所	電気機器	171,000	831.94	142,261,740	859.10	146,906,100	1.00
11	日本	株式	三菱地所	不動産業	52,000	2,851.81	148,294,260	2,795.50	145,366,000	0.99
12	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	85,200	1,205.27	102,689,004	1,699.00	144,754,800	0.99
13	日本	株式	ファナック	電気機器	7,400	17,268.21	127,784,754	19,120.00	141,488,000	0.97
14	日本	株式	キヤノン	電気機器	41,400	3,210.47	132,913,458	3,389.00	140,304,600	0.96
15	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	28,000	4,780.61	133,857,080	4,804.50	134,526,000	0.92
16	日本	株式	三井不動産	不動産業	37,000	3,494.33	129,290,210	3,507.50	129,777,500	0.88

17	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	29,500	4,265.38	125,828,710	4,281.00	126,289,500	0.86
18	日本	株式	三菱商事	卸売業	54,000	1,967.98	106,270,920	2,163.50	116,829,000	0.80
19	日本	株式	パナソニック	電気機器	87,000	1,314.97	114,402,605	1,305.00	113,535,000	0.77
20	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	13,100	7,937.65	103,983,215	8,645.00	113,249,500	0.77
21	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	58,100	1,732.29	100,646,049	1,862.00	108,182,200	0.74
22	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	6,400	11,991.98	76,748,672	16,505.00	105,632,000	0.72
23	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	29,000	3,266.09	94,716,846	3,513.00	101,877,000	0.69
24	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	100,200	937.57	93,944,514	997.90	99,989,580	0.68
25	日本	株式	三井物産	卸売業	59,800	1,453.55	86,922,290	1,665.50	99,596,900	0.68
26	日本	株式	三菱電機	電気機器	71,000	1,286.69	91,354,990	1,396.50	99,151,500	0.67
27	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	144,100	789.81	113,811,621	674.90	97,253,090	0.66
28	日本	株式	小松製作所	機械	37,100	2,063.33	76,549,751	2,609.50	96,812,450	0.66
29	日本	株式	ソニー	電気機器	45,900	1,823.88	83,716,188	2,072.00	95,104,800	0.65
30	日本	株式	信越化学工業	化学	13,400	5,751.01	77,063,534	7,044.00	94,389,600	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10月31日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.45
		建設業	2.62
		食料品	3.93
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.21
		化学	5.47
		医薬品	4.49
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	0.85
		鉄鋼	1.46
		非鉄金属	0.89
		金属製品	0.62
		機械	5.05
		電気機器	12.11
		輸送用機器	10.82
		精密機器	1.35
その他製品	1.31		
電気・ガス業	1.99		

	陸運業	3.84
	海運業	0.28
	空運業	0.53
	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	6.94
	卸売業	4.08
	小売業	3.94
	銀行業	8.87
	証券、商品先物取引業	1.35
	保険業	2.20
	その他金融業	1.24
	不動産業	3.16
	サービス業	2.45
合計		94.87

（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10月31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	21,525	8,131.61	175,033,030	11,697.1932	251,782,084	1.93
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	15,349	10,139.09	155,625,018	10,327.1630	158,511,625	1.22
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	28,069	4,130.86	115,949,255	5,035.1069	141,330,418	1.08
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	10,165	10,283.42	104,531,035	11,703.7535	118,968,655	0.91
5	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	17,880	4,669.91	83,498,016	5,735.9763	102,559,258	0.78
6	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO (US)	資本財	35,799	2,957.64	105,880,804	2,806.7577	100,479,122	0.77
7	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	11,794	7,574.06	89,328,497	7,942.3020	93,671,510	0.72
8	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	9,675	9,021.64	87,284,400	9,506.0196	91,970,740	0.70
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	13,575	5,899.98	80,092,316	6,493.7026	88,152,013	0.67
10	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	6,813	13,250.91	90,278,481	12,814.6480	87,306,197	0.67
11	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	8,341	8,125.27	67,772,944	10,029.3720	83,654,992	0.64
12	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	2,573	28,799.27	74,100,545	32,409.6241	83,389,963	0.64

13	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	14,827	5,482.30	81,286,175	5,456.0660	80,897,091	0.62
14	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	銀行	69,300	1,214.08	84,135,994	1,100.5475	76,267,945	0.58
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	22,790	3,424.52	78,045,012	3,262.7056	74,357,061	0.57
16	アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,807	7,366.23	42,775,732	12,488.8148	72,522,548	0.55
17	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	18,608	3,845.48	71,556,837	3,773.3234	70,214,002	0.54
18	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	37,525	1,565.74	58,754,724	1,862.0601	69,873,809	0.53
19	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	14,887	4,379.06	65,191,171	4,526.6760	67,388,626	0.51
20	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	11,477	5,460.43	62,669,465	5,811.4210	66,697,679	0.51
21	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	4,299	12,671.41	54,474,403	15,257.3035	65,591,148	0.50
22	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	10,456	5,117.11	53,504,523	6,266.2754	65,520,176	0.50
23	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,062	55,810.41	59,270,662	61,259.9218	65,058,037	0.50
24	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	1,062	55,638.75	59,088,355	60,170.8954	63,901,491	0.49
25	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	17,847	2,634.00	47,009,009	3,562.2971	63,576,318	0.48
26	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	ソフトウェア・サービス	3,486	19,680.10	68,604,852	17,970.0289	62,643,521	0.48
27	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	5,808	9,386.83	54,518,761	10,458.3710	60,742,219	0.46
28	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	6,157	7,498.53	46,168,494	9,864.6548	60,736,680	0.46
29	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	7,469	5,374.97	40,145,673	8,103.1874	60,522,707	0.46
30	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	食品・飲料・タバコ	5,985	9,776.08	58,509,895	9,660.1889	57,816,231	0.44

(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10月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成26年10月31日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.92
		素材	5.00
		資本財	6.98
		商業・専門サービス	0.87

	運輸	2.08
	自動車・自動車部品	1.59
	耐久消費財・アパレル	1.54
	消費者サービス	1.63
	メディア	2.94
	小売	3.08
	食品・生活必需品小売り	2.00
	食品・飲料・タバコ	5.95
	家庭用品・パーソナル用品	1.70
	ヘルスケア機器・サービス	3.26
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.30
	銀行	9.19
	各種金融	3.90
	保険	4.09
	不動産	0.67
	ソフトウェア・サービス	6.72
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.14
	電気通信サービス	3.05
	公益事業	3.38
	半導体・半導体製造装置	1.58
投資信託受益証券		0.01
投資証券		2.31
合計		96.01

（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10月31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303回利付 国債(10年)	250,000,000	106.71	266,780,000	106.20	265,505,000	1.4000	2019.09.20	1.49
2	日本	国債証券	第97回利付国 債(5年)	260,000,000	100.68	261,783,300	100.60	261,578,200	0.4000	2016.06.20	1.47
3	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	250,000,000	100.81	252,039,900	101.57	253,925,000	0.6000	2024.06.20	1.42
4	日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	220,000,000	107.01	235,426,800	106.74	234,834,600	1.4000	2020.03.20	1.32
5	日本	国債証券	第308回利付 国債(10年)	220,000,000	106.48	234,259,000	106.47	234,234,000	1.3000	2020.06.20	1.31
6	日本	国債証券	第93回利付国 債(5年)	230,000,000	100.83	231,919,700	100.53	231,239,700	0.5000	2015.12.20	1.30
7	日本	国債証券	第323回利付 国債(10年)	220,000,000	103.42	227,536,600	104.70	230,348,800	0.9000	2022.06.20	1.29
8	日本	国債証券	第313回利付 国債(10年)	210,000,000	106.53	223,729,000	107.08	224,882,700	1.3000	2021.03.20	1.26

9	日本	国債証券	第99回利付国債（5年）	220,000,000	100.73	221,619,100	100.70	221,544,400	0.4000	2016.09.20	1.24
10	日本	国債証券	第116回利付国債（5年）	220,000,000	100.03	220,076,700	100.45	220,992,200	0.2000	2018.12.20	1.24
11	日本	国債証券	第117回利付国債（5年）	220,000,000	100.10	220,232,300	100.41	220,908,600	0.2000	2019.03.20	1.24
12	日本	国債証券	第118回利付国債（5年）	220,000,000	100.21	220,480,700	100.39	220,858,000	0.2000	2019.06.20	1.24
13	日本	国債証券	第290回利付国債（10年）	210,000,000	105.28	221,092,800	104.52	219,500,400	1.4000	2018.03.20	1.23
14	日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	200,000,000	105.84	211,683,600	106.60	213,210,000	1.2000	2021.06.20	1.19
15	日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	190,000,000	100.09	190,188,000	101.85	193,515,000	0.6000	2023.12.20	1.08
16	日本	国債証券	第114回利付国債（5年）	190,000,000	100.52	191,002,000	100.86	191,651,100	0.3000	2018.09.20	1.07
17	日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	170,000,000	105.87	179,994,300	106.30	180,720,200	1.2000	2020.12.20	1.01
18	日本	国債証券	第285回利付国債（10年）	170,000,000	105.13	178,725,700	103.94	176,701,400	1.7000	2017.03.20	0.99
19	日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	170,000,000	104.86	178,266,900	103.54	176,023,100	1.7000	2016.12.20	0.98
20	日本	国債証券	第103回利付国債（5年）	170,000,000	100.54	170,925,500	100.62	171,065,900	0.3000	2017.03.20	0.96
21	日本	国債証券	第276回利付国債（10年）	160,000,000	103.16	165,067,200	101.77	162,838,400	1.6000	2015.12.20	0.91
22	日本	国債証券	第112回利付国債（5年）	160,000,000	100.97	161,562,600	101.21	161,936,000	0.4000	2018.06.20	0.91
23	日本	国債証券	第96回利付国債（5年）	160,000,000	100.88	161,419,100	100.65	161,040,000	0.5000	2016.03.20	0.90
24	日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	150,000,000	104.48	156,731,700	104.94	157,423,500	1.0000	2020.09.20	0.88
25	日本	国債証券	第280回利付国債（10年）	150,000,000	104.60	156,902,600	103.03	154,558,500	1.9000	2016.06.20	0.86
26	日本	国債証券	第277回利付国債（10年）	150,000,000	103.51	155,269,500	102.15	153,234,000	1.6000	2016.03.20	0.86
27	日本	国債証券	第101回利付国債（5年）	150,000,000	100.83	151,251,000	100.78	151,177,500	0.4000	2016.12.20	0.85
28	日本	国債証券	第98回利付国債（5年）	150,000,000	100.43	150,655,500	100.44	150,667,500	0.3000	2016.06.20	0.84
29	日本	国債証券	第318回利付国債（10年）	140,000,000	104.32	146,058,800	105.38	147,543,200	1.0000	2021.09.20	0.82
30	日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	140,000,000	105.28	147,404,100	104.52	146,329,400	1.5000	2017.12.20	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。

ロ.種類別投資比率

(平成26年10月31日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.49
地方債証券	7.19
特殊債券	8.13
社債券	4.74
合計	99.57

（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10月31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	169	568,000	95,992,000	622,000	105,118,000	9.26
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	150	553,000	82,950,000	608,000	91,200,000	8.04
3	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	290	213,500	61,915,000	223,700	64,873,000	5.71
4	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	206	247,000	50,882,000	258,700	53,292,200	4.69
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	301	164,500	49,514,500	175,100	52,705,100	4.64
6	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	156	250,700	39,109,200	261,400	40,778,400	3.59
7	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	99	382,500	37,867,500	410,000	40,590,000	3.57
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	253	138,000	34,914,000	148,000	37,444,000	3.30
9	日本	投資証券	GLP投資法人	286	121,300	34,691,800	125,600	35,921,600	3.16
10	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	158	192,400	30,399,200	199,400	31,505,200	2.77
11	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	53	572,000	30,316,000	594,000	31,482,000	2.77
12	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	59	509,000	30,031,000	513,000	30,267,000	2.66
13	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	188	150,500	28,294,000	156,100	29,346,800	2.58
14	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	30	867,000	26,010,000	904,000	27,120,000	2.39
15	日本	投資証券	野村不動産マスタ・ファンド投資法人	199	129,400	25,750,600	134,900	26,845,100	2.36
16	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	42	577,000	24,234,000	592,000	24,864,000	2.19
17	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	99	240,300	23,789,700	250,300	24,779,700	2.18
18	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	334	66,300	22,144,200	68,700	22,945,800	2.02
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	55	389,000	21,395,000	405,500	22,302,500	1.96
20	日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	45	492,000	22,140,000	494,000	22,230,000	1.95
21	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	145	138,700	20,111,500	147,400	21,373,000	1.88
22	日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	45	461,500	20,767,500	470,000	21,150,000	1.86
23	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	20	896,000	17,920,000	910,000	18,200,000	1.60
24	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	117	145,100	16,976,700	154,500	18,076,500	1.59
25	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	35	475,000	16,625,000	498,500	17,447,500	1.53
26	日本	投資証券	福岡リート投資法人	83	192,200	15,952,600	208,200	17,280,600	1.52
27	日本	投資証券	イオンリート投資法人	114	135,300	15,424,200	141,400	16,119,600	1.42
28	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	82	161,600	13,251,200	167,100	13,702,200	1.20
29	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	176	76,400	13,446,400	77,400	13,622,400	1.20
30	日本	投資証券	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	121	104,100.42	12,596,152	109,000	13,189,000	1.16

(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10月31日現在）

種類	投資比率（％）
投資証券	98.54
合計	98.54

（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10月31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	4,405	18,415.04	81,118,263	19,341.1525	85,197,777	7.27
2	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	5,600	10,187.20	57,048,364	10,813.7260	60,556,866	5.17
3	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	4,800	8,847.26	42,466,891	9,101.4616	43,687,016	3.73
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2,100	18,753.99	39,383,393	19,657.1452	41,280,005	3.52
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	5,100	7,205.50	36,748,081	7,431.8398	37,902,383	3.23
6	アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	4,400	7,325.78	32,233,432	7,662.5472	33,715,208	2.87
7	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	7,100	4,274.10	30,346,115	4,488.4070	31,867,690	2.72
8	アメリカ	投資証券	HCP INC	6,500	4,646.95	30,205,175	4,766.1306	30,979,849	2.64
9	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,842	16,332.11	30,083,757	16,790.2502	30,927,641	2.64
10	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	4,155	7,261.26	30,170,575	7,434.0267	30,888,381	2.63
11	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	2,200	13,072.69	28,759,919	13,729.8236	30,205,612	2.58
12	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	2,435	11,460.15	27,905,476	11,764.9839	28,647,736	2.44
13	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	7,500	3,608.70	27,065,258	3,667.2636	27,504,477	2.34
14	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	10,779	2,348.62	25,315,809	2,512.6331	27,083,673	2.31
15	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	7,150	2,640.56	18,880,011	2,756.4613	19,708,699	1.68
16	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	886	20,414.87	18,087,576	21,513.7381	19,061,172	1.62
17	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	1,400	11,871.35	16,619,898	12,567.5392	17,594,555	1.50
18	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3,192	4,760.66	15,196,038	5,086.4968	16,236,098	1.38
19	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	5,800	2,494.04	14,465,463	2,683.2036	15,562,581	1.32
20	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	2,001	7,212.06	14,431,345	7,571.7951	15,151,162	1.29
21	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	1,000	13,354.78	13,354,788	14,333.3810	14,333,381	1.22
22	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,900	7,040.40	13,376,765	7,380.4500	14,022,855	1.19
23	アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	12,889	1,303.33	16,798,656	1,029.9827	13,275,448	1.13
24	アメリカ	投資証券	JDR INC	3,558	3,118.37	11,095,185	3,243.0244	11,538,681	0.98
25	アメリカ	投資証券	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	2,500	4,412.96	11,032,405	4,442.4840	11,106,210	0.94
26	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	4,900	1,952.65	9,568,015	2,051.2183	10,050,970	0.85
27	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,200	7,777.35	9,332,825	8,273.7575	9,928,509	0.84
28	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,500	5,994.01	8,991,028	6,214.8853	9,322,328	0.79
29	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE	1,000	8,753.76	8,753,761	9,019.4570	9,019,457	0.77
30	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	1,200	7,081.95	8,498,342	7,318.1258	8,781,751	0.75

（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10月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ. 種類別投資比率

(平成26年10月31日現在)

種類	投資比率（％）
投資証券	98.98
合計	98.98

【投資不動産物件】

新光7資産バランスファンド

該当事項はありません。

(参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

新光7資産バランスファンド

該当事項はありません。

(参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成26年10月31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	東証株価指数先物	買建	55	日本円	702,518,400	735,350,000	5.04

(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10月31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	25	米ドル	2,463,737.5	269,385,058	2,485,750	271,791,905	2.09
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60IX	買建	2	カナダドル	350,012	34,171,671	335,320	32,737,291	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO ST50	買建	14	ユーロ	450,592	62,091,578	423,360	58,339,008	0.44
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200	買建	2	オーストラリアドル	272,124	26,251,802	272,900	26,326,663	0.20
	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	6	英ポンド	403,156	70,528,110	385,980	67,523,341	0.51
	スイス	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	3	スイスフラン	260,956	29,842,928	261,420	29,895,991	0.23

(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10月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

(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
第16特定期間末（平成26年10月20日）	7,644,769,179	7,663,292,344	0.8254	0.8274
平成25年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	
6月末日	7,986,141,302		0.8214	
7月末日	7,928,821,058		0.8297	
8月末日	7,862,036,800		0.8359	
9月末日	7,952,575,954		0.8510	
10月末日	7,958,323,114		0.8617	

(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
第16特定期間	平成26年 4月22日～平成26年10月20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
第16特定期間	平成26年 4月22日～平成26年10月20日	5.1

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

(4) 【設定及び解約の実績】

新光7資産バランスファンド

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1特定期間	平成18年10月31日～平成19年4月20日	43,240,359,545	754,263,663
第2特定期間	平成19年4月21日～平成19年10月22日	34,395,579,932	3,913,983,006
第3特定期間	平成19年10月23日～平成20年4月21日	7,842,389,976	13,713,317,012
第4特定期間	平成20年4月22日～平成20年10月20日	995,245,882	19,708,278,668
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年4月20日	176,344,143	11,818,197,061
第6特定期間	平成21年4月21日～平成21年10月20日	262,138,325	7,040,526,124
第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年4月20日	65,470,071	5,293,476,712
第8特定期間	平成22年4月21日～平成22年10月20日	64,807,629	3,510,685,871
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年4月20日	93,294,151	2,262,935,013
第10特定期間	平成23年4月21日～平成23年10月20日	55,270,668	2,043,398,766
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年4月20日	24,129,070	3,124,126,893
第12特定期間	平成24年4月21日～平成24年10月22日	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年4月22日	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	平成25年4月23日～平成25年10月21日	22,407,208	820,891,392
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
第16特定期間	平成26年4月22日～平成26年10月20日	8,899,172	916,673,106

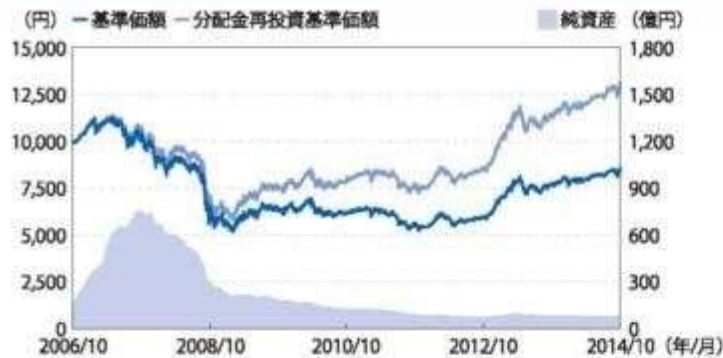
(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

運用実績

2014年10月31日現在

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



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。換金時の費用・税金などは考慮していません。
 ※分配金再投資基準価額は、取引日の分配金を当ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のものであり、実際の基準価額とは異なります。
 ※設定時から510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10月	20円
2014年9月	20円
2014年8月	20円
2014年7月	20円
2014年6月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	2,960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
新光米国REITマザーファンド	14.50%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	14.33%
新光J-REITマザーファンド	14.10%
新光日本債券インデックスマザーファンド	13.80%
新光外国株式インデックスマザーファンド	13.73%
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	13.73%
海外国債マザーファンド	13.48%
合計	97.70%

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	4.38%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.45%
ソフトバンク	情報・通信業	2.03%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.60%
本田技研工業	輸送用機器	1.53%

※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303回利付国債（10年）	2019/09/20	1.400%	1.49%
第97回利付国債（5年）	2016/06/20	0.400%	1.47%
第334回利付国債（10年）	2024/06/20	0.600%	1.42%
第306回利付国債（10年）	2020/03/20	1.400%	1.32%
第308回利付国債（10年）	2020/06/20	1.300%	1.31%

※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	9.26%
ジャパコリアルエステイト投資法人	8.04%
日本リテールファンド投資法人	5.71%
日本プロロジスリート投資法人	4.69%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.64%

※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。

2014年10月31日現在

外国株式等の組入上位5銘柄(新光外国株式インデックスマザーファンド)

銘柄名	国・地域	業種	純資産比率
APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.93%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.22%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.08%
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	0.91%
WELLS FARGO & COMPANY	アメリカ	銀行	0.78%

※世界産業分類基準(GICS)にしたがって記載しています。

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

外国債券の組入上位5銘柄(海外国債マザーファンド)

銘柄名	償還日	利率	通貨	純資産比率
US TREASURY N/B	2015/09/15	0.250%	米ドル	8.96%
FRANCE (GOVT OF)	2021/10/25	3.250%	ユーロ	3.36%
FRANCE (GOVT OF)	2023/10/25	4.250%	ユーロ	3.32%
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2028/07/04	4.750%	ユーロ	3.19%
FRANCE (GOVT OF)	2022/04/25	3.000%	ユーロ	3.10%

※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10月14日現在)

①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	44.2%
ユーロ	9.6%
ブラジルレアル	6.1%
ウルグアイペソ	4.1%
メキシコペソ	3.6%

②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
その他(国際機関債)	9.2%
ナイジェリア	8.6%
ロシア	6.9%
トルコ	5.4%
ウルグアイ	4.1%

※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。

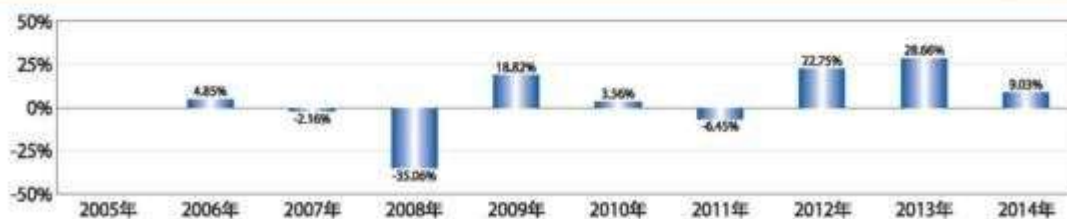
米国REITの組入上位5銘柄(新光米国REITマザーファンド)

銘柄名	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	7.27%
AMERICAN TOWER CORPORATION	5.17%
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3.73%
PUBLIC STORAGE	3.52%
EQUITY RESIDENTIAL	3.23%

※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



※税引前の分配金を基に計算しています。

※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10月末までの収益率を記載しています。

- 当ページの回表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

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

- 最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認いただけます。

17

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

2【換金(解約)手続等】

一部解約(解約請求によるご解約)

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

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

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

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

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

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

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク
フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

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

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

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

当ファンドの主な投資対象の評価方法は以下のとおりです。

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

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

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

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

(ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分之一を超えるときは、投資信託契約の解約をしません。

(ホ) 委託者は、上記(ニ)の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られ

たる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(ヘ) 上記(ハ)から(ホ)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(ホ)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(ト) 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

(チ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

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

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

b. 投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

d. 運用報告書

委託者は、毎年4月、10月の決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知れている

受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

運用報告書（全体版）は、下記「e．公告」に記載の委託者のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

e．公告

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

<http://www.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。

f．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g．信託事務処理の再信託

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

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

h．信託業務の委託等

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

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

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

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

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

i．関係法人との契約の更改

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

思表示のないときは自動的に1年間更新されるものとし、その後も同様とします。

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

b．一部解約請求権

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

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

c．償還金請求権

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

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

第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期特定期間（平成26年4月22日から平成26年10月20日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【新光7資産バランスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期特定期間末 平成26年 4月21日現在	第16期特定期間末 平成26年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	190,535,534	172,274,564
投資信託受益証券	1,093,744,000	1,059,391,000
親投資信託受益証券	6,857,504,052	6,422,275,155
未収入金	-	41,000,000
未収利息	202	161
流動資産合計	8,141,783,788	7,694,940,880
資産合計	8,141,783,788	7,694,940,880
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	20,338,713	18,523,165
未払解約金	9,516,650	25,471,550
未払受託者報酬	608,221	517,565
未払委託者報酬	6,614,421	5,628,505
その他未払費用	32,755	30,916
流動負債合計	37,110,760	50,171,701
負債合計	37,110,760	50,171,701
純資産の部		
元本等		
元本	10,169,356,853	9,261,582,919
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,064,683,825	1,616,813,740
(分配準備積立金)	205,003,399	210,928,244
元本等合計	8,104,673,028	7,644,769,179
純資産合計	8,104,673,028	7,644,769,179
負債純資産合計	8,141,783,788	7,694,940,880

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期特定期間		第16期特定期間	
	自	平成25年10月22日	自	平成26年 4月22日
	至	平成26年 4月21日	至	平成26年10月20日
営業収益				
受取配当金		80,677,500		78,075,000
受取利息		46,836		42,263
有価証券売買等損益		345,148,420		358,418,103
営業収益合計		425,872,756		436,535,366
営業費用				
受託者報酬		3,505,068		3,415,825
委託者報酬		38,117,572		37,147,061
その他費用		184,281		203,021
営業費用合計		41,806,921		40,765,907
営業利益		384,065,835		395,769,459
経常利益		384,065,835		395,769,459
当期純利益		384,065,835		395,769,459
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		3,440,780		2,221,235
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,531,384,787		2,064,683,825
剰余金増加額又は欠損金減少額		217,496,231		170,722,582
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		217,496,231		170,722,582
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,313,829		1,594,514
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,313,829		1,594,514
分配金		126,106,495		114,806,207
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,064,683,825		1,616,813,740

（ 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16期特定期間 自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 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 前特定期間終了日に該当する日が休業日のため、当特定期間は平成26年 4月22日から平成26年10月20日までとなっております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

第15期特定期間末 平成26年 4月21日現在	第16期特定期間末 平成26年10月20日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 10,169,356,853口	1. 特定期間末日における受益権の総数 9,261,582,919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 2,064,683,825円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,616,813,740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)	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 0.8254円 (1万口当たり純資産額) (8,254円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

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	第16期特定期間 自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日

分配金の計算過程	<p>第83期（自 平成25年10月22日 至 平成25年11月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（24,473,984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89期（自 平成26年 4月22日 至 平成26年 5月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（21,522,870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（3,522,767円）及び分配準備積立金（200,750,743円）より分配対象収益は225,796,380円（1万口当たり227.21円）であり、うち19,873,604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）</p> <p>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90期（自 平成26年 5月21日 至 平成26年 6月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（24,532,327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（3,491,987円）及び分配準備積立金（199,087,432円）より分配対象収益は227,111,746円（1万口当たり232.59円）であり、うち19,526,977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）</p> <p>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91期（自 平成26年 6月21日 至 平成26年 7月22日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,966,098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（3,463,516円）及び分配準備積立金（200,997,246円）より分配対象収益は223,426,860円（1万口当たり232.75円）であり、うち19,197,530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92期（自 平成26年 7月23日 至 平成26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（22,596,417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（3,451,647円）及び分配準備積立金（198,557,975円）より分配対象収益は224,606,039円（1万口当たり236.83円）であり、うち18,965,184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93期（自 平成26年 8月21日 至 平成26年 9月22日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（25,751,721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（3,438,733円）及び分配準備積立金（199,770,009円）より分配対象収益は228,960,463円（1万口当たり244.60円）であり、うち18,719,747円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>

第88期（自 平成26年 3月21日 至 平成26年 4月21日）	第94期（自 平成26年 9月23日 至 平成26年10月20日）
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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（24,617,903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（3,439,555円）及び分配準備積立金（204,833,506円）より分配対象収益は232,890,964円（1万口当たり251.45円）であり、うち18,523,165円（1万口当たり20円）を分配しております。

（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15期特定期間 自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日	第16期特定期間 自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、投資信託受益証券、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左

3.金融商品に係るリスクの管理体制	<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	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

第15期特定期間末 平成26年 4月21日現在	第16期特定期間末 平成26年10月20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 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して おります。</p> <p>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。</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 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	第15期特定期間 自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日	第16期特定期間 自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第15期特定期間末 平成26年 4月21日現在	第16期特定期間末 平成26年10月20日現在
期首元本額	11,140,490,610円	10,169,356,853円
期中追加設定元本額	25,208,228円	8,899,172円
期中一部解約元本額	996,341,985円	916,673,106円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第15期特定期間末 平成26年 4月21日現在	第16期特定期間末 平成26年10月20日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	20,820,000	41,640,000
親投資信託受益証券	141,243,391	189,510,060
合計	162,063,391	231,150,060

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	1,059,391,000	
投資信託受益証券 小計		173,500	1,059,391,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	512,128,420	1,103,124,616	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	706,846,977	1,047,405,850	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	631,083,609	1,024,879,781	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	920,382,291	1,095,162,888	
	新光J - R E I Tマザーファンド	765,275,608	1,066,870,725	
	新光米国R E I Tマザーファンド	893,747,978	1,084,831,295	
親投資信託受益証券 小計		4,429,464,883	6,422,275,155	
合計		4,429,638,383	7,481,666,155	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」、「海外国債マザーファンド」、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「新光外国株式インデックスマザーファンド」、「新光日本債券インデックスマザーファンド」、「新光J - R E I Tマザーファンド」及び「新光米国R E I Tマザーファンド」各受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」の受益証券であり、「親投資信託受益証券」は、「海外国債マザーファンド」、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「新光外国株式インデックスマザーファンド」、「新光日本債券インデックスマザーファンド」、「新光J - R E I Tマザーファンド」及び「新光米国R E I Tマザーファンド」の受益証券であります。

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

「フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド」の状況

「フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド」は、ケイマン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの平成26年5月31日現在の財務書類は、国際財務報告基準に従い作成されており、独立監査人の監査を受けております。

同ファンドの財政状態計算書、包括利益計算書、受益証券保有者に帰属する純資産変動計算書、キャッシュ・フロー計算書及び財務書類に対する注記は、同ファンドの副管理事務代行会社であるザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店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

2014年5月31日現在

	注記	2014年5月31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	5(a)	42,740,987,754	57,033,825,945
ブローカーに対する債権		288,324,826	-
発行に係る未収入金		62,340,480	1,646,943,740
現金および現金同等物	6	1,492,885,496	8,730,924,392
その他の債権	7	6,720,638	-
資産合計		44,591,259,194	67,411,694,077
負債			
流動負債			
償還に係る未払金		67,437,408	141,861,135
ブローカーに対する債務		99,129,427	231,334,913
未払費用	8	47,134,875	59,382,969
負債合計		213,701,710	432,579,017
受益証券保有者に帰属する純資産	9	44,377,557,484	66,979,115,060

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

2014年5月31日終了会計年度

	注記	2014年5月31日終了会計年度 (日本円)	2013年5月31日終了会計年度 (日本円)
収益			
保管受託銀行に預けた預金からの受取利息		303,373	79,848
その他の収益	3	-	23,032,411
為替差益純額		45,959,709	1,132,990,380
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	5(b)	2,999,467,201	18,799,379,522
純収益合計		3,045,730,283	19,955,482,161
費用			
運用報酬	7(a)	223,746,038	207,017,727
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	7(b)	58,347,362	51,630,992

保管受託銀行報酬	7(c)	22,997,135	24,841,163
費用の払戻し	7(d)	(6,720,638)	-
当座借越利息		47,768	85,474
その他の営業費用		6,384,135	18,314,140
営業費用合計		304,801,800	301,889,496
税引前利益		2,740,928,483	19,653,592,665
源泉税		-	-
受益証券保有者に帰属する純資産の営業活動による増加額		2,740,928,483	19,653,592,665

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部である。

(3) 受益証券保有者に帰属する純資産変動計算書

2014年5月31日終了会計年度

	注記	2014年5月31日終了会計年度		2013年5月31日終了会計年度	
		受益証券 口数	(日本円)	受益証券 口数	(日本円)
受益証券保有者に帰属する純資産の期首残高		9,631,135	66,979,115,060	7,781,812	43,603,106,877
受益証券保有者に帰属する純資産の営業による増加額		-	2,740,928,483	-	19,653,592,665
当期分配金	11	-	(8,910,457,680)	-	(8,820,848,250)
受益証券の発行		2,243,149	14,408,531,803	5,039,283	31,634,238,087
受益証券の償還		(4,852,302)	(30,840,560,182)	(3,189,960)	(19,090,974,319)
受益証券保有者に帰属する純資産の期末残高		7,021,982	44,377,557,484	9,631,135	66,979,115,060

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

2014年5月31日終了会計年度

	注記	2014年5月31日終了会計年度 (日本円)	2013年5月31日終了会計年度 (日本円)
営業活動によるキャッシュ・フロー			
包括利益合計		2,740,928,483	19,653,592,665
- 受取利息		(303,373)	(79,848)
- 当座借越利息		47,768	85,474
運転資本変動前営業キャッシュ・フロー		2,740,672,878	19,653,598,291
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減少/(増加)額		14,292,838,191	(13,988,609,486)
- ブローカーに対する債権の(増加)/減少		(288,324,826)	147,042,062
- その他の債権の(増加)/減少		(6,720,638)	206,405
- ブローカーに対する債務の減少		(132,205,486)	(72,466,916)
- 未払費用の(減少)/増加		(12,248,094)	12,193,518
営業によるキャッシュ		16,594,012,025	5,751,963,874
利息の受取額		303,373	79,848
営業活動による正味キャッシュ収入		16,594,315,398	5,752,043,722

財務活動によるキャッシュ・フロー		
償還可能受益証券の保有者に対する支払		
分配金	(8,910,457,680)	(8,820,848,250)
受益証券の発行による収入	15,993,135,063	29,987,294,347
受益証券の償還による支払	(30,914,983,909)	(19,104,644,173)
当座借越利息	(47,768)	(85,474)
財務活動による正味キャッシュ（支出）/収入	(23,832,354,294)	2,061,716,450
現金および現金同等物の純（減少）/増加額	(7,238,038,896)	7,813,760,172
現金および現金同等物期首残高	8,730,924,392	917,164,220
現金および現金同等物期末残高	6 1,492,885,496	8,730,924,392

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
 2014年5月31日終了会計年度

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

1 一般的情報

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

本財務書類に対する注記において、純資産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純資産を指している。

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

本財務書類は、2014年8月27日に受託会社によって公表を承認された。

2 重要な会計方針の要約

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

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。

2.1 表示の基礎

(a) 2013年6月1日発効の基準および既存の基準の修正

当ファンドに重要な影響を及ぼすと見込まれる、発効されている基準、解釈指針および既存の基準の修正はない。

(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。

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および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、負債証券およびワラントに対する投資を、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、年度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、各年度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、契約済であるが年度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。

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 受益証券保有者に帰属する純資産

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、当ファンドの純資産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口当たり純資産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純資産を、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、受益証券保有者に帰属する純資産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、受益証券保有者に帰属する純資産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およびキャピタル・ゲインに係る源泉税を課される可能性がある。このような収益またはキャピタル・ゲインは、包括利益計算書に源泉税込みの総額で計上される。源泉税は、包括利益計算書に独立項目として計上される。

3 その他の収益

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

4 金融リスク管理

4.1 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。

る。

4.2 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。下表をご参照のこと。

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

また、新興市場における国々は3つのリスクベースのカテゴリーに分類されており、カテゴリー1は最もリスクが低いとみなされ、カテゴリー3は最もリスクが高い。当ファンドの純資産価値全体に基づく投資制限は、以下に示されている。

リスクベースのカテゴリー	カテゴリー1	カテゴリー2	カテゴリー3
投資上限（％）	国/地方当たり最大16%	国/地方当たり最大8%	国/地方当たり最大4%

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

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

投資顧問会社は、VaRがリスクに対する有益な指針であるものの、限界があることを認識している。将来の事象の見積りの代用として過去のデータを使用することで、すべての潜在的な事象が、特に将来における極端な事象が網羅されないことがある。例えば、当該モデルが、市場ストレス期間における市場流動性の著しい低下を完全に予測できないことがあり、結果として、そのようなときに売買されたポートフォリオのポジションが、VaRの見積りに反映されていない重要な費用を負担することもあり得る。

2014年5月31日の感応度分析は、VaRモデルを使用して実施された。VaRモデルの使用により、リスク変数(市場価格リスク、外国為替リスクおよび金利リスクを含む。)間の相互依存性をより反映することが可能である。

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

	2014年5月31日現在	2013年5月31日現在
VaR（％）	7.341%	7.105%
VaR（金額）	3,257,756,495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。

2014年および2013年5月31日現在、当ファンドが保有しているクレジット・リンク債はない。

当ファンドは、原油ワラントまたは原油価格連動型債務支払証書(以下「OIP0」という。)にも投資を行っている。これらのOIP0は相対的に流動性が低いため、有価証券の価格が毎日定期的に変動しないことから、リスクの見積りおよび感応性分析は困難になる。かかる統計情報の不足を考慮した場合、これらの資産に対する当ファンドのリスク・エクスポージャーの定量化に最適な方法は、当レビュー年度中における月次総利回りの最大値、最小値および中央値に着目することである。

以下の表は、OIP0から導出された2014年度の月次総利回りの中央値、最小値および最大値を受けた資本金および剰余金の変動を説明したものである。

資本金および剰余金の変動

	2014年5月31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)	(34,197,228)	(1.58)	(46,217,579)
月次総利回り最大値	1.68	34,818,996	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	(0.75)	(12,939,180)	0.40	7,901,808
月次総利回り最小値	(8.42)	(145,263,858)	(2.42)	(47,805,939)
月次総利回り最大値	12.79	220,656,145	4.60	90,870,794

4.3 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)
2014年5月31日現在						
在						
資産						
純損益を通じて公						
正価値で測定する	2,758,135,168	3,273,865,044	14,011,244,470	18,899,959,808	3,797,783,264	42,740,987,754
金融資産						
ブローカーに対す						
る債権	-	-	-	-	288,324,826	288,324,826
発行に係る未収入						
金	-	-	-	-	62,340,480	62,340,480
現金および現金同						
等物	1,492,885,496	-	-	-	-	1,492,885,496
その他の債権						
	-	-	-	-	6,720,638	6,720,638
資産合計	4,251,020,664	3,273,865,044	14,011,244,470	18,899,959,808	4,155,169,208	44,591,259,194
負債						
償還に係る未払金						
	-	-	-	-	67,437,408	67,437,408
ブローカーに対す						
る債務	-	-	-	-	99,129,427	99,129,427
未払費用						
	-	-	-	-	47,134,875	47,134,875

負債合計	-	-	-	-	213,701,710	213,701,710
金利感应度ギャップ合計	4,251,020,664	3,273,865,044	14,011,244,470	18,899,959,808		
	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
負債合計	-	-	-	-	432,579,017	432,579,017
金利感应度ギャップ合計	13,670,538,388	5,714,266,800	15,937,289,589	25,542,040,291		

金利感应度分析

金利リスクに対する感应度分析は、VaRが使用されていることから、2014年および2013年5月31日現在において、独立して開示されていない。注記4.2 市場価格リスクを参照のこと。

4.4 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。

	2014年5月31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	2,319,227,818	3,207,379,309
コロンビア・ペソ	506,080,356	-
コスタリカ・コロン	1,253,139,934	1,420,839,628
ドイツ・マルク	1,323,244,904	1,707,953,635
ドミニカ・ペソ	497,130,064	1,261,521,070
ユーロ	3,402,420,073	4,693,392,063

ガーナ・セディ	822,301,572	1,548,019,358
インド・ルピー	1,157,777,395	-
日本円	157,532,380	8,630,903,593
ケニア・シリング	547,915,158	-
メキシコ・ヌエボ・ペソ	1,384,028,602	2,215,182,089
新トルコ・リラ	1,048,432,057	1,962,703,244
ナイジェリア・ナイラ	1,266,058,479	1,769,053,553
ロシア・ルーブル	935,988,745	1,393,128,994
セルビア・ディナール	822,258,051	702,603,445
南アフリカ・ランド	1,598,026,185	1,131,367,523
ウガンダ・シリング	591,745,878	741,689,760
ウルグアイ・ペソ	1,525,887,179	2,384,539,746
米ドル	23,432,064,364	32,641,417,067
資産合計	44,591,259,194	67,411,694,077
負債		
日本円	98,368,952	185,693,856
シンガポール・ドル	4,869,735	5,351,339
南アフリカ・ランド	99,129,427	-
米ドル	11,333,596	241,533,822
負債合計	213,701,710	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、2014年および2013年5月31日現在において、独立して開示されていない。注記4.2 市場価格リスクを参照のこと。

4.5 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。2014年5月31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：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)	2014年5月31日現在 純資産比率(%)	2013年5月31日現在 純資産比率(%)
Aaa / AAA	7.84	-
Baa1 / BBB+	6.49	4.94
Baa2 / BBB	3.46	6.37
Baa3 / BBB-	14.32	14.55
Ba1 / BB+	3.08	1.90
Ba2 / BB	2.82	2.97

Ba3 / BB-	22.55	21.36
B1 / B+	9.82	6.67
B2 / B	11.96	9.87
B3 / B-	4.00	14.96
Caa1 / CCC+	3.89	0.78
Caa3 / CCC-	3.96	-
D (スタンダード・アンド・プアーズのみ)	2.11	0.80
その他の資産*	3.70	14.83
	100.00	100.00

* その他の資産は、ブローカーに対する債権、発行に係る未収入金、現金および現金同等物、その他の債権、償還に係る未払金、ブローカーに対する債務、および未払費用を含む。

年度末日現在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。

	2014年5月31日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
債券	38,943,204,490	52,133,210,676
デリバティブ資産	3,797,783,264	4,900,615,269
ブローカーに対する債権	288,324,826	-
発行に係る未収入金	62,340,480	1,646,943,740
現金および現金同等物	1,492,885,496	8,730,924,392
その他の債権	6,720,638	-
合計	44,591,259,194	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。

	2014年5月31日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
Astana Finance 7.875% 08/06/2010	937,760,200	532,706,620
Astana Finance JSC *	-	-
	937,760,200	532,706,620

* 2014年5月31日現在、当該証券の価格はゼロであった。

上記の投資は、不履行となっている支払を2014年および2013年5月31日現在の公正価値の考慮に入れている。

以下の表は、2014年および2013年5月31日現在における主要な取引相手方に係る保有金融資産の比率の要約である。

2014年5月31日現在	純資産比率 (%)	ムーディーズ信用格付け
<u>銀行</u>		
バンク・オブ・ニューヨーク・メロン	3.36	A1
<u>保管受託銀行</u>		
バンク・オブ・ニューヨーク・メロン	96.31	A1
2013年5月31日現在	純資産比率 (%)	ムーディーズ信用格付け

銀行

バンク・オブ・ニューヨーク・メロン	13.04	Aa3
-------------------	-------	-----

保管受託銀行

バンク・オブ・ニューヨーク・メロン	85.15	Aa3
-------------------	-------	-----

報告期間末日における信用リスクの最大エクスポージャーは、金融資産の帳簿価額である。

4.6 流動性リスク

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

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

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

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

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

以下の表は、当ファンドの金融資産および負債を、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12ヶ月未満 (日本円)	合計 (日本円)
2014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	42,740,987,754	-	42,740,987,754
ブローカーに対する債権	288,324,826	-	288,324,826
発行に係る未収入金	62,340,480	-	62,340,480
現金および現金同等物	1,492,885,496	-	1,492,885,496
その他の債権	-	6,720,638	6,720,638
合計	44,584,538,556	6,720,638	44,591,259,194

負債

償還に係る未払金	67,437,408	-	67,437,408
ブローカーに対する債務	99,129,427	-	99,129,427
未払費用	-	47,134,875	47,134,875
合計	166,566,835	47,134,875	213,701,710

	1ヶ月未満 (日本円)	1ヶ月以上12ヶ月未満 (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	57,033,825,945	-	57,033,825,945
ブローカーに対する債権	-	-	-
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	67,411,694,077	-	67,411,694,077
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	373,196,048	59,382,969	432,579,017

4.7 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な制限された場合、受益証券は、受益証券保有者の間で比例償還され、償還されなかった受益証券は、同様の制限を条件として、次の取引日に償還が繰り越される。

当年度末日現在、受益証券保有者は1名(2013年：1名)であり、当ファンドの82%(2013年：80%)の持分を保有していた。

4.8 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。

価格が取得不能な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実効金利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4.2で実施されている。当会計年度末日現在、実効金利価格付けの手法を用いて評価するソブリン短期証券はない。

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

2014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	-	38,943,204,490	-	38,943,204,490
- デリバティブ資産	-	3,797,783,264	-	3,797,783,264
資産合計	-	42,740,987,754	-	42,740,987,754

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、2014年および2013年5月31日終了年度に係るレベル3の商品の変動を示したものである。

	債券 2014年5月31日現在 (日本円)	債券 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	(1,651,866,293)	(801,535,219)
レベル3への振替	-	-
レベル3からの振替	-	-
包括利益計算書に認識された利益および損失合計	21,796,981	(250,236,437)
期末残高	-	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純変動額	(373,995,354)	321,364,359

レベル1に分類された現金および現金同等物を除き、2014年および2013年5月31日現在、公正価値で測定されていない当ファンドの資産および負債は、レベル2に分類された。これらの資産および負債の帳簿価額は、報告日末日現在のそれらの公正価値に近似する。

5 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産

(a) 投資ポートフォリオ - 明細

	2014年5月31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	38,943,204,490	52,133,210,676
原油ワラント	3,797,783,264	4,900,615,269

売買目的保有合計	42,740,987,754	57,033,825,945
----------	----------------	----------------

以下の表は保有する金融資産の要約である。

	公正価値 2014年5月31日現在 (日本円)	公正価値 2013年5月31日現在 (日本円)
債券		
アルゼンチン		
Province Del Neuquen 8.656% due 18/10/2014 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	-	958,771,413
アルゼンチン合計	-	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
Rubrika Finance Co Ltd (International Bank Of AZ) 7.20% due 31/10/2016 REGS	930,097,730	-
アゼルバイジャン合計	930,097,730	935,208,438
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina 0% due 11/12/2021	1,323,244,904	1,707,953,635
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	1,323,244,904	1,707,953,635
中国		
Bright Food Hong Kong Ltd 3.00% due 21/05/2018 REGS	984,162,001	985,793,403
Franshion Development Ltd 6.75% due 15/04/2021 REGS	569,019,712	569,468,170
中国合計	1,553,181,713	1,555,261,573
コロンビア		
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	506,080,356	-
コロンビア合計	506,080,356	-
コスタリカ		
Republic of Costa Rica 10.58% due 23/09/2015 REGS	872,961,390	986,937,497
Republic of Costa Rica 10.58% due 22/06/2016 REGS	380,178,544	433,902,131
コスタリカ合計	1,253,139,934	1,420,839,628
ドミニカ共和国		
Dominican Republic 10.50% due 09/08/2013 REGS	-	1,261,521,070
Dominican Republic 11.7% due 06/06/2014 REGS	497,130,064	-
Ege Haina Finance Company 9.50% due 26/04/2017 Series REGS	-	493,009,515
ドミニカ共和国合計	497,130,064	1,754,530,585
	公正価値 2014年5月31日現在 (日本円)	公正価値 2013年5月31日現在 (日本円)
エクアドル		
Republic of Ecuador 9.375% due 15/12/2015 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	-	191,281,601
エジプト合計	-	191,281,601
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	1,351,450,677	1,895,999,498
エルサルバドル合計	1,351,450,677	1,895,999,498
マケドニア・旧ユーゴスラビア共和国		
Former Yugoslav Republic of Macedonia 4.625% due 08/12/2015	730,068,455	855,978,396
マケドニア・旧ユーゴスラビア共和国合計	730,068,455	855,978,396
グルジア		
Georgian Oil & Gas Corp 6.875% due 16/05/2017 REGS	610,625,016	829,516,695
Republic of Georgia 6.875% due 12/04/2021 REGS	648,325,491	1,365,873,646
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022	378,911,172	384,173,223
グルジア合計	1,637,861,679	2,579,563,564
ガーナ		
Ghana Govt 23.00% due 21/08/2017	822,301,572	1,548,019,358
ガーナ合計	822,301,572	1,548,019,358

ホンジュラス		
Republic Of Honduras 8.75% due 16/12/2020 REGS	58,159,634	-
Honduras Government 7.50% due 15/03/2024 REGS	393,930,910	371,982,253
ホンジュラス合計	452,090,544	371,982,253
ハンガリー		
Hungarian Development Bank 5.875% due 31/05/2016	-	1,270,231,477
ハンガリー合計	-	1,270,231,477
インド		
Indian Oil Corp Ltd 5.625% due 02/08/2021 REGS	-	693,694,983
インド合計	-	693,694,983
インドネシア		
Indonesia Republic 3.375% due 15/04/2023 REGS	290,688,944	-
インドネシア合計	290,688,944	-
イラク		
Republic of Iraq 5.80% due 15/01/2028	-	1,317,324,069
イラク合計	-	1,317,324,069
コートジボワール		
Ivory Coast 2.50% due 31/12/2032 Series REGS	-	398,376,950
コートジボワール合計	-	398,376,950
	公正価値 2014年5月31日現在 (日本円)	公正価値 2013年5月31日現在 (日本円)
ヨルダン		
Dev Inv Jordan Arm Force 6.14% due 16/12/2019	2,016,620,202	2,491,745,425
ヨルダン合計	2,016,620,202	2,491,745,425
カザフスタン		
Astana Finance 7.875% due 08/06/2010(注記 4.5)	937,760,200	532,706,620
Astana Finance JSC*	-	-
Kazmunaigaz Finance SUB 11.75% due 23/01/2015 Series REGS	-	716,038,842
カザフスタン合計	937,760,200	1,248,745,462
ケニア		
Kenya T-Bill 0% due 11/08/2014	164,217,330	-
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	383,697,828	-
ケニア合計	547,915,158	-
メキシコ		
Mexican Bondes Desarroll FRN due 15/01/2015 Series LD	-	2,201,383,082
Mexican Udibonos 4.00% due 15/11/2040 Index Linked	1,384,028,602	-
メキシコ合計	1,384,028,602	2,201,383,082
モンゴル		
Mongolia Government International Bond 5.125% due 05/12/2022 REGS	759,487,371	-
モンゴル合計	759,487,371	-
モンテネグロ		
Republic of Montenegro 7.875% due 14/09/2015	618,426,806	916,065,542
モンテネグロ合計	618,426,806	916,065,542
モザンビーク		
Ematum Via Mozambique Ematum Finance 2020 BV 6.305% due 11/09/2020 REGS	938,216,431	-
モザンビーク合計	938,216,431	-
ナイジェリア		
Nigeria Treasury Bill 0% due 13/06/2013	-	441,596,205
Nigeria Treasury Bill 0% due 01/08/2013	-	209,753,601
Nigeria Treasury Bill 0% due 23/04/2015	566,349,206	-
Nigeria Treasury Bill 0% due 21/05/2015	325,935,663	-
Government of Nigeria 16.39% due 27/01/2022	-	591,444,273
Government of Nigeria 10.00% due 23/07/2030	373,629,057	294,707,038
ナイジェリア合計	1,265,913,926	1,537,501,117
パラグアイ		
Republic of Paraguay 4.625% due 25/01/2023 REGS	479,267,408	154,903,158
パラグアイ合計	479,267,408	154,903,158

ロシア

Federal Grid Co OJSC/Finance Ltd 8.446% due 13/03/2019 REGS	440,390,374	716,565,971
RZD Capital Ltd 8.30% due 02/04/2019 REGS	495,598,371	676,563,023
Gaz Capital SA 9.25% due 23/04/2019 SER REGS	-	1,163,774,486
RSHB Capital (RUSS AGRIC BK) 6.00% due 03/06/2021 REGS	1,310,275,204	1,000,589,319
RZD Capital Ltd 5.70% due 05/04/2022 REGS	583,771,930	825,962,802
ロシア合計	2,830,035,879	4,383,455,601

* 2014年5月31日現在、当該証券の価格はゼロであった。

	公正価値 2014年5月31日現在 (日本円)	公正価値 2013年5月31日現在 (日本円)
ルワンダ		
Republic of Rwanda 6.625% due 02/05/2023 REGS	472,006,071	-
ルワンダ合計	472,006,071	-
セルビア		
Serbia Treasury Bill 0% due 13/09/2013	-	702,603,445
Serbia Treasury Bill 0% due 19/09/2014	822,258,051	-
セルビア合計	822,258,051	702,603,445
南アフリカ		
South Africa Republic of 8.00% due 21/12/2018	960,068,303	514,160,112
Republic of South Africa 2.25% due 31/01/2038 Index Linked	536,794,450	592,238,800
南アフリカ合計	1,496,862,753	1,106,398,912
スリランカ		
National Savings Bank 8.875% due 18/09/2018 REGS	701,972,836	-
スリランカ合計	701,972,836	-
国際機関		
International Finance Corp 7.75% due 03/12/2016	1,157,777,395	-
International Bank Recon & Dev 6.00% due 15/09/2016	-	3,207,379,309
International Bank Recon & Dev 9.50% due 02/03/2017	2,319,227,818	-
国際機関合計	3,477,005,213	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 REGS	1,783,502,367	2,380,374,184
トリニダード・トバゴ合計	1,783,502,367	2,380,374,184
チュニジア		
Banque Cent de Tunisie 4.50% due 22/06/2020 REGS	1,116,164,612	789,704,027
チュニジア合計	1,116,164,612	789,704,027
トルコ		
Turkey Government Bond FRN due 26/02/2014	-	1,329,777,293
Turkey Government Bond 4.00% due 29/04/2015 Index Linked	534,766,472	-
Turkey Government Bond FRN due 04/01/2017	503,375,821	538,322,947
Turkiye Halk Bankasi As 3.875% due 05/02/2020 REGS	1,040,044,200	602,703,834
トルコ合計	2,078,186,493	2,470,804,074
ウガンダ		
Uganda Treasury Bills 0% due 13/06/2013	-	55,974,454
Uganda Treasury Bills 0% due 12/12/2013	-	220,141,607
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 01/01/2015	256,389,508	244,387,461
Republic of Uganda Government Bonds 10.00% due 21/05/2015	100,572,993	-
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 21/04/2016	115,607,944	109,968,439
Republic of Uganda Government Bonds 10.75% due 22/02/2018	115,085,239	108,917,460
ウガンダ合計	587,655,684	739,389,421
	公正価値 2014年5月31日現在 (日本円)	公正価値 2013年5月31日現在 (日本円)
ウクライナ		
City of KYIV (CSFB) 8.00% due 06/11/2015	354,397,276	378,254,590
State Savings Bank of Ukraine 8.25% due 10/03/2016	947,902,881	1,222,074,335
Ukraine 9.25% due 24/07/2017 REGS	-	1,341,752,536
State Savings Bank Of Ukraine 8.875% due 20/03/2018 REGS	454,394,519	641,795,067

ウクライナ合計	1,756,694,676	3,583,876,528
ウルグアイ Republica Orient Uruguay 3.70% due 26/06/2037	1,525,887,179	2,384,539,746
ウルグアイ合計	1,525,887,179	2,384,539,746
債券合計	38,943,204,490	52,133,210,676
原油ワラント ナイジェリア Central Bank of Nigeria Expires 15/11/2020	2,072,559,300	2,925,163,235
ナイジェリア合計	2,072,559,300	2,925,163,235
ベネズエラ Republic of Venezuela - Oil Expires 15/04/2020 Series USD	1,725,223,964	1,975,452,034
ベネズエラ合計	1,725,223,964	1,975,452,034
原油ワラント合計	3,797,783,264	4,900,615,269
投資ポートフォリオ	42,740,987,754	57,033,825,945

(b) 投資ポートフォリオ - 各年度の損益

	2014年5月31日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産の公正価値のその他の純変動額		
- 実現	5,825,950,089	1,607,929,594
- 未実現の変動額	(2,826,482,888)	17,191,449,928
利益合計	2,999,467,201	18,799,379,522

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。

	2014年5月31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	1,492,885,496	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 関連当事者との取引

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

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

(a) 運用報酬

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

(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬

2013年6月1日から2014年4月30日まで、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。

2014年5月1日より発効された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0.115%、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0.095%、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0.075%、500百万米ドル超に相当する日本円に対しては0.045%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。かかる費用の払戻しは、投資顧問会社によってなされる。

以下の表は各年度の関連当事者との取引の詳細である。

	費用		債務	
	2014年5月31日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
(a) 運用報酬	223,746,038	207,017,727	30,931,544	43,832,721
(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	58,347,362	51,630,992	6,629,387	8,072,278
(c) 保管受託銀行報酬	22,997,135	24,841,163	4,083,218	2,126,631
費用合計	305,090,535	283,489,882	41,644,149	54,031,630
			債権	
(d) 費用 払戻し	(6,720,638)	-	6,720,638	-

8 未払費用

	2014年5月31日現在 (日本円)	2013年5月31日現在 (日本円)
未払運用報酬	30,931,544	43,832,721
未払受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	6,629,387	8,072,278
未払保管受託銀行報酬	4,083,218	2,126,631
その他の未払費用	5,490,726	5,351,339
	47,134,875	59,382,969

未払費用の帳簿価額は、年度末日現在の公正価値に近似していた。

9 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、受益証券保有者に帰属する純資産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4のリスク管理方針に従い、当ファンドは受け取った申込金額を適切な投資対象に投資するよう努める一方で、償還に見合う十分な流動性を維持する。このような流動性は、短期借入金または必要な場合には上場有価証券の処分によって高められる。

当ファンドは、上場金融資産および負債の評価インプットとして仲値を利用している。このことは、当ファンドの1口当たりの取引価値の計算について当ファンドの募集要項で規定されているインプットに合致する。当ファンドの純資産額は、財政状態計算書日現在、44,377,557,484円（2013年：66,979,115,060円）である。

10 デリバティブ金融商品

当ファンドは、原油ワラントまたは原油価格連動型債務支払証書（以下「OIPO」という。）を保有してお

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

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

11 分配金

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

各年度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)
2014年5月31日		
受益証券1口当たり分配金90円	2013年6月3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
受益証券1口当たり分配金75円	2013年12月3日	689,247,600
受益証券1口当たり分配金75円	2014年1月6日	644,656,725
受益証券1口当たり分配金75円	2014年2月3日	629,664,075
受益証券1口当たり分配金75円	2014年3月3日	613,503,000
受益証券1口当たり分配金75円	2014年4月3日	587,025,300
受益証券1口当たり分配金75円	2014年5月7日	538,375,800
		8,910,457,680

	権利付最終日	分配金額 (日本円)
2013年5月31日		
受益証券1口当たり分配金90円	2012年6月6日	700,363,080
受益証券1口当たり分配金90円	2012年7月3日	672,773,580
受益証券1口当たり分配金90円	2012年8月3日	695,323,440
受益証券1口当たり分配金90円	2012年9月4日	706,425,210
受益証券1口当たり分配金90円	2012年10月3日	708,391,620
受益証券1口当たり分配金90円	2012年11月5日	703,047,960
受益証券1口当たり分配金90円	2012年12月3日	714,831,840
受益証券1口当たり分配金90円	2013年1月4日	717,264,360
受益証券1口当たり分配金90円	2013年2月4日	750,641,850
受益証券1口当たり分配金90円	2013年3月4日	791,724,870
受益証券1口当たり分配金90円	2013年4月3日	823,449,330
受益証券1口当たり分配金90円	2013年5月7日	836,611,110
		8,820,848,250

12 後発事象

オルタナティブ投資ファンド運用会社規制（以下「AIFMD」という。）は、2011年5月に欧州理事会および議会で承認され、2011年7月21日に施行された。EU加盟国は、2013年7月22日までに、AIFMDを国内法制化するよう要請された。2013年7月22日以前に、オルタナティブ投資ファンド運用業務を実施することをすでに認可された運用会社に対して、2013年7月から2014年7月までの1年間は、法令順守の猶予期間である。

AIFMDは、対象となるオルタナティブ投資ファンド運用会社およびオルタナティブ投資ファンド（AIFs）を規制する。当ファンドは、オルタナティブ投資ファンド運用会社規制の意義の範囲内で、オルタナティブ投資ファンドとしての資格を有する。2014年7月1日発効で、当ファンドは、フランクリン テンプルトン インターナショナル サービス S.a r.l.（以下「管理会社」という。）を、オルタナティブ投資ファンド運用会社に任命した。管理会社は、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（以下「FTIML」という。）にポートフォリオ管理を委任する予定である。

ポートフォリオ管理の役割に関連して、FTIMLは、当ファンドの募集要項で示された投資目的、政策、および戦略を実行するため、当ファンドの資産の日次管理を行う予定である。

リスク管理の役割に関連して、管理会社は、リスク管理システムを設置、実行、（および適合できた場合には）定期的に評価する予定である。かかるリスク管理システムは、流動性管理システムを含み、当ファンドの投資戦略、また、オルタナティブ投資ファンド運用会社の規則に従うことで管理会社が影響を受ける、リスク管理義務および責任に関連する、さらされるまたはさらされる可能性のあるすべてのリスク（流動性リスクを含む）を適切に特定、測定、管理、および監視するために必要である。

海外国債マザーファンド

貸借対照表

	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
（単位：円）		
資産の部		
流動資産		
預金	2,776,408	-
コール・ローン	659,379,678	1,060,419,498
国債証券	56,056,845,671	50,890,485,289
未収入金	-	3,216,438,456
未収利息	583,032,030	428,849,451
前払費用	53,918,418	51,066,873
流動資産合計	57,355,952,205	55,647,259,567
資産合計	57,355,952,205	55,647,259,567
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,507
未払金	-	3,231,986,767
未払解約金	100,000,000	-
流動負債合計	100,000,000	3,231,988,274
負債合計	100,000,000	3,231,988,274
純資産の部		
元本等		
元本	27,781,925,943	24,333,561,079
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	29,474,026,262	28,081,710,214
元本等合計	57,255,952,205	52,415,271,293
純資産合計	57,255,952,205	52,415,271,293
負債純資産合計	57,355,952,205	55,647,259,567

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26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配は使用いたしません。）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

（貸借対照表に関する注記）

平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 27,781,925,943口	1. 計算日における受益権の総数 24,333,561,079口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.0609円 (1万口当たり純資産額) (20,609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 2.1540円 (1万口当たり純資産額) (21,540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10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左

区分	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、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。</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26年 4月21日現在	平成26年10月20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</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に</p> <p>近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま</p> <p>す。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>国債証券</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に</p> <p>近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま</p> <p>す。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお		
ける当該親投資信託の元本額	33,171,251,198円	27,781,925,943円
期中追加設定元本額	15,025,197円	14,950,889円
期中一部解約元本額	5,404,350,452円	3,463,315,753円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	17,244,522,120円	15,063,839,198円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	2,026,066,222円	1,906,386,975円
新光7資産バランスファンド	556,171,822円	512,128,420円
海外国債ファンド（1年決算型）	29,789,038円	34,802,517円
海外国債ファンド（変額年金）	7,920,944,765円	6,804,443,663円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適		
格機関投資家私募）	- 円	3,472,754円
グローバル・ナビ	4,431,976円	8,487,552円
合計	27,781,925,943円	24,333,561,079円

2 有価証券関係
売買目的有価証券

種類	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	853,277,685	1,897,071,143
合計	853,277,685	1,897,071,143

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

種類	平成26年 4月21日現在				平成26年10月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	-	-	-	-	6,865,632	-	6,864,125	1,507
ユーロ	-	-	-	-	6,865,632	-	6,864,125	1,507
合計	-	-	-	-	6,865,632	-	6,864,125	1,507

時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-0.25%-15/09/15	43,000,000.00	43,057,109.58	

		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	13,700,000.00	14,423,531.25	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	13,800,000.00	14,510,484.44	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	13,000,000.00	14,453,359.43	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	11,500,000.00	12,439,765.61	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	9,200,000.00	9,360,281.26	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	2,000,000.00	2,821,093.73	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	9,400,000.00	9,474,171.90	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	6,800,000.00	6,840,906.25	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	6,100,000.00	6,013,742.20	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	5,000,000.00	4,871,093.74	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	8,300,000.00	8,051,000.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	11,800,000.00	11,750,218.75	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	12,300,000.00	11,965,593.75	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	1,600,000.00	2,140,125.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	10,200,000.00	10,521,937.50	
米ドル建小計			177,700,000.00	182,694,414.39	(19,575,706,501)
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	2,900,000.00	3,107,843.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	3,300,000.00	3,207,402.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	3,200,000.00	3,355,200.00	
カナダドル建小計			9,400,000.00	9,670,445.00	(918,788,979)
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-22/07/04	9,300,000.00	10,151,880.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	7,000,000.00	7,501,900.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	7,000,000.00	7,494,900.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	7,000,000.00	7,487,900.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	7,000,000.00	7,773,500.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	3,900,000.00	5,830,110.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	7,000,000.00	7,604,800.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	7,000,000.00	7,436,100.00	

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,900,000.00	1,924,700.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	8,400,000.00	12,139,680.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	2,400,000.00	2,442,480.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	4,800,000.00	5,789,760.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	4,500,000.00	5,604,750.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	4,900,000.00	6,095,110.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	4,100,000.00	4,812,170.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	5,700,000.00	6,821,190.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,600,000.00	4,032,600.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	5,400,000.00	6,361,200.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	4,600,000.00	5,113,820.00	
	FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	10,900,000.00	12,783,520.00	
	FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	10,200,000.00	11,753,460.00	
	FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	7,500,000.00	8,218,500.00	
	FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	3,200,000.00	5,177,280.00	
	FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	7,700,000.00	8,166,620.00	
	FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	9,900,000.00	12,597,750.00	
	FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	8,400,000.00	9,184,560.00	
ユーロ建小計		162,300,000.00	190,300,240.00 (26,004,527,796)	
英ポンド	国債証券	TSY-4.0%-22/03/07	4,200,000.00	4,823,532.00
		TSY-1.75%-22/09/07	7,800,000.00	7,685,730.00
		TSY-2.25%-23/09/07	7,600,000.00	7,713,620.00
		TSY-2.75%-24/09/07	5,000,000.00	5,242,250.00
英ポンド建小計		24,600,000.00	25,465,132.00 (4,391,462,013)	
合計			50,890,485,289 (50,890,485,289)	

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	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	債券 16銘柄	37.3%	38.5%
カナダドル	債券 3銘柄	1.8%	1.8%
ユーロ	債券 26銘柄	49.6%	51.1%
英ポンド	債券 4銘柄	8.4%	8.6%

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	655,856,129	465,436,723
株式	13,023,623,950	12,646,969,850
派生商品評価勘定	794,750	829,200
未収配当金	129,588,267	100,893,154
未収利息	697	436
前払金	14,675,000	54,143,000
流動資産合計	13,824,538,793	13,268,272,363

	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
資産合計	13,824,538,793	13,268,272,363
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,163,000	30,391,600
未払解約金	9,900,000	1,020,000
流動負債合計	27,063,000	31,411,600
負債合計	27,063,000	31,411,600
純資産の部		
元本等		
元本	9,811,465,885	8,932,703,871
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,986,009,908	4,304,156,892
元本等合計	13,797,475,793	13,236,860,763
純資産合計	13,797,475,793	13,236,860,763
負債純資産合計	13,824,538,793	13,268,272,363

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26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 4月21日現在	平成26年10月20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 137,963,500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 146,028,200円
2. 計算日における受益権の総数 9,811,465,885口	2. 計算日における受益権の総数 8,932,703,871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 1.4063円 (1万口当たり純資産額) (14,063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 1.4818円 (1万口当たり純資産額) (14,818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10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左
2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・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	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26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	10,407,539,324円	9,811,465,885円
期中追加設定元本額	244,412,995円	37,126,580円
期中一部解約元本額	840,486,434円	915,888,594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	498,106,875円	469,923,858円
新光7資産バランスファンド	783,372,885円	706,846,977円

ニュー トピックス インデックス（変額年金）	796,660,298円	679,537,007円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,398,031,312円	2,261,176,521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）	2,377,985,161円	2,086,306,473円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	159,638,394円	104,577,305円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	2,038,921,838円	1,921,277,785円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	739,891,469円	680,450,909円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）	- 円	2,999,475円
グローバル・ナビ	18,857,653円	19,607,561円
合計	9,811,465,885円	8,932,703,871円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,081,277,510	440,873,216
合計	1,081,277,510	440,873,216

(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26年 4月21日現在				平成26年10月20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	778,493,250	-	762,125,000	16,368,250	704,687,400	-	675,125,000	29,562,400
東証株価指数先物	778,493,250	-	762,125,000	16,368,250	704,687,400	-	675,125,000	29,562,400
合計	778,493,250	-	762,125,000	16,368,250	704,687,400	-	675,125,000	29,562,400

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	7,000	248.00	1,736,000	
日本水産	10,000	304.00	3,040,000	
マルハニチロ	1,600	1,521.00	2,433,600	
サカタのタネ	1,200	1,490.00	1,788,000	
ホクト	900	1,905.00	1,714,500	
日鉄鉱業	4,000	399.00	1,596,000	
三井松島産業	11,000	129.00	1,419,000	
国際石油開発帝石	39,400	1,312.00	51,692,800	
日本海洋掘削	300	4,230.00	1,269,000	
石油資源開発	1,200	3,505.00	4,206,000	
ショーボンドホールディングス	700	4,125.00	2,887,500	
ミライト・ホールディングス	2,300	1,190.00	2,737,000	
安藤・間	5,400	642.00	3,466,800	
東急建設	2,900	495.00	1,435,500	
コムシスホールディングス	3,900	1,704.00	6,645,600	
ミサワホーム	1,100	1,052.00	1,157,200	
高松コンストラクショングループ	800	2,015.00	1,612,000	
東建コーポレーション	300	4,705.00	1,411,500	
大成建設	41,000	563.00	23,083,000	
大林組	24,000	690.00	16,560,000	
清水建設	25,000	765.00	19,125,000	
飛島建設	7,500	265.00	1,987,500	
長谷工コーポレーション	10,800	770.00	8,316,000	
鹿島建設	36,000	483.00	17,388,000	
不動テトラ	5,700	261.00	1,487,700	
鉄建建設	5,000	479.00	2,395,000	
西松建設	11,000	469.00	5,159,000	

三井住友建設	21,800	124.00	2,703,200
大豊建設	3,000	476.00	1,428,000
前田建設工業	5,000	877.00	4,385,000
奥村組	7,000	558.00	3,906,000
東鉄工業	1,000	2,331.00	2,331,000
戸田建設	9,000	472.00	4,248,000
熊谷組	12,000	396.00	4,752,000
矢作建設工業	1,600	682.00	1,091,200
大東建託	3,100	12,495.00	38,734,500
N I P P O	2,000	1,845.00	3,690,000
東亜道路工業	3,000	386.00	1,158,000
前田道路	3,000	1,566.00	4,698,000
日本道路	3,000	588.00	1,764,000
東亜建設工業	7,000	182.00	1,274,000
若築建設	5,000	197.00	985,000
東洋建設	3,800	445.00	1,691,000
五洋建設	9,600	329.00	3,158,400
世紀東急工業	1,200	524.00	628,800
福田組	2,000	1,103.00	2,206,000
住友林業	5,600	1,111.00	6,221,600
パナホーム	3,000	716.00	2,148,000
大和ハウス工業	22,300	1,884.50	42,024,350
ライト工業	1,700	962.00	1,635,400
積水ハウス	21,800	1,280.00	27,904,000
ユアテック	1,000	510.00	510,000
西部電気工業	3,000	464.00	1,392,000
中電工	1,200	1,575.00	1,890,000
関電工	4,000	507.00	2,028,000
きんでん	5,000	1,027.00	5,135,000
住友電設	200	1,323.00	264,600
日本電設工業	1,300	1,612.00	2,095,600
協和エクシオ	3,200	1,288.00	4,121,600
九電工	1,000	1,169.00	1,169,000
三機工業	3,000	733.00	2,199,000
日揮	8,000	2,527.50	20,220,000
中外炉工業	5,000	209.00	1,045,000
太平電業	2,000	814.00	1,628,000
高砂熱学工業	2,300	1,279.00	2,941,700
明星工業	1,000	615.00	615,000
大気社	1,100	2,301.00	2,531,100
日比谷総合設備	1,400	1,545.00	2,163,000
東芝プラントシステム	1,300	1,728.00	2,246,400

東洋エンジニアリング	4,000	520.00	2,080,000
千代田化工建設	6,000	1,044.00	6,264,000
新興プラントック	1,700	786.00	1,336,200
日本製粉	5,000	506.00	2,530,000
日清製粉グループ本社	8,900	1,011.00	8,997,900
鳥越製粉	3,600	697.00	2,509,200
フィード・ワンホールディングス	16,700	109.00	1,820,300
三井製糖	3,000	364.00	1,092,000
森永製菓	8,000	226.00	1,808,000
中村屋	4,000	407.00	1,628,000
江崎グリコ	1,400	3,695.00	5,173,000
不二家	2,000	193.00	386,000
山崎製パン	6,000	1,393.00	8,358,000
モロゾフ	9,000	344.00	3,096,000
亀田製菓	500	3,040.00	1,520,000
カルビー	3,000	3,565.00	10,695,000
森永乳業	7,000	348.00	2,436,000
ヤクルト本社	4,700	5,390.00	25,333,000
明治ホールディングス	2,400	8,380.00	20,112,000
雪印メグミルク	1,700	1,383.00	2,351,100
日本ハム	5,000	2,429.00	12,145,000
伊藤ハム	4,000	525.00	2,100,000
サッポロホールディングス	13,000	422.00	5,486,000
アサヒグループホールディングス	16,300	3,127.00	50,970,100
キリンホールディングス	34,700	1,356.50	47,070,550
宝ホールディングス	6,400	765.00	4,896,000
オエノンホールディングス	7,000	229.00	1,603,000
コカ・コーラウエスト	2,700	1,476.00	3,985,200
コカ・コーライーストジャパン	2,500	1,823.00	4,557,500
サントリー食品インターナショナル	4,900	3,660.00	17,934,000
ダイドードリンコ	400	4,380.00	1,752,000
伊藤園	2,200	2,118.00	4,659,600
キーコーヒー	700	1,582.00	1,107,400
不二製油	2,000	1,772.00	3,544,000
キッコーマン	7,000	2,141.00	14,987,000
味の素	19,000	1,918.00	36,442,000
キュービー	4,100	1,765.00	7,236,500
ハウス食品グループ本社	2,800	1,812.00	5,073,600
カゴメ	3,100	1,691.00	5,242,100
焼津水産化学工業	2,800	956.00	2,676,800
アリアケジャパン	700	2,274.00	1,591,800
ニチレイ	9,000	426.00	3,834,000

東洋水産	4,000	3,535.00	14,140,000
日清食品ホールディングス	3,200	5,700.00	18,240,000
ロック・フィールド	1,200	1,874.00	2,248,800
日本たばこ産業	44,900	3,438.50	154,388,650
わらべや日洋	700	1,977.00	1,383,900
なとり	1,600	1,097.00	1,755,200
片倉工業	1,400	1,217.00	1,703,800
グンゼ	6,000	285.00	1,710,000
東洋紡	32,000	150.00	4,800,000
ユニチカ	29,000	49.00	1,421,000
富士紡ホールディングス	6,000	298.00	1,788,000
日清紡ホールディングス	5,000	818.00	4,090,000
倉敷紡績	8,000	178.00	1,424,000
シキボウ	3,000	130.00	390,000
日本毛織	2,000	747.00	1,494,000
トーア紡コーポレーション	7,000	73.00	511,000
帝国繊維	1,000	2,445.00	2,445,000
帝人	31,000	246.00	7,626,000
東レ	55,000	687.30	37,801,500
住江織物	4,000	276.00	1,104,000
アツギ	21,000	110.00	2,310,000
ダイニック	10,000	168.00	1,680,000
セーレン	2,000	946.00	1,892,000
小松精練	2,500	518.00	1,295,000
ワコールホールディングス	5,000	1,074.00	5,370,000
ホギメディカル	500	5,440.00	2,720,000
T S Iホールディングス	3,600	625.00	2,250,000
三陽商会	8,000	236.00	1,888,000
オンワードホールディングス	5,000	622.00	3,110,000
ゴールドウイン	3,000	586.00	1,758,000
デサント	2,000	902.00	1,804,000
王子ホールディングス	33,000	373.00	12,309,000
日本製紙	3,900	1,525.00	5,947,500
三菱製紙	19,000	83.00	1,577,000
北越紀州製紙	5,200	424.00	2,204,800
中越パルプ工業	1,000	169.00	169,000
大王製紙	3,000	908.00	2,724,000
レンゴー	6,000	463.00	2,778,000
トーモク	6,000	282.00	1,692,000
ザ・バック	1,000	2,130.00	2,130,000
クラレ	12,000	1,234.00	14,808,000
旭化成	47,000	840.10	39,484,700

昭和電工	50,000	134.00	6,700,000	
住友化学	56,000	344.00	19,264,000	
住友精化	2,000	610.00	1,220,000	
日産化学工業	5,100	1,735.00	8,848,500	
クレハ	5,000	507.00	2,535,000	
テイカ	2,000	422.00	844,000	
石原産業	14,000	82.00	1,148,000	
日本曹達	5,000	564.00	2,820,000	
東ソー	20,000	401.00	8,020,000	
トクヤマ	12,000	303.00	3,636,000	
セントラル硝子	7,000	335.00	2,345,000	
東亜合成	9,000	436.00	3,924,000	
ダイソー	5,000	342.00	1,710,000	
関東電化工業	2,000	390.00	780,000	
電気化学工業	15,000	336.00	5,040,000	
信越化学工業	13,600	6,726.00	91,473,600	
日本カーバイド工業	1,000	224.00	224,000	
堺化学工業	6,000	314.00	1,884,000	
エア・ウォーター	6,000	1,606.00	9,636,000	
大陽日酸	10,000	945.00	9,450,000	
日本パーカライズニング	1,800	2,298.00	4,136,400	
四国化成工業	1,000	764.00	764,000	
日本触媒	6,000	1,145.00	6,870,000	
大日精化工業	3,000	567.00	1,701,000	
カネカ	9,000	574.00	5,166,000	
三菱瓦斯化学	12,000	633.00	7,596,000	
三井化学	34,000	288.00	9,792,000	
J S R	7,000	1,774.00	12,418,000	
東京応化工業	1,500	2,738.00	4,107,000	
三菱ケミカルホールディングス	47,400	505.40	23,955,960	
日本合成化学工業	2,000	715.00	1,430,000	
ダイセル	10,000	1,132.00	11,320,000	
住友ベークライト	6,000	410.00	2,460,000	
積水化学工業	16,000	1,224.00	19,584,000	
日本ゼオン	6,000	977.00	5,862,000	
アイカ工業	2,100	2,123.00	4,458,300	
宇部興産	38,000	157.00	5,966,000	
積水樹脂	1,100	1,398.00	1,537,800	
タキロン	3,000	531.00	1,593,000	
日立化成	3,300	1,799.00	5,936,700	
リケンテクノス	2,000	454.00	908,000	
大倉工業	3,000	346.00	1,038,000	

群栄化学工業	3,000	324.00	972,000
日本化薬	5,000	1,214.00	6,070,000
日本精化	800	751.00	600,800
A D E K A	3,300	1,318.00	4,349,400
日油	6,000	696.00	4,176,000
花王	20,900	4,095.00	85,585,500
第一工業製薬	1,000	399.00	399,000
三洋化成工業	2,000	665.00	1,330,000
大日本塗料	9,000	144.00	1,296,000
日本ペイントホールディングス	7,000	2,251.00	15,757,000
関西ペイント	9,000	1,507.00	13,563,000
中国塗料	2,000	763.00	1,526,000
藤倉化成	1,600	514.00	822,400
太陽ホールディングス	600	3,360.00	2,016,000
D I C	30,000	214.00	6,420,000
サカタインクス	1,500	1,029.00	1,543,500
東洋インキS Cホールディングス	7,000	483.00	3,381,000
富士フイルムホールディングス	17,300	3,392.50	58,690,250
資生堂	13,500	1,740.00	23,490,000
ライオン	9,000	571.00	5,139,000
高砂香料工業	3,000	491.00	1,473,000
マンダム	800	3,465.00	2,772,000
ミルボン	400	3,375.00	1,350,000
ファンケル	1,800	1,443.00	2,597,400
コーセー	1,200	4,290.00	5,148,000
ドクターシーラボ	500	3,565.00	1,782,500
ポーラ・オルビスホールディングス	900	4,265.00	3,838,500
コニシ	1,000	1,900.00	1,900,000
長谷川香料	1,000	1,490.00	1,490,000
星光P M C	200	924.00	184,800
小林製薬	1,200	6,290.00	7,548,000
メック	500	1,015.00	507,500
日本高純度化学	900	2,273.00	2,045,700
J C U	400	4,530.00	1,812,000
アース製薬	500	3,965.00	1,982,500
イハラケミカル工業	2,100	1,001.00	2,102,100
大成ラミック	800	2,617.00	2,093,600
クミアイ化学工業	2,000	625.00	1,250,000
日本農薬	1,700	1,019.00	1,732,300
アキレス	11,000	138.00	1,518,000
有沢製作所	2,400	720.00	1,728,000
日東電工	6,200	5,461.00	33,858,200

レック	900	1,115.00	1,003,500	
藤森工業	600	2,924.00	1,754,400	
前澤化成工業	1,900	1,036.00	1,968,400	
エフピコ	700	2,950.00	2,065,000	
天馬	1,000	1,461.00	1,461,000	
東リ	9,000	223.00	2,007,000	
ニフコ	1,700	3,120.00	5,304,000	
日本バルカー工業	8,000	288.00	2,304,000	
ユニ・チャーム	14,000	2,424.00	33,936,000	
協和発酵キリン	9,000	1,209.00	10,881,000	
武田薬品工業	28,400	4,470.50	126,962,200	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	86,300	1,559.00	134,541,700	
大日本住友製薬	5,400	1,243.00	6,712,200	
塩野義製薬	11,800	2,466.00	29,098,800	
田辺三菱製薬	6,300	1,589.00	10,010,700	
あすか製薬	1,600	1,302.00	2,083,200	
日本新薬	2,000	3,095.00	6,190,000	
中外製薬	7,500	3,150.00	23,625,000	
科研製薬	3,000	2,391.00	7,173,000	
エーザイ	9,300	4,226.50	39,306,450	
ロート製薬	3,200	1,483.00	4,745,600	
小野薬品工業	3,400	9,030.00	30,702,000	
久光製薬	2,400	3,520.00	8,448,000	
持田製薬	500	6,420.00	3,210,000	
参天製薬	2,800	5,880.00	16,464,000	
扶桑薬品工業	5,000	293.00	1,465,000	
ツムラ	2,200	2,300.00	5,060,000	
日医工	1,800	1,780.00	3,204,000	
キッセイ薬品工業	1,400	2,583.00	3,616,200	
生化学工業	1,600	1,650.00	2,640,000	
栄研化学	1,000	1,894.00	1,894,000	
鳥居薬品	500	2,878.00	1,439,000	
JCRファーマ	600	2,361.00	1,416,600	
東和薬品	400	4,735.00	1,894,000	
沢井製薬	1,200	6,260.00	7,512,000	
ゼリア新薬工業	1,200	2,066.00	2,479,200	
第一三共	23,900	1,641.00	39,219,900	
キョーリン製薬ホールディングス	2,000	2,175.00	4,350,000	
大幸薬品	500	1,988.00	994,000	
大塚ホールディングス	15,000	3,740.50	56,107,500	
大正製薬ホールディングス	1,800	6,980.00	12,564,000	

日本コークス工業	13,800	105.00	1,449,000
昭和シェル石油	6,800	926.00	6,296,800
コスモ石油	21,000	172.00	3,612,000
ニチレキ	1,000	852.00	852,000
東燃ゼネラル石油	11,000	924.00	10,164,000
ユシロ化学工業	1,200	1,369.00	1,642,800
富士石油	800	319.00	255,200
出光興産	3,600	2,065.00	7,434,000
JXホールディングス	84,100	459.90	38,677,590
横浜ゴム	8,000	907.00	7,256,000
東洋ゴム工業	3,400	1,692.00	5,752,800
ブリヂストン	23,800	3,462.00	82,395,600
住友ゴム工業	5,900	1,456.00	8,590,400
ニッタ	700	2,394.00	1,675,800
住友理工	1,400	897.00	1,255,800
三ツ星ベルト	3,000	710.00	2,130,000
バンドー化学	5,000	402.00	2,010,000
日東紡績	6,000	366.00	2,196,000
旭硝子	37,000	533.10	19,724,700
日本板硝子	37,000	99.00	3,663,000
日本山村硝子	5,000	163.00	815,000
日本電気硝子	16,000	463.00	7,408,000
住友大阪セメント	14,000	329.00	4,606,000
太平洋セメント	45,000	385.00	17,325,000
日本ヒューム	1,800	874.00	1,573,200
日本コンクリート工業	2,000	594.00	1,188,000
三谷セキサン	300	1,866.00	559,800
ジャパンパイル	1,300	806.00	1,047,800
東海カーボン	7,000	272.00	1,904,000
日本カーボン	9,000	175.00	1,575,000
東洋炭素	700	1,889.00	1,322,300
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	242.00	1,936,000
TOTO	11,000	1,103.00	12,133,000
日本碍子	10,000	2,375.00	23,750,000
日本特殊陶業	6,500	2,882.00	18,733,000
MARUWA	200	3,190.00	638,000
フジインコーポレーテッド	1,200	1,466.00	1,759,200
ニチアス	4,000	637.00	2,548,000
ニチハ	1,300	932.00	1,211,600
新日鐵住金	320,000	255.10	81,632,000
神戸製鋼所	121,000	161.00	19,481,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	19,300	1,933.50	37,316,550

日新製鋼	3,200	920.00	2,944,000
東京製鐵	4,200	542.00	2,276,400
共英製鋼	700	1,882.00	1,317,400
大和工業	1,600	3,330.00	5,328,000
東京鐵鋼	2,000	493.00	986,000
淀川製鋼所	5,000	399.00	1,995,000
東洋鋼鈑	3,000	540.00	1,620,000
丸一鋼管	2,500	2,475.00	6,187,500
大同特殊鋼	13,000	399.00	5,187,000
日本冶金工業	5,900	245.00	1,445,500
山陽特殊製鋼	4,000	349.00	1,396,000
愛知製鋼	4,000	374.00	1,496,000
日立金属	7,000	1,872.00	13,104,000
大太平洋金属	5,000	337.00	1,685,000
新日本電工	5,600	251.00	1,405,600
栗本鐵工所	6,000	216.00	1,296,000
三菱製鋼	7,000	219.00	1,533,000
日本輕金属ホールディングス	17,200	147.00	2,528,400
三井金属鉱業	19,000	277.00	5,263,000
東邦亜鉛	4,000	357.00	1,428,000
三菱マテリアル	47,000	319.00	14,993,000
住友金属鉱山	20,000	1,407.50	28,150,000
D O W Aホールディングス	8,000	853.00	6,824,000
古河機械金属	13,000	207.00	2,691,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	800	2,025.00	1,620,000
東邦チタニウム	2,100	625.00	1,312,500
U A C J	10,000	376.00	3,760,000
古河電気工業	24,000	186.00	4,464,000
住友電気工業	28,500	1,445.00	41,182,500
フジクラ	12,000	456.00	5,472,000
昭和電線ホールディングス	15,000	101.00	1,515,000
タツタ電線	900	565.00	508,500
リョービ	5,000	290.00	1,450,000
アサヒホールディングス	1,100	1,767.00	1,943,700
宮地エンジニアリンググループ	5,000	193.00	965,000
トーカロ	600	2,045.00	1,227,000
S U M C O	5,200	1,183.00	6,151,600
東洋製罐グループホールディングス	5,400	1,151.00	6,215,400
横河ブリッジホールディングス	1,400	1,375.00	1,925,000
三和ホールディングス	6,000	690.00	4,140,000
文化シャッター	3,000	856.00	2,568,000
三協立山	900	1,904.00	1,713,600

LIIXILグループ	10,600	2,143.00	22,715,800
ノーリツ	1,500	1,925.00	2,887,500
長府製作所	800	2,854.00	2,283,200
リンナイ	1,200	8,690.00	10,428,000
岡部	1,500	999.00	1,498,500
東プレ	1,500	1,444.00	2,166,000
高周波熱錬	1,500	757.00	1,135,500
東京製綱	10,000	161.00	1,610,000
パイオラックス	400	4,630.00	1,852,000
日本発條	6,000	928.00	5,568,000
日本製鋼所	11,000	382.00	4,202,000
三浦工業	3,400	1,173.00	3,988,200
タクマ	2,000	664.00	1,328,000
ツガミ	2,000	570.00	1,140,000
オークマ	5,000	751.00	3,755,000
東芝機械	4,000	424.00	1,696,000
アマダ	11,300	911.00	10,294,300
アイダエンジニアリング	1,700	1,028.00	1,747,600
富士機械製造	2,300	960.00	2,208,000
牧野フライス製作所	4,000	699.00	2,796,000
オーエスジー	3,500	1,634.00	5,719,000
旭ダイヤモンド工業	1,900	1,336.00	2,538,400
D M G 森精機	4,500	1,177.00	5,296,500
ディスコ	800	6,990.00	5,592,000
島精機製作所	1,000	1,644.00	1,644,000
日阪製作所	1,800	916.00	1,648,800
やまびこ	400	4,040.00	1,616,000
ナブテスコ	3,500	2,486.00	8,701,000
三井海洋開発	800	2,567.00	2,053,600
S M C	2,200	27,735.00	61,017,000
ホソカワミクロン	2,000	596.00	1,192,000
オイレス工業	900	2,019.00	1,817,100
サトーホールディングス	800	2,690.00	2,152,000
小松製作所	35,300	2,396.50	84,596,450
住友重機械工業	21,000	558.00	11,718,000
日立建機	3,900	2,005.00	7,819,500
日工	2,000	398.00	796,000
井関農機	8,000	243.00	1,944,000
北川鉄工所	7,000	183.00	1,281,000
クボタ	39,000	1,606.50	62,653,500
月島機械	1,200	1,116.00	1,339,200
帝国電機製作所	800	1,211.00	968,800

新東工業	1,800	699.00	1,258,200
澁谷工業	600	2,578.00	1,546,800
小森コーポレーション	1,800	1,128.00	2,030,400
鶴見製作所	1,100	1,710.00	1,881,000
酒井重工業	3,000	263.00	789,000
荏原製作所	17,000	565.00	9,605,000
西島製作所	1,200	848.00	1,017,600
ダイキン工業	9,900	6,268.00	62,053,200
トヨーカネツ	6,000	243.00	1,458,000
栗田工業	4,600	2,192.00	10,083,200
椿本チエイン	4,000	811.00	3,244,000
大同工業	1,000	252.00	252,000
アネスト岩田	2,300	774.00	1,780,200
ダイフク	3,100	1,141.00	3,537,100
加藤製作所	2,000	746.00	1,492,000
タダノ	3,000	1,688.00	5,064,000
フジテック	2,100	1,186.00	2,490,600
C K D	2,000	940.00	1,880,000
キトー	1,400	1,244.00	1,741,600
平和	1,600	2,076.00	3,321,600
理想科学工業	600	3,100.00	1,860,000
S A N K Y O	2,200	3,735.00	8,217,000
日本金銭機械	800	1,895.00	1,516,000
マースエンジニアリング	900	1,918.00	1,726,200
福島工業	200	2,113.00	422,600
ダイコク電機	600	1,863.00	1,117,800
アマノ	2,100	1,133.00	2,379,300
J U K I	7,000	338.00	2,366,000
サンデン	4,000	576.00	2,304,000
蛇の目ミシン工業	11,000	168.00	1,848,000
マックス	1,000	1,163.00	1,163,000
グローリー	2,200	2,667.00	5,867,400
大和冷機工業	1,000	811.00	811,000
セガサミーホールディングス	7,800	1,598.00	12,464,400
日本ピストンリング	6,000	221.00	1,326,000
リケン	4,000	414.00	1,656,000
T P R	900	2,213.00	1,991,700
ホシザキ電機	1,600	4,725.00	7,560,000
日本精工	16,000	1,338.00	21,408,000
N T N	17,000	437.00	7,429,000
ジェイテクト	7,700	1,607.00	12,373,900
不二越	7,000	645.00	4,515,000

日本トムソン	3,000	502.00	1,506,000
T H K	4,500	2,543.00	11,443,500
ユーシン精機	500	2,112.00	1,056,000
イーグル工業	900	1,993.00	1,793,700
日本ピラー工業	400	873.00	349,200
キット	3,200	489.00	1,564,800
日立工機	1,900	889.00	1,689,100
マキタ	4,700	5,460.00	25,662,000
日立造船	5,700	585.00	3,334,500
三菱重工業	129,000	632.50	81,592,500
I H I	52,000	515.00	26,780,000
イビデン	4,400	1,608.00	7,075,200
コニカミノルタ	18,400	1,092.00	20,092,800
ブラザー工業	9,400	1,761.00	16,553,400
ミネベア	10,000	1,354.00	13,540,000
日立製作所	174,000	770.30	134,032,200
東芝	143,000	441.40	63,120,200
三菱電機	72,000	1,301.00	93,672,000
富士電機	20,000	436.00	8,720,000
東洋電機製造	1,000	375.00	375,000
安川電機	7,900	1,304.00	10,301,600
シンフォニアテクノロジー	9,000	159.00	1,431,000
明電舎	7,000	382.00	2,674,000
山洋電気	1,000	810.00	810,000
デンヨー	900	1,340.00	1,206,000
東芝テック	5,000	634.00	3,170,000
マブチモーター	1,100	8,730.00	9,603,000
日本電産	7,900	6,725.00	53,127,500
東光高岳	700	1,429.00	1,000,300
ダイヘン	4,000	354.00	1,416,000
J V C ケンウッド	6,200	246.00	1,525,200
日新電機	1,000	579.00	579,000
大崎電気工業	1,000	580.00	580,000
オムロン	8,200	4,495.00	36,859,000
日東工業	1,100	1,869.00	2,055,900
I D E C	1,900	880.00	1,672,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	14,000	529.00	7,406,000
メルコホールディングス	200	1,818.00	363,600
日本電気	100,000	345.00	34,500,000
富士通	70,000	700.60	49,042,000
沖電気工業	32,000	236.00	7,552,000
電気興業	2,000	547.00	1,094,000

サンケン電気	4,000	810.00	3,240,000	
アイホン	400	1,814.00	725,600	
ルネサスエレクトロニクス	3,700	761.00	2,815,700	
セイコーエプソン	4,900	4,740.00	23,226,000	
ワコム	5,700	409.00	2,331,300	
アルバック	1,300	1,229.00	1,597,700	
アクセル	800	1,519.00	1,215,200	
E I Z O	700	2,253.00	1,577,100	
ジャパンディスプレイ	12,200	345.00	4,209,000	
日本信号	2,000	1,028.00	2,056,000	
能美防災	1,000	1,530.00	1,530,000	
エレコム	100	2,384.00	238,400	
日本無線	3,000	345.00	1,035,000	
パナソニック	82,700	1,181.00	97,668,700	代用有価証券 7,500株
シャープ	52,000	272.00	14,144,000	
アンリツ	4,200	755.00	3,171,000	
富士通ゼネラル	2,000	1,179.00	2,358,000	
日立国際電気	1,000	1,537.00	1,537,000	
ソニー	41,500	1,875.00	77,812,500	代用有価証券 3,700株
T D K	4,400	5,720.00	25,168,000	
帝国通信工業	8,000	170.00	1,360,000	
ミツミ電機	2,800	659.00	1,845,200	
タムラ製作所	6,000	389.00	2,334,000	
アルプス電気	5,300	1,703.00	9,025,900	
パイオニア	10,000	279.00	2,790,000	
日本電波工業	1,000	840.00	840,000	
日本トリム	200	2,760.00	552,000	
ローランド ディー . ジー .	400	4,265.00	1,706,000	
フォスター電機	1,000	1,491.00	1,491,000	
クラリオン	7,000	403.00	2,821,000	
S M K	3,000	480.00	1,440,000	
東光	2,000	298.00	596,000	
ホシデン	3,100	553.00	1,714,300	
ヒロセ電機	1,300	12,610.00	16,393,000	
日本航空電子工業	2,000	2,151.00	4,302,000	
T O A	1,400	1,105.00	1,547,000	
日立マクセル	1,300	1,707.00	2,219,100	
古野電気	500	730.00	365,000	
ユニデン	4,000	219.00	876,000	
アルパイン	1,600	1,673.00	2,676,800	

アイコム	700	2,421.00	1,694,700
船井電機	1,100	1,066.00	1,172,600
横河電機	7,800	1,317.00	10,272,600
新電元工業	3,000	618.00	1,854,000
アズビル	2,200	2,450.00	5,390,000
日本光電工業	1,500	5,230.00	7,845,000
堀場製作所	1,300	3,700.00	4,810,000
アドバンテスト	4,900	1,231.00	6,031,900
エスベック	1,800	934.00	1,681,200
キーエンス	1,600	44,560.00	71,296,000
日置電機	1,200	1,647.00	1,976,400
シスメックス	6,100	4,045.00	24,674,500
メガチップス	1,100	1,387.00	1,525,700
O B A R A G R O U P	500	3,880.00	1,940,000
コーセル	1,300	1,180.00	1,534,000
オブテックス	900	1,837.00	1,653,300
千代田インテグレ	400	1,564.00	625,600
レーザーテック	1,000	1,367.00	1,367,000
スタンレー電気	5,200	2,090.00	10,868,000
岩崎電気	3,000	225.00	675,000
ウシオ電機	4,400	1,082.00	4,760,800
日本セラミック	200	1,544.00	308,800
遠藤照明	100	1,240.00	124,000
日本デジタル研究所	500	1,952.00	976,000
日本電子	4,000	490.00	1,960,000
カシオ計算機	7,300	1,729.00	12,621,700
ファナック	8,100	18,695.00	151,429,500
エンプラス	200	5,050.00	1,010,000
ローム	3,800	6,040.00	22,952,000
浜松ホトニクス	3,000	4,655.00	13,965,000
三井ハイテック	900	628.00	565,200
新光電気工業	2,400	701.00	1,682,400
京セラ	12,700	4,523.00	57,442,100
太陽誘電	3,500	1,064.00	3,724,000
村田製作所	7,600	11,795.00	89,642,000
ユーシン	2,200	682.00	1,500,400
双葉電子工業	1,300	1,463.00	1,901,900
北陸電気工業	2,000	158.00	316,000
ニチコン	2,300	711.00	1,635,300
日本ケミコン	5,000	292.00	1,460,000
K O A	1,500	1,068.00	1,602,000
小糸製作所	4,000	2,708.00	10,832,000

ミツバ	1,300	1,546.00	2,009,800	
スター精密	1,400	1,698.00	2,377,200	
S C R E E Nホールディングス	7,000	525.00	3,675,000	
キヤノン電子	300	1,940.00	582,000	
キヤノン	42,000	3,253.00	136,626,000	代用有価証券 4,100株
リコー	21,800	1,066.50	23,249,700	
東京エレクトロン	6,500	6,334.00	41,171,000	
トヨタ紡織	2,500	1,091.00	2,727,500	
ユニプレス	1,200	2,064.00	2,476,800	
豊田自動織機	6,600	4,750.00	31,350,000	
モリタホールディングス	2,000	1,033.00	2,066,000	
デンソー	17,900	4,723.50	84,550,650	
東海理化電機製作所	1,900	2,074.00	3,940,600	
三井造船	28,000	225.00	6,300,000	
川崎重工業	56,000	411.00	23,016,000	
名村造船所	2,100	961.00	2,018,100	
日本車輛製造	3,000	341.00	1,023,000	
日産自動車	101,600	955.90	97,119,440	
いすゞ自動車	21,000	1,332.50	27,982,500	
トヨタ自動車	99,900	6,028.00	602,197,200	代用有価証券 9,000株
日野自動車	9,000	1,474.00	13,266,000	
三菱自動車工業	25,900	1,160.00	30,044,000	
武蔵精密工業	800	2,089.00	1,671,200	
日産車体	3,500	1,415.00	4,952,500	
新明和工業	3,000	926.00	2,778,000	
極東開発工業	1,200	1,490.00	1,788,000	
日信工業	1,500	1,578.00	2,367,000	
トピー工業	10,000	198.00	1,980,000	
ティラド	5,000	253.00	1,265,000	
曙ブレーキ工業	3,400	415.00	1,411,000	
タチエス	1,100	1,351.00	1,486,100	
N O K	3,500	2,446.00	8,561,000	
フタバ産業	3,300	564.00	1,861,200	
カヤバ工業	7,000	448.00	3,136,000	
大同メタル工業	1,000	1,200.00	1,200,000	
プレス工業	4,000	425.00	1,700,000	
カルソニックカンセイ	5,000	548.00	2,740,000	
太平洋工業	2,400	765.00	1,836,000	
ケーヒン	1,700	1,333.00	2,266,100	
河西工業	1,900	926.00	1,759,400	

アイシン精機	6,600	3,650.00	24,090,000	
マツダ	21,600	2,302.00	49,723,200	
ダイハツ工業	7,700	1,548.00	11,919,600	
今仙電機製作所	600	1,879.00	1,127,400	
本田技研工業	65,100	3,367.50	219,224,250	代用有価証券 6,000株
スズキ	15,100	3,203.50	48,372,850	
富士重工業	24,600	3,255.00	80,073,000	
ヤマハ発動機	11,000	1,872.00	20,592,000	
ショーワ	1,700	1,045.00	1,776,500	
エクセディ	900	2,556.00	2,300,400	
豊田合成	2,300	1,954.00	4,494,200	
ヨロズ	800	1,801.00	1,440,800	
エフ・シー・シー	1,200	1,747.00	2,096,400	
シマノ	3,100	12,070.00	37,417,000	
タカタ	1,300	2,186.00	2,841,800	
テイ・エス テック	1,500	2,314.00	3,471,000	
テルモ	11,100	2,432.00	26,995,200	
日機装	2,300	1,076.00	2,474,800	
島津製作所	9,000	911.00	8,199,000	
東京計器	4,000	262.00	1,048,000	
東京精密	1,300	1,677.00	2,180,100	
マニー	400	6,460.00	2,584,000	
ニコン	13,500	1,443.00	19,480,500	
トプコン	1,900	2,373.00	4,508,700	
オリンパス	10,800	3,675.00	39,690,000	
理研計器	700	1,003.00	702,100	
タムロン	600	2,088.00	1,252,800	
H O Y A	17,200	3,386.50	58,247,800	
シチズンホールディングス	8,900	651.00	5,793,900	
セイコーホールディングス	5,000	486.00	2,430,000	
ニプロ	3,900	871.00	3,396,900	
パラマウントベッドホールディングス	700	3,165.00	2,215,500	
前田工織	800	1,240.00	992,000	
永大産業	1,000	447.00	447,000	
アートネイチャー	200	2,824.00	564,800	
パンダイナムコホールディングス	8,000	2,545.00	20,360,000	
パイロットコーポレーション	600	5,790.00	3,474,000	
トッパン・フォームズ	300	1,002.00	300,600	
フジシールインターナショナル	900	3,170.00	2,853,000	
タカラトミー	3,500	628.00	2,198,000	
アーク	3,500	141.00	493,500	

大建工業	7,000	242.00	1,694,000
凸版印刷	20,000	697.00	13,940,000
大日本印刷	22,000	987.00	21,714,000
共同印刷	3,000	368.00	1,104,000
日本写真印刷	1,200	1,652.00	1,982,400
宝印刷	1,700	764.00	1,298,800
アシックス	7,200	2,358.00	16,977,600
ヤマハ	5,300	1,325.00	7,022,500
クリナップ	600	912.00	547,200
ピジョン	1,200	6,140.00	7,368,000
リンテック	1,700	2,143.00	3,643,100
イトーキ	2,200	592.00	1,302,400
任天堂	4,500	10,960.00	49,320,000
三菱鉛筆	600	3,315.00	1,989,000
タカラスタンド	3,000	831.00	2,493,000
コクヨ	3,800	815.00	3,097,000
ナカバヤシ	8,000	196.00	1,568,000
グロープライド	3,000	127.00	381,000
岡村製作所	2,800	770.00	2,156,000
美津濃	4,000	552.00	2,208,000
アデランス	900	1,230.00	1,107,000
東京電力	61,400	333.00	20,446,200
中部電力	23,800	1,179.50	28,072,100
関西電力	29,500	962.30	28,387,850
中国電力	10,000	1,311.00	13,110,000
北陸電力	7,100	1,347.00	9,563,700
東北電力	18,100	1,155.00	20,905,500
四国電力	6,500	1,284.00	8,346,000
九州電力	16,000	1,060.00	16,960,000
北海道電力	6,800	841.00	5,718,800
沖縄電力	500	3,220.00	1,610,000
電源開発	4,500	3,565.00	16,042,500
東京瓦斯	82,000	572.00	46,904,000
大阪瓦斯	75,000	407.20	30,540,000
東邦瓦斯	18,000	539.00	9,702,000
西部瓦斯	8,000	248.00	1,984,000
静岡瓦斯	3,000	671.00	2,013,000
東武鉄道	41,000	505.00	20,705,000
相鉄ホールディングス	12,000	380.00	4,560,000
東京急行電鉄	43,000	655.00	28,165,000
京浜急行電鉄	19,000	853.00	16,207,000
小田急電鉄	23,000	927.00	21,321,000

京王電鉄	20,000	754.00	15,080,000
京成電鉄	11,000	1,123.00	12,353,000
富士急行	2,000	1,033.00	2,066,000
新京成電鉄	2,000	376.00	752,000
東日本旅客鉄道	13,300	8,014.00	106,586,200
西日本旅客鉄道	6,500	4,856.50	31,567,250
東海旅客鉄道	6,500	13,950.00	90,675,000
西武ホールディングス	5,800	1,993.00	11,559,400
西日本鉄道	9,000	408.00	3,672,000
近畿日本鉄道	73,000	353.00	25,769,000
阪急阪神ホールディングス	49,000	592.00	29,008,000
南海電気鉄道	15,000	495.00	7,425,000
京阪電気鉄道	15,000	470.00	7,050,000
神戸電鉄	6,000	336.00	2,016,000
名古屋鉄道	26,000	419.00	10,894,000
山陽電気鉄道	3,000	422.00	1,266,000
日本通運	29,000	440.00	12,760,000
ヤマトホールディングス	13,300	2,037.50	27,098,750
山九	9,000	517.00	4,653,000
丸全昭和運輸	1,000	333.00	333,000
センコー	3,000	451.00	1,353,000
日本梱包運輸倉庫	2,200	1,722.00	3,788,400
福山通運	4,000	526.00	2,104,000
セイノーホールディングス	5,000	799.00	3,995,000
神奈川中央交通	1,000	531.00	531,000
日立物流	1,500	1,364.00	2,046,000
日本郵船	61,000	260.00	15,860,000
商船三井	41,000	320.00	13,120,000
川崎汽船	32,000	222.00	7,104,000
N S ユナイテッド海運	5,000	235.00	1,175,000
飯野海運	3,000	585.00	1,755,000
第一中央汽船	6,000	69.00	414,000
日本航空	12,200	2,750.00	33,550,000
A N A ホールディングス	142,000	239.30	33,980,600
スカイマーク	900	220.00	198,000
トランコム	400	4,425.00	1,770,000
日新	7,000	256.00	1,792,000
三菱倉庫	5,000	1,439.00	7,195,000
三井倉庫ホールディングス	4,000	381.00	1,524,000
住友倉庫	5,000	552.00	2,760,000
澁澤倉庫	2,000	324.00	648,000
東陽倉庫	8,000	260.00	2,080,000

東洋埠頭	1,000	197.00	197,000
上組	9,000	948.00	8,532,000
郵船ロジスティクス	1,100	1,021.00	1,123,100
近鉄エクスプレス	600	3,975.00	2,385,000
N E C ネットエスアイ	800	2,305.00	1,844,000
システナ	500	777.00	388,500
新日鉄住金ソリューションズ	600	3,075.00	1,845,000
I T ホールディングス	2,600	1,717.00	4,464,200
グリーン	4,300	737.00	3,169,100
コーエーテックモホールディングス	1,400	1,629.00	2,280,600
三菱総合研究所	200	2,546.00	509,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	500	903.00	451,500
ネクソン	6,800	904.00	6,147,200
ブロードリーフ	600	1,646.00	987,600
G M O ペイメントゲートウェイ	600	2,065.00	1,239,000
ザッパラス	1,100	598.00	657,800
インターネットイニシアティブ	1,000	1,955.00	1,955,000
ビットアイル	400	506.00	202,400
S R A ホールディングス	200	1,493.00	298,600
野村総合研究所	4,000	3,345.00	13,380,000
フジ・メディア・ホールディングス	6,900	1,446.00	9,977,400
オービック	2,500	3,610.00	9,025,000
ジャストシステム	700	841.00	588,700
ヤフー	51,200	403.00	20,633,600
トレンドマイクロ	3,800	3,390.00	12,882,000
日本オラクル	1,100	4,080.00	4,488,000
フューチャーアーキテクト	500	610.00	305,000
オービックビジネスコンサルタント	400	3,310.00	1,324,000
伊藤忠テクノソリューションズ	800	4,240.00	3,392,000
アイティフォー	3,800	452.00	1,717,600
大塚商会	1,900	4,115.00	7,818,500
サイボウズ	600	327.00	196,200
C I J	4,700	474.00	2,227,800
WOWOW	400	4,245.00	1,698,000
ネットワンシステムズ	2,700	599.00	1,617,300
アルゴグラフィックス	1,100	1,921.00	2,113,100
マーベラス	1,500	1,133.00	1,699,500
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,300	1,505.00	1,956,500
日本ユニシス	1,700	899.00	1,528,300
東京放送ホールディングス	3,900	1,109.00	4,325,100
日本テレビホールディングス	7,100	1,536.00	10,905,600

テレビ朝日ホールディングス	1,800	1,566.00	2,818,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	5,400	604.00	3,261,600	
テレビ東京ホールディングス	900	2,179.00	1,961,100	
コネクシオ	1,400	1,113.00	1,558,200	
日本電信電話	28,100	6,362.00	178,772,200	代用有価証券 3,200株
K D D I	22,200	6,410.00	142,302,000	
光通信	600	6,710.00	4,026,000	
N T T ドコモ	58,900	1,696.50	99,923,850	
G M O インターネット	2,400	859.00	2,061,600	
K A D O K A W A ・ D W A N G O	1,600	1,892.00	3,027,200	
学研ホールディングス	4,000	242.00	968,000	
ゼンリン	1,600	1,174.00	1,878,400	
松竹	5,000	961.00	4,805,000	
東宝	5,100	2,271.00	11,582,100	
東映	3,000	542.00	1,626,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	5,000	3,755.00	18,775,000	
D T S	900	2,139.00	1,925,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,600	2,134.00	5,548,400	
カプコン	1,800	1,591.00	2,863,800	
ジャステック	700	829.00	580,300	
S C S K	1,700	2,759.00	4,690,300	
アイネス	2,200	865.00	1,903,000	
T K C	600	2,016.00	1,209,600	
富士ソフト	1,000	2,454.00	2,454,000	
N S D	1,500	1,587.00	2,380,500	
コナミ	3,200	2,072.00	6,630,400	
J B C C ホールディングス	800	724.00	579,200	
ソフトバンク	35,100	7,230.00	253,773,000	
高千穂交易	2,000	998.00	1,996,000	
J A L U X	400	1,270.00	508,000	
双日	47,800	153.00	7,313,400	
アルフレッサ ホールディングス	8,500	1,355.00	11,517,500	
横浜冷凍	1,800	782.00	1,407,600	
アルコニックス	400	1,351.00	540,400	
あい ホールディングス	1,100	1,954.00	2,149,400	
ダイワポウホールディングス	8,000	202.00	1,616,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,000	886.00	886,000	
U K C ホールディングス	800	1,659.00	1,327,200	
T O K A I ホールディングス	5,600	494.00	2,766,400	
三洋貿易	300	1,294.00	388,200	
シップヘルスケアホールディングス	1,000	2,575.00	2,575,000	

小野建	500	1,109.00	554,500	
ナガイレーベン	1,000	1,915.00	1,915,000	
三菱食品	800	2,224.00	1,779,200	
メディバルホールディングス	7,100	1,161.00	8,243,100	
S P K	1,000	1,867.00	1,867,000	
アズワン	500	3,250.00	1,625,000	
ドウシシャ	1,400	1,890.00	2,646,000	
黒田電気	1,200	1,511.00	1,813,200	
エクセル	800	1,168.00	934,400	
ガリバーインターナショナル	2,400	832.00	1,996,800	
進和	400	1,269.00	507,600	
シークス	600	1,791.00	1,074,600	
マクニカ	600	3,080.00	1,848,000	
伊藤忠商事	57,000	1,212.50	69,112,500	
丸紅	62,500	672.70	42,043,750	
長瀬産業	4,000	1,291.00	5,164,000	
豊田通商	8,000	2,446.00	19,568,000	
兼松	15,000	156.00	2,340,000	
三井物産	64,600	1,559.00	100,711,400	
日本紙パルプ商事	4,000	308.00	1,232,000	
日立ハイテクノロジーズ	2,200	2,990.00	6,578,000	
スターゼン	2,000	308.00	616,000	
山善	2,700	810.00	2,187,000	
住友商事	42,200	1,114.50	47,031,900	
三菱商事	54,700	2,011.00	110,001,700	代用有価証券 5,200株
第一実業	5,000	545.00	2,725,000	
キャノンマーケティングジャパン	2,000	1,922.00	3,844,000	
菱洋エレクトロ	1,400	997.00	1,395,800	
ユアサ商事	700	1,958.00	1,370,600	
阪和興業	7,000	373.00	2,611,000	
菱電商事	3,000	764.00	2,292,000	
岩谷産業	8,000	704.00	5,632,000	
すてきナイスグループ	6,000	195.00	1,170,000	
昭光通商	11,000	152.00	1,672,000	
三愛石油	3,000	678.00	2,034,000	
稲畑産業	1,700	972.00	1,652,400	
ワキタ	1,400	1,143.00	1,600,200	
東邦ホールディングス	2,300	1,755.00	4,036,500	
サンゲツ	1,300	2,602.00	3,382,600	
サンリオ	1,800	2,937.00	5,286,600	
リョーサン	1,100	2,211.00	2,432,100	

トーホー	2,000	401.00	802,000
東陽テクニカ	1,700	1,044.00	1,774,800
モスフードサービス	900	2,111.00	1,899,900
加賀電子	1,200	1,179.00	1,414,800
ソーダニッカ	1,000	447.00	447,000
P a l t a c	1,000	1,300.00	1,300,000
太平洋興発	3,000	89.00	267,000
ヤマタネ	11,000	163.00	1,793,000
日鉄住金物産	5,000	374.00	1,870,000
トラスコ中山	800	2,705.00	2,164,000
オートバックスセブン	2,400	1,595.00	3,828,000
加藤産業	1,000	2,139.00	2,139,000
イエローハット	800	2,337.00	1,869,600
杉本商事	1,400	1,015.00	1,421,000
因幡電機産業	1,000	3,485.00	3,485,000
ミスミグループ本社	2,900	2,964.00	8,595,600
スズケン	3,000	2,871.00	8,613,000
ローソン	2,900	7,020.00	20,358,000
サンエー	500	3,450.00	1,725,000
エービーシー・マート	1,000	5,920.00	5,920,000
アスクル	700	2,042.00	1,429,400
ゲオホールディングス	500	957.00	478,500
アダストリアホールディングス	600	2,399.00	1,439,400
くらコーポレーション	500	2,987.00	1,493,500
パル	600	3,245.00	1,947,000
エディオン	3,300	757.00	2,498,100
アルペン	200	1,616.00	323,200
ジェイアイエヌ	500	2,378.00	1,189,000
ビックカメラ	3,100	1,055.00	3,270,500
D C Mホールディングス	3,500	727.00	2,544,500
M o n o t a R O	1,400	2,502.00	3,502,800
J . フロント リテイリング	8,400	1,334.00	11,205,600
ドトール・日レスホールディングス	1,300	1,617.00	2,102,100
マツモトキヨシホールディングス	1,500	2,982.00	4,473,000
スタートトゥデイ	2,200	2,158.00	4,747,600
物語コーポレーション	100	3,505.00	350,500
ココカラファイン	700	2,759.00	1,931,300
三越伊勢丹ホールディングス	14,200	1,316.00	18,687,200
ウエルシアホールディングス	600	3,400.00	2,040,000
クリエイトSDホールディングス	500	3,730.00	1,865,000
チムニー	100	2,175.00	217,500
コスモス薬品	400	14,270.00	5,708,000

セブン&アイ・ホールディングス	29,900	3,953.50	118,209,650	
ツルハホールディングス	1,400	5,960.00	8,344,000	
サンマルクホールディングス	400	5,740.00	2,296,000	
クスリのアオキ	400	4,730.00	1,892,000	
総合メディカル	300	4,995.00	1,498,500	
カップ・クリエイトホールディングス	2,100	1,116.00	2,343,600	
良品計画	800	13,660.00	10,928,000	
コナカ	1,600	594.00	950,400	
コーナン商事	1,000	1,186.00	1,186,000	
ワタミ	800	1,240.00	992,000	
ドンキホーテホールディングス	2,500	6,180.00	15,450,000	
西松屋チェーン	2,300	935.00	2,150,500	
ゼンショーホールディングス	3,300	977.00	3,224,100	
幸楽苑	1,500	1,379.00	2,068,500	
サイゼリヤ	1,100	1,533.00	1,686,300	
ユナイテッドアローズ	900	3,725.00	3,352,500	
ハイデイ日高	800	3,010.00	2,408,000	
京都きもの友禅	2,300	998.00	2,295,400	
コロワイド	2,400	1,285.00	3,084,000	
壱番屋	400	5,120.00	2,048,000	
スギホールディングス	1,300	4,290.00	5,577,000	
ヨンドシーホールディングス	900	1,993.00	1,793,700	
ファミリーマート	2,400	4,060.00	9,744,000	
木曽路	900	1,884.00	1,695,600	
サトレストランシステムズ	1,700	796.00	1,353,200	
千趣会	2,400	853.00	2,047,200	
上新電機	2,000	912.00	1,824,000	
日本瓦斯	1,100	2,592.00	2,851,200	
ロイヤルホールディングス	1,200	1,716.00	2,059,200	
島忠	1,700	2,502.00	4,253,400	
チヨダ	800	1,941.00	1,552,800	
ライフコーポレーション	500	1,687.00	843,500	
カスミ	3,400	995.00	3,383,000	
リンガーハット	1,500	1,660.00	2,490,000	
AOKIホールディングス	1,200	1,195.00	1,434,000	
オークワ	1,000	893.00	893,000	
コメリ	1,100	2,293.00	2,522,300	
青山商事	1,800	2,527.00	4,548,600	
しまむら	800	9,560.00	7,648,000	
高島屋	10,000	868.00	8,680,000	
松屋	1,400	1,266.00	1,772,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,900	1,708.00	4,953,200	

近鉄百貨店	3,000	283.00	849,000
ニッセンホールディングス	1,400	338.00	473,200
丸井グループ	9,300	828.00	7,700,400
井筒屋	9,000	62.00	558,000
ダイエー	8,800	117.00	1,029,600
イオン	28,500	1,026.00	29,241,000
ユニーグループ・ホールディングス	6,800	540.00	3,672,000
イズミ	1,600	3,465.00	5,544,000
東武ストア	10,000	278.00	2,780,000
平和堂	1,400	1,872.00	2,620,800
フジ	800	1,983.00	1,586,400
ヤオコー	400	6,660.00	2,664,000
ゼビオ	900	1,643.00	1,478,700
ケーズホールディングス	1,500	3,135.00	4,702,500
アインファーマシーズ	800	2,636.00	2,108,800
ヤマダ電機	28,200	326.00	9,193,200
アークランドサカモト	800	2,310.00	1,848,000
ニトリホールディングス	2,800	6,470.00	18,116,000
吉野家ホールディングス	1,900	1,239.00	2,354,100
サガミチェーン	2,000	1,011.00	2,022,000
関西スーパーマーケット	700	768.00	537,600
王将フードサービス	500	4,010.00	2,005,000
プレナス	800	1,995.00	1,596,000
ミニストップ	400	1,526.00	610,400
アークス	1,200	2,211.00	2,653,200
パロー	1,500	1,663.00	2,494,500
ベルク	800	3,110.00	2,488,000
ファーストリテイリング	1,400	37,905.00	53,067,000
サンドラッグ	1,500	4,595.00	6,892,500
じもとホールディングス	8,500	198.00	1,683,000
足利ホールディングス	3,700	394.00	1,457,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	600	3,240.00	1,944,000
新生銀行	62,000	217.00	13,454,000
あおぞら銀行	37,000	374.00	13,838,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	541,300	570.40	308,757,520
りそなホールディングス	67,900	589.90	40,054,210
三井住友トラスト・ホールディングス	140,000	396.70	55,538,000
三井住友フィナンシャルグループ	54,000	3,963.00	214,002,000
第四銀行	9,000	353.00	3,177,000
北越銀行	8,000	200.00	1,600,000
西日本シティ銀行	25,000	253.00	6,325,000
千葉銀行	28,000	695.00	19,460,000

横浜銀行	46,000	554.60	25,511,600	
常陽銀行	26,000	490.00	12,740,000	
群馬銀行	16,000	579.00	9,264,000	
武蔵野銀行	1,100	3,190.00	3,509,000	
千葉興業銀行	2,800	692.00	1,937,600	
筑波銀行	5,100	334.00	1,703,400	
七十七銀行	11,000	530.00	5,830,000	
青森銀行	5,000	302.00	1,510,000	
秋田銀行	5,000	279.00	1,395,000	
山形銀行	4,000	463.00	1,852,000	
岩手銀行	500	4,355.00	2,177,500	
東邦銀行	6,000	357.00	2,142,000	
東北銀行	18,000	146.00	2,628,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	29,000	478.00	13,862,000	
静岡銀行	21,000	993.00	20,853,000	
十六銀行	9,000	360.00	3,240,000	
スルガ銀行	7,000	1,980.00	13,860,000	
八十二銀行	13,000	582.00	7,566,000	
山梨中央銀行	5,000	425.00	2,125,000	
大垣共立銀行	9,000	274.00	2,466,000	
福井銀行	6,000	236.00	1,416,000	
北國銀行	8,000	340.00	2,720,000	
清水銀行	200	2,578.00	515,600	
滋賀銀行	7,000	536.00	3,752,000	
南都銀行	7,000	393.00	2,751,000	
百五銀行	6,000	411.00	2,466,000	
京都銀行	14,000	820.00	11,480,000	
紀陽銀行	2,800	1,390.00	3,892,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	49,000	191.00	9,359,000	
広島銀行	21,000	476.00	9,996,000	
山陰合同銀行	4,000	759.00	3,036,000	
中国銀行	5,100	1,401.00	7,145,100	
鳥取銀行	7,000	200.00	1,400,000	
伊予銀行	7,600	998.00	7,584,800	
百十四銀行	8,000	320.00	2,560,000	
阿波銀行	6,000	593.00	3,558,000	
鹿児島銀行	5,000	627.00	3,135,000	
大分銀行	4,000	365.00	1,460,000	
宮崎銀行	5,000	293.00	1,465,000	
肥後銀行	6,000	559.00	3,354,000	
佐賀銀行	3,000	226.00	678,000	
十八銀行	8,000	266.00	2,128,000	

沖縄銀行	500	4,325.00	2,162,500
琉球銀行	1,400	1,615.00	2,261,000
セブン銀行	26,800	410.00	10,988,000
みずほフィナンシャルグループ	928,900	184.70	171,567,830
高知銀行	2,000	131.00	262,000
山口フィナンシャルグループ	7,000	924.00	6,468,000
長野銀行	4,000	183.00	732,000
名古屋銀行	6,000	369.00	2,214,000
北洋銀行	10,800	381.00	4,114,800
愛知銀行	300	4,835.00	1,450,500
京葉銀行	6,000	500.00	3,000,000
関西アーバン銀行	1,000	1,151.00	1,151,000
栃木銀行	4,000	384.00	1,536,000
東和銀行	19,000	93.00	1,767,000
福島銀行	20,000	82.00	1,640,000
大東銀行	14,000	130.00	1,820,000
トモニホールディングス	5,500	416.00	2,288,000
フィデアホールディングス	6,900	193.00	1,331,700
池田泉州ホールディングス	5,400	521.00	2,813,400
F P G	500	944.00	472,000
S B Iホールディングス	8,600	1,052.00	9,047,200
日本アジア投資	11,000	69.00	759,000
ジャフコ	1,000	3,880.00	3,880,000
大和証券グループ本社	71,000	764.80	54,300,800
野村ホールディングス	146,000	597.50	87,235,000
岡三証券グループ	6,000	756.00	4,536,000
丸三証券	2,100	748.00	1,570,800
東洋証券	5,000	273.00	1,365,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	7,600	684.00	5,198,400
水戸証券	3,700	361.00	1,335,700
いちよし証券	1,400	1,186.00	1,660,400
松井証券	3,600	944.00	3,398,400
マネックスグループ	7,800	249.00	1,942,200
カブドットコム証券	2,800	508.00	1,422,400
極東証券	900	1,714.00	1,542,600
岩井コスモホールディングス	800	1,036.00	828,800
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	15,900	2,435.50	38,724,450
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	21,300	2,158.00	45,965,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	6,800	1,618.00	11,002,400
第一生命保険	42,600	1,469.50	62,600,700
東京海上ホールディングス	27,700	3,195.50	88,515,350

T & Dホールディングス	24,500	1,262.00	30,919,000
全国保証	1,700	3,235.00	5,499,500
クレディセゾン	5,800	1,956.00	11,344,800
芙蓉総合リース	700	3,935.00	2,754,500
興銀リース	1,200	2,415.00	2,898,000
東京センチュリーリース	1,700	2,586.00	4,396,200
日本証券金融	3,100	576.00	1,785,600
アイフル	13,000	363.00	4,719,000
リコーリース	500	2,821.00	1,410,500
イオンフィナンシャルサービス	4,200	2,037.00	8,555,400
アコム	14,300	316.00	4,518,800
ジャックス	4,000	543.00	2,172,000
オリエントコーポレーション	16,500	188.00	3,102,000
日立キャピタル	1,400	2,396.00	3,354,400
オリックス	44,600	1,353.50	60,366,100
三菱UFJリース	18,100	519.00	9,393,900
日本取引所グループ	10,500	2,285.00	23,992,500
イー・ギャランティ	200	1,634.00	326,800
NECキャピタルソリューション	100	1,841.00	184,100
日本駐車場開発	12,600	115.00	1,449,000
ヒューリック	12,100	1,059.00	12,813,900
野村不動産ホールディングス	4,700	1,674.00	7,867,800
常和ホールディングス	400	3,690.00	1,476,000
フージャースホールディングス	2,000	462.00	924,000
東急不動産ホールディングス	15,800	681.00	10,759,800
飯田グループホールディングス	3,100	1,121.00	3,475,100
パーク24	3,800	1,617.00	6,144,600
三井不動産	37,000	2,960.50	109,538,500
三菱地所	50,000	2,263.00	113,150,000
平和不動産	1,400	1,581.00	2,213,400
東京建物	16,000	801.00	12,816,000
ダイビル	2,100	1,147.00	2,408,700
住友不動産	17,000	3,457.00	58,769,000
大京	12,000	182.00	2,184,000
テーオーシー	2,500	644.00	1,610,000
レオパレス21	8,200	574.00	4,706,800
フジ住宅	3,000	578.00	1,734,000
空港施設	500	702.00	351,000
住友不動産販売	500	2,328.00	1,164,000
ゴールドクレスト	700	1,801.00	1,260,700
タカラレーベン	3,900	409.00	1,595,100
イオンモール	4,600	1,847.00	8,496,200

トーセイ	1,300	659.00	856,700
エヌ・ティ・ティ都市開発	4,400	1,038.00	4,567,200
サンフロンティア不動産	900	1,139.00	1,025,100
日本空港ビルデング	2,500	3,870.00	9,675,000
日本工営	3,000	429.00	1,287,000
ネクスト	800	631.00	504,800
日本M&Aセンター	1,200	3,070.00	3,684,000
アコーディア・ゴルフ	3,100	1,093.00	3,388,300
タケエイ	200	1,017.00	203,400
エス・エム・エス	600	2,724.00	1,634,400
テンプホールディングス	1,700	3,180.00	5,406,000
クックパッド	500	3,310.00	1,655,000
総合警備保障	2,800	2,258.00	6,322,400
カカクコム	4,500	1,542.00	6,939,000
新日本科学	900	790.00	711,000
ツクイ	1,300	1,044.00	1,357,200
エムスリー	5,100	1,706.00	8,700,600
ディー・エヌ・エー	4,100	1,305.00	5,350,500
博報堂DYホールディングス	10,500	968.00	10,164,000
ぐるなび	1,100	1,388.00	1,526,800
一休	1,000	1,362.00	1,362,000
ファンコミュニケーションズ	1,300	1,013.00	1,316,900
PGMホールディングス	1,800	1,034.00	1,861,200
バリューコマース	200	693.00	138,600
J Pホールディングス	2,300	389.00	894,700
イーピーエス	1,300	1,329.00	1,727,700
ケネディクス	10,700	417.00	4,461,900
電通	7,100	3,715.00	26,376,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,061.00	530,500
みらかホールディングス	2,000	4,240.00	8,480,000
アルプス技研	1,000	1,225.00	1,225,000
サニックス	1,100	470.00	517,000
オリエンタルランド	2,000	20,710.00	41,420,000
ダスキン	2,000	1,720.00	3,440,000
明光ネットワークジャパン	1,600	1,148.00	1,836,800
ファルコホールディングス	200	1,138.00	227,600
ラウンドワン	2,100	680.00	1,428,000
リゾートトラスト	2,600	2,436.00	6,333,600
ビー・エム・エル	500	2,927.00	1,463,500
もしもしホットライン	1,400	1,017.00	1,423,800
ユー・エス・エス	9,200	1,527.00	14,048,400
楽天	32,800	1,186.00	38,900,800

セントラルスポーツ	400	1,714.00	685,600	
リブセンス	300	786.00	235,800	
リロ・ホールディング	300	7,160.00	2,148,000	
エイチ・アイ・エス	1,200	2,568.00	3,081,600	
共立メンテナンス	400	4,360.00	1,744,000	
イチネンホールディングス	2,900	850.00	2,465,000	
建設技術研究所	500	1,655.00	827,500	
東京テアトル	8,000	135.00	1,080,000	
よみうりランド	3,000	440.00	1,320,000	
東京都競馬	5,000	290.00	1,450,000	
常磐興産	11,000	138.00	1,518,000	
カナモト	1,100	3,955.00	4,350,500	
東京ドーム	6,000	413.00	2,478,000	
西尾レントオール	600	3,880.00	2,328,000	
トランス・コスモス	1,000	1,976.00	1,976,000	
乃村工藝社	2,100	975.00	2,047,500	
藤田観光	1,000	341.00	341,000	
トーカイ	600	3,260.00	1,956,000	
セコム	7,900	5,948.00	46,989,200	
セントラル警備保障	900	1,130.00	1,017,000	
丹青社	1,100	858.00	943,800	
メイテック	1,000	3,190.00	3,190,000	
アサツー ディ・ケイ	1,400	2,539.00	3,554,600	
応用地質	1,100	1,811.00	1,992,100	
船井総研ホールディングス	2,800	972.00	2,721,600	
ベネッセホールディングス	2,500	3,355.00	8,387,500	
イオンディライト	700	2,476.00	1,733,200	
ニチイ学館	1,600	768.00	1,228,800	
ダイセキ	1,100	1,768.00	1,944,800	
合 計	11,707,300		12,646,969,850	

(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26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	326,732,559	331,031,630
コール・ローン	12,286,917	10,605,070
株式	12,284,157,139	11,406,730,598
投資信託受益証券	1,870,796	1,952,808
投資証券	280,862,620	283,941,608
派生商品評価勘定	2,282,412	7,047
未収入金	3,152,953	3,142,440
未収配当金	19,183,722	10,226,360
未収利息	13	9
差入委託証拠金	276,206,548	144,906,526
流動資産合計	13,206,735,679	12,192,544,096
資産合計		
	13,206,735,679	12,192,544,096
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,234,347	25,098,571
未払金	7,188,914	-
未払解約金	-	4,000,000
流動負債合計	9,423,261	29,098,571
負債合計		
	9,423,261	29,098,571
純資産の部		
元本等		
元本	8,292,700,405	7,489,665,114
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,904,612,013	4,673,780,411
元本等合計	13,197,312,418	12,163,445,525
純資産合計		
	13,197,312,418	12,163,445,525
負債純資産合計		
	13,206,735,679	12,192,544,096

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26年 4月22日 至 平成26年10月20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。 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	<p>受取配当金 (1) 株式及び投資証券 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 投資信託受益証券 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 8,292,700,405口	1. 計算日における受益権の総数 7,489,665,114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 1.5914円 (1万口当たり純資産額) (15,914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 1.6240円 (1万口当たり純資産額) (16,240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10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左

2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスク、為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・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26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,636,167,385円	8,292,700,405円
期中追加設定元本額	334,853,184円	93,351,001円
期中一部解約元本額	1,678,320,164円	896,386,292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	715,179,800円	631,083,609円
新光外国株式インデックスVA	3,726,380,709円	3,417,844,015円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	849,466,897円	802,745,348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）	705,663,211円	617,545,402円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	377,456,738円	241,075,858円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,229,889,070円	1,147,597,833円

ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	677,365,670円	617,160,659円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）	- 円	3,902,699円
グローバル・ナビ	11,298,310円	10,709,691円
合計	8,292,700,405円	7,489,665,114円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	495,395,736	307,635,025
投資信託受益証券	124,720	130,187
投資証券	14,392,043	26,512,151
合計	509,663,059	334,016,989

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

種類	平成26年 4月21日現在				平成26年10月20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	606,776,756	-	606,755,127	21,629	450,546,519	-	425,399,738	25,146,781
S&P500 EMINI	401,321,569	-	400,498,213	823,356	253,512,025	-	241,858,980	11,653,045
S&P/TSE 601X	15,308,337	-	15,366,450	58,113	33,254,640	-	31,106,274	2,148,366
DJ EURO ST50	74,519,415	-	74,640,487	121,072	61,573,397	-	56,436,450	5,136,947
LIFFE FTSE	67,929,959	-	68,009,081	79,122	69,524,252	-	64,973,986	4,550,266
SWISS MKT IX	28,669,704	-	29,009,502	339,798	19,894,727	-	18,717,098	1,177,629
OMXS30 INDEX	6,188,368	-	6,196,770	8,402	-	-	-	-
SPI 200	12,839,404	-	13,034,624	195,220	12,787,478	-	12,306,950	480,528
合計	606,776,756	-	606,755,127	21,629	450,546,519	-	425,399,738	25,146,781

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26年 4月21日現在				平成26年10月20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	-	-	-	-	20,050,885	-	20,043,838	7,047
米ドル	-	-	-	-	18,217,285	-	18,213,800	3,485
スウェーデンクロー ナ	-	-	-	-	1,833,600	-	1,830,038	3,562
合計	-	-	-	-	20,050,885	-	20,043,838	7,047

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	1,937	88.52	171,463.24	
	ANTERO RESOURCES CORPORATION	240	50.21	12,050.40	
	APACHE CORP	1,516	72.85	110,440.60	
	BAKER HUGHES INC	1,674	53.13	88,939.62	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,582	30.95	48,962.90	
	CAMERON INTERNATIONAL CORPORATION	763	57.35	43,758.05	
	CHENIERE ENERGY INC	857	68.40	58,618.80	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	2,100	20.16	42,336.00	
	CHEVRON CORP	6,813	111.80	761,693.40	
	CIMAREX ENERGY CO	400	109.14	43,656.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	1,300	10.81	14,053.00	
	CONCHO RESOURCES INC	525	104.84	55,041.00	
	CONOCOPHILLIPS	4,711	68.08	320,724.88	
	CONSOL ENERGY INC	1,001	34.78	34,814.78	
	CONTINENTAL RESOURCES INC	400	55.78	22,312.00	
	CORE LABORATORIES NV	200	139.08	27,816.00	
	DENBURY RESOURCES INC	1,400	12.42	17,388.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,461	58.17	84,986.37	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC	300	37.03	11,109.00	
	ENERGEN CORPORATION	300	59.11	17,733.00	
	ENSCO PLC-CLASS A	945	37.78	35,702.10	
	EOG RESOURCES INC	2,110	91.22	192,474.20	
	EQT CORPORATION	610	83.42	50,886.20	
	EXXON MOBIL CORP	15,349	91.21	1,399,982.29	
	FMC TECHNOLOGIES INC	866	50.26	43,525.16	
	HALLIBURTON CO	3,233	52.60	170,055.80	
	HELMERICH & PAYNE INC	534	84.68	45,219.12	
	HESS CORPORATION	1,107	78.61	87,021.27	
	HOLLYFRONTIER CORPORATION	800	42.74	34,192.00	
	KINDER MORGAN INC	2,725	36.81	100,307.25	
	MARATHON OIL CORP	2,601	33.93	88,251.93	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	1,118	79.25	88,601.50	
	MURPHY OIL CORPORATION	693	51.46	35,661.78	
	NABORS INDUSTRIES LTD	1,246	17.74	22,104.04	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,733	70.44	122,072.52		
NOBLE CORPORATION PLC	1,108	19.50	21,606.00		
NOBLE ENERGY INC	1,354	56.59	76,622.86		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,963	88.36	261,810.68		
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	500	62.64	31,320.00		
ONEOK INC	772	57.36	44,281.92		

PEABODY ENERGY CORP	1,300	11.03	14,339.00
PHILLIPS 66	2,205	72.21	159,223.05
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	561	178.68	100,239.48
QEP RESOURCES INC	758	23.18	17,570.44
RANGE RESOURCES CORP	715	67.32	48,133.80
SCHLUMBERGER LIMITED	4,931	93.97	463,366.07
SOUTHWESTERN ENERGY CO	1,424	31.99	45,553.76
SPECTRA ENERGY CORPORATION	2,631	37.84	99,557.04
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	504	24.75	12,474.00
TESORO CORPORATION	471	60.38	28,438.98
VALERO ENERGY CORP	2,093	45.15	94,498.95
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	2,947	16.39	48,301.33
WHITING PETROLEUM CORPORATION	480	59.20	28,416.00
WILLIAMS COS INC	2,666	52.10	138,898.60
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	755	129.01	97,402.55
AIRGAS INC	300	109.25	32,775.00
ALBEMARLE CORPORATION	258	54.59	14,084.22
ALCOA INC	4,523	15.62	70,649.26
ASHLAND INC	300	100.42	30,126.00
AVERY DENNISON CORPORATION	429	43.13	18,502.77
BALL CORPORATION	456	65.03	29,653.68
CELANESE CORP-SERIES A	600	54.09	32,454.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	232	244.96	56,830.72
CROWN HOLDINGS INC	598	46.22	27,639.56
DOW CHEMICAL	4,609	46.05	212,244.45
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	3,549	66.98	237,712.02
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	600	75.14	45,084.00
ECOLAB INC	1,098	107.89	118,463.22
FMC CORPORATION	600	56.49	33,894.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	3,989	30.34	121,026.26
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	400	95.41	38,164.00
INTERNATIONAL PAPER CO	1,553	46.66	72,462.98
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	1,703	89.63	152,639.89
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	300	117.71	35,313.00
MEADWESTVACO CORPORATION	657	39.82	26,161.74
MONSANTO CO	2,028	111.28	225,675.84
NEWMONT MINING CORP	1,900	22.40	42,560.00
NUCOR CORP	1,188	49.91	59,293.08
OWENS-ILLINOIS INC	683	25.14	17,170.62
PPG INDUSTRIES INC	604	187.25	113,099.00
PRAXAIR INC	1,192	124.11	147,939.12
ROCK-TENN COMPANY-CL A	596	47.17	28,113.32

SEALED AIR CORPORATION	846	32.51	27,503.46
SIGMA-ALDRICH	508	134.03	68,087.24
THE MOSAIC COMPANY	1,300	40.76	52,988.00
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	364	217.01	78,991.64
VULCAN MATERIALS CO	500	59.09	29,545.00
WESTLAKE CHEMICAL CORPORATION	213	73.04	15,557.52
3M CO	2,389	137.40	328,248.60
AGCO CORPORATION	419	43.53	18,239.07
AMETEK INC	1,033	48.83	50,441.39
B/E AEROSPACE INC	366	76.83	28,119.78
BOEING CO	2,690	123.24	331,515.60
CATERPILLAR INC	2,276	95.05	216,333.80
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	439	48.08	21,107.12
CUMMINS INC	652	130.53	85,105.56
DANAHER CORP	2,399	74.79	179,421.21
DEERE & CO	1,272	83.29	105,944.88
DOVER CORP	722	74.51	53,796.22
EATON CORPORATION PLC	1,804	61.44	110,837.76
EMERSON ELECTRIC CO	2,749	61.22	168,293.78
FASTENAL CO	1,233	41.09	50,663.97
FLOWSERVE CORPORATION	600	64.96	38,976.00
FLUOR CORP	589	62.25	36,665.25
GENERAL DYNAMICS CORP	1,112	120.87	134,407.44
GENERAL ELECTRIC CO(US)	35,799	24.82	888,531.18
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,817	90.06	253,699.02
ILLINOIS TOOL WORKS	1,507	83.39	125,668.73
INGERSOLL-RAND PLC	1,078	56.48	60,885.44
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	500	45.96	22,980.00
JOY GLOBAL INC	431	52.17	22,485.27
KBR INC	394	18.08	7,123.52
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	400	110.63	44,252.00
LOCKHEED MARTIN CORP	1,102	176.24	194,216.48
MASCO CORP	1,600	21.67	34,672.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	754	124.44	93,827.76
PACCAR INC	1,433	58.40	83,687.20
PALL CORPORATION	500	82.15	41,075.00
PARKER HANNIFIN CORP	604	104.42	63,069.68
PENTAIR PLC	842	63.74	53,669.08
PRECISION CASTPARTS CORP	615	226.32	139,186.80
QUANTA SERVICES INC	896	31.48	28,206.08
RAYTHEON COMPANY	1,193	97.46	116,269.78
ROCKWELL AUTOMATION INC	600	105.17	63,102.00

ROCKWELL COLLINS INC.	475	76.25	36,218.75
ROPER INDUSTRIES INC	434	144.47	62,699.98
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	700	43.71	30,597.00
SPX CORP	206	87.87	18,101.22
STANLEY BLACK & DECKER INC	643	84.19	54,134.17
TEXTRON INC	1,100	36.65	40,315.00
TRANSDIGM GROUP INC	200	174.85	34,970.00
UNITED RENTALS INC	442	103.27	45,645.34
UNITED TECHNOLOGIES CORP	3,328	101.53	337,891.84
WW GRAINGER INC	255	231.90	59,134.50
XYLEM INC	784	34.21	26,820.64
CINTAS CORPORATION	441	69.29	30,556.89
DUN & BRADSTREET CORP	206	115.23	23,737.38
EQUIFAX INC	493	72.88	35,929.84
IHS INC-CLASS A	300	123.73	37,119.00
MANPOWER GROUP	281	60.91	17,115.71
NIELSEN NV	1,100	42.03	46,233.00
REPUBLIC SERVICES INC	1,225	38.20	46,795.00
ROBERT HALF INTL INC	607	47.07	28,571.49
STERICYCLE INC	400	118.33	47,332.00
THE ADT CORPORATION	673	32.83	22,094.59
TOWERS WATSON & COMPANY-CL A	297	102.66	30,490.02
TYCO INTERNATIONAL LIMITED	1,822	40.19	73,226.18
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	600	59.46	35,676.00
WASTE MANAGEMENT INC	1,683	46.72	78,629.76
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	823	33.38	27,471.74
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	574	67.98	39,020.52
CSX CORP	3,809	33.86	128,972.74
DELTA AIR LINES INC	800	34.39	27,512.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	900	39.60	35,640.00
FEDEX CORP	1,118	156.12	174,542.16
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,800	20.18	36,324.00
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	400	74.91	29,964.00
KANSAS CITY SOUTHERN	500	115.79	57,895.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,219	106.54	129,872.26
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	705	31.05	21,890.25
UNION PACIFIC CORP	3,528	106.40	375,379.20
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	400	44.68	17,872.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,697	97.26	262,310.22
AUTOLIV INC	407	91.97	37,431.79
BORGWARNER INC	900	54.98	49,482.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	1,234	63.09	77,853.06

FORD MOTOR CO	13,895	14.02	194,807.90
GENERAL MOTORS CO	4,943	30.24	149,476.32
HARLEY-DAVIDSON INC	876	58.63	51,359.88
JOHNSON CONTROLS INC	2,473	40.92	101,195.16
TESLA MOTORS INC	362	227.48	82,347.76
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORPORATION	495	100.50	49,747.50
COACH INC	1,135	34.49	39,146.15
DR HORTON INC	1,176	21.56	25,354.56
FOSSIL GROUP INC	200	96.99	19,398.00
GARMIN LIMITED	474	52.24	24,761.76
HASBRO INC	473	53.85	25,471.05
LEGGETT & PLATT INC	608	34.40	20,915.20
LENNAR CORPORATION-CLASS A	800	41.46	33,168.00
LULULEMON ATHLETICA INC	500	38.84	19,420.00
MATTEL INC	1,307	28.78	37,615.46
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	816	71.51	58,352.16
MOHAWK INDUSTRIES INC	257	128.83	33,109.31
NEWELL RUBBERMAID INC	1,100	33.33	36,663.00
NIKE INC -CL B	2,680	87.18	233,642.40
POLARIS INDUSTRIES INC	259	143.50	37,166.50
PULTEGROUP INC	1,201	18.23	21,894.23
PVH CORPORATION	341	110.75	37,765.75
RALPH LAUREN CORPORATION	256	156.25	40,000.00
TOLL BROTHERS INC	800	31.23	24,984.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	658	65.13	42,855.54
VF CORP	1,287	63.76	82,059.12
WHIRLPOOL CORP	347	150.04	52,063.88
CARNIVAL CORP(US)	1,482	34.92	51,751.44
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	129	641.72	82,781.88
DARDEN RESTAURANTS INC	570	48.68	27,747.60
H&R BLOCK INC	1,100	29.91	32,901.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	1,200	22.81	27,372.00
LAS VEGAS SANDS CORP	1,559	63.74	99,370.66
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	870	65.01	56,558.70
MCDONALD'S CORP	3,828	91.04	348,501.12
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,587	21.71	34,453.77
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	750	57.71	43,282.50
STARBUCKS CORP	2,850	73.54	209,589.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	808	75.50	61,004.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	481	76.24	36,671.44
WYNN RESORTS LTD	354	182.45	64,587.30
YUM! BRANDS INC	1,703	68.37	116,434.11

CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	900	17.43	15,687.00
CBS CORP-CLASS B	1,867	52.35	97,737.45
CHARTER COMMUNICATION INC-A	300	143.80	43,140.00
COMCAST CORP-CL A	8,146	50.68	412,839.28
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	1,702	50.65	86,206.30
DIRECTV	1,807	85.02	153,631.14
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	1,190	34.38	40,912.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	650	34.65	22,522.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	900	58.53	52,677.00
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	1,785	17.47	31,183.95
LIBERTY GLOBAL PLC-A	964	42.15	40,632.60
LIBERTY GLOBAL PLC-C	2,102	41.28	86,770.56
LIBERTY MEDIA CORPORATION	400	43.85	17,540.00
LIBERTY MEDIA CORPORATION-C	800	43.32	34,656.00
NEWS CORPRATION-CLASS A	1,325	14.71	19,490.75
OMNICOM GROUP	986	67.11	66,170.46
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	400	72.68	29,072.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	11,416	3.27	37,330.32
THE WALT DISNEY CO.	6,157	83.83	516,141.31
TIME WARNER CABLE INC	1,141	135.35	154,434.35
TIME WARNER INC	3,362	75.85	255,007.70
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	5,404	32.70	176,710.80
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	1,721	31.64	54,452.44
VIACOM INC-CLASS B	1,467	69.31	101,677.77
ADVANCE AUTO PARTS INC	319	135.79	43,317.01
AMAZON.COM INC	1,482	303.64	449,994.48
AUTONATION INC	255	49.30	12,571.50
AUTOZONE INC	136	507.59	69,032.24
BED BATH & BEYOND INC	769	63.10	48,523.90
BEST BUY CO INC	1,300	31.34	40,742.00
CARMAX INC	945	46.71	44,140.95
DICK'S SPORTING GOODS INC	457	43.28	19,778.96
DOLLAR GENERAL CORPORATION	1,244	59.95	74,577.80
DOLLAR TREE INC	842	56.57	47,636.15
EXPEDIA INC	385	74.57	28,709.45
FAMILY DOLLAR STORES	431	76.77	33,087.87
GAMESTOP CORP-CLASS A	500	39.86	19,930.00
GAP INC/THE	1,042	35.74	37,241.08
GENUINE PARTS CO	600	88.55	53,130.00
HOME DEPOT INC	5,200	90.24	469,248.00
KOHL'S CORP	771	56.54	43,592.34
L BRANDS INC	1,000	67.30	67,300.00

LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	1,941	24.10	46,778.10
LIBERTY VENTURES-SER A	275	30.11	8,280.25
LKQ CORPORATION	1,269	26.25	33,311.25
LOWE'S COS INC	3,950	52.51	207,414.50
MACY'S INC	1,392	56.21	78,244.32
NETFLIX INC	236	357.09	84,273.24
NORDSTROM INC	640	68.98	44,147.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	353	152.08	53,686.00
PETSMART INC	399	66.77	26,641.23
PRICELINE GROUP INC/THE	208	1,077.27	224,072.16
ROSS STORES INC	777	77.19	59,976.63
SEARS HOLDINGS CORP	169	28.41	4,801.29
SEARS HOLDINGS CORP-RIGHTS	169	0.34	57.46
STAPLES INC	2,889	11.92	34,436.88
TARGET CORP	2,331	59.07	137,692.17
TIFFANY & CO	518	88.84	46,019.12
TJX COMPANIES INC	2,695	60.40	162,778.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	600	58.83	35,298.00
TRIPADVISOR INC	500	81.05	40,525.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	284	116.57	33,105.88
URBAN OUTFITTERS INC	498	29.62	14,750.76
COSTCO WHOLESALE CORP	1,669	124.65	208,040.85
CVS HEALTH CORPORATION	4,418	79.96	353,263.28
KROGER CO	1,882	51.65	97,205.30
SAFEWAY INC	855	33.69	28,804.95
SYSCO CORP	2,210	36.50	80,665.00
WAL-MART STORES INC	6,089	74.10	451,194.90
WALGREEN CO	3,452	60.27	208,052.04
WHOLE FOODS MARKET INC	1,431	36.94	52,861.14
ALTRIA GROUP INC	7,496	45.66	342,267.36
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,488	44.50	110,716.00
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	450	85.72	38,574.00
BUNGE LIMITED	596	82.41	49,116.36
CAMPBELL SOUP COMPANY	825	42.04	34,683.00
COCA-COLA CO/THE	14,887	42.88	638,354.56
COCA-COLA ENTERPRISES INC	911	41.11	37,451.21
CONAGRA FOODS INC	1,646	33.65	55,387.90
CONSTELLATION BRANDS INC-A	700	84.05	58,835.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	790	63.09	49,841.10
GENERAL MILLS INC	2,367	49.29	116,669.43
HERSHEY CO/THE	627	92.01	57,690.27
HORMEL FOODS CORPORATION	598	50.17	30,001.66

KELLOGG COMPANY	1,073	60.92	65,367.16
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	535	137.71	73,674.85
KRAFT FOODS GROUP INC	2,319	54.99	127,521.81
LORILLARD INC	1,391	58.59	81,498.69
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	485	67.10	32,543.50
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	800	100.23	80,184.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	600	69.96	41,976.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	6,444	32.62	210,203.28
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	602	92.11	55,450.22
PEPSICO INC	5,808	91.51	531,490.08
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	5,985	86.00	514,710.00
REYNOLDS AMERICAN INC	1,328	58.48	77,661.44
THE JM SMUCKER COMPANY	426	98.66	42,029.16
TYSON FOODS INC-CL A	1,234	37.56	46,349.04
AVON PRODUCTS INC	1,516	11.25	17,055.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	586	68.38	40,070.68
CLOROX COMPANY	500	96.30	48,150.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,545	63.73	225,922.85
ENERGIZER HOLDINGS INC	300	115.24	34,572.00
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	908	72.18	65,539.44
HERBALIFE LIMITED	349	45.43	15,855.07
KIMBERLY-CLARK CORP	1,545	106.26	164,171.70
PROCTER & GAMBLE CO	9,675	83.27	805,637.25
ABBOTT LABORATORIES	5,659	40.86	231,226.74
AETNA INC	1,351	75.39	101,851.89
AMERISOURCEBERGEN CORP	876	75.84	66,435.84
BARD (C.R.) INC	342	145.27	49,682.34
BAXTER INTERNATIONAL INC.	2,095	67.24	140,867.80
BECTON DICKINSON & CO	821	121.73	99,940.33
BOSTON SCIENTIFIC CORP	4,979	11.37	56,611.23
CARDINAL HEALTH INC	1,282	73.62	94,380.84
CAREFUSION CORPORATION	855	56.34	48,170.70
CERNER CORPORATION	1,150	57.19	65,768.50
CIGNA CORP	1,096	89.04	97,587.84
COVIDIEN PLC	1,731	82.20	142,288.20
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	700	72.75	50,925.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	700	45.30	31,710.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	391	99.00	38,709.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	2,962	70.74	209,531.88
HCA HOLDINGS INC	1,200	69.44	83,328.00
HENRY SCHEIN INC	400	113.26	45,304.00
HOLOGIC INC	894	23.86	21,330.84

HUMANA INC	631	128.23	80,913.13
INTUITIVE SURGICAL INC	154	470.24	72,416.96
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	400	98.67	39,468.00
MCKESSON CORP	930	191.23	177,843.90
MEDTRONIC INC	3,838	61.99	237,917.62
OMNICARE INC	352	62.49	21,996.48
PATTERSON COMPANIES INC	448	40.42	18,108.16
QUEST DIAGNOSTICS	564	58.81	33,168.84
RESMED INC	604	46.77	28,249.08
ST JUDE MEDICAL INC	1,056	58.28	61,543.68
STRYKER CORP	1,279	80.28	102,678.12
UNITEDHEALTH GROUP INC	3,675	88.18	324,061.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	413	103.31	42,667.03
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	381	79.34	30,228.54
WELLPOINT INC	1,096	114.99	126,029.04
ZIMMER HOLDINGS INC	717	97.52	69,921.84
ABBVIE INC	6,039	53.37	322,301.43
ACTAVIS PLC	1,043	224.73	234,393.39
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,347	52.27	70,407.69
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	827	164.75	136,248.25
ALLERGAN INC	1,203	177.49	213,520.47
AMGEN INC	2,853	133.69	381,417.57
BIOGEN IDEC INC	856	306.71	262,543.76
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	592	70.45	41,706.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,265	50.42	315,881.30
CELGENE CORP	3,136	88.12	276,344.32
ELI LILLY & CO	3,804	62.58	238,054.32
ENDO INTERNATIONAL PLC	649	61.62	39,991.38
GILEAD SCIENCES INC	5,807	100.75	585,055.25
HOSPIRA INC	697	50.07	34,898.79
ILLUMINA INC	529	164.91	87,237.39
JOHNSON & JOHNSON	10,165	98.70	1,003,285.50
MERCK & CO. INC.	10,456	54.02	564,833.12
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	122	240.92	29,392.24
MYLAN INC	1,470	49.46	72,706.20
PERRIGO CO PLC	562	145.78	81,928.36
PFIZER INC	22,790	27.83	634,245.70
PHARMACYCLICS INC	283	112.21	31,755.43
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	267	55.30	14,765.10
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	327	369.64	120,872.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,463	112.36	164,382.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	900	102.35	92,115.00

WATERS CORP	400	96.98	38,792.00
ZOETIS INC	1,887	35.37	66,743.19
BANK OF AMERICA CORPORATION	37,525	16.21	608,280.25
BB&T CORPORATION	2,777	35.20	97,750.40
CIT GROUP INC	835	44.95	37,533.25
CITIGROUP INC	11,477	50.07	574,653.39
COMERICA INC	709	43.06	30,529.54
FIFTH THIRD BANCORP	3,224	18.13	58,451.12
FIRST REPUBLIC BANK/CA	500	47.19	23,595.00
HUDSON CITY BANCORP INC	1,800	8.88	15,984.00
JPMORGAN CHASE & CO	13,575	56.20	762,915.00
KEYCORP	3,630	12.35	44,830.50
M & T BANK CORP	500	112.86	56,430.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	1,557	14.99	23,339.43
OCWEN FINANCIAL CORPORATION	525	25.52	13,398.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	1,460	13.82	20,177.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,054	79.77	163,847.58
REGIONS FINANCIAL CORP	5,576	9.10	50,741.60
SUNTRUST BANKS INC	2,170	35.84	77,772.80
US BANCORP	6,892	39.40	271,544.80
WELLS FARGO & COMPANY	17,880	48.69	870,577.20
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	230	185.15	42,584.50
ALLY FINANCIAL INC	1,200	21.61	25,932.00
AMERICAN EXPRESS CO	3,603	82.58	297,535.74
AMERIPRISE FINANCIAL INC	787	112.30	88,380.10
BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	4,349	36.36	158,129.64
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	4,299	137.09	589,349.91
BLACKROCK INC	552	315.68	174,255.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,234	76.43	170,744.62
CME GROUP INC	1,243	78.26	97,277.18
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,846	62.45	115,282.70
EATON VANCE CORPORATION	529	35.61	18,837.69
FRANKLIN RESOURCES INC	1,646	51.71	85,114.66
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,643	176.91	290,663.13
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	487	196.61	95,749.07
INVESCO LIMITED	1,737	36.69	63,730.53
LEGG MASON INC	386	49.03	18,925.58
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,200	22.33	26,796.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	1,086	79.55	86,391.30
MOODY'S CORP	768	91.52	70,287.36
MORGAN STANLEY	5,624	33.22	186,829.28
NASDAQ OMX GROUP INC	539	40.16	21,646.24

NAVIENT CORPORATION	1,608	18.61	29,924.88
NORTHERN TRUST CORP	900	63.30	56,970.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	500	51.28	25,640.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	587	34.08	20,004.96
STATE STREET CORP	1,677	67.38	112,996.26
T ROWE PRICE GROUP INC	1,000	76.39	76,390.00
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	963	30.03	28,918.89
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	4,490	25.84	116,021.60
VOYA FINANCIAL INC	640	35.91	22,982.40
ACE LIMITED	1,276	104.61	133,482.36
AFLAC INC	1,767	57.01	100,736.67
ALLEGHANY CORPORATION	76	417.70	31,745.20
ALLSTATE CORP	1,660	60.64	100,662.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	5,162	50.76	262,023.12
AON PLC	1,058	80.97	85,666.26
ARCH CAPITAL GROUP LTD	584	54.37	31,752.08
ASSURANT INC	294	62.32	18,322.08
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	450	46.22	20,799.00
CHUBB CORP	1,019	92.89	94,654.91
CINCINNATI FINANCIAL CORP	600	46.81	28,086.00
EVEREST RE GROUP LTD	200	160.10	32,020.00
FNF GROUP	1,100	28.04	30,844.00
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	1,868	12.70	23,723.60
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,691	36.09	61,028.19
LINCOLN NATIONAL CORP	962	48.16	46,329.92
LOEWS CORPORATION	1,440	41.15	59,256.00
MARSH & MCLENNAN COS	2,121	50.63	107,386.23
METLIFE INC	3,644	48.86	178,045.84
PARTNERRE LTD	200	109.75	21,950.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,200	49.36	59,232.00
PROGRESSIVE CORP	2,215	24.76	54,843.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,766	81.06	143,151.96
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	200	98.44	19,688.00
TORCHMARK CORPORATION	525	51.31	26,937.75
TRAVELERS COS INC/THE	1,374	93.24	128,111.76
UNUM GROUP	953	32.74	31,201.22
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	732	40.29	29,492.28
WR BERKLEY CORP	500	48.22	24,110.00
XL GROUP PLC	1,145	32.24	36,914.80
CBRE GROUP INC	1,140	28.98	33,037.20
REALOGY HOLDINGS CORPORATION	600	36.86	22,116.00
ACCENTURE PLC	2,373	76.62	181,819.26

ACTIVISION BLIZZARD INC	1,910	18.85	36,003.50
ADOBE SYSTEMS INC	1,818	64.52	117,297.36
AKAMAI TECHNOLOGIES	700	53.84	37,688.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	225	259.72	58,437.00
ANSYS INC	400	72.99	29,196.00
AUTODESK INC	941	50.79	47,793.39
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,949	72.68	141,653.32
CA INC	1,349	26.35	35,546.15
CDK GLOBAL INC	649	26.67	17,308.83
CITRIX SYSTEMS INC	687	64.54	44,338.98
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	2,449	44.20	108,245.80
COMPUTER SCIENCES CORP	646	56.44	36,460.24
EBAY INC	4,316	47.95	206,952.20
ELECTRONIC ARTS INC	1,251	34.27	42,878.02
EQUINIX INC	200	206.37	41,275.00
FACEBOOK INC-A	7,469	75.95	567,270.55
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,080	53.41	57,682.80
FIREEYE INC	296	29.05	8,598.80
FISERV INC	1,044	62.77	65,531.88
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	316	133.30	42,122.80
GOOGLE INC-CL A	1,062	522.97	555,394.14
GOOGLE INC-CL C	1,062	511.17	542,862.54
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	3,486	182.05	634,626.30
INTUIT INC	1,096	81.03	88,808.88
LINKEDIN CORPORATION-A	418	195.96	81,911.28
MASTERCARD INC.-CLASS A	3,919	71.56	280,443.64
MICROSOFT CORP	28,069	43.63	1,224,650.47
NETSUITE INC	152	90.17	13,705.84
NUANCE COMMUNICATIONS INC	798	14.60	11,650.80
ORACLE CORPORATION	13,458	37.87	509,654.46
PAYCHEX INC	1,439	43.49	62,589.30
RACKSPACE HOSTING INC	600	35.02	21,012.00
RED HAT INC	828	55.69	46,111.32
SALESFORCE COM INC	2,194	55.63	122,052.22
SERVICENOW INC	460	60.38	27,774.80
SYMANTEC CORP	2,658	22.32	59,326.56
SYNOPSYS INC	700	37.83	26,481.00
TERADATA CORPORATION	567	42.29	23,978.43
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	746	29.29	21,850.34
TWITTER INC	1,338	48.77	65,254.26
VANTIV INC-CLASS A	561	30.77	17,261.97
VERISIGN INC	455	54.24	24,679.20

VISA INC-CLASS A SHARES	1,948	206.00	401,288.00
VMWARE INC-CLASS A	400	89.35	35,740.00
WESTERN UNION COMPANY	2,334	15.91	37,133.94
WORKDAY INC-CLASS A	401	82.97	33,270.97
XEROX CORPORATION	4,221	12.68	53,522.28
YAHOO! INC	3,601	38.45	138,458.45
AMPHENOL CORPORATION-CL A	1,192	48.03	57,251.76
APPLE INC	21,525	97.67	2,102,346.75
ARROW ELECTRONICS INC	430	49.46	21,267.80
AVNET INC	600	38.85	23,310.00
CISCO SYSTEMS INC	19,342	23.25	449,701.50
CORNING INC	4,976	17.75	88,324.00
EMC CORP/MASSACHUSETTS	7,830	27.11	212,271.30
F5 NETWORKS INC	328	113.70	37,293.60
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	2,460	8.89	21,869.40
FLIR SYSTEMS INC	573	29.05	16,645.65
HARRIS CORPORATION	500	64.23	32,115.00
HEWLETT-PACKARD COMPANY	7,179	34.16	245,234.64
JUNIPER NETWORKS INC	1,743	19.48	33,953.64
MOTOROLA SOLUTIONS INC	942	60.79	57,264.18
NETAPP INC	1,287	38.82	49,961.34
QUALCOMM INC	6,438	72.43	466,304.34
SANDISK CORP	854	82.80	70,711.20
SEAGATE TECHNOLOGY	1,304	52.95	69,046.80
TE CONNECTIVITY LIMITED	1,561	53.44	83,419.84
TRIMBLE NAVIGATION LIMITED	1,086	28.74	31,217.07
WESTERN DIGITAL CORPORATION	862	86.84	74,856.08
AT&T INC	18,608	34.08	634,160.64
CENTURYLINK INC	2,193	38.86	85,219.98
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	4,219	6.08	25,651.52
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	659	41.23	27,170.57
SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	520	108.30	56,316.00
SPRINT CORPORATION	3,109	6.03	18,747.27
T-MOBILE US INC	1,050	26.11	27,415.50
VERIZON COMMUNICATIONS INC	14,827	48.07	712,733.89
WINDSTREAM HOLDINGS INC	2,593	10.08	26,137.44
AES CORP	2,757	13.29	36,640.53
ALLIANT ENERGY CORP	469	58.07	27,234.83
AMEREN CORPORATION	1,008	39.67	39,987.36
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,872	54.61	102,229.92
AMERICAN WATER WORKS CO INC	700	49.60	34,720.00
CALPINE CORPORATION	1,400	20.70	28,980.00

CENTERPOINT ENERGY INC	1,581	23.17	36,631.77
CMS ENERGY CORPORATION	1,129	30.55	34,490.95
CONSOLIDATED EDISON INC	1,200	60.70	72,840.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	2,249	68.73	154,573.77
DTE ENERGY COMPANY	700	76.98	53,886.00
DUKE ENERGY CORPORATION	2,658	78.43	208,466.94
EDISON INTERNATIONAL	1,209	58.76	71,040.84
ENTERGY CORP	680	79.33	53,944.40
EXELON CORP	3,322	34.38	114,210.36
FIRSTENERGY CORP	1,629	34.74	56,591.46
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	428	68.72	29,412.16
MDU RESOURCES GROUP INC	800	26.09	20,872.00
NEXTERA ENERGY INC	1,696	94.25	159,848.00
NISOURCE INC	1,167	39.70	46,329.90
NORTHEAST UTILITIES	1,331	47.18	62,796.58
NRG ENERGY INC	1,366	28.21	38,534.86
OGE ENERGY CORPORATION	803	35.60	28,586.80
P G & E CORPORATION	1,819	44.70	81,309.30
PEPCO HOLDINGS INC	944	26.66	25,167.04
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	465	57.72	26,839.80
PPL CORPORATION	2,400	33.35	80,040.00
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	2,048	37.50	76,800.00
SCANA CORPORATION	600	51.35	30,810.00
SEMPRA ENERGY	940	103.36	97,158.40
SOUTHERN CO	3,369	46.22	155,715.18
WISCONSIN ENERGY CORPORATION	1,000	47.19	47,190.00
XCEL ENERGY INC	1,876	31.89	59,825.64
ALTERA CORPORATION	1,151	32.52	37,430.52
ANALOG DEVICES INC	1,159	44.94	52,085.46
APPLIED MATERIALS INC	4,574	19.88	90,931.12
AVAGO TECHNOLOGIES LIMITED	1,044	77.15	80,544.60
BROADCOM CORP-CL A	2,097	35.77	75,009.69
CREE INC	397	33.13	13,152.61
INTEL CORP	17,847	31.38	560,038.86
KLA-TENCOR CORPORATION	675	68.44	46,197.00
LAM RESEARCH CORP	700	69.19	48,433.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	948	39.09	37,057.32
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,274	12.15	15,479.10
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	1,100	26.26	28,886.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	900	38.39	34,551.00
MICRON TECHNOLOGY INC	4,058	28.76	116,728.37
NVIDIA CORP	2,301	17.42	40,083.42

	TEXAS INSTRUMENTS INC	4,231	43.67	184,767.77
	XILINX INC	1,126	41.05	46,222.30
	米ドル 建小計	1,181,604		65,700,617.87 (7,039,821,204)
カナダドル	ALTAGAS LIMITED	379	45.86	17,380.94
	ARC RESOURCES LIMITED	1,319	28.68	37,828.92
	ATHABASCA OIL CORPORATION	581	4.35	2,527.35
	BAYTEX ENERGY CORPORATION	525	35.70	18,742.50
	CAMECO CORP (CA)	1,672	18.59	31,082.48
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,995	38.65	154,406.75
	CANADIAN OIL SANDS LIMITED	1,828	18.00	32,904.00
	CENOVUS ENERGY INC	2,796	26.38	73,758.48
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,593	37.68	60,024.24
	ENBRIDGE INC	2,885	50.98	147,077.30
	ENCANA CORP	2,696	21.02	56,669.92
	ENERPLUS CORP	853	17.02	14,518.06
	HUSKY ENERGY INC	1,300	27.90	36,270.00
	IMPERIAL OIL LTD	1,097	51.45	56,440.65
	INTER PIPELINE LIMITED	1,290	34.90	45,021.00
	KEYERA CORP	355	89.45	31,754.75
	MEG ENERGY CORPORATION	585	28.73	16,807.05
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	1,299	15.93	20,693.07
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	1,267	45.40	57,521.80
	PENGROWTH ENERGY CORPORATION	2,500	4.68	11,700.00
	PENN WEST PETROLEUM LIMITED	1,438	5.42	7,793.96
	PEYTO EXPLORATION & DEVELOPMENT CORP	700	33.96	23,772.00
	SUNCOR ENERGY INC	5,127	37.73	193,441.71
	TALISMAN ENERGY INC	3,775	7.36	27,784.00
	TOURMALINE OIL CORPORATION	700	46.01	32,207.00
	TRANSCANADA CORPORATION	2,562	52.71	135,043.02
	VERMILION ENERGY INC	354	65.25	23,098.50
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	731	32.34	23,640.54
	AGRIUM INC	624	93.36	58,256.64
	BARRICK GOLD CORP	4,316	15.12	65,257.92
	ELDORADO GOLD CORPORATION	2,600	7.87	20,462.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	2,200	18.37	40,414.00
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	621	60.25	37,415.25
	GOLDCORP INC	3,034	25.85	78,428.90
	KINROSS GOLD CORP	4,830	3.28	15,842.40
	METHANEX CORPORATION	434	63.23	27,441.82
	NEW GOLD INC	2,400	4.99	11,976.00
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	3,094	36.00	111,384.00

SILVER WHEATON CORPORATION	1,309	21.97	28,758.73
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	2,097	17.65	37,012.05
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	1,800	3.73	6,714.00
YAMANA GOLD INC	3,600	6.24	22,464.00
BOMBARDIER INC 'B'	6,312	3.58	22,596.96
CAE INC	1,104	14.08	15,544.32
FINNING INTERNATIONAL INC	737	28.23	20,805.51
SNC-LAVALIN GROUP INC	641	47.88	30,691.08
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,806	73.60	206,521.60
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	741	224.99	166,717.59
MAGNA INTERNATIONAL INC	805	101.59	81,779.95
GILDAN ACTIVEWEAR INC	521	62.18	32,395.78
TIM HORTONS INC(CA)	460	87.27	40,144.20
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,491	27.29	40,689.39
THOMSON REUTERS CORP(CA)	1,433	39.99	57,305.67
CANADIAN TIRE CORP -CL A	326	117.50	38,305.00
DOLLARAMA INC	300	98.10	29,430.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,615	35.58	57,461.70
EMPIRE COMPANY LIMITED A	150	74.57	11,185.50
GEORGE WESTON LIMITED	200	86.91	17,382.00
LOBLAW COMPANIES LTD	913	53.97	49,274.61
METRO INC	371	74.54	27,654.34
SAPUTO INC	1,000	31.38	31,380.00
CATAMARAN CORPORATION	835	45.07	37,633.45
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	1,084	135.44	146,816.96
BANK OF MONTREAL	2,407	79.79	192,054.53
BANK OF NOVA SCOTIA	4,293	67.31	288,961.83
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,392	97.53	135,761.76
NATIONAL BANK OF CANADA	1,200	50.62	60,744.00
ROYAL BANK OF CANADA	5,033	78.82	396,701.06
TORONTO-DOMINION BANK(CA)	6,362	53.47	340,176.14
CI FINANCIAL CORPORATION	883	32.14	28,379.62
IGM FINANCIAL INC	293	43.70	12,804.10
ONEX CORPORATION	400	60.73	24,292.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	88	501.02	44,089.76
GREAT-WEST LIFECO INC	1,100	30.22	33,242.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	442	42.47	18,771.74
INTACT FINANCIAL CORPORATION	500	73.15	36,575.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	6,760	20.04	135,470.40
POWER CORP OF CANADA	1,529	28.64	43,790.56
POWER FINANCIAL CORP	873	31.80	27,761.40

	SUN LIFE FINANCIAL INC	2,250	38.09	85,702.50
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,235	51.17	114,364.95
	FIRST CAPITAL REALTY INC	500	17.86	8,930.00
	CGI GROUP INC -CL A	877	37.93	33,264.61
	OPEN TEXT CORPORATION	489	60.91	29,784.99
	BLACKBERRY LIMITED	1,900	10.70	20,330.00
	BCE INC	1,036	47.33	49,033.88
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,383	42.28	58,473.24
	TELUS CORPORATION	944	38.04	35,909.76
	ATCO LIMITED	194	46.06	8,935.64
	CANADIAN UTILITIES LTD A	528	38.88	20,528.64
	FORTIS INC	800	34.85	27,880.00
	TRANSALTA CORP	781	10.87	8,489.47
	カナダドル 建小計	150,478		5,434,656.89 (516,346,751)
ユーロ	ENI SPA	9,762	16.36	159,706.32
	FUGRO NV-CVA	345	20.34	7,019.02
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,322	11.29	14,925.38
	KONINKLIJKE VOPAK NV	307	39.71	12,190.97
	NESTE OIL OYJ	628	16.05	10,079.40
	OMV AG	644	23.79	15,323.98
	REPSOL SA	3,910	16.90	66,079.00
	SAIPEM	1,158	15.65	18,122.70
	TECHNIP S.A.	430	57.53	24,737.90
	TENARIS SA	1,812	14.99	27,161.88
	TOTAL SA	7,785	44.15	343,746.67
	AIR LIQUIDE SA	1,321	92.00	121,532.00
	AKZO NOBEL	921	50.21	46,243.41
	ARCELORMITTAL	3,835	9.77	37,471.78
	ARKEMA	220	48.36	10,640.30
	BASF SE	3,405	69.31	236,000.55
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	354	28.16	9,970.41
	HEIDELBERGCEMENT AG	541	51.76	28,002.16
	IMERYS SA	148	53.18	7,870.64
	K+S AG	727	19.96	14,514.55
	KONINKLIJKE DSM NV	674	45.08	30,383.92
	LAFARGE SA	756	50.96	38,525.76
	LANXESS AG	352	40.38	14,213.76
	LINDE AG	713	147.80	105,381.40
	SOLVAY SA	251	110.10	27,635.10
	STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	2,327	6.28	14,625.19
	THYSSENKRUPP AG	1,890	18.11	34,227.90

UMICORE	482	30.57	14,734.74
UPM-KYMMENE OYJ	2,142	10.88	23,304.96
VOESTALPINE AG	431	29.66	12,785.61
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	708	27.69	19,604.52
AIRBUS GROUP NV	2,256	43.96	99,173.76
ALSTOM	944	26.09	24,633.68
ANDRITZ AG	209	37.24	7,783.16
BOSKALIS WESTMINSTER NV	342	39.17	13,397.85
BOUYGUES SA	736	25.37	18,676.00
BRENTAG AG	675	36.27	24,485.62
CNH INDUSTRIAL NV	3,635	6.25	22,718.75
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,684	32.86	55,344.66
FERROVIAL SA	1,633	15.24	24,886.92
FINMECCANICA SPA	1,770	6.83	12,097.95
GEA GROUP AG	740	33.86	25,060.10
HOCHTIEF AG	66	57.30	3,781.80
KONE OYJ-B	1,201	31.95	38,371.95
KONINKLIJKE PHILIPS NV	3,796	22.06	83,758.74
LEGRAND SA	1,072	39.48	42,327.92
MAN SE	176	90.41	15,912.16
METSO OYJ	433	27.31	11,825.23
OCI NV	445	24.28	10,804.60
OSRAM LICHT AG	396	26.70	10,573.20
PRYSMIAN SPA	862	13.45	11,593.90
REXEL SA	1,041	13.77	14,339.77
SAFRAN SA	1,041	45.50	47,365.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,001	57.60	115,257.60
SIEMENS AG-REG	2,923	84.20	246,116.60
THALES SA	358	38.44	13,761.52
VALLOUREC SA	520	30.75	15,990.00
VINCI SA	1,856	43.80	81,292.80
WARTSILA OYJ-B SHARES	568	32.70	18,573.60
ZARDOYA OTIS SA	767	8.62	6,611.54
ZODIAC AEROSPACE	835	22.97	19,184.12
BUREAU VERITAS SA	849	17.47	14,832.03
EDENRED	781	20.95	16,361.95
RANDSTAD HOLDING NV	484	32.81	15,882.46
SOCIETE BIC SA	117	102.10	11,945.70
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	1,635	14.65	23,960.92
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	145	88.90	12,890.50
ATLANTIA SPA	1,710	17.69	30,249.90

BOLLORE	25	378.85	9,471.25
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	689	11.66	8,037.18
DEUTSCHE POST AG-REG	3,670	23.00	84,410.00
FRAPORT AG	208	48.35	10,056.80
GROUPE EUROTUNNEL SA	1,794	8.98	16,122.67
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	3,914	4.42	17,315.53
TNT EXPRESS NV	1,979	4.50	8,905.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,271	80.57	102,404.47
BMW-PFD	236	64.91	15,318.76
CONTINENTAL AG	423	151.65	64,147.95
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	3,697	59.35	219,416.95
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	3,696	7.20	26,629.68
MICHELIN (CGDE)-B	715	71.31	50,986.65
NOKIAN RENKAAT OYJ	580	24.74	14,349.20
PEUGEOT SA	1,503	9.27	13,940.32
PIRELLI & C SPA	1,006	10.52	10,583.12
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	620	61.89	38,371.80
RENAULT SA	738	54.47	40,198.86
VALEO SA	290	82.22	23,843.80
VOLKSWAGEN AG	134	161.95	21,701.30
VOLKSWAGEN AG-PFD	624	160.00	99,840.00
ADIDAS AG	803	54.64	43,875.92
CHRISTIAN DIOR SA	231	130.55	30,157.05
HUGO BOSS AG-ORD	134	98.71	13,227.14
KERING	291	147.60	42,951.60
LUXOTTICA GROUP SPA	706	37.20	26,263.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	1,073	125.20	134,339.60
ACCOR SA	673	31.50	21,202.86
SODEXO	382	72.62	27,740.84
ALTICE SA	278	44.20	12,287.60
AXEL SPRINGER SE	194	42.83	8,309.02
EUTELSAT COMMUNICATIONS	687	24.27	16,676.92
JC DECAUX SA	326	24.03	7,833.78
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	105	105.25	11,051.25
LAGARDERE S.C.A.	487	18.96	9,233.52
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	846	30.60	25,887.60
PUBLICIS GROUPE	696	53.21	37,034.16
REED ELSEVIER NV(NL)	2,810	16.80	47,222.05
RTL GROUP SA	176	68.12	11,989.12
SES	1,166	26.70	31,132.20
SKY DEUTSCHLAND AG	1,994	6.73	13,435.57
TELENET GROUP HOLDING NV	226	42.70	9,651.33

WOLTERS KLUWER NV-CVA	1,277	19.76	25,239.90
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	4,186	20.67	86,524.62
CARREFOUR SA	2,397	23.14	55,478.56
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	218	77.88	16,977.84
COLRUYT SA	270	34.84	9,406.80
DELHAIZE GROUP	447	51.01	22,801.47
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	2,374	4.81	11,418.94
JERONIMO MARTINS SGPS SA	1,138	8.38	9,536.44
KONINKLIJKE AHOLD NV	3,766	12.18	45,869.88
METRO AG	567	23.98	13,599.49
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	3,086	83.38	257,310.68
DANONE	2,221	50.91	113,071.11
HEINEKEN HOLDING NV	387	49.14	19,019.11
HEINEKEN NV	885	56.65	50,135.25
PERNOD-RICARD SA	815	84.46	68,834.90
REMY COINTREAU SA	144	51.53	7,420.32
UNILEVER NV-CVA	6,251	29.68	185,560.93
BEIERSDORF AG	441	62.52	27,571.32
HENKEL AG & CO KGAA	449	70.00	31,430.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	684	74.99	51,293.16
L'OREAL	979	119.35	116,843.65
CELESIO AG	192	25.62	4,920.00
ESSILOR INTERNATIONAL SA	783	82.47	64,574.01
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	831	54.27	45,098.37
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,450	38.30	55,542.25
BAYER AG	3,044	104.85	319,163.40
GRIFOLS SA	604	30.35	18,331.40
MERCK KGAA	496	68.71	34,080.16
ORION OYJ-CLASS B	501	27.19	13,622.19
QIAGEN NV	896	17.30	15,505.28
SANOFI	4,352	81.25	353,600.00
UCB SA	465	64.09	29,801.85
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	16,688	0.85	14,209.83
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	22,920	8.78	201,375.12
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-R	135,170	0.08	10,813.60
BANCO DE SABADELL SA	13,086	2.14	28,095.64
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.00	0.00
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	1,382	11.28	15,588.96
BANCO POPULAR ESPANOL SA	6,483	4.61	29,919.04
BANCO SANTANDER SA	44,117	6.96	307,319.02
BANKIA SA	16,317	1.33	21,783.19

BNP PARIBAS	4,030	47.00	189,410.00
CAIXABANK	6,813	4.48	30,535.86
COMMERZBANK AG	3,714	10.75	39,925.50
CREDIT AGRICOLE SA	3,840	10.90	41,856.00
ERSTE GROUP BANK AG	1,091	17.57	19,174.32
ING GROEP NV-CVA	14,795	10.62	157,122.90
INTESA SANPAOLO	44,632	2.19	97,833.34
INTESA SANPAOLO-RSP	4,262	1.95	8,323.68
KBC GROEP NV	1,013	39.63	40,150.25
NATIXIS SA	3,577	5.15	18,439.43
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	315	16.23	5,112.45
SOCIETE GENERALE	2,763	36.19	100,006.78
UNICREDIT SPA	16,939	5.55	94,011.45
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	3,288	5.83	19,169.04
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	5,427	24.09	130,736.43
DEUTSCHE BOERSE AG	781	52.00	40,612.00
EURAZEO	160	48.80	7,808.00
EXOR SPA	362	28.32	10,251.84
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	310	67.62	20,962.20
MEDIOBANCA SPA	2,531	6.30	15,945.30
WENDEL	158	81.03	12,802.74
AEGON NV	7,333	6.01	44,122.66
AGEAS	938	25.16	23,604.77
ALLIANZ SE-REG	1,748	120.45	210,546.60
ASSICURAZIONI GENERALI	4,481	15.20	68,111.20
AXA	6,969	17.54	122,271.10
CNP ASSURANCES	659	14.05	9,258.95
DELTA LLOYD NV	611	17.24	10,533.64
HANNOVER RUECK SE	232	60.65	14,070.80
MAPFRE SA	3,546	2.58	9,177.04
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	664	147.00	97,608.00
SAMPO OYJ-A SHS	1,772	36.46	64,607.12
SCOR SE	590	23.06	13,608.35
UNIPOLSAI SPA	3,801	2.06	7,860.46
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG	198	35.16	6,961.68
DEUTSCHE WOHNEN AG	1,098	16.35	17,952.30
IMMOFINANZ AG	4,809	2.20	10,579.80
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	1,460	26.00	37,960.00
ATOS	284	54.08	15,358.72
CAP GEMINI SA	606	51.13	30,984.78
DASSAULT SYSTEMES SA	485	48.99	23,762.57

	GEMALTO NV	335	59.14	19,811.90
	IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
	SAP SE	3,536	54.01	190,979.36
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	450	30.70	13,817.25
	ALCATEL-LUCENT	10,799	1.94	20,982.45
	NOKIA OYJ	14,371	6.29	90,465.44
	BELGACOM SA	665	26.27	17,469.55
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	11,711	10.68	125,073.48
	ELISA OYJ	696	19.55	13,606.80
	ILIAD SA	113	175.05	19,780.65
	KONINKLIJKE KPN NV	13,544	2.23	30,203.12
	ORANGE	7,115	10.65	75,774.75
	TELECOM ITALIA SPA	38,613	0.78	30,195.36
	TELECOM ITALIA-RSP	25,484	0.62	15,825.56
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,396	3.67	5,131.69
	TELEFONICA SA	15,717	11.09	174,380.11
	TELEKOM AUSTRIA AG	425	6.68	2,842.40
	VIVENDI	4,644	18.04	83,800.98
	ZIGGO NV	576	36.53	21,041.28
	E.ON SE	7,679	13.00	99,827.00
	ELECTRICITE DE FRANCE	1,023	22.13	22,638.99
	ENAGAS SA	779	24.41	19,019.28
	ENEL GREEN POWER SPA	6,716	1.83	12,317.14
	ENEL SPA	25,258	3.65	92,191.70
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	8,124	3.23	26,264.89
	FORTUM OYJ	1,705	17.74	30,246.70
	GAS NATURAL SDG SA	1,344	21.23	28,539.84
	GDF SUEZ	5,612	17.83	100,090.02
	IBERDROLA SA	19,555	5.26	102,996.18
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	438	64.79	28,378.02
	RWE AG	1,878	26.46	49,691.88
	SNAM SPA	7,786	4.08	31,829.16
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	1,187	12.55	14,896.85
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	6,593	3.77	24,868.79
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,506	12.81	19,299.39
	ASML HOLDING NV	1,372	72.78	99,854.16
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,572	7.23	33,096.70
	STMICROELECTRONICS NV	2,695	5.29	14,267.33
	ユーロ 建小計	871,587		10,835,454.34 (1,480,664,835)
英債券	AMEC PLC	1,127	10.30	11,608.10
	BG GROUP PLC	12,884	10.65	137,214.60

BP PLC	67,035	4.28	287,244.97
PETROFAC LIMITED	981	10.60	10,398.60
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	14,283	21.49	306,941.67
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	8,855	22.40	198,396.27
TULLOW OIL PLC	3,440	5.24	18,025.60
ANGLO AMERICAN PLC	5,277	13.65	72,031.05
ANTOFAGASTA PLC	1,725	6.83	11,790.37
BHP BILLITON PLC(UK)	7,980	16.82	134,263.50
CRODA INTERNATIONAL PLC	513	20.42	10,475.46
FRESNILLO PLC	778	7.98	6,208.44
GLENCORE PLC	40,131	3.21	128,981.03
JOHNSON MATTHEY PLC	775	28.74	22,273.50
RANDGOLD RESOURCES LIMITED	355	42.24	14,995.20
REXAM PLC	2,660	4.61	12,262.60
RIO TINTO PLC(UK)	4,807	30.99	148,968.93
BAE SYSTEMS PLC	11,946	4.43	53,028.29
BUNZL PLC	1,262	16.44	20,747.28
COBHAM PLC	4,302	2.71	11,658.42
IMI PLC	1,169	11.99	14,016.31
MEGGITT PLC	3,044	4.41	13,436.21
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,049	2.48	10,045.56
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	7,104	8.32	59,105.28
SMITHS GROUP PLC	1,491	11.95	17,817.45
THE WEIR GROUP PLC	901	22.29	20,083.29
TRAVIS PERKINS PLC	992	16.21	16,080.32
WOLSELEY PLC	1,075	31.34	33,690.50
AGGREKO PLC	1,083	14.91	16,147.53
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	1,894	10.37	19,640.78
CAPITA PLC	2,498	11.27	28,152.46
EXPERIAN PLC	3,754	9.35	35,118.67
G4S PLC	5,862	2.50	14,666.72
INTERTEK GROUP PLC	610	24.52	14,957.20
ROYAL MAIL PLC	2,744	4.31	11,845.84
GKN PLC	6,923	3.05	21,170.53
BURBERRY GROUP PLC	1,677	14.33	24,031.41
PERSIMMON PLC	1,153	13.53	15,600.09
CARNIVAL PLC(UK)	803	22.14	17,778.42
COMPASS GROUP PLC	6,346	9.58	60,794.68
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	893	21.56	19,253.08
TUI TRAVEL PLC	2,190	3.39	7,426.29
WHITBREAD PLC	686	42.07	28,860.02
WILLIAM HILL PLC	3,294	3.53	11,644.29

BRITISH SKY BROADCASTING PLC	3,901	8.49	33,119.49
ITV PLC	14,471	2.03	29,390.60
PEARSON PLC	3,095	11.31	35,004.45
REED ELSEVIER PLC(UK)	4,336	9.53	41,322.08
WPP PLC	5,016	11.40	57,182.40
ASOS PLC	229	19.36	4,433.44
KINGFISHER PLC	8,953	2.99	26,769.47
MARKS & SPENCER GROUP PLC	6,168	4.07	25,159.27
NEXT PLC	586	65.60	38,441.60
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	1,231	6.06	7,466.01
SAINSBURY (J) PLC	5,225	2.44	12,790.80
TESCO PLC	30,667	1.74	53,529.24
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	7,940	1.58	12,616.66
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,442	25.69	37,044.98
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	6,859	34.55	237,012.74
COCA-COLA HBC AG-CDI	875	12.91	11,296.25
DIAGEO PLC	8,997	17.48	157,267.56
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	3,616	25.63	92,678.08
SABMILLER PLC	3,643	32.85	119,690.76
TATE & LYLE PLC	1,760	5.79	10,199.20
UNILEVER PLC	4,849	24.98	121,128.02
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,458	51.40	126,341.20
SMITH & NEPHEW PLC	3,373	9.46	31,925.44
ASTRAZENECA PLC	4,622	41.86	193,500.03
GLAXOSMITHKLINE PLC	17,879	13.54	242,171.05
SHIRE PLC	2,226	37.80	84,142.80
BARCLAYS PLC	62,318	2.13	132,799.65
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	69,300	6.23	432,293.40
LLOYDS BANKING GROUP PLC	204,471	0.74	152,596.70
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	9,437	3.44	32,548.21
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	9,324	10.76	100,326.24
3I GROUP PLC	3,933	3.62	14,272.85
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	3,476	4.05	14,077.80
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,045	9.21	9,624.45
ICAP PLC	2,839	3.88	11,018.15
INVESTEC PLC	2,446	5.20	12,731.43
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	669	18.48	12,363.12
SCHRODERS PLC	508	22.26	11,308.08
ADMIRAL GROUP PLC	732	12.22	8,945.04
AVIVA PLC	11,136	4.94	55,067.52
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	5,667	2.64	14,994.88
FRIENDS LIFE GROUP LIMITED	5,358	2.96	15,859.68

	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	22,357	2.20	49,230.11
	OLD MUTUAL PLC	19,822	1.74	34,609.21
	PRUDENTIAL PLC	9,688	13.53	131,078.64
	RSA INSURANCE GROUP PLC	3,826	4.55	17,431.25
	STANDARD LIFE PLC	9,032	3.83	34,673.84
	SAGE GROUP PLC (THE)	4,839	3.58	17,357.49
	BT GROUP PLC	29,912	3.62	108,490.82
	INMARSAT PLC	1,815	6.85	12,432.75
	VODAFONE GROUP PLC	95,691	1.89	181,334.44
	CENTRICA PLC	19,043	2.95	56,272.06
	NATIONAL GRID PLC	14,109	8.73	123,171.57
	SEVERN TRENT PLC	967	19.00	18,373.00
	SSE PLC	3,684	15.28	56,291.52
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,884	8.20	23,663.22
	ARM HOLDINGS PLC	5,320	8.75	46,550.00
	英ポンド 建小計	1,043,416		5,932,287.55 (1,023,022,987)
スイスフラン	TRANSOCEAN LIMITED(CHF)	1,460	28.59	41,741.40
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	31	333.50	10,338.50
	GIVAUDAN-REG	36	1,494.00	53,784.00
	HOLCIM LTD-REG	857	63.85	54,719.45
	SIKA AG-BR	9	3,200.00	28,800.00
	SYNGENTA AG(CH)	349	289.00	100,861.00
	ABB LIMITED-REG	8,230	19.40	159,662.00
	GEBERIT AG-REG	142	297.20	42,202.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	80	123.80	9,904.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	202	127.00	25,654.00
	SULZER AG-REG	124	101.00	12,524.00
	ADECCO SA-REG	638	60.95	38,886.10
	SGS SA-REG	21	1,891.00	39,711.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	228	117.50	26,790.00
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	1,954	77.30	151,044.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	184	79.00	14,536.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	116	438.50	50,866.00
	ARYZTA AG	327	76.30	24,950.10
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	9	994.00	8,946.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	1	53,325.00	53,325.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	4	4,412.00	17,648.00
	NESTLE SA-REGISTERED	11,794	66.25	781,352.50
	SONOVA HOLDING AG-REG	204	138.40	28,233.60
	ACTELION LTD-REG	383	102.00	39,066.00
	LONZA GROUP AG-REG	199	106.00	21,094.00

	NOVARTIS AG-REG SHS	8,341	82.20	685,630.20
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,573	267.70	688,792.10
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5,835	24.26	141,557.10
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	838	39.12	32,782.56
	PARGESA HOLDING SA-BR	140	72.25	10,115.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	73	239.70	17,498.10
	UBS AG-REGISTERED	12,954	15.05	194,957.70
	BALOISE HOLDING AG-REG	192	114.80	22,041.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	121	208.50	25,228.50
	SWISS RE LIMITED	1,318	71.70	94,500.60
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	559	271.90	151,992.10
	SWISS PRIME SITE AG-REG	230	70.85	16,295.50
	SWISSCOM AG-REG	88	515.50	45,364.00
	スイスフラン 建小計	60,844		3,963,394.31 (448,616,601)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	973	104.90	102,067.70
	BOLIDEN AB	1,041	110.80	115,342.80
	ALFA LAVAL AB	1,273	149.40	190,186.20
	ASSA ABLOY AB-B	1,271	353.40	449,171.40
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,718	195.10	530,281.80
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,580	177.30	280,134.00
	SANDVIK AB	4,056	77.65	314,948.40
	SKANSKA AB-B SHS	1,607	137.50	220,962.50
	SKF AB-B SHARES	1,602	143.00	229,086.00
	VOLVO AB-B SHS	6,178	75.85	468,601.30
	SECURITAS AB-B SHS	1,192	75.55	90,055.60
	ELECTROLUX AB-SER B	810	185.10	149,931.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,018	47.55	48,405.90
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	3,612	281.40	1,016,416.80
	SWEDISH MATCH AB	854	218.90	186,940.60
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	2,234	163.20	364,588.80
	ELEKTA AB-B SHS	1,129	67.00	75,643.00
	GETINGE AB-B SHS	606	156.30	94,717.80
	NORDEA BANK AB	11,555	88.50	1,022,617.50
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	5,779	87.70	506,818.30
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,899	320.50	608,629.50
	SWEDBANK AB-A SHARES	3,445	176.90	609,420.50
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	521	117.60	61,269.60
	INVESTOR AB-B SHS	1,844	231.60	427,070.40
	KINNEVIK INVESTMENT AB	1,008	209.40	211,075.20
	ERICSSON LM-B SHS	11,577	82.80	958,575.60
	HEXAGON AB-B SHS	971	205.90	199,928.90

	MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	207	539.00	111,573.00
	TELE2 AB-B SHS	1,347	84.35	113,619.45
	TELIASONERA AB	9,060	46.86	424,551.60
	スウェーデンクローナ 建小計	82,967		10,182,631.15 (151,823,030)
ノルウェークローネ	AKASTOR ASA	443	22.03	9,759.29
	AKER SOLUTIONS ASA	443	48.05	21,286.15
	SEADRILL LIMITED	1,488	157.10	233,764.80
	STATOIL ASA	4,193	153.00	641,529.00
	SUBSEA 7 SA	1,319	78.70	103,805.30
	NORSK HYDRO ASA	5,880	34.08	200,390.40
	YARA INTERNATIONAL ASA	733	302.90	222,025.70
	ORKLA ASA	3,342	50.85	169,940.70
	DNB ASA	3,751	110.30	413,735.30
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	918	130.10	119,431.80
	TELENOR ASA	2,985	133.90	399,691.50
	ノルウェークローネ 建小計	25,495		2,535,359.94 (41,503,842)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	956	232.60	222,365.60
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	893	178.70	159,579.10
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	16	11,990.00	191,840.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	29	12,400.00	359,600.00
	DSV A/S	761	158.20	120,390.20
	PANDORA A/S	400	442.30	176,920.00
	CARLSBERG AS-B	468	500.50	234,234.00
	COLOPLAST A/S	443	461.70	204,533.10
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	129	418.10	53,934.90
	NOVO NORDISK A/S-B	7,575	258.20	1,955,865.00
	DANSKE BANK A/S	2,654	150.80	400,223.20
	TRYG A/S	86	589.00	50,654.00
	TDC A/S	3,613	42.88	154,925.44
	デンマーククローネ 建小計	18,023		4,285,064.54 (78,630,934)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	490	28.56	13,994.40
	ORIGIN ENERGY LIMITED	4,004	14.27	57,137.08
	SANTOS LTD	3,546	12.72	45,105.12
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,787	39.58	110,309.46
	WORLEYPARSONS LIMITED	751	14.12	10,604.12
	ALUMINA LIMITED	10,661	1.60	17,057.60
	AMCOR LTD	4,378	10.90	47,720.20
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	11,652	33.40	389,176.80
	BORAL LIMITED	3,385	4.85	16,417.25

FORTECUE METALS GROUP LIMITED	6,584	3.44	22,648.96
ILUKA RESOURCES LIMITED	1,520	7.63	11,597.60
INCITEC PIVOT LIMITED	6,593	2.71	17,867.03
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,616	11.54	18,648.64
NEWCREST MINING LIMITED	2,781	10.00	27,810.00
ORICA LTD	1,346	18.80	25,304.80
RIO TINTO LIMITED(AU)	1,581	59.37	93,863.97
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	422	18.70	7,891.40
ALS LIMITED	1,925	5.57	10,722.25
BRAMBLES LTD	5,671	9.19	52,116.49
SEEK LIMITED	1,174	15.83	18,584.42
ASCIANO LIMITED	3,539	5.77	20,420.03
AURIZON HOLDINGS LIMITED	7,754	4.41	34,195.14
QANTAS AIRWAYS LTD	5,737	1.33	7,630.21
SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	3,940	4.22	16,626.80
TOLL HOLDINGS LIMITED	3,221	5.66	18,230.86
TRANSURBAN GROUP	6,172	7.92	48,882.24
CROWN RESORTS LIMITED	1,322	13.71	18,124.62
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	126	41.03	5,169.78
TABCORP HOLDINGS LIMITED	1,719	3.71	6,377.49
TATTS GROUP LTD	4,799	3.10	14,876.90
REA GROUP LIMITED	240	41.65	9,996.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	2,150	3.38	7,267.00
METCASH LTD	1,622	2.64	4,282.08
WESFARMERS LIMITED	4,148	41.02	170,150.96
WOOLWORTHS LIMITED	4,562	34.76	158,575.12
COCA-COLA AMATIL LIMITED	2,078	8.54	17,746.12
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	1,882	4.24	7,979.68
COCHLEAR LIMITED	154	70.83	10,907.82
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	555	48.79	27,078.45
SONIC HEALTHCARE LTD	1,336	17.28	23,086.08
CSL LIMITED	1,738	74.65	129,741.70
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	9,956	31.93	317,895.08
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	1,454	12.24	17,796.96
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	1,575	11.55	18,191.25
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	5,883	76.54	450,284.82
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	8,540	33.15	283,101.00
WESTPAC BANKING CORPORATION	11,280	33.10	373,368.00
ASX LTD	703	34.34	24,141.02
MACQUARIE GROUP LIMITED	1,049	57.49	60,307.01
AMP LIMITED	10,731	5.16	55,371.96
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	9,093	5.94	54,012.42

	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	4,869	10.95	53,315.55	
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,668	13.87	64,745.16	
	LEND LEASE GROUP	2,312	14.86	34,356.32	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,716	11.65	19,991.40	
	TELSTRA CORPORATION	15,047	5.38	80,952.86	
	TPG TELECOM LIMITED	1,270	7.00	8,890.00	
	AGL ENERGY LIMITED	2,695	13.68	36,867.60	
	APA GROUP	3,655	7.42	27,120.10	
	AUSNET SERVICES	3,897	1.31	5,124.55	
	オーストラリアドル 建小計	232,054		3,757,755.73 (353,229,038)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	3,001	8.48	25,448.48	
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	4,307	3.80	16,366.60	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	1,697	7.22	12,252.34	
	XERO LIMITED	290	17.05	4,944.50	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	7,947	2.88	22,927.09	
	CONTACT ENERGY LIMITED	1,604	5.90	9,463.60	
	ニュージーランドドル 建小計	18,846		91,402.61 (7,775,620)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	8,629	95.95	827,952.55	
	NWS HOLDINGS LIMITED	6,500	13.58	88,270.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	6,000	13.70	82,200.00	
	MTR CORPORATION	3,903	30.45	118,846.35	
	LI & FUNG LIMITED	22,000	9.09	199,980.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED	5,273	22.50	118,642.50	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	2,838	24.60	69,814.80	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	9,537	48.75	464,928.75	
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	4,155	23.20	96,396.00	
	SANDS CHINA LIMITED	9,774	44.50	434,943.00	
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	5,813	11.06	64,291.78	
	SJM HOLDINGS LIMITED	9,000	15.48	139,320.00	
	WYNN MACAU LIMITED	5,499	26.95	148,198.05	
	BANK OF EAST ASIA	5,267	31.10	163,803.70	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	14,684	25.10	368,568.40	
	HANG SENG BANK LTD	3,100	128.60	398,660.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	10,000	8.17	81,700.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	3,966	173.70	688,894.20	
	AIA GROUP LIMITED	44,751	41.10	1,839,266.10	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	6,000	131.00	786,000.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	7,864	22.80	179,299.20		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,950	51.70	255,915.00		
HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	3,000	36.00	108,000.00		

	KERRY PROPERTIES LIMITED	2,952	25.70	75,866.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	20,562	9.40	193,282.80	
	SINO LAND CO	12,576	12.40	155,942.40	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	7,000	113.40	793,800.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	3,000	100.70	302,100.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	4,032	24.10	97,171.20	
	WHARF HOLDINGS LTD	7,000	55.35	387,450.00	
	WHEELLOCK AND COMPANY LTD	4,000	37.20	148,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	11,080	9.11	100,938.80	
	PCCW LIMITED	16,884	4.80	81,043.20	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	3,000	56.25	168,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	6,735	64.95	437,438.25	
	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	25,688	17.70	454,677.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	5,067	72.00	364,824.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	1,100	72.70	79,970.00	
	香港ドル 建小計	333,179		11,565,945.03 (159,725,700)	
シンガポールドル	KEPPEL CORPORATION LIMITED	5,900	9.46	55,814.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	17,636	1.25	22,133.18	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	4,000	4.78	19,120.00	
	SEBACORP MARINE LIMITED	3,987	3.62	14,432.94	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	6,000	3.59	21,540.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	3,069	1.11	3,421.93	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	8,000	2.43	19,440.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,000	9.65	19,300.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	26,000	1.06	27,690.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	7,000	4.16	29,120.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	1,000	40.80	40,800.00	
	OLAM INTERNATIONAL LIMITED	385	2.08	800.80	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	31,000	0.48	14,880.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	8,000	3.03	24,240.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	7,000	17.90	125,300.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	10,000	9.55	95,500.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	5,000	21.85	109,250.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	3,000	6.82	20,460.00	
	CAPITALAND LTD	9,000	2.96	26,640.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	2,000	9.31	18,620.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	11,000	2.65	29,150.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	4,000	3.19	12,760.00	
	UOL GROUP LIMITED	2,000	6.27	12,540.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	29,000	3.65	105,850.00	
	STARHUB LIMITED	3,000	4.02	12,060.00	

シンガポールドル 建小計		208,977		880,862.85 (74,124,608)
イスラエルシユケル	DELEK GROUP LIMITED	31	1,339.00	41,509.00
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	1,806	25.52	46,089.12
	THE ISRAEL CORPORATION LIMITED	19	1,955.00	37,145.00
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	3,449	190.40	656,689.60
	BANK HAPOALIM BM	4,613	20.26	93,459.38
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	6,133	14.64	89,787.12
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	561	44.56	24,998.16
	NICE SYSTEMS LIMITED	300	146.00	43,800.00
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	9,340	6.57	61,419.84
イスラエルシユケル 建小計		26,252		1,094,897.22 (31,445,448)
合 計		4,253,722		11,406,730,598 (11,406,730,598)

(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 (1,952,808)	
	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORPORATION	1,622	36,413.90	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	3,150	37,548.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	1,470	136,959.90	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	4,006	44,867.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	538	80,361.06	
		BOSTON PROPERTIES INC	619	74,007.64	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	400	28,452.00	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	1,300	105,092.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	600	38,634.00	
		DUKE REALTY CORP	1,375	24,516.25	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,297	85,472.30	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	349	65,161.79	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	300	36,642.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	1,968	47,527.20	
		HCP INC	1,847	78,497.50	
		HEALTH CARE REIT INC	1,152	77,184.00	
		HOST HOTELS & RESORTS	2,880	61,862.40	

		IRON MOUNTAIN INC	779	25,216.23
		KIMCO REALTY CORP	1,792	40,875.52
		LIBERTY PROPERTY TRUST	600	19,998.00
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	800	32,288.00
		PROLOGIS INC	1,881	73,528.29
		PUBLIC STORAGE	592	101,539.84
		RAYONIER INC	533	17,322.50
		REALTY INCOME CORP	900	39,186.00
		REGENCY CENTERS CORPORATION	400	22,552.00
		SIMON PROPERTY GROUP	1,156	194,693.52
		SL GREEN REALTY CORPORATION	400	43,300.00
		THE MACERICH COMPANY	569	37,531.24
		UDR INC	1,000	28,520.00
		VENTAS INC	1,240	82,348.40
		VORNADO REALTY TRUST	736	77,037.12
		WEYERHAEUSER COMPANY	2,047	67,530.53
		投資証券 小計	40,298	1,962,666.33 (210,299,697)
米ドル建小計			67,298	1,980,891.33 (212,252,505)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	600	12,942.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	597	15,277.23
カナダドル建小計			1,197	28,219.23 (2,681,109)
ユーロ	投資証券	CORIO NV	271	9,685.54
		FONCIERE DES REGIONS	109	7,471.95
		GECINA SA	108	10,848.60
		ICADE	121	7,384.63
		KLEPIERRE	404	12,881.54
		UNIBAIL-RODAMCO SE	375	70,987.50
ユーロ建小計			1,388	119,259.76 (16,296,846)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	3,857	26,497.59
		HAMMERSON PLC	2,886	16,363.62
		INTU PROPERTIES PLC	3,843	12,385.98
		LAND SECURITIES GROUP PLC	2,986	30,845.38
		SEGRO PLC	2,805	9,584.68
英ポンド建小計			16,377	95,677.25 (16,499,541)
オーストラリアドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	8,528	17,056.00
		DEXUS PROPERTY GROUP	23,762	27,088.68
		FEDERATION CENTRES	4,021	10,414.39

		GOODMAN GROUP	6,957	37,011.24	
		GPT GROUP	7,306	28,420.34	
		MIRVAC GROUP	13,396	22,840.18	
		SCENTRE GROUP	19,316	64,515.44	
		STOCKLAND	9,333	36,958.68	
		WESTFIELD CORPORATION	7,163	52,862.94	
オーストラリアドル建小計			99,782	297,167.89	(27,933,781)
香港ドル	投資証券	THE LINK REIT	9,107	417,555.95	
香港ドル建小計			9,107	417,555.95	(5,766,447)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,000	20,160.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	8,669	13,740.36	
		CAPITAMALL TRUST	10,000	19,150.00	
シンガポールドル建小計			27,669	53,050.36	(4,464,187)
合計				285,894,416	(285,894,416)

(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、口数及び証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

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 588銘柄	57.9%			60.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 33銘柄			1.7%	1.8%
カナダドル	株式 92銘柄	4.2%			4.4%
	投資証券 2銘柄			0.0%	0.0%
ユーロ	株式 230銘柄	12.2%			12.7%
	投資証券 6銘柄			0.1%	0.1%
英ポンド	株式 101銘柄	8.4%			8.7%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.7%			3.8%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	1.2%			1.3%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	0.3%			0.4%
デンマーククローネ	株式 13銘柄	0.6%			0.7%
オーストラリアドル	株式 60銘柄	2.9%			3.0%

	投資証券	9銘柄		0.2%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	0.1%		0.1%
香港ドル	株式	38銘柄	1.3%		1.4%
	投資証券	1銘柄		0.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	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	0.3%		0.3%

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

新光日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,889,279	34,425,396
国債証券	13,998,984,000	14,103,924,700
地方債証券	1,284,962,200	1,278,090,100
特殊債券	1,442,122,800	1,445,383,700
社債券	842,110,000	843,720,000
未収利息	44,254,334	42,804,713
前払費用	1,002,407	1,126,860
流動資産合計	17,638,325,020	17,749,475,469
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	15,004,175,198	14,916,956,426
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,631,749,822	2,832,519,043
元本等合計	17,635,925,020	17,749,475,469
純資産合計	17,635,925,020	17,749,475,469

平成26年 4月21日現在

平成26年10月20日現在

負債純資産合計	17,638,325,020	17,749,475,469
---------	----------------	----------------

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26年 4月22日 至 平成26年10月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配は使用いたしません。)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)に基づいて評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 15,004,175,198口	1. 計算日における受益権の総数 14,916,956,426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 1.1754円 (1万口当たり純資産額) (11,754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 1.1899円 (1万口当たり純資産額) (11,899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10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券であり、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p>	同左

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	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26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	15,057,742,796円	15,004,175,198円
期中追加設定元本額	619,993,188円	446,536,796円
期中一部解約元本額	673,560,786円	533,755,568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）	107,188,279円	107,521,879円
新光7資産バランスファンド	990,005,798円	920,382,291円
日本債券ファンド	356,760,517円	612,910,571円
新光日本債券インデックスVA	3,077,410,646円	3,043,967,034円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,335,966,811円	2,301,927,154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）	2,917,277,082円	2,815,825,560円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	401,995,100円	287,829,924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	11,680,885円	20,701,933円

合計	15,004,175,198円	14,916,956,426円
----	-----------------	-----------------

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	12,873,700	87,706,900
地方債証券	1,278,500	2,079,400
特殊債券	705,900	4,106,000
社債券	1,597,000	3,207,000
合計	13,261,100	97,099,300

(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9 3 回利付国債（5年）	230,000,000	231,294,900	
	第9 5 回利付国債（5年）	140,000,000	141,142,400	
	第9 6 回利付国債（5年）	160,000,000	161,080,000	
	第9 7 回利付国債（5年）	260,000,000	261,638,000	
	第9 8 回利付国債（5年）	150,000,000	150,696,000	
	第9 9 回利付国債（5年）	220,000,000	221,597,200	
	第1 0 1 回利付国債（5年）	150,000,000	151,198,500	
	第1 0 3 回利付国債（5年）	170,000,000	171,103,300	
	第1 0 5 回利付国債（5年）	140,000,000	140,595,000	

第106回利付国債(5年)	40,000,000	40,180,000	
第107回利付国債(5年)	100,000,000	100,473,000	
第109回利付国債(5年)	130,000,000	130,176,800	
第112回利付国債(5年)	160,000,000	161,926,400	
第114回利付国債(5年)	190,000,000	191,592,200	
第116回利付国債(5年)	220,000,000	220,910,800	
第117回利付国債(5年)	220,000,000	220,866,800	
第118回利付国債(5年)	220,000,000	220,814,000	
第120回利付国債(5年)	50,000,000	50,170,500	
第1回利付国債(40年)	20,000,000	23,457,800	
第2回利付国債(40年)	20,000,000	22,414,200	
第3回利付国債(40年)	30,000,000	33,575,100	
第4回利付国債(40年)	40,000,000	44,698,800	
第5回利付国債(40年)	50,000,000	53,126,000	
第6回利付国債(40年)	30,000,000	30,997,800	
第7回利付国債(40年)	20,000,000	19,493,800	
第276回利付国債(10年)	160,000,000	162,944,000	
第277回利付国債(10年)	150,000,000	153,336,000	
第280回利付国債(10年)	150,000,000	154,680,000	
第282回利付国債(10年)	70,000,000	72,247,700	
第283回利付国債(10年)	40,000,000	41,360,800	
第284回利付国債(10年)	170,000,000	176,150,600	
第285回利付国債(10年)	160,000,000	166,449,600	
第286回利付国債(10年)	90,000,000	94,209,300	
第288回利付国債(10年)	40,000,000	41,931,200	
第289回利付国債(10年)	140,000,000	146,407,800	
第290回利付国債(10年)	210,000,000	219,569,700	
第291回利付国債(10年)	40,000,000	41,686,800	
第293回利付国債(10年)	130,000,000	138,235,500	
第296回利付国債(10年)	110,000,000	116,091,800	
第297回利付国債(10年)	110,000,000	115,949,900	
第299回利付国債(10年)	90,000,000	94,718,700	
第300回利付国債(10年)	80,000,000	84,896,800	
第301回利付国債(10年)	120,000,000	127,704,000	
第303回利付国債(10年)	250,000,000	265,560,000	
第305回利付国債(10年)	60,000,000	63,598,800	
第306回利付国債(10年)	220,000,000	234,878,600	
第308回利付国債(10年)	220,000,000	234,198,800	
第309回利付国債(10年)	10,000,000	10,533,100	
第310回利付国債(10年)	150,000,000	157,333,500	
第311回利付国債(10年)	20,000,000	20,743,600	
第312回利付国債(10年)	170,000,000	180,621,600	

第313回利付国債(10年)	210,000,000	224,756,700
第315回利付国債(10年)	210,000,000	223,727,700
第317回利付国債(10年)	70,000,000	74,168,500
第318回利付国債(10年)	140,000,000	147,385,000
第319回利付国債(10年)	100,000,000	105,980,000
第320回利付国債(10年)	60,000,000	63,165,600
第321回利付国債(10年)	60,000,000	63,157,800
第322回利付国債(10年)	60,000,000	62,722,200
第323回利付国債(10年)	220,000,000	229,970,400
第325回利付国債(10年)	140,000,000	145,241,600
第326回利付国債(10年)	50,000,000	51,449,500
第327回利付国債(10年)	100,000,000	103,694,000
第328回利付国債(10年)	10,000,000	10,200,000
第329回利付国債(10年)	120,000,000	124,329,600
第330回利付国債(10年)	140,000,000	144,880,400
第332回利付国債(10年)	200,000,000	203,174,000
第333回利付国債(10年)	80,000,000	81,156,000
第334回利付国債(10年)	250,000,000	253,235,000
第335回利付国債(10年)	30,000,000	30,042,300
第5回利付国債(30年)	20,000,000	23,495,800
第7回利付国債(30年)	20,000,000	23,691,600
第10回利付国債(30年)	30,000,000	29,480,700
第11回利付国債(30年)	20,000,000	21,557,400
第12回利付国債(30年)	20,000,000	22,862,600
第13回利付国債(30年)	30,000,000	33,686,400
第15回利付国債(30年)	40,000,000	48,194,800
第17回利付国債(30年)	50,000,000	59,211,500
第19回利付国債(30年)	30,000,000	34,942,500
第20回利付国債(30年)	10,000,000	12,002,600
第21回利付国債(30年)	20,000,000	23,261,200
第22回利付国債(30年)	20,000,000	23,979,000
第23回利付国債(30年)	30,000,000	35,962,800
第24回利付国債(30年)	40,000,000	47,900,000
第26回利付国債(30年)	40,000,000	47,063,600
第27回利付国債(30年)	50,000,000	59,800,500
第28回利付国債(30年)	40,000,000	47,926,000
第29回利付国債(30年)	50,000,000	58,957,000
第30回利付国債(30年)	50,000,000	57,922,500
第31回利付国債(30年)	50,000,000	56,915,000
第32回利付国債(30年)	60,000,000	69,469,200
第33回利付国債(30年)	60,000,000	65,597,400
第34回利付国債(30年)	70,000,000	79,418,500

第35回利付国債(30年)	60,000,000	65,437,800
第36回利付国債(30年)	70,000,000	76,279,000
第37回利付国債(30年)	70,000,000	74,627,700
第38回利付国債(30年)	60,000,000	62,526,600
第39回利付国債(30年)	30,000,000	31,925,100
第40回利付国債(30年)	30,000,000	31,216,800
第41回利付国債(30年)	50,000,000	50,842,500
第42回利付国債(30年)	50,000,000	50,746,000
第43回利付国債(30年)	20,000,000	20,259,600
第44回利付国債(30年)	10,000,000	10,120,400
第45回利付国債(20年)	30,000,000	33,648,000
第47回利付国債(20年)	60,000,000	67,191,600
第48回利付国債(20年)	60,000,000	68,548,800
第50回利付国債(20年)	30,000,000	33,261,000
第51回利付国債(20年)	10,000,000	11,187,200
第52回利付国債(20年)	20,000,000	22,561,000
第53回利付国債(20年)	30,000,000	33,916,500
第55回利付国債(20年)	30,000,000	33,783,000
第57回利付国債(20年)	30,000,000	33,632,100
第58回利付国債(20年)	30,000,000	33,696,600
第59回利付国債(20年)	40,000,000	44,372,800
第61回利付国債(20年)	10,000,000	10,526,600
第63回利付国債(20年)	30,000,000	33,627,900
第64回利付国債(20年)	20,000,000	22,630,200
第65回利付国債(20年)	90,000,000	101,975,400
第69回利付国債(20年)	40,000,000	46,102,800
第70回利付国債(20年)	30,000,000	35,497,800
第72回利付国債(20年)	30,000,000	34,696,800
第76回利付国債(20年)	30,000,000	34,188,900
第78回利付国債(20年)	40,000,000	45,621,200
第81回利付国債(20年)	40,000,000	46,089,200
第84回利付国債(20年)	80,000,000	92,246,400
第85回利付国債(20年)	60,000,000	69,907,800
第88回利付国債(20年)	60,000,000	71,310,000
第90回利付国債(20年)	60,000,000	70,711,800
第92回利付国債(20年)	70,000,000	81,715,900
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,391,500
第95回利付国債(20年)	70,000,000	83,461,700
第97回利付国債(20年)	70,000,000	82,629,400
第99回利付国債(20年)	70,000,000	81,760,700
第100回利付国債(20年)	70,000,000	82,667,900
第103回利付国債(20年)	70,000,000	83,598,900

	第105回利付国債(20年)	70,000,000	81,750,200	
	第108回利付国債(20年)	80,000,000	91,252,000	
	第111回利付国債(20年)	70,000,000	82,642,000	
	第113回利付国債(20年)	70,000,000	81,634,000	
	第114回利付国債(20年)	10,000,000	11,655,300	
	第116回利付国債(20年)	90,000,000	106,047,000	
	第118回利付国債(20年)	80,000,000	91,888,800	
	第121回利付国債(20年)	90,000,000	101,959,200	
	第123回利付国債(20年)	80,000,000	92,889,600	
	第125回利付国債(20年)	80,000,000	94,061,600	
	第128回利付国債(20年)	90,000,000	101,566,800	
	第130回利付国債(20年)	80,000,000	88,872,000	
	第132回利付国債(20年)	80,000,000	87,433,600	
	第134回利付国債(20年)	90,000,000	99,640,800	
	第137回利付国債(20年)	90,000,000	97,984,800	
	第140回利付国債(20年)	90,000,000	97,787,700	
	第141回利付国債(20年)	100,000,000	108,344,000	
	第143回利付国債(20年)	90,000,000	95,788,800	
	第145回利付国債(20年)	80,000,000	86,229,600	
	第146回利付国債(20年)	80,000,000	85,966,400	
	第147回利付国債(20年)	100,000,000	105,492,000	
	第148回利付国債(20年)	90,000,000	93,150,000	
	第149回利付国債(20年)	120,000,000	123,757,200	
国債証券 小計		13,230,000,000	14,103,924,700	
地方債証券	第18回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,470,000	
	第654回東京都公募公債	100,000,000	104,730,000	
	第678回東京都公募公債	80,000,000	84,968,000	
	平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	31,356,000	
	第164回神奈川県公募公債	100,000,000	106,290,000	
	第87回大阪府公募公債(5年)	50,000,000	50,170,000	
	第302回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	41,764,000	
	平成18年度第2回静岡県公募公債	10,000,000	10,329,000	
	平成20年度第1回愛知県公募公債(10年)	48,000,000	50,961,600	
	平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	68,343,000	
	平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	102,200,000	
	第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,820,000	
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,590,000	
	第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	52,745,000	
	平成18年度第3回大阪市公募公債	39,000,000	40,404,000	
	第12回す号名古屋市公募公債	30,000,000	30,693,000	
	第485回名古屋市公募公債(10年)	30,000,000	30,543,000	
	平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	31,566,000	

	平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,617,500	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,530,000	
地方債証券 小計		1,216,000,000	1,278,090,100	
特殊債券	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,840,000	
	第33回日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,380,000	
	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	105,090,000	
	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	115,750,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,020,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,330,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,010,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,550,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	105,918,700	
	第188回政府保証中小企業債券	100,000,000	103,350,000	
	第2回成田国際空港社債	100,000,000	101,740,000	
	い第736号商工債券	70,000,000	70,483,000	
	い第759号農林債	20,000,000	20,152,000	
	第274回信金中金債(5年)	100,000,000	100,520,000	
第13回中日本高速道路社債(財投機関債)	100,000,000	106,250,000		
特殊債券 小計		1,391,000,000	1,445,383,700	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	102,740,000	
	第30回新日鐵住金社債	100,000,000	108,560,000	
	第1回日本電産社債	100,000,000	100,620,000	
	第8回トヨタ自動車社債	100,000,000	107,530,000	
	第30回住友商事社債	100,000,000	102,140,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,640,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	106,500,000	
	第524回東京電力社債	100,000,000	100,990,000	
社債券 小計		800,000,000	843,720,000	
合計		16,637,000,000	17,671,118,500	

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26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,304,583	4,151,770
投資証券	1,129,538,280	1,062,842,850
未収入金	-	44,705,376
未収配当金	8,199,011	7,359,776
未収利息	9	3
流動資産合計	1,147,041,883	1,119,059,775
資産合計	1,147,041,883	1,119,059,775
負債の部		
流動負債		
未払金	3,714,808	-
未払解約金	-	41,100,000
流動負債合計	3,714,808	41,100,000
負債合計	3,714,808	41,100,000
純資産の部		
元本等		
元本	917,907,152	773,206,973
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	225,419,923	304,752,802
元本等合計	1,143,327,075	1,077,959,775
純資産合計	1,143,327,075	1,077,959,775
負債純資産合計	1,147,041,883	1,119,059,775

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26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 917,907,152口	1. 計算日における受益権の総数 773,206,973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 1.2456円 (1万口当たり純資産額) (12,456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 1.3941円 (1万口当たり純資産額) (13,941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10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	コンプライアンス・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26年 4月21日現在	平成26年10月20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10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	1,004,866,979円	917,907,152円
期中追加設定元本額	3,647,964円	4,478,428円
期中一部解約元本額	90,607,791円	149,178,607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	914,259,188円	765,275,608円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適 格機関投資家私募）	- 円	3,583,455円
グローバル・ナビ	3,647,964円	4,347,910円
合計	917,907,152円	773,206,973円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	4,598,696	99,689,605
合計	4,598,696	99,689,605

（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
してあります。

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	55	21,395,000	
	M I Dリート投資法人	22	6,091,800	
	森ヒルズリート投資法人	188	28,294,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	19	10,754,000	
	産業ファンド投資法人	20	17,920,000	
	大和ハウスリート投資法人	35	16,625,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	156	39,109,200	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	33	9,108,000	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	30	26,010,000	
	G L P 投資法人	286	34,691,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	48	9,859,200	
	日本プロロジスリート投資法人	206	50,882,000	
	野村不動産マスタ - ファンド投資法人	199	25,750,600	
	星野リゾート・リート投資法人	5	5,655,000	
	S I A 不動産投資法人	9	3,730,500	
	イオンリート投資法人	114	15,424,200	
	ヒューリックリート投資法人	82	13,251,200	
	日本リート投資法人	18	5,347,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	52	5,241,600	
	日本ビルファンド投資法人	169	95,992,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	150	82,950,000	
	日本リートファンド投資法人	290	61,915,000	
	オリックス不動産投資法人	253	34,914,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	99	37,867,500	
プレミア投資法人	26	12,194,000		
東急リアル・エステート投資法人	117	16,976,700		
グローバル・ワン不動産投資法人	23	7,843,000		

野村不動産オフィスファンド投資法人	45	22,140,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	301	49,514,500	
森トラスト総合リート投資法人	158	30,399,200	
インヴィンシブル投資法人	319	11,659,450	
フロンティア不動産投資法人	59	30,031,000	
平和不動産リート投資法人	105	9,072,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	99	23,789,700	
福岡リート投資法人	83	15,952,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	42	24,234,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	115	11,971,500	
いちご不動産投資法人	123	9,950,700	
大和証券オフィス投資法人	53	30,316,000	
阪急リート投資法人	14	8,498,000	
スタートプロシード投資法人	18	3,276,000	
トップリート投資法人	21	9,775,500	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	45	20,767,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	334	22,144,200	
日本賃貸住宅投資法人	176	13,446,400	
ジャパンエクセレント投資法人	145	20,111,500	
合計	4,959	1,062,842,850	

(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26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	11,874,798	6,897,080
コール・ローン	4,324,092	6,264,849
投資証券	1,156,417,903	1,084,628,074
未収配当金	951,816	816,246
未収利息	4	5
流動資産合計	1,173,568,613	1,098,606,254
資産合計	1,173,568,613	1,098,606,254

平成26年 4月21日現在

平成26年10月20日現在

負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	1,072,870,103	905,073,922
剰余金		
剰余金又は欠損金()	100,698,510	193,532,332
元本等合計	1,173,568,613	1,098,606,254
純資産合計	1,173,568,613	1,098,606,254
負債純資産合計	1,173,568,613	1,098,606,254

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26年 4月22日 至 平成26年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場 (最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 1,072,870,103口	1. 計算日における受益権の総数 905,073,922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 1.0939円 (1万口当たり純資産額) (10,939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 1.2138円 (1万口当たり純資産額) (12,138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10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日

1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、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26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>投資証券</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に</p> <p>近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま</p> <p>す。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成25年10月22日 至 平成26年 4月21日	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,191,174,643円	1,072,870,103円
期中追加設定元本額	4,179,120円	8,120,641円
期中一部解約元本額	122,483,660円	175,916,822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	1,068,690,983円	893,747,978円
世界アセット・アロケーション・ファンド(適格機関投資家私募)	- 円	6,229,480円
グローバル・ナビ	4,179,120円	5,096,464円
合計	1,072,870,103円	905,073,922円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年 4月21日現在	平成26年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	26,370,747	70,376,196

合計	26,370,747	70,376,196
----	------------	------------

(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	823	23,743.55	
		AGREE REALTY CORPORATION	200	5,758.00	
		ALEXANDER'S INC	40	16,310.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	1,000	80,060.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	500	17,430.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,500	57,915.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	2,100	34,923.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL HEALTHCARE TRUST	2,400	26,472.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	12,889	153,636.88	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	300	5,721.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	5,600	521,752.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	2,075	69,533.25	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	400	3,612.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	240	3,676.80	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,000	10,030.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	800	14,776.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,842	275,139.54	
		AVIV REIT INC	400	11,236.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	2,700	56,700.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,200	263,032.00	
		BRANDYWINE REALTY	2,500	35,550.00	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,200	27,540.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,200	85,356.00	
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	900	5,742.00	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	400	4,512.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	2,384	42,220.64	
CEDAR REALTY TRUST INC	1,200	7,476.00	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	3,500	27,230.00	
CHATHAM LODGING TRUST	400	9,356.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	800	24,112.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1,800	44,730.00	
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	500	3,490.00	
CORESITE REALTY CORPORATION	300	10,314.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,200	30,888.00	
CORRECTIONS CORPORATION OF AMERICA	1,600	54,816.00	
COUSINS PROPERTIES INC	2,962	36,106.78	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	4,700	379,948.00	
CUBESMART	2,100	40,173.00	
CYRUSONE INC	500	12,385.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	4,700	37,177.00	
DDR CORPORATION	4,297	72,447.42	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	2,752	36,188.80	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,900	122,341.00	
DOUGLAS EMMETT INC	1,900	50,331.00	
DUKE REALTY CORP	4,700	83,801.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	900	25,524.00	
EASTGROUP PROPERTIES	400	25,624.00	
EDUCATION REALTY TRUST	2,000	21,600.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	1,100	16,676.00	
EPR PROPERTIES	800	42,552.00	
EQUITY COMMONWEALTH	1,775	43,700.50	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	1,100	49,082.00	
EQUITY ONE INC	800	17,944.00	
EQUITY RESIDENTIAL	5,100	336,090.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	886	165,425.06	
EXCEL TRUST INC	800	9,872.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,500	82,230.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT	1,000	122,140.00	
FELCOR LODGING TRUST	1,900	18,050.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY	1,600	28,560.00	
FIRST POTOMAC REALTY	800	9,528.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES	1,300	15,132.00	

GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,200	37,896.00
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	7,150	172,672.50
GETTY REALTY CORP	400	6,952.00
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	200	3,406.00
GLIMCHER REALTY TRUST	2,100	28,014.00
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	1,000	22,780.00
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	1,500	8,805.00
HCP INC	6,500	276,250.00
HEALTH CARE REIT INC	4,400	294,800.00
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,400	35,098.00
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	3,400	42,432.00
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,600	17,082.00
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,300	52,494.00
HOME PROPERTIES INC	800	49,152.00
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2,100	57,813.00
HOST HOTELS & RESORTS	10,779	231,532.92
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	800	20,712.00
INLAND REAL ESTATE CORP	1,200	12,300.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,600	12,608.00
KILROY REALTY CORP	1,200	75,108.00
KIMCO REALTY CORP	5,800	132,298.00
KITE REALTY GROUP TRUST	1,125	27,731.25
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,500	51,810.00
LEXINGTON REALTY TRUST	3,254	33,288.42
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,100	69,993.00
LTC PROPERTIES INC	500	19,485.00
MACK-CALI REALTY CORP	1,200	23,268.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,500	33,050.00
MID-AMERICA APARTMENT	1,076	72,608.48
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	700	7,371.00
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	400	24,364.00
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,800	66,348.00
NEW YORK REIT INC	2,300	25,622.00
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	1,800	67,032.00
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	200	4,240.00
PARKWAY PROPERTIES INC	1,000	19,170.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	900	34,335.00
PENN REAL ESTATE INVESTMENT	900	17,478.00
PHYSICIANS REALTY TRUST	700	9,961.00
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	2,200	40,678.00
PLUM CREEK TIMBER COMPANY	2,500	100,900.00

POST PROPERTIES INC	800	42,712.00
POTLATCH CORPORATION	500	21,165.00
PROLOGIS INC	7,100	277,539.00
PS BUSINESS PARKS INC/CA	300	23,901.00
PUBLIC STORAGE	2,100	360,192.00
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1,100	17,886.00
RAYONIER INC	1,800	58,500.00
REALTY INCOME CORP	3,192	138,979.68
REGENCY CENTERS CORPORATION	1,300	73,294.00
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	1,300	19,591.00
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	3,400	51,136.00
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	600	8,610.00
RLJ LODGING TRUST	1,900	56,430.00
ROUSE PROPERTIES INC	520	8,626.80
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	700	31,703.00
SABRA HEALTH CARE REIT INC	700	17,822.00
SAUL CENTERS INC	200	9,806.00
SELECT INCOME REIT	500	11,710.00
SENIOR HOUSING PROPERTIES	2,900	62,756.00
SILVER BAY REALTY TRUST CORPORATION	500	8,310.00
SIMON PROPERTY GROUP	4,405	741,890.10
SL GREEN REALTY CORPORATION	1,300	140,725.00
SOVRAN SELF STORAGE INC	500	39,835.00
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	5,447	62,041.33
STAG INDUSTRIAL INC	800	17,880.00
STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL	500	12,845.00
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	3,400	39,440.00
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1,200	13,128.00
SUN COMMUNITIES INC	600	31,782.00
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	2,875	40,278.75
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,400	47,488.00
TAUBMAN CENTERS INC	900	66,681.00
TERRENO REALTY CORP	400	8,028.00
THE GEO GROUP INC	1,000	36,900.00
THE MACERICH COMPANY	2,001	131,985.96
UDR INC	3,558	101,474.16
UMH PROPERTIES INC	300	2,886.00
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	200	8,992.00
URSTADT BIDDLE-CL A	300	6,318.00
VENTAS INC	4,155	275,933.55
VORNADO REALTY TRUST	2,335	244,404.45
WASHINGTON PRIME GROUP INC	2,252	37,338.16

	WASHINGTON REAL ESTATE INV	900	23,814.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1,600	52,928.00	
	WEYERHAEUSER COMPANY	7,400	244,126.00	
	WHITESTONE REIT	300	4,290.00	
	WINTHROP REALTY TRUST INC	420	6,337.80	
	WP CAREY INC	1,200	77,724.00	
米ドル建小計		282,309	10,122,520.53	(1,084,628,074)
	合計		1,084,628,074	(1,084,628,074)

(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 151銘柄	98.7%	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10月31日現在)

資産総額	7,962,541,501円
負債総額	4,218,387円
純資産総額(-)	7,958,323,114円
発行済口数	9,236,111,684口
1口当たり純資産額(/)	0.8617円
(1万口当たり純資産額)	(8,617円)

(参考) 海外国債マザーファンド

(平成26年10月31日現在)

資産総額	52,490,264,222円
負債総額	円
純資産総額(-)	52,490,264,222円
発行済口数	24,064,974,421口
1口当たり純資産額(/)	2.1812円
(1万口当たり純資産額)	(21,812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10月31日現在)

資産総額	15,068,897,710円
負債総額	484,991,369円
純資産総額(-)	14,583,906,341円
発行済口数	9,034,670,118口
1口当たり純資産額(/)	1.6142円
(1万口当たり純資産額)	(16,142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10月31日現在)

資産総額	12,997,480,194円
負債総額	8,334,611円

純資産総額（ - ）	12,989,145,583円
発行済口数	7,497,216,470口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7325円
（1万口当たり純資産額）	（17,325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10月31日現在）

資産総額	17,780,869,717円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	17,780,869,717円
発行済口数	14,900,884,127口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1933円
（1万口当たり純資産額）	（11,933円）

（参考）新光J-REITマザーファンド

（平成26年10月31日現在）

資産総額	1,134,229,756円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	1,134,229,756円
発行済口数	773,408,096口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4665円
（1万口当たり純資産額）	（14,665円）

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成26年10月31日現在）

資産総額	1,170,729,251円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	1,170,729,251円
発行済口数	906,637,514口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2913円
（1万口当たり純資産額）	（12,913円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

益証券を発行しません。

(1) 投資信託受益証券の名義書換等

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 償還金

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

(8) 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a．資本金の額（平成26年10月末現在）

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

直近5ヵ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

b．委託会社の機構

(イ) 株主総会において、15名以内の取締役が選任されます。

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

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

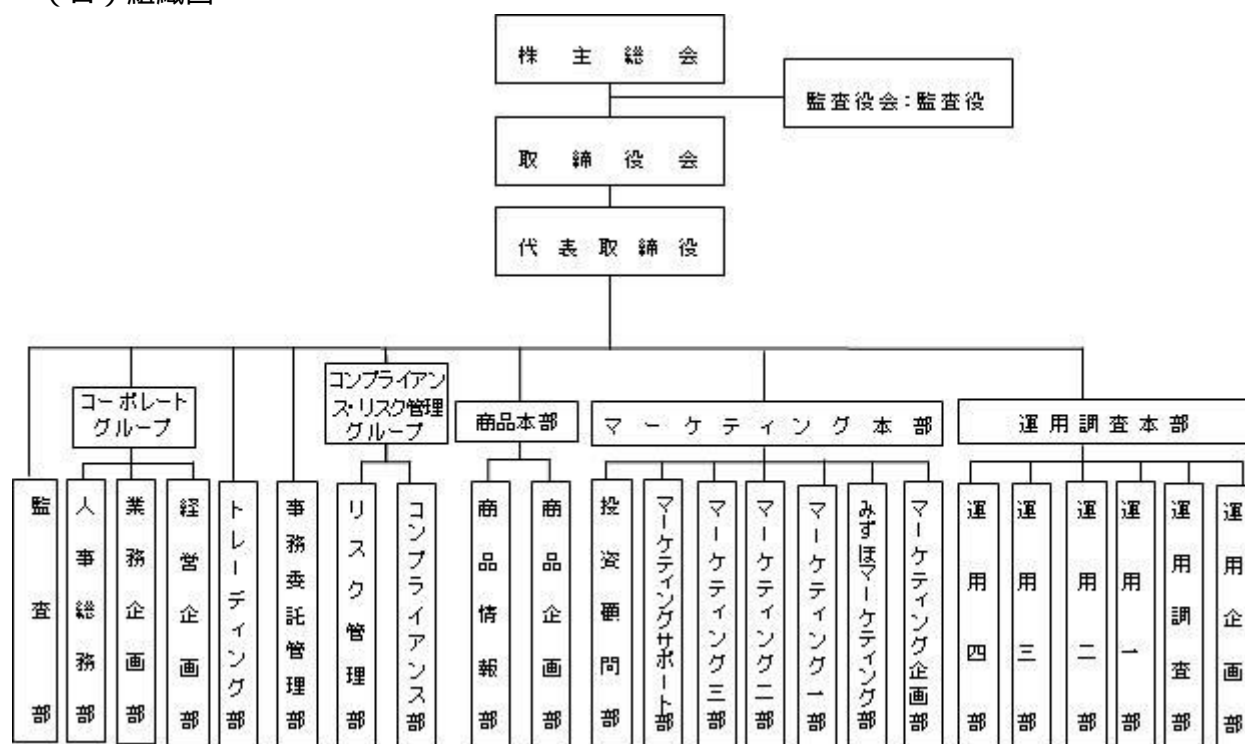
取締役会の決議により、取締役の中から会長1名、社長1名、副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

取締役会の決議をもって代表取締役3名以内を決定します。

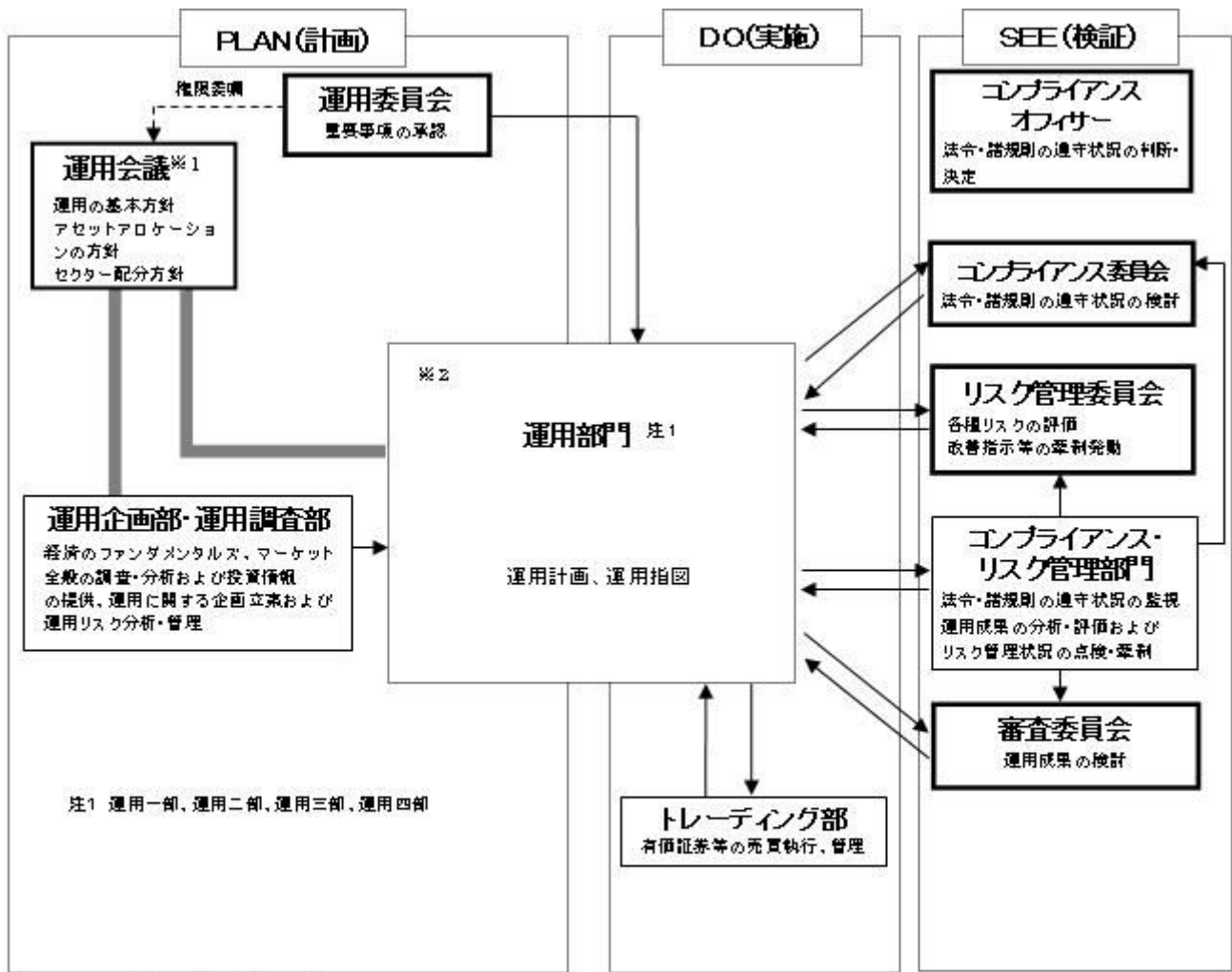
代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

(ロ) 組織図



(ハ) 投資運用の意思決定機構



実線の矢印は情報の流れを示します。

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

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10月31日現在）

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	279	3,889,233
株式投資信託（合計）	251	3,212,018
単位型	35	136,058
追加型	216	3,075,959
公社債投資信託（合計）	28	677,215
単位型	1	203
追加型	27	677,011

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

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

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

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第55期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

1．財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成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	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			株 主	評価・換算差額等
	利益剰余金				

	利益 剰余金 合計	自己 株式	資本 合計	その他有価証 券評価差額金	純資産合計
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）

（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	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	当事業年度
--	-------	-------

(平成25年3月31日)

(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利預金や有価証券などにより、通常取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行っております。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並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、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 その他有価証券」には含めておりません。

（注）３．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日）

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

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	-	-	-	-
その他有価証券	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	(1) 国債・地方債等	-	-	-

を超えるもの	(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	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			

得原価を超えるもの	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・販売に係る代行手数料の兼任	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・販売に係る代行手数料の兼任	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
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	91,562	その他未払金	8,536
							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おりません。

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成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。

2. 中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

当中間会計期間	
(平成26年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	13,392,308
有価証券	4,503,686
貯蔵品	2,672
未収委託者報酬	2,835,160
未収運用受託報酬	84,271
繰延税金資産	258,726
その他	221,068
流動資産合計	21,297,894
固定資産	
有形固定資産	
建物(純額)	14,060
構築物(純額)	1,547
器具・備品(純額)	88,371
リース資産(純額)	170
有形固定資産合計	104,149
無形固定資産	
ソフトウェア	82,679
ソフトウェア仮勘定	3,885
その他	91
無形固定資産合計	86,656
投資その他の資産	
投資有価証券	3,596,673
前払年金費用	421,561
その他	131,197
投資その他の資産合計	4,149,431
固定資産合計	4,340,237
資産合計	25,638,131

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成26年9月30日)

負債の部

流動負債

リース債務 754

未払金

未払収益分配金 175

未払償還金 8,852

未払手数料 1,372,909

その他未払金 279,650

未払金合計 1,661,587

未払法人税等 966,772

未払消費税等 2 349,104

賞与引当金 382,000

役員賞与引当金 33,000

その他 671,869

流動負債合計 4,065,087

固定負債

退職給付引当金 146,778

役員退職慰労引当金 32,166

執行役員退職慰労引当金 50,916

繰延税金負債 32,867

固定負債合計 262,728

負債合計

4,327,816

純資産の部

株主資本

資本金 4,524,300

資本剰余金

資本準備金 2,761,700

資本剰余金合計 2,761,700

利益剰余金

利益準備金 360,493

その他利益剰余金

別途積立金 8,900,000

繰越利益剰余金 4,658,210

利益剰余金合計 13,918,704

自己株式 72,415

株主資本合計 21,132,288

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金 178,027

評価・換算差額等合計 178,027

純資産合計

21,310,315

負債純資産合計

25,638,131

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

当中間会計期間

（自 平成26年4月 1日

至 平成26年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		16,867,457
運用受託報酬		113,806
営業収益合計		16,981,264
営業費用及び一般管理費	1	14,312,421
営業利益		2,668,842
営業外収益		
受取配当金		82,555
有価証券利息		1,807
受取利息		5,629
時効成立分配金・償還金		1,275
その他		2,831
営業外収益合計		94,099
営業外費用		
支払利息		16
時効成立後支払分配金・償還金		3,071
その他		2,321
営業外費用合計		5,410
経常利益		2,757,531
特別利益		
投資有価証券売却益		34,225
特別利益合計		34,225
特別損失		
固定資産除却損		1,398
投資有価証券評価損		58,680
その他		22,227
特別損失合計		82,306
税引前中間純利益		2,709,450
法人税、住民税及び事業税		961,036
法人税等調整額		25,644
法人税等合計		986,680
中間純利益		1,722,769

（ 3 ） 中 間 株 主 資 本 等 変 動 計 算 書

当中間会計期間（自 平成26年4月 1日 至 平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本剰余金	利益剰余金	
		その他利益剰余金	

	資本金	資本準備金	利益準備金	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	8,900,000	2,889,165
会計方針の変更による累積的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当中間期変動額					
剰余金の配当					
中間純利益					1,722,769
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	-	1,722,769
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	4,658,210

	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	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による累積的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当中間期変動額					
剰余金の配当	-		-		-
中間純利益	1,722,769		1,722,769		1,722,769
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）				127,152	127,152
当中間期変動額合計	1,722,769	-	1,722,769	127,152	1,849,921
当中間期末残高	13,918,704	72,415	21,132,288	178,027	21,310,315

注記事項

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法。但し、平成10年4月1日以後に取得した建物（建物附属設備を除く）については、定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	8～18年
構築物	20年
器具備品	2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

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

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日において発生していると認められる額を計上しております。

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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

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

(4) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当中間会計期間末日要支給額を計上しております。

(5) 執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当中間会計期間末日要支給額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

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

理しております。

（会計方針の変更）

（退職給付に関する会計基準等の適用）

「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。以下「退職給付会計基準」という。）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。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の算定方法を退職給付の支払見込期間ごとに設定された複数の割引率を使用する方法に変更しました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を利益剰余金に加減しております。

この結果、当中間会計期間の期首の前払年金費用が69,164千円増加、退職給付引当金が2,738千円減少し、利益剰余金が46,276千円増加しております。なお、当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。

（中間貸借対照表関係）

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

	当中間会計期間 (平成26年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	555,450千円

2．消費税等の取扱い

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

（中間損益計算書関係）

1．減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
有形固定資産	20,991千円
無形固定資産	11,590千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,823,250	-	-	1,823,250

2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
-------	---------	----	----	----------

普通株式（株）	9,386	-	-	9,386
---------	-------	---	---	-------

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

当中間会計期間（平成26年9月30日）

ファイナンス・リース取引

（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

1. リース資産の内容

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

2. リース資産の減価償却方法

重要な会計方針の「2. 固定資産の減価償却の方法(3)リース資産」に記載のとおりであります。

(金融商品関係)

金融商品の時価等に関する事項

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

当中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金及び預金	13,392,308	13,392,308	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,824,207	7,824,207	-
(3) 未収委託者報酬	2,835,160	2,835,160	-
(4) 未払手数料	1,372,909	1,372,909	-

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 未払手数料

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

(注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	276,151

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成26年9月30日)

1. 関連会社株式

関連会社株式(中間貸借対照表計上額 77,100千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて
困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,859,109	2,501,935	357,173
	小計	2,859,109	2,501,935	357,173
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	4,965,098	5,045,660	80,561
	小計	4,965,098	5,045,660	80,561
合計		7,824,207	7,547,595	276,611

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額199,051千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが
極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

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

当中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

項目	当中間会計期間 (平成26年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	11,748円57銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	21,310,315
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	21,310,315
普通株式の発行済株式数(株)	1,823,250
普通株式の自己株式数(株)	9,386
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	949円77銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,722,769

普通株主に帰属しない金額（千円）	-
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	1,722,769
普通株式の期中平均株式数（株）	1,813,864

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

（重要な後発事象）

当社は、将来の事業展開や市況変動に備えるために適正な内部留保を維持しつつ、利益配分については株主の皆様へ安定的かつ可能な範囲で高水準の配当を実施していくことを基本的な考え方としており、平成26年11月18日開催の取締役会において、平成26年12月24日開催を予定している臨時株主総会に、次のとおり剰余金の処分を付議することを決議いたしました。

株主配当に関する決議事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	2,539,409千円
1株当たり配当額	1,400円
基準日	平成26年11月26日
効力発生日	平成26年12月25日

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等（委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託者の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託者の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

a．定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

b．訴訟事件その他の重要事項

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

なお、「委託会社等の経理状況 中間財務諸表」の注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、平成26年12月24日付の臨時株主総会で期中配当を行うことを決議しました。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a．資本金の額

平成26年9月末現在、342,037百万円

b．事業の内容

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

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

a．資本金の額

平成26年9月末現在、300万ポンド

b．事業の内容

英国籍の法人であり、内外の有価証券等にかかる投資顧問業務を営んでいます。

(3) 販売会社

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

販売会社一覧表

（資本金の額は平成26年9月末現在）

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
大山日ノ丸証券株式会社	215	同上
岡安証券株式会社	650	同上
岡三にいがた証券株式会社	852	同上
三豊証券株式会社	300	同上
永和証券株式会社	500	同上
六和証券株式会社	204	同上
西村証券株式会社	500	同上
八幡証券株式会社	2,000	同上
いちよし証券株式会社	14,577	同上
上光証券株式会社	500	同上
あかつき証券株式会社	2,834	同上
楽天証券株式会社	7,495	同上
株式会社SBI証券	47,937	同上

S M B C 日興証券株式会社	10,000	同上
立花証券株式会社	6,695	同上
東京海上日動火災保険株式会社	101,994	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

「販売会社」は以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

(1) みずほ証券株式会社は、委託者の株式の76.5%を所有しています。

(2) 委託者は、三豊証券株式会社の株式の4.5%を所有しています。

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

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

業務の概要 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託事務の一部(投資信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙などに委託会社の名称、ロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、ファンドの形態などを記載することがあります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・交付目論見書または請求目論見書である旨

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

独立監査人の監査報告書

平成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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年12月2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26年4月22日から平成26年10月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの平成26年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

新光投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- () 1 . 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月17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 伊藤 志保
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛
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26年4月1日から平成27年3月31日までの第55期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、新光投信株式会社の平成26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成26年11月18日開催の取締役会において、平成26年12月24日開催予定の臨時株主総会に、剰余金の処分を付議することを決議した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。