

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年7月17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】	坂本 久
【電話番号】	03-3277-1800
【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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出しましたので、平成27年 1月20日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するとともに、併せて原届出書添付書類の訂正を行うため提出するものです。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

b. ファンドの特色

<訂正前>

(略)

主な投資制限

(略)	
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。

(略)

<訂正後>

(略)

主な投資制限

(略)	
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。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(略)

(3)【ファンドの仕組み】

b. 委託会社の概況

<訂正前>

(イ) 資本金の額（平成26年10月末現在）

(略)

(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
(略)			

<訂正後>

(イ) 資本金の額（平成27年4月末現在）

（略）

(ハ) 大株主の状況

（平成27年4月末現在）

株主名	住所	持株数	持株比率
（略）			

2【投資方針】

(1)【投資方針】

b. 運用の方法

<訂正前>

（略）

(八) 主な投資制限

（略）

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。

<訂正後>

（略）

(八) 主な投資制限

（略）

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。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(2)【投資対象】

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

<訂正前>

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)

(略)

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)

(略)

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)

(略)

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

(略)

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

フランクリン テンブルトン インベストメント マネジメント リミテッド (FTIML社) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンブルトン インベストメンツ (設立：1947年、運用総資産：約98.5兆円) の一員です。FTIML社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2014年9月末現在、1米ドル = 109.565円で換算

(略)

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

<訂正後>

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、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)

(略)

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、新投資口予約権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)

(略)

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、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)

(略)

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

(略)

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

フランクリン テンブルトン インベストメント マネジメント リミテッド (FTIML社) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンブルトン インベストメンツ (設立：1947年、運用総資産：約105.6兆円) の一員です。FTIML社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2015年3月末現在、1米ドル = 119.925円で換算

(略)

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成27年7月17日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(5) 【投資制限】

<訂正前>

(略)

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

（略）

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いが、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。

<訂正後>

（略）

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。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えること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

（略）

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いが、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。

j . 信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたいが当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

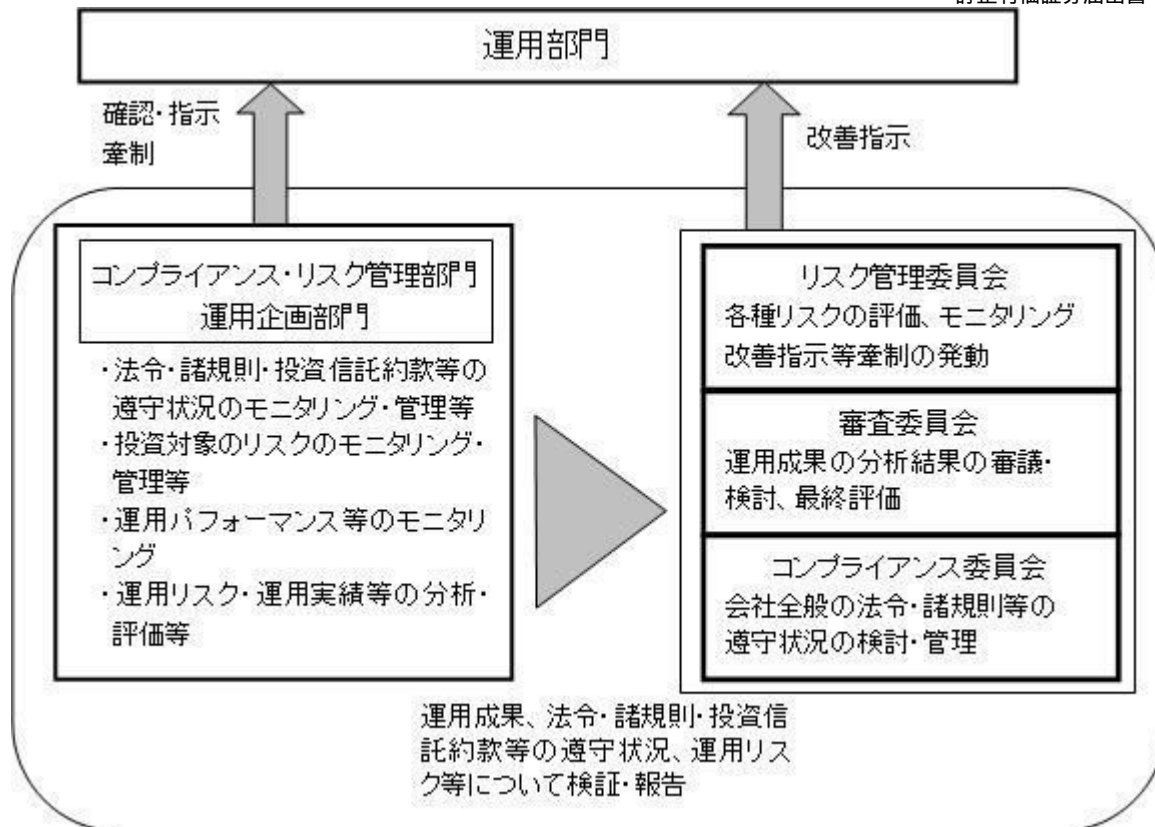
3【投資リスク】

(2) リスク管理体制

<更新後>

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

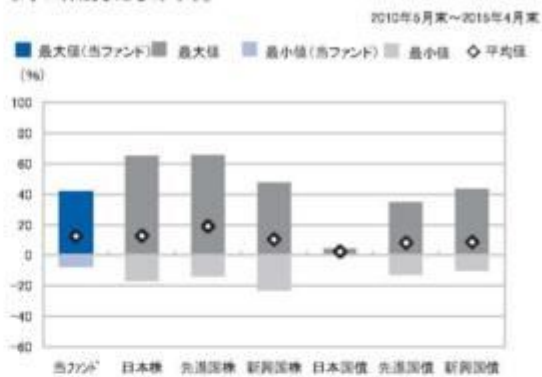


- ※分配金再投資基準価額は、2010年5月末の基準価額を10,000として指数化してあります。
- ※年間騰落率は、2010年5月から2015年4月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※分配金再投資基準価額は、取引前の分配金を当ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のものであり、実際の基準価額とは異なります。

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。



※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。

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	47.4	4.5	34.9
最小値	△7.2	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△12.7
平均値	12.7	12.8	19.1	10.5	2.4	8.2

- ※2010年5月から2015年4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。

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に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日本の国債市場の動向を表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、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が開発し、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とした指数です。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。本指数は特許を受けて使用されています。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】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

a．個人の受益者の場合

(略)

(八) 損益通算について

(略)

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。

(略)

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。

<訂正後>

a．個人の受益者の場合

(略)

(八) 損益通算について

(略)

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）。

なお、平成28年1月1日以降、上記の損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象範囲に特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等が追加されます。

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、上場株式や公募株式投資信託などについての非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額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一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、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。

(略)

上記は平成27年4月末現在のものです。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27年 4月30日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン諸島	1,049,848,500	13.68
親投資信託受益証券	日本	6,435,666,742	83.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		184,960,652	2.41
純資産総額		7,670,475,894	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27年 4月30日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	21,258,409,165	44.87
	カナダ	873,422,120	1.84
	ドイツ	5,992,735,676	12.64
	イタリア	7,005,553,209	14.78
	フランス	6,633,178,025	14.00
	イギリス	4,514,631,612	9.52
	小計	46,277,929,807	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,096,121,682	2.31
純資産総額		47,374,051,489	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27年 4月30日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	13,672,642,260	97.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		389,326,357	2.76
純資産総額		14,061,968,617	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

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	6,737,806,889	51.32
	カナダ	503,935,646	3.83
	モーリシャス	898,492	0.00
	パナマ	6,773,575	0.05
	ドイツ	456,628,013	3.47
	イタリア	107,135,153	0.81
	フランス	451,492,691	3.43
	オランダ	200,732,105	1.52
	スペイン	174,710,829	1.33
	ベルギー	65,322,041	0.49
	オーストリア	10,877,608	0.08
	ルクセンブルグ	19,253,639	0.14
	フィンランド	42,972,702	0.32
	アイルランド	196,074,979	1.49
	ポルトガル	8,189,279	0.06
	イギリス	980,225,559	7.46
	スイス	538,227,699	4.10
	スウェーデン	153,735,516	1.17
	ノルウェー	32,487,052	0.24
	デンマーク	84,562,658	0.64
	ケイマン諸島	18,514,041	0.14
	リベリア	4,490,525	0.03
	オーストラリア	340,338,484	2.59
	バミューダ諸島	44,839,361	0.34
	ニュージーランド	6,686,399	0.05
	香港	135,301,843	1.03
	シンガポール	82,038,647	0.62
	イスラエル	29,269,957	0.22
	キュラソー	44,866,061	0.34
	ジャージー	62,476,741	0.47
	英ヴァージン諸島	4,760,000	0.03
	マン島	1,932,298	0.01
	小計	11,547,556,482	87.96
投資信託受益証券	シンガポール	1,526,175	0.01
投資証券	アメリカ	203,738,267	1.55
	カナダ	2,633,687	0.02
	フランス	16,822,798	0.12
	イギリス	17,845,478	0.13
	オーストラリア	28,905,816	0.22
	香港	5,116,435	0.03
	シンガポール	5,424,382	0.04

	小計	280,486,863	2.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,297,179,593	9.88
純資産総額		13,126,749,113	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27年 4月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	14,048,833,300	80.49
地方債証券	日本	1,246,656,700	7.14
特殊債券	日本	1,347,332,900	7.71
社債券	日本	741,590,000	4.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		69,670,354	0.39
純資産総額		17,454,083,254	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27年 4月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	1,482,788,400	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		27,729,176	1.83
純資産総額		1,510,517,576	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27年 4月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	1,022,931,294	98.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,106,942	1.36
純資産総額		1,037,038,236	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27年 4月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式インデックスマザー ファンド	550,960,391	1.9779	1,089,744,557	2.0050	1,104,675,583	14.40
2	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	472,102,025	2.3038	1,087,628,645	2.3119	1,091,452,671	14.22
3	日本	親投資信託 受益証券	新光J-R E I Tマザーファンド	669,236,233	1.6277	1,089,315,816	1.6272	1,088,981,198	14.19
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	886,444,703	1.2140	1,076,143,869	1.2110	1,073,484,535	13.99
5	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	543,468,058	1.9331	1,050,578,103	1.9461	1,057,643,187	13.78
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	5.968	1,035,448,000	6.051	1,049,848,500	13.68
7	日本	親投資信託 受益証券	新光米国R E I Tマザーファンド	695,618,948	1.4824	1,031,185,528	1.4655	1,019,429,568	13.29

(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27年 4月30日現在)

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	13.68
親投資信託受益証券	83.90
合計	97.58

(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27年 4月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,700,000	12,140.46	2,391,671,761	12,267.2266	2,416,643,644	2.3750	2024.08.15	5.10
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,700,000	12,228.12	2,408,940,559	12,126.8437	2,388,988,219	2.2500	2024.11.15	5.04
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,200,000	12,270.15	2,355,869,478	12,400.1718	2,380,833,000	2.5000	2024.05.15	5.02
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,100,000	12,522.56	2,141,357,939	12,666.0625	2,165,896,688	2.7500	2023.11.15	4.57
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,900,000	12,466.77	1,857,549,689	12,653.0468	1,885,303,983	2.7500	2024.02.15	3.97
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,100,000	11,784.00	1,779,384,147	12,011.5624	1,813,745,937	2.0000	2023.02.15	3.82
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,300,000	11,551.49	1,767,378,777	11,754.9687	1,798,510,218	1.7500	2023.05.15	3.79
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	12,240.10	1,591,214,265	12,433.6406	1,616,373,281	2.5000	2023.08.15	3.41
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,400,000	11,870.14	1,590,600,020	11,859.0937	1,589,118,563	2.0000	2025.02.15	3.35
10	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,300,000	16,967.51	1,238,628,625	17,544.2998	1,280,733,886	4.2500	2023.10.25	2.70

11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,200,000	11,511.80	1,174,204,609	11,723.3593	1,195,782,655	1.6250	2022.11.15	2.52
12	イギリス	国債証券	TSY	6,000,000	19,529.48	1,171,769,112	19,789.7460	1,187,384,760	2.7500	2024.09.07	2.50
13	イギリス	国債証券	TSY	6,300,000	18,143.37	1,143,032,901	18,512.3360	1,166,277,168	1.7500	2022.09.07	2.46
14	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,400,000	15,356.22	1,136,360,518	15,747.8016	1,165,337,319	3.0000	2022.04.25	2.45
15	イギリス	国債証券	TSY	6,000,000	18,669.66	1,120,180,129	19,094.9820	1,145,698,920	2.2500	2023.09.07	2.41
16	イギリス	国債証券	TSY	4,300,000	24,164.00	1,039,052,094	23,610.9480	1,015,270,764	5.0000	2025.03.07	2.14
17	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000	19,092.09	916,420,455	20,580.3553	987,857,055	4.7500	2028.07.04	2.08
18	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,600,000	14,258.18	941,040,417	14,745.0433	973,172,864	1.7500	2024.11.25	2.05
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000	15,921.10	907,502,786	16,769.0804	955,837,583	4.7500	2023.08.01	2.01
20	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,400,000	14,225.94	910,460,260	14,775.4700	945,630,086	1.7500	2023.05.25	1.99
21	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,100,000	14,575.71	889,118,444	15,327.1193	934,954,283	2.2500	2024.05.25	1.97
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	11,685.31	888,084,132	11,867.4609	901,927,032	1.7500	2022.05.15	1.90
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000	15,649.90	845,094,978	16,647.3735	898,958,174	4.5000	2024.03.01	1.89
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000	17,712.04	903,314,220	17,464.9258	890,711,216	5.0000	2025.03.01	1.88
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,900,000	16,536.25	810,276,250	17,263.8450	845,928,405	5.5000	2022.11.01	1.78
26	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,500,000	14,619.36	804,065,233	15,137.9446	832,586,958	2.2500	2022.10.25	1.75
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,700,000	11,564.36	774,812,312	11,748.4609	787,146,884	1.6250	2022.08.15	1.66
28	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000	16,529.63	743,833,598	17,225.4809	775,146,641	5.5000	2022.09.01	1.63
29	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000	14,800.60	680,827,839	15,865.5396	729,814,826	3.7500	2024.09.01	1.54
30	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000	14,440.77	678,716,491	14,808.5425	696,001,502	1.7500	2022.07.04	1.46

(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27年 4月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ. 種類別投資比率

(平成27年 4月30日現在)

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.68
合計	97.68

(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27年 4月30日現在)

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	81,300	7,396.00	601,294,800	8,358.00	679,505,400	4.83
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	466,600	616.90	287,845,540	855.90	399,362,940	2.84
3	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	30,800	6,960.00	214,368,000	7,505.00	231,154,000	1.64
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	44,000	4,007.50	176,330,000	5,242.00	230,648,000	1.64
5	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	53,000	3,548.00	188,044,000	4,041.50	214,199,500	1.52
6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	810,800	194.40	157,627,330	228.70	185,429,960	1.31
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	22,800	6,454.00	147,151,200	8,084.00	184,315,200	1.31
8	日本	株式	KDDI	情報・通信業	59,100	2,531.00	149,582,100	2,840.00	167,844,000	1.19
9	日本	株式	ファナック	電気機器	6,100	18,895.00	115,259,500	26,525.00	161,802,500	1.15
10	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	36,600	3,120.00	114,192,000	4,211.00	154,122,600	1.09
11	日本	株式	キヤノン	電気機器	34,200	3,738.00	127,839,600	4,283.00	146,478,600	1.04
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	23,100	5,121.00	118,295,100	6,157.00	142,226,700	1.01
13	日本	株式	ソニー	電気機器	38,500	2,445.75	94,161,375	3,644.50	140,313,250	0.99
14	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	70,300	1,729.50	121,583,850	1,869.50	131,425,850	0.93
15	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	24,300	4,167.00	101,258,100	5,175.00	125,752,500	0.89
16	日本	株式	パナソニック	電気機器	71,800	1,339.50	96,176,100	1,724.00	123,783,200	0.88
17	日本	株式	三菱地所	不動産業	43,000	2,385.00	102,555,000	2,823.00	121,389,000	0.86
18	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	23,600	3,795.50	89,573,800	4,901.00	115,663,600	0.82
19	日本	株式	三菱商事	卸売業	44,600	2,048.00	91,340,800	2,590.50	115,536,300	0.82
20	日本	株式	日立製作所	電気機器	141,000	873.60	123,177,600	819.30	115,521,300	0.82
21	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	10,800	8,958.00	96,746,400	10,595.00	114,426,000	0.81
22	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	5,300	18,085.00	95,850,500	21,455.00	113,711,500	0.80
23	日本	株式	三井不動産	不動産業	31,000	3,075.00	95,325,000	3,561.50	110,406,500	0.78
24	日本	株式	村田製作所	電気機器	6,200	13,170.00	81,654,000	16,970.00	105,214,000	0.74
25	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	82,700	997.00	82,451,900	1,251.00	103,457,700	0.73
26	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	19,300	4,225.50	81,552,150	5,021.00	96,905,300	0.68
27	日本	株式	花王	化学	16,600	4,900.50	81,348,300	5,749.00	95,433,400	0.67
28	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	44,800	1,888.50	84,604,800	2,125.00	95,200,000	0.67
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	59,000	1,350.50	79,679,500	1,564.00	92,276,000	0.65
30	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	118,900	631.50	75,085,350	773.40	91,957,260	0.65

(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27年 4月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.06
		鉱業	0.42

建設業	2.53
食料品	3.97
繊維製品	0.72
パルプ・紙	0.23
化学	5.74
医薬品	4.67
石油・石炭製品	0.46
ゴム製品	0.92
ガラス・土石製品	0.88
鉄鋼	1.41
非鉄金属	0.88
金属製品	0.60
機械	4.74
電気機器	12.72
輸送用機器	11.24
精密機器	1.36
その他製品	1.47
電気・ガス業	1.95
陸運業	3.95
海運業	0.30
空運業	0.59
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	6.56
卸売業	3.94
小売業	4.20
銀行業	9.29
証券、商品先物取引業	1.35
保険業	2.51
その他金融業	1.25
不動産業	2.93
サービス業	3.04
合計	97.23

（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27年 4月30日現在）

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	18,226	12,972.19	236,431,135	15,308.1599	279,006,524	2.12

2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	24,335	5,792.91	140,970,708	5,838.1400	142,071,137	1.08
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	13,159	11,494.20	151,252,309	10,456.5299	137,597,478	1.04
4	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	11,225	8,942.70	100,381,833	9,271.5119	104,072,722	0.79
5	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	8,699	12,875.80	112,006,585	11,946.4100	103,921,821	0.79
6	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	15,315	6,406.95	98,122,592	6,599.7399	101,075,018	0.76
7	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO (US)	資本財	31,207	3,142.79	98,077,048	3,223.7100	100,602,318	0.76
8	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	8,007	11,334.92	90,758,771	12,248.0219	98,069,912	0.74
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	11,617	7,314.93	84,977,542	7,568.4000	87,922,103	0.66
10	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	2,445	35,567.01	86,961,340	33,995.5439	83,119,105	0.63
11	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	19,580	3,560.48	69,714,199	4,080.5100	79,896,386	0.60
12	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	8,397	10,606.47	89,062,529	9,502.1500	79,789,554	0.60
13	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	5,875	14,137.20	83,056,050	13,295.8699	78,113,236	0.59
14	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	12,896	6,052.33	78,050,976	6,005.9299	77,452,473	0.59
15	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	銀行	59,600	1,157.94	69,013,224	1,186.9804	70,744,032	0.53
16	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	16,119	4,154.28	66,963,000	4,136.4399	66,675,276	0.50
17	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	5,006	10,710.00	53,614,260	13,067.3899	65,415,354	0.49
18	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,859	7,061.45	62,557,474	7,101.9199	62,915,909	0.47
19	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,223	35,683.34	43,640,725	51,095.0302	62,489,222	0.47
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	32,681	2,065.83	67,513,717	1,901.6199	62,146,843	0.47
21	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	3,590	17,089.58	61,351,628	16,946.7899	60,838,976	0.46
22	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	ソフトウェア・サービス	2,922	19,286.32	56,354,656	20,753.5999	60,642,019	0.46
23	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	9,414	6,396.24	60,214,297	6,397.4399	60,225,500	0.45
24	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	6,220	8,996.40	55,957,608	9,575.3350	59,558,584	0.45
25	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	885	65,666.57	58,114,923	66,805.4101	59,122,788	0.45
26	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	12,250	5,036.08	61,691,981	4,818.3100	59,024,298	0.44
27	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	15,025	3,996.01	60,040,200	3,913.3149	58,797,557	0.44
28	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	11,017	4,752.86	52,362,259	5,322.8700	58,642,059	0.44

29	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	896	64,236.80	57,556,178	65,340.5200	58,545,106	0.44
30	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	4,688	12,667.54	59,385,474	12,176.0799	57,081,463	0.43

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年4月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成27年4月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.68
		素材	4.66
		資本財	6.38
		商業・専門サービス	0.82
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.60
		耐久消費財・アパレル	1.55
		消費者サービス	1.52
		メディア	2.91
		小売	3.11
		食品・生活必需品小売り	1.92
		食品・飲料・タバコ	5.53
		家庭用品・パーソナル用品	1.52
		ヘルスケア機器・サービス	3.13
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.16
		銀行	8.54
		各種金融	3.70
		保険	3.82
		不動産	0.65
		ソフトウェア・サービス	6.50
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.07		
電気通信サービス	2.78		
公益事業	2.91		
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			2.13
合計			90.11

(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27年 4月30日現在)

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第101回利付 国債(5年)	360,000,000	100.77	362,807,800	100.66	362,394,000	0.4000	2016.12.20	2.07
2	日本	国債証券	第103回利付 国債(5年)	250,000,000	100.63	251,585,300	100.57	251,447,500	0.3000	2017.03.20	1.44
3	日本	国債証券	第99回利付 国債(5年)	250,000,000	100.71	251,779,400	100.56	251,405,000	0.4000	2016.09.20	1.44
4	日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	230,000,000	106.74	245,503,500	106.45	244,841,900	1.4000	2020.03.20	1.40
5	日本	国債証券	第303回利付 国債(10年)	230,000,000	106.20	244,266,900	105.86	243,494,100	1.4000	2019.09.20	1.39
6	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	230,000,000	101.56	233,604,100	102.89	236,649,300	0.6000	2024.06.20	1.35
7	日本	国債証券	第308回利付 国債(10年)	220,000,000	106.44	234,185,600	106.24	233,745,600	1.3000	2020.06.20	1.33
8	日本	国債証券	第323回利付 国債(10年)	220,000,000	104.69	230,324,600	105.43	231,950,400	0.9000	2022.06.20	1.32
9	日本	国債証券	第335回利付 国債(10年)	220,000,000	100.91	222,004,300	101.91	224,215,200	0.5000	2024.09.20	1.28
10	日本	国債証券	第122回利付 国債(5年)	210,000,000	100.22	210,471,800	100.13	210,289,800	0.1000	2019.12.20	1.20
11	日本	国債証券	第313回利付 国債(10年)	190,000,000	107.06	203,423,000	107.03	203,360,800	1.3000	2021.03.20	1.16
12	日本	国債証券	第315回利付 国債(10年)	190,000,000	106.64	202,624,300	106.72	202,775,600	1.2000	2021.06.20	1.16
13	日本	国債証券	第117回利付 国債(5年)	200,000,000	100.43	200,874,400	100.65	201,312,000	0.2000	2019.03.20	1.15
14	日本	国債証券	第97回利付 国債(5年)	190,000,000	100.61	191,170,400	100.45	190,860,700	0.4000	2016.06.20	1.09
15	日本	国債証券	第290回利付 国債(10年)	180,000,000	104.53	188,156,400	104.01	187,227,000	1.4000	2018.03.20	1.07
16	日本	国債証券	第116回利付 国債(5年)	180,000,000	100.47	180,846,000	100.66	181,204,200	0.2000	2018.12.20	1.03
17	日本	国債証券	第118回利付 国債(5年)	180,000,000	100.41	180,741,200	100.65	181,184,400	0.2000	2019.06.20	1.03
18	日本	国債証券	第285回利付 国債(10年)	170,000,000	103.93	176,689,500	103.19	175,431,500	1.7000	2017.03.20	1.00
19	日本	国債証券	第98回利付 国債(5年)	170,000,000	100.45	170,766,500	100.34	170,579,700	0.3000	2016.06.20	0.97
20	日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	160,000,000	106.28	170,052,200	106.23	169,980,800	1.2000	2020.12.20	0.97
21	日本	国債証券	第310回利付 国債(10年)	150,000,000	105.01	157,518,700	104.89	157,339,500	1.0000	2020.09.20	0.90
22	日本	国債証券	第280回利付 国債(10年)	150,000,000	103.02	154,530,000	102.13	153,201,000	1.9000	2016.06.20	0.87
23	日本	国債証券	第114回利付 国債(5年)	150,000,000	100.88	151,326,000	100.97	151,465,500	0.3000	2018.09.20	0.86
24	日本	国債証券	第318回利付 国債(10年)	130,000,000	105.37	136,986,200	105.69	137,408,700	1.0000	2021.09.20	0.78
25	日本	国債証券	第293回利付 国債(10年)	130,000,000	106.25	138,131,500	105.60	137,280,000	1.8000	2018.06.20	0.78
26	日本	国債証券	第325回利付 国債(10年)	130,000,000	103.91	135,090,800	104.70	136,111,300	0.8000	2022.09.20	0.77
27	日本	国債証券	第109回利付 国債(5年)	130,000,000	100.16	130,217,100	100.27	130,353,600	0.1000	2018.03.20	0.74
28	日本	国債証券	第149回利付 国債(20年)	120,000,000	104.76	125,712,000	107.85	129,422,400	1.5000	2034.06.20	0.74

29	日本	国債証券	第301回利付 国債(10年)	120,000,000	106.38	127,666,800	106.00	127,207,200	1.5000	2019.06.20	0.72
30	日本	国債証券	第329回利付 国債(10年)	120,000,000	103.80	124,561,200	104.71	125,652,000	0.8000	2023.06.20	0.71

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

ロ.種類別投資比率

(平成27年 4月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	80.49
地方債証券	7.14
特殊債券	7.71
社債券	4.24
合計	99.60

(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27年 4月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	193	574,037.37	110,789,214	595,000	114,835,000	7.60
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	179	562,175.5	100,629,416	566,000	101,314,000	6.70
3	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	332	222,403.74	73,838,044	255,000	84,660,000	5.60
4	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	362	171,342.42	62,025,959	190,300	68,888,600	4.56
5	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	237	252,260.74	59,785,796	259,000	61,383,000	4.06
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	306	147,558.25	45,152,827	177,000	54,162,000	3.58
7	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	178	261,693.66	46,581,473	281,800	50,160,400	3.32
8	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	113	390,676.28	44,146,420	430,500	48,646,500	3.22
9	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	181	205,905.97	37,268,982	236,000	42,716,000	2.82
10	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	38	919,381.23	34,936,486	1,087,000	41,306,000	2.73
11	日本	投資証券	GLP投資法人	327	123,206.77	40,288,615	122,800	40,155,600	2.65
12	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	68	519,206.69	35,306,055	585,000	39,780,000	2.63
13	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	60	597,551.82	35,853,109	631,000	37,860,000	2.50
14	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	410	69,914.18	28,664,817	88,300	36,203,000	2.39
15	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	55	611,758.4	33,646,712	648,000	35,640,000	2.35
16	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	228	133,794.36	30,505,115	155,600	35,476,800	2.34
17	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	215	154,583.36	33,235,423	164,700	35,410,500	2.34
18	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	66	408,783.79	26,979,730	466,000	30,756,000	2.03
19	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	114	242,825.85	27,682,148	254,000	28,956,000	1.91
20	日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	51	515,121.9	26,271,216	549,000	27,999,000	1.85
21	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	48	479,963.87	23,038,265	577,000	27,696,000	1.83

22	日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	102	240,751.25	24,556,627	260,900	26,611,800	1.76
23	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	166	142,307.35	23,623,021	158,300	26,277,800	1.73
24	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	48	496,148.35	23,815,121	534,000	25,632,000	1.69
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人	149	145,956.14	21,747,466	165,100	24,599,900	1.62
26	日本	投資証券	プレミアム投資法人	36	538,308.02	19,379,088	665,000	23,940,000	1.58
27	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	365	40,656.48	14,839,618	62,600	22,849,000	1.51
28	日本	投資証券	福岡リート投資法人	102	202,121.14	20,616,357	217,700	22,205,400	1.47
29	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	134	147,924.12	19,821,833	161,100	21,587,400	1.42
30	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	107	166,021.6	17,764,312	186,900	19,998,300	1.32

(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27年 4月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.16
合計	98.16

(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27年 4月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	3,200	20,041.98	64,134,336	21,788.9000	69,724,480	6.72
2	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	4,400	11,099.48	48,837,717	11,127.6900	48,961,836	4.72
3	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3,500	9,628.29	33,699,015	10,066.2100	35,231,735	3.39
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	1,500	20,410.88	30,616,320	22,439.8300	33,659,745	3.24
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	3,700	7,842.10	29,015,770	8,974.9800	33,207,426	3.20
6	アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	3,600	8,026.55	28,895,580	8,801.2400	31,684,464	3.05
7	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	3,500	7,902.79	27,659,765	8,433.5300	29,517,355	2.84
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,400	17,775.03	24,885,042	19,962.2500	27,947,150	2.69
9	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	5,300	4,651.71	24,654,063	4,888.5200	25,909,156	2.49
10	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1,600	14,227.64	22,764,224	16,050.7200	25,681,152	2.47
11	アメリカ	投資証券	HCP INC	4,800	5,057.50	24,276,000	4,912.3200	23,579,136	2.27
12	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1,700	11,287.15	19,188,155	12,534.2700	21,308,259	2.05
13	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	5,500	3,927.00	21,598,500	3,775.8700	20,767,285	2.00
14	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	7,900	2,556.12	20,193,348	2,412.1300	19,055,827	1.83
15	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	700	22,262.52	15,583,764	26,753.5800	18,727,506	1.80
16	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	5,300	2,873.85	15,231,405	3,318.9100	17,590,223	1.69
17	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	600	28,437.89	17,062,736	29,131.2000	17,478,720	1.68
18	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	1,600	8,112.23	12,979,568	9,724.6800	15,559,488	1.50
19	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	1,000	12,919.83	12,919,830	14,763.1400	14,763,140	1.42
20	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2,300	5,182.45	11,919,635	5,690.5800	13,088,334	1.26
21	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	4,300	2,714.39	11,671,877	2,930.9700	12,603,171	1.21

22	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	700	14,534.66	10,174,262	16,264.9200	11,385,444	1.09
23	アメリカ	投資証券	UDR INC	2,700	3,397.45	9,173,115	3,978.1700	10,741,059	1.03
24	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,400	7,662.41	10,727,374	7,598.1500	10,637,410	1.02
25	アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	9,700	1,413.72	13,713,084	1,078.1400	10,457,958	1.00
26	アメリカ	投資証券	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	1,800	4,802.84	8,645,112	5,078.9200	9,142,056	0.88
27	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	3,600	2,124.15	7,646,940	2,377.6200	8,559,432	0.82
28	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,100	6,523.58	7,175,938	7,745.7100	8,520,281	0.82
29	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	900	8,464.47	7,618,023	9,077.3200	8,169,588	0.78
30	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	1,900	4,731.44	8,989,736	4,212.6000	8,003,940	0.77

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年4月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別投資比率

(平成27年4月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.63
合計	98.63

【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27年 4月30日現在）

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	24	日本円	380,030,920	381,240,000	2.71

（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27年 4月30日現在）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	S&P500 EMINI	買建	69	米ドル	7,124,877	847,860,363	7,241,550	861,744,450	6.56
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 601X	買建	3	カナダド ル	520,256	51,520,951	535,560	53,036,506	0.40
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EURO ST50	買建	37	ユーロ	1,335,676	176,696,578	1,318,680	174,448,177	1.32
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI 200	買建	3	オース トラリア ドル	437,511	41,751,674	437,025	41,705,295	0.31
	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	10	英ポンド	677,070	124,445,466	691,950	127,180,410	0.96

（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27年 4月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新光J-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
第17特定期間末（平成27年4月20日）	7,692,606,511	7,709,179,240	0.9283	0.9303
平成26年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	
11月末日	8,353,359,668		0.9200	

12月末日	8,201,635,471		0.9300
平成27年 1月末日	7,934,237,505		0.9196
2月末日	7,894,906,768		0.9291
3月末日	7,791,986,343		0.9291
4月末日	7,670,475,894		0.9313

(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
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4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
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4月20日	13.9

(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
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4月20日	13,815,643	989,033,927

(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

2015年4月30日現在

<基準価額・純資産の推移> (2006年10月31日～2015年4月30日)



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

<分配の推移>

2015年4月	20円
2015年3月	20円
2015年2月	20円
2015年1月	20円
2014年12月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	3,080円

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

<主要な資産の状況>

組入状況

ファンド名	純資産比率
新光外国株式インデックスマザーファンド	14.40%
海外国債マザーファンド	14.22%
新光J-REITマザーファンド	14.19%
新光日本債券インデックスマザーファンド	13.99%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	13.78%
フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	13.68%
新光米国REITマザーファンド	13.29%
合計	97.58%

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	4.83%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.84%
ソフトバンク	情報・通信業	1.64%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.64%
本田技研工業	輸送用機器	1.52%

※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101回利付国債(5年)	2016/12/20	0.400%	2.07%
第103回利付国債(5年)	2017/03/20	0.300%	1.44%
第99回利付国債(5年)	2016/09/20	0.400%	1.44%
第306回利付国債(10年)	2020/03/20	1.400%	1.40%
第303回利付国債(10年)	2019/09/20	1.400%	1.39%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

国内REITの組入上位5銘柄(新光J-REITマザーファンド)

銘柄名	純資産比率
日本ビルファンド投資法人	7.60%
ジャパンリアルエステイト投資法人	6.70%
日本リテールファンド投資法人	5.60%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.56%
日本プロダクトリート投資法人	4.06%

※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。

2015年4月30日現在

外国株式等の組入上位5銘柄(新光外国株式インデックスマザーファンド)

銘柄名	国・地域	業種	純資産比率
APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.12%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.08%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.04%
NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	0.79%
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	0.79%

※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	2024/08/15	2.375%	米ドル	5.10%
US TREASURY N/B	2024/11/15	2.250%	米ドル	5.04%
US TREASURY N/B	2024/05/15	2.500%	米ドル	5.02%
US TREASURY N/B	2023/11/15	2.750%	米ドル	4.57%
US TREASURY N/B	2024/02/15	2.750%	米ドル	3.97%

※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4月14日現在)

①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	50.8%
ユーロ	8.4%
ブラジルレアル	5.0%
ウルグアイペソ	3.7%
メキシコペソ	3.6%

②組入公社債の上位5ヵ国

国・地域	比率
その他(国際機関債)	8.6%
ロシア	6.7%
ナイジェリア	6.1%
カザフスタン	5.0%
トルコ	4.7%

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

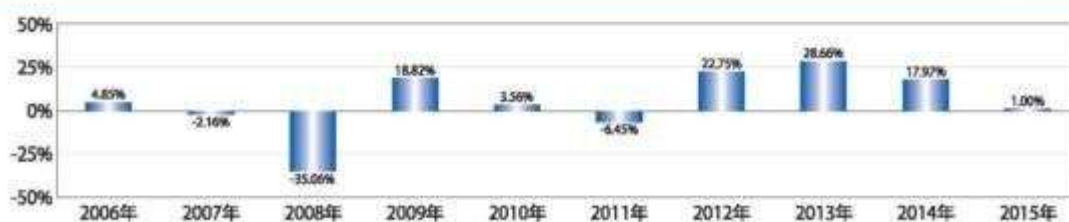
米国REITの組入上位5銘柄(新光米国REITマザーファンド)

銘柄名	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	6.72%
AMERICAN TOWER CORPORATION	4.72%
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3.39%
PUBLIC STORAGE	3.24%
EQUITY RESIDENTIAL	3.20%

※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



※税引前の分配金を単純に合算して計算しています。
 ※当ファンドにはベンチマークがありません。
 ※2006年については、設定時から12月末までの収益率を記載しています。
 ※2015年については、年初から4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】

3【資産管理等の概要】

(3) 【信託期間】

< 訂正前 >

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。

(略)

< 訂正後 >

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から平成33年10月20日までです。

(略)

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17期特定期間（平成26年10月21日から平成27年4月20日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【新光7資産バランスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期特定期間末 平成26年10月20日現在	第17期特定期間末 平成27年4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	172,274,564	215,640,249
投資信託受益証券	1,059,391,000	1,035,448,000
親投資信託受益証券	6,422,275,155	6,478,161,182
未収入金	41,000,000	-
未収利息	161	224
流動資産合計	7,694,940,880	7,729,249,655
資産合計	7,694,940,880	7,729,249,655
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	18,523,165	16,572,729
未払解約金	25,471,550	13,243,800
未払受託者報酬	517,565	570,669
未払委託者報酬	5,628,505	6,206,022
その他未払費用	30,916	49,924
流動負債合計	50,171,701	36,643,144
負債合計	50,171,701	36,643,144
純資産の部		
元本等		
元本	9,261,582,919	8,286,364,635
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,616,813,740	593,758,124
（分配準備積立金）	210,928,244	219,272,756
元本等合計	7,644,769,179	7,692,606,511
純資産合計	7,644,769,179	7,692,606,511
負債純資産合計	7,694,940,880	7,729,249,655

(2)【損益及び剰余金計算書】

	第16期特定期間		第17期特定期間	
	自	平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自	平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
営業収益				
受取配当金		78,075,000		78,075,000
受取利息		42,263		49,960
有価証券売買等損益		358,418,103		1,008,943,027
営業収益合計		436,535,366		1,087,067,987
営業費用				
受託者報酬		3,415,825		3,444,357
委託者報酬		37,147,061		37,457,284
その他費用		203,021		245,362
営業費用合計		40,765,907		41,147,003
営業利益		395,769,459		1,045,920,984
経常利益		395,769,459		1,045,920,984
当期純利益		395,769,459		1,045,920,984
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		2,221,235		13,356,887
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,064,683,825		1,616,813,740
剰余金増加額又は欠損金減少額		170,722,582		95,757,575
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		170,722,582		95,757,575
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,594,514		1,229,348
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,594,514		1,229,348
分配金		114,806,207		104,036,708
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,616,813,740		593,758,124

(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17期特定期間	
	自	平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 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。	

(貸借対照表に関する注記)

第16期特定期間末 平成26年10月20日現在	第17期特定期間末 平成27年 4月20日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 9,261,582,919口	1. 特定期間末日における受益権の総数 8,286,364,635口

2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,616,813,740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 593,758,124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)	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 0.9283円 (1万口当たり純資産額) (9,283円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	第17期特定期間 自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
分配金の計算過程	<p>第89期（自 平成26年 4月22日 至 平成26年 5月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（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90期（自 平成26年 5月21日 至 平成26年 6月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（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91期（自 平成26年 6月21日 至 平成26年 7月22日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（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95期（自 平成26年10月21日 至 平成26年11月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,419,545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（3,418,830円）及び分配準備積立金（207,282,238円）より分配対象収益は234,120,613円（1万口当たり257.35円）であり、うち18,193,541円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第96期（自 平成26年11月21日 至 平成26年12月22日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,146,329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（3,457,440円）及び分配準備積立金（210,179,416円）より分配対象収益は236,783,185円（1万口当たり263.29円）であり、うち17,984,852円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第97期（自 平成26年12月23日 至 平成27年 1月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（22,308,993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（3,418,470円）及び分配準備積立金（207,911,835円）より分配対象収益は233,639,298円（1万口当たり269.88円）であり、うち17,313,554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> <p>第94期（自 平成26年 9月23日 至 平成26年10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（24,617,903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。</p>	<p>第98期（自 平成27年 1月21日 至 平成27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（17,036,821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（3,456,215円）及び分配準備積立金（210,642,363円）より分配対象収益は231,135,399円（1万口当たり270.08円）であり、うち17,114,744円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第99期（自 平成27年 2月21日 至 平成27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（24,023,937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（3,431,630円）及び分配準備積立金（207,668,970円）より分配対象収益は235,124,537円（1万口当たり278.95円）であり、うち16,857,288円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第100期（自 平成27年 3月21日 至 平成27年 4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（24,327,559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（3,400,637円）及び分配準備積立金（211,517,926円）より分配対象収益は239,246,122円（1万口当たり288.70円）であり、うち16,572,729円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>
---	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	第16期特定期間 自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	第17期特定期間 自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資信託受益証券、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p>	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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16期特定期間末 平成26年10月20日現在	第17期特定期間末 平成27年 4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>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

	第16期特定期間 自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	第17期特定期間 自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第16期特定期間末 平成26年10月20日現在	第17期特定期間末 平成27年 4月20日現在
期首元本額	10,169,356,853円	9,261,582,919円
期中追加設定元本額	8,899,172円	13,815,643円
期中一部解約元本額	916,673,106円	989,033,927円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第16期特定期間末 平成26年10月20日現在	第17期特定期間末 平成27年 4月20日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当特定期間の損益に含まれた評価差額 （円）
投資信託受益証券	41,640,000	14,400,500
親投資信託受益証券	189,510,060	20,548,329
合計	231,150,060	6,147,829

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・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	173,500	1,035,448,000	
投資信託受益証券 小計		173,500	1,035,448,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	472,102,025	1,087,628,645	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	571,177,263	1,104,142,767	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	550,960,391	1,089,744,557	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	886,444,703	1,076,143,869	
	新光J-REITマザーファンド	669,236,233	1,089,315,816	
	新光米国REITマザーファンド	695,618,948	1,031,185,528	
親投資信託受益証券 小計		3,845,539,563	6,478,161,182	
合計		3,845,713,063	7,513,609,182	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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

「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」は、ケイマン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの平成26年11月30日現在の財務書類は、国際財務報告基準に従い作成されておりますが、独立監査人の監査を受けておりません。

同ファンドの財政状態計算書、包括利益計算書、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（無監査）

2014年11月30日現在

	注記	2014年11月30日 現在 (日本円)	2014年5月31日 現在 (日本円)
資産			
流動資産			
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	4(a)	39,304,410,778	42,740,987,754
ブローカーに対する債権		50,786,323	288,324,826
発行に係る未収入金		4,151,412	62,340,480
現金および現金同等物	5	1,517,719,250	1,492,885,496
その他の債権	6(d)	3,777,074	6,720,638
資産合計		40,880,844,837	44,591,259,194
負債			
流動負債			
償還に係る未払金		97,391,966	67,437,408
ブローカーに対する債務		23,322,991	99,129,427
未払費用	7	39,281,025	47,134,875
負債合計		159,995,982	213,701,710
受益証券保有者に帰属する純資産	8	40,720,848,855	44,377,557,484

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部です。

（2）包括利益計算書（無監査）

2014年11月30日に終了した半年間

	注記	2014年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2013年11月30日に 終了した半年間 (日本円)
収益			

受取利息		121,731	40,707
為替差益純額		181,324,587	100,291,434
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る公正価値のその他の純変動額	4(b)	4,736,592,751	352,151,053
純収益合計		4,918,039,069	452,483,194
費用			
運用報酬	6(a)	82,767,198	122,252,870
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	6(b)	21,086,882	30,372,804
保管受託銀行報酬	6(c)	8,996,944	10,074,135
費用の払戻し	6(d)	(3,777,074)	(1,038,432)
監査報酬		3,745,999	3,002,369
当座借越利息		-	2,242
その他の営業費用		1,736,775	36,510
営業費用合計		114,556,724	164,702,498
税引前利益		4,803,482,345	287,780,696
源泉税		(6,154,784)	-
営業による受益証券保有者に帰属する純資産の増加額		4,797,327,561	287,780,696

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部です。

（３）受益証券保有者に帰属する純資産変動計算書（無監査）

2014年11月30日に終了した半年間

	注記	2014年11月30日に 終了した半年間		2013年11月30日に 終了した半年間	
		受益証券口数	(日本円)	受益証券口数	(日本円)
受益証券保有者に 帰属する純資産期 首残高		7,021,982	44,377,557,484	9,631,135	66,979,115,060
営業による受益証券 保有者に帰属する 純資産の増加額		-	4,797,327,561	-	287,780,696
半年間の分配金	10	-	(3,002,521,200)	-	(5,207,985,180)
受益証券の発行		368,600	2,362,321,125	1,425,972	9,242,283,272
受益証券の償還		(1,240,116)	(7,813,836,115)	(1,863,048)	(11,975,949,236)
受益証券保有者に 帰属する純資産期 末残高		6,150,466	40,720,848,855	9,194,059	59,325,244,612

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部です。

（４）キャッシュ・フロー計算書（無監査）

2014年11月30日に終了した半年間

	注記	2014年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2013年11月30日に 終了した半年間 (日本円)
営業活動によるキャッシュ・フロー			
包括利益合計		4,797,327,561	287,780,696
- 源泉税		6,154,784	-
- 受取利息		(121,731)	(40,707)
- 当座借越利息		-	2,242
運転資本変動前営業キャッシュ・フロー		4,803,360,614	287,742,231
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)		3,436,576,976	(2,237,304,408)
- ブローカーに対する債権の減少		237,538,503	-
- その他の債権の減少 / (増加)		2,943,564	(1,038,432)
- ブローカーに対する債務の減少		(75,806,436)	(231,334,913)
- 未払費用の減少		(7,853,850)	(4,108,857)
営業によるキャッシュ		8,396,759,371	(2,186,044,379)

源泉税支払額	(6,154,784)	-
利息受取額	121,731	40,707
営業活動による正味キャッシュ収入 / (支出)	8,390,726,318	(2,186,003,672)
財務活動によるキャッシュ・フロー		
償還可能受益証券保有者に対する分配金支払額	(3,002,521,200)	(5,207,985,180)
受益証券の発行による収入	2,420,510,193	10,886,859,752
受益証券の償還による支払	(7,783,881,557)	(11,716,278,474)
当座借越利息	-	(2,242)
財務活動による正味キャッシュ支出	(8,365,892,564)	(6,037,406,144)
現金および現金同等物の純増加 / (減少) 額	24,833,754	(8,223,409,816)
現金および現金同等物期首残高	1,492,885,496	8,730,924,392
現金および現金同等物期末残高	5 1,517,719,250	507,514,576

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部です。

(5) 財務書類に対する注記（無監査）
2014年11月30日に終了した半年間

本注記は、添付の財務書類の不可分の一部であり、財務書類と併せて読まれるべきです。

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」といいます。）は、ケイマン諸島で設立され、同地に籍を置いています。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です。当ファンドは、2006年3月8日に設立され、2006年4月3日に運用を開始しました。

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ます。

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 テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（以下「投資顧問会社」といいます。）により管理されています。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」といいます。）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ます。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ます。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す。

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ます。

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ません。

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す。これらの方針は、別途記載がない限り、表示されたすべての期間において首尾一貫して適用されています。

本財務書類は、国際財務報告基準（以下「IFRS」といいます。）に準拠して作成されています。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みます。）の再評価によって修正されています。

IFRSに準拠したこれらの財務書類の作成では、当ファンドの会計方針を適用する過程で経営者が判断を行うことが要求されています。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ます。

2.1 作成の基礎

(a) 2014年6月1日より発効される基準および既存の基準の修正

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日以後開始する年度から発効されます。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、適用における不整合に対処しています。

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ます。当該修正は、当ファンドの財政状態または業績に影響を及ぼさない見込みです。

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、解釈指針または既存の基準の修正は、他にありません。

(b) 2014年6月1日以降に発効する早期適用されていない新基準、修正および解釈指針

IFRS第9号「金融商品」は、2018年1月1日以後開始する年度から発効され、金融資産および金融負債の分類、測定および認識について取り扱っています。IFRS第9号の完全版は、IAS第39号のほとんどのガイダンスを

置き換えるものです。IFRS第9号は、混合測定モデルを維持しつつ簡略化しており、金融資産について、償却原価、その他の包括利益を通じた公正価値および純損益を通じた公正価値という3つの主要な測定区分を定めています。

分類のベースは、企業の事業モデルおよび金融資産の契約上のキャッシュ・フローの特性に依拠します。資本性金融商品に対する投資は、純損益を通じて公正価値で測定することが要求され、当初認識時に、公正価値の変動をその他の包括利益に表示するという取消不能な選択をすることになります。IAS第39号で用いていた発生損失モデルは、新たな予想信用損失モデルに置き換えられることになります。

純損益を通じて公正価値で測定するものとして指定された負債について自己の信用リスクの変化をその他の包括利益として認識することを除き、金融負債に関して分類および測定の変更はありません。IFRS第9号は、ヘッジの有効性テストに関する数値基準を置き換えることにより、ヘッジの有効性に関する要求事項を緩和しています。同基準は、ヘッジ対象とヘッジ手段の間に経済的関係を要求しており、「ヘッジ比率」は経営者がリスク管理目的で実際に使用する比率と同じでなければなりません。同時的な文書化は引き続き要求されますが、IAS第39号に基づいて現在作成されているものとは異なります。当該新基準は当ファンドの財政状態または業績に重大な影響を及ぼさない見込みです。

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ます。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す。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ます。

(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ます。外貨建取引の決済から、および外貨建金融資産および金融負債の期末換算レートでの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ます。

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

金融資産は、主として短期間に売却または買戻しを行う目的で取得したかまたは発生した場合、あるいは当初認識時において、まとめて管理され、かつ、最近における実際の短期的な利益獲得のパターンの証拠がある識別された金融商品のポートフォリオの一部である場合に、売買目的保有として分類されます。

当初認識時に純損益を通じて公正価値で測定するものとして指定された金融資産は、売買目的保有として分類されない金融商品であるが、当ファンドの文書化された投資戦略に従って公正価値ベースで管理され業績評価されます。

債券およびワラントに対する投資は、当初認識時に純損益を通じて公正価値で測定するものとして指定されます。

(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ます。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ます。

(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ます。取引費用は、包括利益計算書に費用計上されます。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ます。「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ます。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」に認識されます。

(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、期末現在の取引市場価格に基づいています。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す。

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ます。当ファンドは、様々な方法を使用し、各年度末現在の市況に基づく仮定を行っています。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ます。

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します。

2.5 ブローカーに対する債権および債務

ブローカーに対する債権および債務の金額は、それぞれ、契約済であるが報告期間末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未収金および購入有価証券に関する未払金を表しています。

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）で測定されます。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ます。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ます。

2.6 現金および現金同等物

現金および現金同等物は要求払銀行預金で構成されています。

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ます。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ます。

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ます。受益証券は、当ファンドの純資産の比例持分に相当する現金と引き換えに、いつでも当ファンドに対する償還請求が可能です。

受益証券は、受益証券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口当たり純資産額に基づく価格で発行および償還されます。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、発行済受益証券の合計口数で除することにより算定されます。当ファンドの規則の条項に従い、投資ポジションは、発行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ます。

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ます。

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の変動計算書に認識されます。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ます。

2.11 課税

当ファンドはケイマン諸島に籍を置いています。

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、売却またはその他に係るケイマン諸島の税金について支払義務はありません。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ります。このような収益または利得は、包括利益計算書に源泉税込みの総額で計上されます。源泉税は、包括利益計算書に個別項目として表示されています。

3 金融リスク管理

3.1 金融商品を利用する際の戦略

当ファンドは、投資取引に従事しており、その活動により様々な金融リスクにさらされています。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りますが、投資顧問会社は、特に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ます。

3.2 市場価格リスク

市場価格リスクは、主に、当ファンドが保有する純損益を通じて公正価値で測定する金融資産の将来価格の不確実性から生じます。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ます。当ファンドの活動の特性に直接的に起因して、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となります。しかし、トップダウンによるリスク管理により、（安全のために）国ごとの最大エクスポージャーを設定してこのリスクを限定することで、この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ます。この目的は、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ます。

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額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ります。下表をご参照ください。

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は最もリスクが高くなっています。当ファンドの純資産総額に基づく投資制限が、以下に示されています。

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ます。

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)です。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ります。以下に示すVaRは、純資産額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ます。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ます。

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ます。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ります。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ます。

2014年11月30日の感応度分析は、VaRモデルを使用して実施されました。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みます。)間の相互依存性をより良く反映することが可能です。

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

	2014年11月30日現在	2014年5月31日現在
VaR(%)	7.346%	7.341%
VaR(金額)	2,991,353,557円	3,257,756,495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ます。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ります。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%を超える投資は行いません。

2014年11月30日および2014年5月31日現在、当ファンドが保有するクレジット・リンク債はありません。

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」といいます。)にも投資を行っています。これらのOIPOは相対的に流動性が低いため、有価証券の価格が毎日定期的に変動しないことから、リスクの見積りおよび感応度分析は困難になります。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、当レビュー半年間における月次総利回りの最大値、最小値および中央値に着目することです。

以下の表は、OIPOから導出された当半年間の月次総利回りの中央値、最小値および最大値による資本金および剰余金の変動を説明したものです。

	資本金および剰余金の変動			
	2014年11月30日		2014年5月31日	
	(%)	(日本円)	(%)	(日本円)
ナイジェリア原油ワラント				
月次総利回り中央値	1.14	26,841,110	0.00	-
月次総利回り最小値	0.00	-	(1.65)	(34,197,228)
月次総利回り最大値	2.83	66,631,879	1.68	34,818,996
ベネズエラ原油ワラント				
月次総利回り中央値	(2.71)	(33,995,695)	(0.75)	(12,939,180)
月次総利回り最小値	(14.81)	(185,784,590)	(8.42)	(145,263,858)
月次総利回り最大値	5.38	67,489,608	12.79	220,656,145

3.3 金利リスク

当ファンドは、その利付金融資産および負債によって、財政状態およびキャッシュ・フローに関する市場金利の実勢水準の変動の影響に関連するリスクにさらされています。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ます。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ます。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ます。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す。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、契約上の価格改定日または満期日のいずれか早い方により分類されています。

	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11月30日現在						
資産						
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	1,363,961,560	4,620,024,343	13,615,600,621	15,342,229,744	4,362,594,510	39,304,410,778
ブローカーに対する債権	-	-	-	-	50,786,323	50,786,323
発行に係る未収入金	-	-	-	-	4,151,412	4,151,412
現金および現金同等物	1,517,719,250	-	-	-	-	1,517,719,250
その他の債権	-	-	-	-	3,777,074	3,777,074
資産合計	2,881,680,810	4,620,024,343	13,615,600,621	15,342,229,744	4,421,309,319	40,880,844,837
負債						
償還に係る未払金	-	-	-	-	97,391,966	97,391,966
ブローカーに対する債務	-	-	-	-	23,322,991	23,322,991
未払費用	-	-	-	-	39,281,025	39,281,025
負債合計	-	-	-	-	159,995,982	159,995,982
金利感応度ギャップ合計	2,881,680,810	4,620,024,343	13,615,600,621	15,342,229,744		

	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						
資産						
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	2,758,135,168	3,273,865,044	14,011,244,470	18,899,959,808	3,797,783,264	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
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

金利感応度ギャップ合計

4,251,020,664 3,273,865,044 14,011,244,470 18,899,959,808

金利感応度分析

金利リスクに対する感応度分析は、VaRが使用されていることから、2014年11月30日および2014年5月31日現在において、個別に開示されていません。注記3.2 市場価格リスクをご参照ください。

3.4 為替リスク

当ファンドは、機能通貨である日本円以外の通貨建の資産を保有しています。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ます。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ります。

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す。

	2014年11月30日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
資産		
ブラジル・リアル	2,451,532,779	2,319,227,818
コロンビア・ペソ	588,680,029	506,080,356
コスタリカ・コロン	1,493,597,199	1,253,139,934
ドイツ・マルク	1,363,961,560	1,323,244,904
ドミニカ・ペソ	-	497,130,064
ユーロ	2,827,646,076	3,402,420,073
ガーナ・セディ	1,077,383,740	822,301,572
インド・ルピー	1,313,809,365	1,157,777,395
日本円	437,250,172	157,532,380
ケニア・シリング	717,663,315	547,915,158
メキシコ・ヌエボ・ペソ	1,477,322,441	1,384,028,602
新トルコ・リラ	1,168,301,162	1,048,432,057
ナイジェリア・ナイラ	808,512,866	1,266,058,479
ロシア・ルーブル	703,756,062	935,988,745
セルビア・ディナール	666,798,159	822,258,051
南アフリカ・ランド	1,416,025,766	1,598,026,185
ウガンダ・シリング	655,586,629	591,745,878
ウルグアイ・ペソ	1,617,549,839	1,525,887,179
米ドル	19,644,453,878	23,432,064,364
ザンビア・クワチャ	451,013,800	-
資産合計	40,880,844,837	44,591,259,194
負債		
日本円	124,047,651	98,368,952
シンガポール・ドル	2,441,525	4,869,735
新トルコ・リラ	23,322,991	99,129,427
米ドル	10,183,815	11,333,596
負債合計	159,995,982	213,701,710

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11月30日および2014年5月31日現在において、個別に開示されていません。注記3.2 市場価格リスクをご参照ください。

3.5 信用リスクおよび相手方リスク

当ファンドは、発行体または相手方が期日に全額を支払うことができなくなるリスクである信用リスクに対するエクスポージャーを引き受けています。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ります。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ます。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ります。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ます。

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ます。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ます。

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投資方

針を厳守することを確保しています。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ます。2014年11月30日現在、当ファンドの有価証券の平均信用格付けは、BB+ (2014年5月31日：BB) です。

格付 (ムーディーズ / スタンダード・アンド・プアーズ)	2014年11月30日現在 純資産比率 (%)	2014年5月31日現在 純資産比率 (%)
Aaa / AAA	9.25	7.84
Baa1 / BBB+	7.10	6.49
Baa2 / BBB	0.91	3.46
Baa3 / BBB-	15.49	14.32
Ba1 / BB+	3.12	3.08
Ba2 / BB	4.74	2.82
Ba3 / BB-	18.05	22.55
B1 / B+	11.69	9.82
B2 / B	10.35	11.96
B3 / B-	7.17	4.00
Caa1 / CCC+	3.08	3.89
Caa3 / CCC-	3.73	3.96
D (スタンダード・アンド・プアーズのみ)	1.85	2.11
その他の純資産*	3.47	3.70
	100.00	100.00

* その他の純資産には、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ならびに未払費用の全額が含まれています。

報告期間末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、以下のとおりです。

	2014年11月30日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
債券	35,695,473,723	38,943,204,490
デリバティブ資産	3,608,937,055	3,797,783,264
ブローカーに対する債権	50,786,323	288,324,826
発行に係る未収入金	4,151,412	62,340,480
現金および現金同等物	1,517,719,250	1,492,885,496
その他の債権	3,777,074	6,720,638
合計	40,880,844,837	44,591,259,194

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、これら資産には、減損しているものも、期日が経過しているが減損していないものもありません。

	2014年11月30日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
Astana Finance 7.875% 08/06/2010	753,657,455	937,760,200
Astana Finance JSC ADR*	-	-
	753,657,455	937,760,200

* 2014年11月30日および2014年5月31日現在、当該有価証券はゼロ評価されました。

上記の投資は、不履行となっている支払を2014年11月30日および2014年5月31日現在の公正価値の考慮に入れています。

以下の表は、2014年11月30日および2014年5月31日現在の主要な相手方に保有する金融資産の比率を要約したものです。

	純資産比率 (%)	ムーディーズの 信用格付
2014年11月30日現在 銀行		

バンク オブ ニューヨーク メロン	3.73	A1
保管受託銀行		
バンク オブ ニューヨーク メロン	96.52	A1
	純資産比率 (%)	ムーディーズの 信用格付
2014年5月31日現在		
銀行		
バンク オブ ニューヨーク メロン	3.36	A1
保管受託銀行		
バンク オブ ニューヨーク メロン	96.31	A1

報告期間末現在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す。

3.6 流動性リスク

当ファンドは日々、現金による受益証券の償還を行っています。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ます。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ます。

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す。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ます。

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す。

当ファンドは適宜、店頭で取引されるデリバティブ商品(主にクレジット・リンク債)に投資する場合があります。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ります。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ります。

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ます。

以下の表は、当ファンドの金融資産および金融負債を、報告期間末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す。表中の金額は、契約上の割引前キャッシュ・フローです。

	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11月30日現在			
資産			
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	39,304,410,778	-	39,304,410,778
ブローカーに対する債権	50,786,323	-	50,786,323
発行に係る未収入金	4,151,412	-	4,151,412
現金および現金同等物	1,517,719,250	-	1,517,719,250
その他の債権	-	3,777,074	3,777,074
合計	40,877,067,763	3,777,074	40,880,844,837
負債			
償還に係る未払金	97,391,966	-	97,391,966
ブローカーに対する債務	23,322,991	-	23,322,991
未払費用	-	39,281,025	39,281,025
合計	120,714,957	39,281,025	159,995,982

	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

3.7 自己資本リスク管理

当ファンドの自己資本は、当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金です。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追加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ります。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、その他のステークホルダーに便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発展を支えるために、強固な自己資本基盤を維持することです。

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す。

- ・ 過剰取引に関して、日々の追加申込および償還請求の水準を監視します。
- ・ 当ファンドの定款に従って、受益証券を償還します。これには、受益証券の償還合計口数を取引日における発行済受益証券の10%以上に制限する能力が含まれます。受益証券の償還がそのように制限された場合、受益証券は、受益証券保有者間で比例償還され、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ます。

報告期間末現在、受益証券保有者は1名（2014年5月31日：1名）であり、当ファンドの84%（2014年5月31日：82%）の持分を保有していました。

3.8 公正価値の見積り

公正価値ヒエラルキーには、以下のレベルがあります。

- ・ 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ます。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ます。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の測定です。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、判断を必要とします。

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す。当ファンドは、容易に入手可能な、定期的に配信または更新される、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ます。

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に分類されます。

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ます。

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しています。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ます。当ファンドは、必要な場合には当該モデルを修正します。

価格が入手不能であるソブリン短期証券の場合、日々増値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による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します。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ます。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ません。代わりに、感応度分析は、その他の投資と共に注記3.2で実施されています。報告期間末現在、実効金利による価格付けの手法を用いて評価されたソブリン短期証券はありません。

以下の表は、報告期間末現在、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す。

2014年11月30日現在 資産	レベル1 (日本円)	レベル2 (日本円)	レベル3 (日本円)	合計 (日本円)
当初認識時に純損益を通じて公正価値で測定するものとして指定された金融資産				
- 債券	-	35,695,473,723	-	35,695,473,723
- デリバティブ資産	-	3,608,937,055	-	3,608,937,055
資産合計	-	39,304,410,778	-	39,304,410,778

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)
当初認識時に純損益を通じて公正価値で測定するものとして指定された金融資産				
- 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

以下の表は、2014年11月30日および2014年5月31日に終了した報告期間に係るレベル3の商品の変動を示したものです。

	債券 2014年11月30日現在 (日本円)	債券 2014年5月31日現在 (日本円)
期首残高	-	1,630,069,312
購入	-	-
売却	-	(1,651,866,293)
レベル3への振替	-	-
レベル3からの振替	-	-
包括利益計算書に認識された損益合計	-	21,796,981
期末残高	-	-
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純変動額	-	(373,995,354)

2014年11月30日および2014年5月31日現在、レベル1に分類される現金および現金同等物を除き、当ファンドの公正価値で測定されない資産および負債はレベル2に分類されています。これらの資産および負債の帳簿価額は、報告日末日現在の公正価値に近似しています。

4 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産

(a) 投資ポートフォリオ - 内訳

	2014年11月30日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
当初認識時に純損益を通じて公正価値で測定するものとして指定された金融資産		
債券	35,695,473,723	38,943,204,490
原油ワラント	3,608,937,055	3,797,783,264
合計	39,304,410,778	42,740,987,754

(b) 投資ポートフォリオ - 半年間の損益

	2014年11月30日 (日本円)	2013年11月30日 (日本円)
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		
- 実現	2,025,682,114	2,398,263,253
- 未実現の変動額	2,710,910,637	(2,046,112,200)
利益合計	4,736,592,751	352,151,053

5 現金および現金同等物

キャッシュ・フロー計算書の目的上、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ます。

	2014年11月30日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
現金および現金同等物	1,517,719,250	1,492,885,496

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す。

6 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ます。

本財務書類中に別途開示された以外に、報告期間中に以下の関連当事者との取引が行われました。

(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しています。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、後払いされます。

(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100百万米ドル以下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%で課されます。

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100百万米ドル以下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%で課されます。

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します。当該年間報酬は、日々発生し、後払いされます。

(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（以下「保管受託銀行」といいます。）のサービスを契約しています。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ます。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ます。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ます。

(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%と定められています。この金額は、投資顧問会社から払い戻される予定です。

以下の表は、報告期間における関連当事者との取引の詳細です。

	費用		債務	
	2014年11月30日 (日本円)	2013年11月30日 (日本円)	2014年11月30日 現在 (日本円)	2014年5月31日 現在 (日本円)
(a) 運用報酬	82,767,198	122,252,870	26,655,685	30,931,544
(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	21,086,882	30,372,804	6,481,664	6,629,387
(c) 保管受託銀行報酬	8,996,944	10,074,135	3,390,807	4,083,218
費用合計	112,851,024	162,699,809	36,528,156	41,644,149
			債権	
(d) 費用 払戻し	(3,777,074)	(1,038,432)	3,777,074	6,720,638

7 未払費用

2014年11月30日現在

2014年5月31日現在

	（日本円）	（日本円）
未払運用報酬	26,655,685	30,931,544
未払受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	6,481,664	6,629,387
未払保管受託銀行報酬	3,390,807	4,083,218
未払監査報酬	2,752,869	5,490,726
	39,281,025	47,134,875

未払費用の帳簿価額は、報告期間末現在の公正価値に近似していました。

8 受益証券

すべての受益証券は、分配金を受け取る権利があり、償還日に当ファンドの受益証券1口当たり純資産額に基づく比例持分の支払を受ける権利があります。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ます。注記1に概説された目的および注記3のリスク管理方針に従い、当ファンドは受け取った申込金額を適切な投資対象に投資するよう努める一方で、償還に見合う十分な流動性を維持します。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ます。

当ファンドは上場金融資産および金融負債の評価インプットとして仲値を使用しています。これは、受益証券1口当たりの取引価額の計算に関して当ファンドの募集文書に規定されているインプットと一致します。財政状態計算書日現在、当ファンドの純資産額は40,720,848,855円（2014年5月31日現在：44,377,557,484円）です。

9 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」といいます。）を保有しています。これらは、1990年代前半のブレイディ・ボンドによるソブリン債務再編の一環として発行されたものであり、当初は債券に付属していましたが、後に分離され別々に取引されるようになりました。これらのOIPOは、いくつかの測定基準（当該期間の平均原油価格を含みます。）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ます。かかる半年ごとの支払については上限金額が定められており、OIPOに基づく最終支払の期日は2020年の予定です。

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

10 分配金

受託会社は、当ファンドから受益証券保有者に対し、毎月分配を行う意向です。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ります。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す。受託会社が決定する適切な分配水準を維持するためにファンドの収入または実現・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ます。受託会社は、毎月分配を行う意向ではあるが、分配を通例として行う、または毎月行う義務はありません。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ます。

当半年間に支払われた分配金は、以下で構成されています。

	権利付最終日	分配金額 （日本円）
2014年11月30日		
受益証券1口当たり分配金75円	2014年6月3日	526,894,125
受益証券1口当たり分配金75円	2014年7月3日	517,537,125
受益証券1口当たり分配金75円	2014年8月4日	508,270,200
受益証券1口当たり分配金75円	2014年9月3日	494,506,950
受益証券1口当たり分配金75円	2014年10月3日	482,681,700
受益証券1口当たり分配金75円	2014年11月4日	472,631,100
		3,002,521,200
2013年11月30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
		5,207,985,180

2014年11月30日および2014年5月31日現在の投資ポートフォリオ

以下の表は、保有する金融資産の要約です。

	公正価値 2014年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2014年5月31日 現在 (日本円)
債券		
アゼルバイジャン		
Rubrika Finance Co Ltd (International Bank Of AZ) 7.20% due 31/10/2016 REGS	1,102,232,779	930,097,730
アゼルバイジャン合計	1,102,232,779	930,097,730
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina 0% due 11/12/2021	1,363,961,560	1,323,244,904
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	1,363,961,560	1,323,244,904
中国		
Bright Food Hong Kong Ltd 3.00% due 21/05/2018 REGS	-	984,162,001
Franshion Development Ltd 6.75% due 15/04/2021 REGS	682,735,229	569,019,712
中国合計	682,735,229	1,553,181,713
コロンビア		
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	588,680,029	506,080,356
コロンビア合計	588,680,029	506,080,356
コスタリカ		
Republic of Costa Rica 10.58% due 23/09/2015 REGS	1,039,398,178	872,961,390
Republic of Costa Rica 10.58% due 22/06/2016 REGS	454,199,021	380,178,544
コスタリカ合計	1,493,597,199	1,253,139,934
ドミニカ共和国		
Dominican Republic 11.7% due 06/06/2014 REGS	-	497,130,064
ドミニカ共和国合計	-	497,130,064
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	1,345,338,480	1,351,450,677
エルサルバドル合計	1,345,338,480	1,351,450,677
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	777,939,274	730,068,455
マケドニア旧ユーゴスラビア共和国合計	777,939,274	730,068,455
グルジア		
Georgian Oil & Gas Corp 6.875% due 16/05/2017 REGS	455,852,649	610,625,016
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022	162,490,103	378,911,172
Republic of Georgia 6.875% due 12/04/2021 REGS	741,643,563	648,325,491
グルジア合計	1,359,986,315	1,637,861,679
債券(続き)		
ガーナ		
Ghana Govt 23.00% due 21/08/2017	1,077,383,740	822,301,572
ガーナ合計	1,077,383,740	822,301,572
ホンジュラス		
Honduras Government 7.50% due 15/03/2024 REGS	478,672,486	393,930,910
Republic of Honduras 8.75% due 16/12/2020 REGS	-	58,159,634

ホンジュラス合計	478,672,486	452,090,544
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
ヨルダン		
Dev Inv Jordan Arm Force 6.14% due 16/12/2019	554,570,076	2,016,620,202
ヨルダン合計	554,570,076	2,016,620,202
カザフスタン		
Astana Finance 7.875% due 08/06/2010 (注記 3.5)	753,657,455	937,760,200
Astana Finance JSC ADR# (注記 3.5)	-	-
カザフスタン合計	753,657,455	937,760,200
ケニア		
Kenya T-Bill 0% due 11/08/2014	-	164,217,330
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	717,574,367	383,697,828
ケニア合計	717,574,367	547,915,158
メキシコ		
Mexican Udibonos 4.00% due 15/11/2040 Index Linked	1,477,322,441	1,384,028,602
メキシコ合計	1,477,322,441	1,384,028,602
モンゴル		
Mongolia Government International Bond 5.125% due 05/12/2022 REGS	881,287,938	759,487,371
モンゴル合計	881,287,938	759,487,371
モンテネグロ		
Republic of Montenegro 7.875% due 14/09/2015	431,449,181	618,426,806
モンテネグロ合計	431,449,181	618,426,806

2014年11月30日および2014年5月31日現在、当該有価証券はゼロ評価されました。

	公正価値 2014年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2014年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き)		
モザンビーク		
Ematum Via Mozambique Ematum Finance 2020 BV 6.305% due 11/09/2020 REGS	874,185,637	938,216,431
モザンビーク合計	874,185,637	938,216,431
ナイジェリア		
Government of Nigeria 10.00% due 23/07/2030	-	373,629,057
Nigeria Treasury Bill 0% due 23/04/2015	443,834,190	566,349,206
Nigeria Treasury Bill 0% due 21/05/2015	364,604,597	325,935,663
ナイジェリア合計	808,438,787	1,265,913,926
パラグアイ		
Republic of Paraguay 4.625% due 25/01/2023 REGS	435,915,232	479,267,408
パラグアイ合計	435,915,232	479,267,408
ロシア		
Federal Grid Co OJSC/Finance Ltd 8.446% due 13/03/2019 REGS	334,628,362	440,390,374
RSHB Capital (RUSS AGRIC BK) 6.00% due 03/06/2021 REGS	1,341,102,533	1,310,275,204
RZD Capital Ltd 8.30% due 02/04/2019 REGS	369,127,700	495,598,371
RZD Capital Ltd 5.70% due 05/04/2022 REGS	603,475,852	583,771,930
ロシア合計	2,648,334,447	2,830,035,879

ルワンダ		
Republic of Rwanda 6.625% due 02/05/2023 REGS	560,114,683	472,006,071
ルワンダ合計	560,114,683	472,006,071
セルビア		
Serbia Treasury Bill 0% due 19/09/2014	-	822,258,051
Serbia Treasury Bonds 10.00% 27/02/2017	666,798,159	-
セルビア合計	666,798,159	822,258,051
南アフリカ		
Republic of South Africa 2.25% due 31/01/2038 Index Linked	167,957,530	536,794,450
South Africa Republic of 8.00% due 21/12/2018	1,247,689,557	960,068,303
南アフリカ合計	1,415,647,087	1,496,862,753
スリランカ		
National Savings Bank 8.875% due 18/09/2018 REGS	591,370,043	701,972,836
スリランカ合計	591,370,043	701,972,836
	公正価値 2014年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2014年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き)		
国際機関		
International Bank Recon & Dev 9.50% due 02/03/2017	2,451,532,779	2,319,227,818
International Finance Corp 7.75% due 03/12/2016	1,313,809,365	1,157,777,395
国際機関合計	3,765,342,144	3,477,005,213
トリニダード・トバゴ		
Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 REGS	1,360,132,126	1,783,502,367
トリニダード・トバゴ合計	1,360,132,126	1,783,502,367
チュニジア		
Banque Cent de Tunisie 4.50% due 22/06/2020 REGS	864,600,166	1,116,164,612
チュニジア合計	864,600,166	1,116,164,612
トルコ		
Turkey Government Bond 4.00% due 29/04/2015 Index Linked	601,446,365	534,766,472
Turkey Government Bond FRN due 04/01/2017	543,531,806	503,375,821
Turkiye Halk Bankasi As 3.875% due 05/02/2020 REGS	1,247,013,560	1,040,044,200
トルコ合計	2,391,991,731	2,078,186,493
ウガンダ		
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 01/01/2015	276,955,453	256,389,508
Republic of Uganda Government Bonds 10.00% due 21/05/2015	109,101,088	100,572,993
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 21/04/2016	133,492,845	115,607,944
Republic of Uganda Government Bonds 10.75% due 22/02/2018	120,431,537	115,085,239
ウガンダ合計	639,980,923	587,655,684
ウクライナ		
City of KYIV (CSFB) 8.00% due 06/11/2015	358,817,630	354,397,276
State Savings Bank of Ukraine 8.25% due 10/03/2016	720,914,490	947,902,881
State Savings Bank Of Ukraine 8.875% due 20/03/2018 REGS	438,066,195	454,394,519
ウクライナ合計	1,517,798,315	1,756,694,676

	公正価値 2014年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2014年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き)		
ウルグアイ		
Republica Orient Uruguay 3.70% due 26/06/2037	1,617,549,839	1,525,887,179
ウルグアイ合計	1,617,549,839	1,525,887,179
ザンビア		
Zambia Treasury Bill 0% due 05/01/2015	250,684,522	-
Zambia Treasury Bill 0% due 24/08/2015	45,117,086	-
Zambia Treasury Bill 0% due 07/09/2015	68,534,364	-
Zambia Treasury Bill 0% due 05/10/2015	70,302,478	-
Zambia Treasury Bill 0% due 19/10/2015	16,247,405	-
ザンビア合計	450,885,855	-
債券合計	35,695,473,723	38,943,204,490
原油ワラント		
ナイジェリア		
Central Bank of Nigeria Expires 15/11/2020	2,354,483,373	2,072,559,300
ナイジェリア合計	2,354,483,373	2,072,559,300
ベネズエラ		
Republic of Venezuela - Oil Expires 15/04/2020 Series USD	1,254,453,682	1,725,223,964
ベネズエラ合計	1,254,453,682	1,725,223,964
原油ワラント合計	3,608,937,055	3,797,783,264
投資ポートフォリオ	39,304,410,778	42,740,987,754

(FRN)変動利付債です。

(Index Linked)インフレ連動債です。

(REGS)Regulation Sの略。米国外での証券の募集に関して1990年に米証券取引委員会より定められた規制です。米国外企業が米国外で募集した証券については当局での登録義務が免除されており、米国証券を購入する海外投資家の負担を軽減しています。

は新光投信にて追記

海外国債マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成26年10月20日現在	平成27年4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,060,419,498	771,176,922
国債証券	50,890,485,289	46,562,778,164
未収入金	3,216,438,456	-
未収利息	428,849,451	365,168,928
前払費用	51,066,873	49,781,599
流動資産合計	55,647,259,567	47,748,905,613
資産合計	55,647,259,567	47,748,905,613
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	-
流動負債合計	3,231,988,274	-

	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
負債合計	3,231,988,274	-
純資産の部		
元本等		
元本	24,333,561,079	20,725,705,706
剰余金		
剰余金又は欠損金()	28,081,710,214	27,023,199,907
元本等合計	52,415,271,293	47,748,905,613
純資産合計	52,415,271,293	47,748,905,613
負債純資産合計	55,647,259,567	47,748,905,613

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配は使用いたしません。)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 24,333,561,079口	1. 計算日における受益権の総数 20,725,705,706口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額 2.1540円	1口当たり純資産額 2.3038円
(1万口当たり純資産額) (21,540円)	(1万口当たり純資産額) (23,038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26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、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、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

区分	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成26年10月20日現在	平成27年 4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 「（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>国債証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>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>

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	27,781,925,943円	24,333,561,079円
期中追加設定元本額	14,950,889円	143,505,827円
期中一部解約元本額	3,463,315,753円	3,751,361,200円

区分	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	15,063,839,198円	13,173,751,227円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	1,906,386,975円	1,703,288,970円
新光7資産バランスファンド	512,128,420円	472,102,025円
海外国債ファンド（1年決算型）	34,802,517円	36,408,901円
海外国債ファンド（変額年金）	6,804,443,663円	5,324,728,631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）	3,472,754円	2,777,885円
グローバル・ナビ	8,487,552円	12,648,067円
合計	24,333,561,079円	20,725,705,706円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,897,071,143	1,609,065,346
合計	1,897,071,143	1,609,065,346

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

3 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項 (通貨関連)

種類	平成26年10月20日現在				平成27年 4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-1.75%-22/05/15	7,600,000.00	7,668,281.27	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	6,700,000.00	6,689,007.84	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	10,200,000.00	10,169,718.74	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	15,100,000.00	15,444,468.75	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	15,300,000.00	15,320,320.38	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	2,000,000.00	2,707,500.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	13,000,000.00	13,769,843.74	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	17,100,000.00	18,455,976.63	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	14,900,000.00	16,080,359.37	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	19,200,000.00	20,308,500.08	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	19,700,000.00	20,621,898.53	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	19,700,000.00	20,398,734.37	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	13,400,000.00	13,574,828.18	
米ドル建小計			173,900,000.00	181,209,437.88 (21,553,050,541)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	2,600,000.00	2,895,880.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	2,900,000.00	2,967,570.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	2,800,000.00	3,090,136.00	
カナダドル建小計			8,300,000.00	8,953,586.00 (873,332,778)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-22/07/04	4,900,000.00	5,548,760.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	3,700,000.00	4,129,200.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	3,700,000.00	4,151,030.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	3,700,000.00	4,162,870.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	3,700,000.00	4,329,000.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	2,100,000.00	3,257,310.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	3,700,000.00	4,273,870.00	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	3,700,000.00	4,195,430.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	3,700,000.00	4,028,190.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	2,200,000.00	2,291,300.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	4,800,000.00	7,652,160.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-22/04/15	1,200,000.00	1,220,400.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/09/01	4,500,000.00	5,872,950.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	4,900,000.00	6,409,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	4,100,000.00	5,114,340.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	5,700,000.00	7,241,280.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	2,600,000.00	4,207,320.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01	5,400,000.00	6,802,920.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01	4,600,000.00	5,533,340.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01	4,700,000.00	5,141,330.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	5,100,000.00	6,752,910.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	7,400,000.00	8,892,580.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	5,500,000.00	6,361,300.00	
		FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	2,300,000.00	3,832,030.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	6,400,000.00	7,214,080.00	
		FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	7,300,000.00	9,812,660.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	6,100,000.00	7,177,260.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	6,600,000.00	7,485,720.00	
ユーロ建小計			124,300,000.00	153,090,740.00 (19,679,814,627)	
英ポンド	国債証券	TSY-1.75%-22/09/07	6,300,000.00	6,445,341.00	
		TSY-2.25%-23/09/07	6,000,000.00	6,340,800.00	
		TSY-2.75%-24/09/07	6,000,000.00	6,595,140.00	
		TSY-5.0%-25/03/07	4,300,000.00	5,636,010.00	
英ポンド建小計			22,600,000.00	25,017,291.00 (4,456,580,218)	
合計				46,562,778,164 (46,562,778,164)	

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 13銘柄	45.1%	46.3%
カナダドル	債券 3銘柄	1.8%	1.9%
ユーロ	債券 28銘柄	41.2%	42.3%
英ポンド	債券 4銘柄	9.3%	9.6%

（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

該当事項はありません。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	465,436,723	590,352,578
株式	12,646,969,850	13,565,779,760
派生商品評価勘定	829,200	1,407,440
未収配当金	100,893,154	113,102,581
未収利息	436	615
前払金	54,143,000	-
流動資産合計	13,268,272,363	14,270,642,974
資産合計	13,268,272,363	14,270,642,974
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	30,391,600	2,063,880
前受金	-	4,120,000
未払解約金	1,020,000	-
流動負債合計	31,411,600	6,183,880
負債合計	31,411,600	6,183,880
純資産の部		
元本等		
元本	8,932,703,871	7,378,969,384
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,304,156,892	6,885,489,710
元本等合計	13,236,860,763	14,264,459,094
純資産合計	13,236,860,763	14,264,459,094

平成26年10月20日現在

平成27年 4月20日現在

負債純資産合計	13,268,272,363	14,270,642,974
---------	----------------	----------------

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10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年10月20日現在	平成27年 4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 146,028,200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 198,369,650円
2. 計算日における受益権の総数 8,932,703,871口	2. 計算日における受益権の総数 7,378,969,384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 1.4818円 (1万口当たり純資産額) (14,818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 1.9331円 (1万口当たり純資産額) (19,331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26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・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

区分	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 2. 時価の算定方法 株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	9,811,465,885円	8,932,703,871円
期中追加設定元本額	37,126,580円	133,008,790円
期中一部解約元本額	915,888,594円	1,686,743,277円

区分	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
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	469,923,858円	394,530,301円
新光7資産バランスファンド	706,846,977円	571,177,263円
ニュー トピックス インデックス（変額年金）	679,537,007円	508,657,020円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,261,176,521円	1,889,544,971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）	2,086,306,473円	1,686,095,397円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	104,577,305円	51,835,805円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,921,277,785円	1,614,549,339円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	680,450,909円	601,408,452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）	2,999,475円	5,192,880円
グローバル・ナビ	19,607,561円	26,399,517円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	- 円	5,675,321円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	- 円	19,473,742円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	- 円	4,429,376円
合計	8,932,703,871円	7,378,969,384円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	440,873,216	1,928,020,661
合計	440,873,216	1,928,020,661

(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10月20日現在				平成27年 4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	704,687,400	-	675,125,000	29,562,400	680,271,440	-	679,615,000	656,440
東証株価指数先物	704,687,400	-	675,125,000	29,562,400	680,271,440	-	679,615,000	656,440
合計	704,687,400	-	675,125,000	29,562,400	680,271,440	-	679,615,000	656,440

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	3,000	278.00	834,000	
日本水産	8,100	357.00	2,891,700	
マルハニチロ	1,300	1,666.00	2,165,800	
サカタのタネ	1,100	2,115.00	2,326,500	
ホクト	700	2,164.00	1,514,800	
住石ホールディングス	1,800	125.00	225,000	
日鉄鉱業	2,000	463.00	926,000	
三井松島産業	4,000	132.00	528,000	
国際石油開発帝石	34,800	1,448.00	50,390,400	
日本海洋掘削	200	4,045.00	809,000	
石油資源開発	900	4,415.00	3,973,500	
K&Oエナジーグループ	400	1,495.00	598,000	
ショーボンドホールディングス	600	5,330.00	3,198,000	
ミライト・ホールディングス	2,000	1,373.00	2,746,000	
タマホーム	500	567.00	283,500	
安藤・間	4,400	664.00	2,921,600	
東急建設	2,300	705.00	1,621,500	
コムシスホールディングス	2,900	1,635.00	4,741,500	
ミサワホーム	800	1,077.00	861,600	
高松コンストラクショングループ	500	2,653.00	1,326,500	
東建コーポレーション	200	6,170.00	1,234,000	
大成建設	34,000	674.00	22,916,000	
大林組	20,000	807.00	16,140,000	
清水建設	20,000	866.00	17,320,000	
飛島建設	4,400	243.00	1,069,200	
長谷工コーポレーション	8,300	1,184.00	9,827,200	
松井建設	1,000	683.00	683,000	
銭高組	1,000	364.00	364,000	
鹿島建設	29,000	553.00	16,037,000	
不動テトラ	5,000	228.00	1,140,000	

大末建設	300	822.00	246,600
鉄建建設	4,000	407.00	1,628,000
日鉄住金テックスエンジ	1,000	591.00	591,000
西松建設	7,000	433.00	3,031,000
三井住友建設	26,800	164.00	4,395,200
大豊建設	2,000	598.00	1,196,000
前田建設工業	4,000	897.00	3,588,000
佐田建設	2,000	136.00	272,000
奥村組	6,000	581.00	3,486,000
大和小田急建設	400	1,065.00	426,000
東鉄工業	800	2,690.00	2,152,000
イチケン	1,000	310.00	310,000
浅沼組	2,000	151.00	302,000
戸田建設	8,000	511.00	4,088,000
熊谷組	8,000	372.00	2,976,000
青木あすなろ建設	500	878.00	439,000
北野建設	1,000	352.00	352,000
植木組	1,000	258.00	258,000
三井ホーム	1,000	517.00	517,000
矢作建設工業	800	775.00	620,000
ピーエス三菱	700	420.00	294,000
東日本ハウス	800	587.00	469,600
大東建託	2,500	14,045.00	35,112,500
新日本建設	800	462.00	369,600
N I P P O	2,000	1,986.00	3,972,000
東亜道路工業	1,000	420.00	420,000
前田道路	2,000	1,960.00	3,920,000
日本道路	2,000	608.00	1,216,000
東亜建設工業	5,000	204.00	1,020,000
若築建設	4,000	182.00	728,000
東洋建設	2,000	469.00	938,000
五洋建設	7,300	440.00	3,212,000
大林道路	1,000	737.00	737,000
世紀東急工業	1,000	532.00	532,000
福田組	1,000	794.00	794,000
住友林業	4,900	1,365.00	6,688,500
日本基礎技術	800	430.00	344,000
日成ビルド工業	2,000	294.00	588,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	3,000	96.00	288,000
巴コーポレーション	800	431.00	344,800
パナホーム	2,000	879.00	1,758,000
大和ハウス工業	19,300	2,693.00	51,974,900
ライト工業	1,100	950.00	1,045,000

積水ハウス	20,500	1,865.50	38,242,750
日特建設	900	520.00	468,000
ユアテック	1,000	824.00	824,000
西部電気工業	1,000	458.00	458,000
四電工	1,000	459.00	459,000
中電工	1,000	2,346.00	2,346,000
関電工	3,000	694.00	2,082,000
きんでん	4,000	1,568.00	6,272,000
東京エネシス	1,000	1,087.00	1,087,000
トーエネック	1,000	574.00	574,000
住友電設	500	1,412.00	706,000
日本電設工業	1,100	1,857.00	2,042,700
協和エクシオ	2,800	1,390.00	3,892,000
新日本空調	600	1,013.00	607,800
N D S	1,000	301.00	301,000
九電工	1,000	1,345.00	1,345,000
三機工業	1,300	935.00	1,215,500
日揮	7,000	2,419.50	16,936,500
中外炉工業	2,000	274.00	548,000
ヤマト	1,000	451.00	451,000
太平電業	1,000	976.00	976,000
高砂熱学工業	1,800	1,520.00	2,736,000
朝日工業社	1,000	438.00	438,000
明星工業	1,200	651.00	781,200
大気社	900	3,125.00	2,812,500
ダイダン	1,000	832.00	832,000
日比谷総合設備	900	1,547.00	1,392,300
東芝プラントシステム	1,100	1,793.00	1,972,300
O S J Bホールディングス	900	247.00	222,300
東洋エンジニアリング	3,000	323.00	969,000
千代田化工建設	5,000	1,049.00	5,245,000
新興プランテック	1,400	889.00	1,244,600
日本製粉	4,000	589.00	2,356,000
日清製粉グループ本社	7,200	1,428.00	10,281,600
昭和産業	3,000	490.00	1,470,000
鳥越製粉	500	723.00	361,500
中部飼料	600	661.00	396,600
フィード・ワンホールディングス	4,000	116.00	464,000
日本甜菜製糖	3,000	197.00	591,000
三井製糖	3,000	423.00	1,269,000
塩水港精糖	700	266.00	186,200
森永製菓	6,000	414.00	2,484,000
中村屋	2,000	495.00	990,000

江崎グリコ	1,500	5,160.00	7,740,000
名糖産業	300	1,203.00	360,900
不二家	4,000	195.00	780,000
山崎製パン	5,000	2,189.00	10,945,000
モロゾフ	1,000	383.00	383,000
亀田製菓	400	4,905.00	1,962,000
寿スピリッツ	200	2,655.00	531,000
カルビー	2,400	4,890.00	11,736,000
森永乳業	6,000	456.00	2,736,000
六甲バター	300	1,265.00	379,500
ヤクルト本社	3,500	7,940.00	27,790,000
明治ホールディングス	2,000	14,070.00	28,140,000
雪印メグミルク	1,600	1,455.00	2,328,000
プリマハム	4,000	344.00	1,376,000
日本ハム	5,000	2,664.00	13,320,000
伊藤ハム	4,000	661.00	2,644,000
丸大食品	3,000	427.00	1,281,000
米久	200	1,812.00	362,400
S Foods	400	2,146.00	858,400
サッポロホールディングス	11,000	483.00	5,313,000
アサヒグループホールディングス	13,300	4,028.50	53,579,050
キリンホールディングス	26,800	1,623.00	43,496,400
宝ホールディングス	5,200	939.00	4,882,800
オエノンホールディングス	2,000	226.00	452,000
コカ・コーラウエスト	2,200	2,074.00	4,562,800
コカ・コーライーストジャパン	2,000	2,398.00	4,796,000
サントリー食品インターナショナル	4,000	5,320.00	21,280,000
ダイトードリンコ	300	5,060.00	1,518,000
伊藤園	2,000	2,570.00	5,140,000
キーコーヒー	600	1,818.00	1,090,800
日清オイリオグループ	3,000	439.00	1,317,000
不二製油	1,800	1,818.00	3,272,400
J-オイルミルズ	3,000	402.00	1,206,000
キッコーマン	5,000	3,660.00	18,300,000
味の素	15,000	2,629.00	39,435,000
キューピー	3,400	3,030.00	10,302,000
ハウス食品グループ本社	2,400	2,520.00	6,048,000
カゴメ	2,600	1,868.00	4,856,800
焼津水産化学工業	300	1,013.00	303,900
アリアケジャパン	600	3,990.00	2,394,000
ニチレイ	7,000	650.00	4,550,000
東洋水産	3,400	4,105.00	13,957,000
日清食品ホールディングス	2,800	5,690.00	15,932,000

永谷園	1,000	1,124.00	1,124,000
フジッコ	1,000	2,016.00	2,016,000
ロック・フィールド	300	2,514.00	754,200
日本たばこ産業	36,600	4,122.00	150,865,200
ケンコーマヨネーズ	200	1,641.00	328,200
わらべや日洋	400	2,654.00	1,061,600
なとり	300	1,499.00	449,700
ミヨシ油脂	2,000	147.00	294,000
片倉工業	800	1,260.00	1,008,000
グンゼ	5,000	320.00	1,600,000
東洋紡	24,000	177.00	4,248,000
ユニチカ	18,000	60.00	1,080,000
富士紡ホールディングス	3,000	303.00	909,000
日清紡ホールディングス	4,000	1,235.00	4,940,000
倉敷紡績	6,000	211.00	1,266,000
シキボウ	4,000	122.00	488,000
日本毛織	2,000	877.00	1,754,000
トーア紡コーポレーション	3,000	76.00	228,000
ガイドーリミテッド	700	512.00	358,400
帝国繊維	600	1,720.00	1,032,000
帝人	25,000	412.00	10,300,000
東レ	48,000	997.00	47,856,000
サカイオーベックス	2,000	197.00	394,000
住江織物	2,000	315.00	630,000
日本バイリーン	1,000	602.00	602,000
芦森工業	1,000	162.00	162,000
アツギ	5,000	119.00	595,000
ダイニック	1,000	182.00	182,000
セーレン	1,500	1,062.00	1,593,000
小松精練	1,000	563.00	563,000
ワコールホールディングス	4,000	1,331.00	5,324,000
ホギメディカル	400	5,890.00	2,356,000
T S Iホールディングス	2,800	808.00	2,262,400
三陽商会	3,000	293.00	879,000
オンワードホールディングス	4,000	807.00	3,228,000
ルック	1,000	231.00	231,000
ゴールドウイン	1,000	792.00	792,000
デサント	1,400	1,557.00	2,179,800
特種東海製紙	4,000	274.00	1,096,000
王子ホールディングス	25,000	531.00	13,275,000
日本製紙	3,000	1,994.00	5,982,000
三菱製紙	9,000	89.00	801,000
北越紀州製紙	3,800	647.00	2,458,600

中越パルプ工業	2,000	248.00	496,000
大王製紙	3,000	1,161.00	3,483,000
レンゴー	5,000	518.00	2,590,000
トモク	2,000	280.00	560,000
ザ・パック	400	2,591.00	1,036,400
クラレ	10,500	1,635.00	17,167,500
旭化成	38,000	1,103.50	41,933,000
共和レザー	400	787.00	314,800
昭和電工	41,000	164.00	6,724,000
住友化学	45,000	642.00	28,890,000
住友精化	1,000	905.00	905,000
日産化学工業	4,000	2,363.00	9,452,000
ラサ工業	2,000	139.00	278,000
クレハ	4,000	522.00	2,088,000
テイカ	1,000	438.00	438,000
石原産業	10,000	119.00	1,190,000
日本曹達	4,000	755.00	3,020,000
東ソー	15,000	639.00	9,585,000
トクヤマ	10,000	279.00	2,790,000
セントラル硝子	6,000	549.00	3,294,000
東亜合成	8,000	551.00	4,408,000
ダイソー	2,000	422.00	844,000
関東電化工業	1,000	783.00	783,000
電気化学工業	13,000	493.00	6,409,000
信越化学工業	11,100	7,544.00	83,738,400
日本カーバイド工業	2,000	231.00	462,000
堺化学工業	2,000	400.00	800,000
エア・ウォーター	5,000	2,098.00	10,490,000
大陽日酸	7,900	1,560.00	12,324,000
日本化学工業	2,000	273.00	546,000
日本パーカライズン	2,900	1,403.00	4,068,700
高圧ガス工業	1,000	613.00	613,000
四国化成工業	1,000	1,012.00	1,012,000
戸田工業	1,000	413.00	413,000
ステラ ケミファ	300	1,359.00	407,700
保土谷化学工業	2,000	201.00	402,000
日本触媒	5,000	1,680.00	8,400,000
大日精化工業	3,000	636.00	1,908,000
カネカ	8,000	844.00	6,752,000
三菱瓦斯化学	11,000	608.00	6,688,000
三井化学	28,000	387.00	10,836,000
J S R	6,100	2,139.00	13,047,900
東京応化工業	1,300	3,905.00	5,076,500

大阪有機化学工業	400	539.00	215,600
三菱ケミカルホールディングス	38,600	726.30	28,035,180
日本合成化学工業	1,000	831.00	831,000
ダイセル	8,700	1,433.00	12,467,100
住友ベークライト	6,000	547.00	3,282,000
積水化学工業	14,000	1,625.00	22,750,000
日本ゼオン	5,000	1,130.00	5,650,000
アイカ工業	1,900	2,693.00	5,116,700
宇部興産	31,000	197.00	6,107,000
積水樹脂	1,000	1,600.00	1,600,000
タキロン	1,000	553.00	553,000
旭有機材工業	2,000	269.00	538,000
日立化成	3,000	2,483.00	7,449,000
ニチバン	1,000	461.00	461,000
リケンテクノス	1,000	445.00	445,000
大倉工業	1,000	375.00	375,000
積水化成成品工業	2,000	477.00	954,000
群栄化学工業	2,000	340.00	680,000
タイガースポリマー	300	810.00	243,000
ミライアル	200	1,490.00	298,000
ダイキョーニシカワ	100	3,520.00	352,000
日本化薬	4,000	1,505.00	6,020,000
カーリットホールディングス	500	638.00	319,000
日本精化	500	951.00	475,500
A D E K A	2,800	1,606.00	4,496,800
日油	5,000	903.00	4,515,000
新日本理化	1,000	226.00	226,000
ハリマ化成グループ	500	483.00	241,500
花王	16,600	5,911.00	98,122,600
第一工業製薬	1,000	391.00	391,000
三洋化成工業	2,000	952.00	1,904,000
大日本塗料	4,000	155.00	620,000
日本ペイントホールディングス	5,300	4,070.00	21,571,000
関西ペイント	7,000	2,086.00	14,602,000
中国塗料	2,000	1,062.00	2,124,000
日本特殊塗料	500	794.00	397,000
藤倉化成	800	556.00	444,800
太陽ホールディングス	500	4,215.00	2,107,500
D I C	25,000	369.00	9,225,000
サカタインクス	1,300	1,082.00	1,406,600
東洋インキSCホールディングス	6,000	573.00	3,438,000
T & K T O K A	200	2,486.00	497,200
富士フイルムホールディングス	14,100	4,543.50	64,063,350

資生堂	11,000	2,249.00	24,739,000
ライオン	7,000	738.00	5,166,000
高砂香料工業	2,000	539.00	1,078,000
マンダム	600	4,725.00	2,835,000
ミルボン	400	3,755.00	1,502,000
ファンケル	1,400	1,550.00	2,170,000
コーセー	1,000	6,970.00	6,970,000
コタ	200	1,556.00	311,200
ドクターシーラボ	400	4,360.00	1,744,000
ポーラ・オルビスホールディングス	700	6,470.00	4,529,000
ノエビアホールディングス	400	2,631.00	1,052,400
エステー	400	1,042.00	416,800
コニシ	500	2,109.00	1,054,500
長谷川香料	800	1,792.00	1,433,600
星光PMC	300	989.00	296,700
小林製薬	1,000	8,550.00	8,550,000
荒川化学工業	500	1,296.00	648,000
メック	500	814.00	407,000
日本高純度化学	200	2,485.00	497,000
JCU	200	5,120.00	1,024,000
新田ゼラチン	400	827.00	330,800
アース製薬	400	4,370.00	1,748,000
イハラケミカル工業	900	1,677.00	1,509,300
北興化学工業	1,000	436.00	436,000
大成ラミック	200	2,773.00	554,600
クミアイ化学工業	1,300	1,050.00	1,365,000
日本農薬	1,400	1,200.00	1,680,000
アキレス	5,000	158.00	790,000
有沢製作所	1,000	1,005.00	1,005,000
日東電工	4,800	7,667.00	36,801,600
レック	200	1,473.00	294,600
きもと	1,100	298.00	327,800
藤森工業	500	3,765.00	1,882,500
前澤化成工業	400	1,243.00	497,200
JSP	500	2,212.00	1,106,000
エフピコ	500	4,600.00	2,300,000
天馬	500	1,922.00	961,000
信越ポリマー	1,200	612.00	734,400
東リ	2,000	270.00	540,000
ニフコ	1,400	4,475.00	6,265,000
日本バルカー工業	3,000	311.00	933,000
ユニ・チャーム	12,500	3,067.50	38,343,750
協和発酵キリン	7,000	1,682.00	11,774,000

武田薬品工業	23,100	6,223.00	143,751,300	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	70,300	1,883.00	132,374,900	
大日本住友製薬	4,400	1,376.00	6,054,400	
塩野義製薬	9,600	4,115.00	39,504,000	
田辺三菱製薬	7,200	2,060.00	14,832,000	
あすか製薬	700	1,221.00	854,700	
日本新薬	1,000	3,980.00	3,980,000	
ピオフェルミン製薬	100	2,922.00	292,200	
中外製薬	6,100	3,685.00	22,478,500	
科研製薬	2,000	4,395.00	8,790,000	
エーザイ	8,100	8,448.00	68,428,800	
ロート製薬	2,800	1,715.00	4,802,000	
小野薬品工業	2,800	12,770.00	35,756,000	
久光製薬	1,700	5,080.00	8,636,000	
持田製薬	400	7,900.00	3,160,000	
参天製薬	11,300	1,603.00	18,113,900	
扶桑薬品工業	2,000	312.00	624,000	
日本ケミファ	1,000	594.00	594,000	
ツムラ	1,900	2,807.00	5,333,300	
日医工	1,400	2,611.00	3,655,400	
キッセイ薬品工業	1,100	3,685.00	4,053,500	
生化学工業	1,200	2,047.00	2,456,400	
栄研化学	500	2,328.00	1,164,000	
日水製薬	200	1,413.00	282,600	
鳥居薬品	400	3,235.00	1,294,000	
JCRファーマ	500	2,705.00	1,352,500	
東和薬品	300	6,310.00	1,893,000	
富士製薬工業	200	2,206.00	441,200	
沢井製薬	1,000	6,830.00	6,830,000	
ゼリア新薬工業	1,300	1,929.00	2,507,700	
第一三共	20,800	1,964.50	40,861,600	
キョーリン製薬ホールディングス	1,600	2,776.00	4,441,600	
大幸薬品	300	1,868.00	560,400	
ダイト	300	2,304.00	691,200	
大塚ホールディングス	12,200	3,942.00	48,092,400	
大正製薬ホールディングス	1,500	8,380.00	12,570,000	
日本コークス工業	5,500	117.00	643,500	
昭和シェル石油	5,500	1,133.00	6,231,500	
コスモ石油	17,000	179.00	3,043,000	
ニチレキ	1,000	1,021.00	1,021,000	
東燃ゼネラル石油	9,000	1,132.00	10,188,000	
ユシロ化学工業	400	1,596.00	638,400	
ピーピー・カストロール	300	1,365.00	409,500	

富士石油	1,400	414.00	579,600
MORESCO	200	2,130.00	426,000
出光興産	2,900	2,360.00	6,844,000
JXホールディングス	68,500	516.50	35,380,250
横浜ゴム	7,000	1,294.00	9,058,000
東洋ゴム工業	2,800	2,362.00	6,613,600
ブリヂストン	19,300	5,002.00	96,538,600
住友ゴム工業	4,800	2,188.00	10,502,400
藤倉ゴム工業	500	737.00	368,500
オカモト	2,000	465.00	930,000
フコク	300	1,162.00	348,600
ニッタ	600	3,250.00	1,950,000
住友理工	1,100	1,113.00	1,224,300
三ツ星ベルト	1,000	956.00	956,000
バンドー化学	2,000	477.00	954,000
日東紡績	5,000	460.00	2,300,000
旭硝子	30,000	808.00	24,240,000
日本板硝子	30,000	126.00	3,780,000
日本山村硝子	2,000	176.00	352,000
日本電気硝子	12,000	661.00	7,932,000
住友大阪セメント	11,000	397.00	4,367,000
太平洋セメント	38,000	375.00	14,250,000
デイ・シイ	600	453.00	271,800
日本ヒューム	600	885.00	531,000
日本コンクリート工業	1,100	481.00	529,100
三谷セキサン	300	1,802.00	540,600
ジャパンパイル	800	671.00	536,800
東海カーボン	5,000	355.00	1,775,000
日本カーボン	3,000	394.00	1,182,000
東洋炭素	300	2,330.00	699,000
ノリタケカンパニーリミテド	3,000	286.00	858,000
TOTO	9,000	1,705.00	15,345,000
日本碍子	8,000	2,582.00	20,656,000
日本特殊陶業	5,300	3,160.00	16,748,000
MARUWA	200	2,879.00	575,800
品川リフラクトリーズ	2,000	312.00	624,000
黒崎播磨	1,000	261.00	261,000
フジインコーポレーテッド	600	2,103.00	1,261,800
ニチアス	3,000	705.00	2,115,000
ニチハ	800	1,329.00	1,063,200
新日鐵住金	261,000	313.20	81,745,200
神戸製鋼所	107,000	231.00	24,717,000
中山製鋼所	5,000	97.00	485,000

合同製鐵	3,000	184.00	552,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,700	2,828.50	44,407,450
日新製鋼	2,600	1,673.00	4,349,800
東京製鐵	3,100	895.00	2,774,500
共英製鋼	700	2,039.00	1,427,300
大和工業	1,400	3,030.00	4,242,000
東京鐵鋼	1,000	506.00	506,000
大阪製鐵	400	2,163.00	865,200
淀川製鋼所	4,000	483.00	1,932,000
東洋鋼鈑	1,500	563.00	844,500
丸一鋼管	1,900	2,976.00	5,654,400
モリ工業	1,000	413.00	413,000
大同特殊鋼	10,000	543.00	5,430,000
日本高周波鋼業	2,000	113.00	226,000
日本冶金工業	4,800	242.00	1,161,600
山陽特殊製鋼	4,000	543.00	2,172,000
愛知製鋼	4,000	594.00	2,376,000
日立金属	6,000	1,886.00	11,316,000
日本金属	2,000	145.00	290,000
大太平洋金属	4,000	343.00	1,372,000
新日本電工	3,800	299.00	1,136,200
栗本鐵工所	3,000	236.00	708,000
三菱製鋼	4,000	274.00	1,096,000
日亜鋼業	900	346.00	311,400
シンニッタン	600	577.00	346,200
新家工業	1,000	190.00	190,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	345.00	345,000
日本軽金属ホールディングス	15,000	187.00	2,805,000
三井金属鉱業	17,000	276.00	4,692,000
東邦亜鉛	3,000	455.00	1,365,000
三菱マテリアル	38,000	421.00	15,998,000
住友金属鉱山	17,000	1,754.00	29,818,000
DOWAホールディングス	7,000	1,063.00	7,441,000
古河機械金属	10,000	209.00	2,090,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	2,711.00	1,626,600
東邦チタニウム	1,000	1,024.00	1,024,000
UACJ	7,000	348.00	2,436,000
古河電気工業	18,000	218.00	3,924,000
住友電気工業	23,200	1,655.50	38,407,600
フジクラ	9,000	552.00	4,968,000
昭和電線ホールディングス	7,000	93.00	651,000
タツタ電線	1,200	522.00	626,400
リョービ	3,000	401.00	1,203,000

アーレスティ	500	840.00	420,000
アサヒホールディングス	900	2,167.00	1,950,300
稲葉製作所	300	1,427.00	428,100
宮地エンジニアリンググループ	2,000	199.00	398,000
トーカロ	400	2,348.00	939,200
アルファC o	200	1,304.00	260,800
SUMCO	4,200	1,965.00	8,253,000
川田テクノロジーズ	100	3,705.00	370,500
東洋製罐グループホールディングス	4,400	1,771.00	7,792,400
ホッカンホールディングス	1,000	283.00	283,000
コロナ	300	1,140.00	342,000
横河ブリッジホールディングス	1,200	1,289.00	1,546,800
駒井ハルテック	1,000	254.00	254,000
三和ホールディングス	5,800	904.00	5,243,200
文化シャッター	1,700	1,091.00	1,854,700
三協立山	800	2,167.00	1,733,600
LIXILグループ	9,200	2,684.00	24,692,800
日本フィルコン	400	510.00	204,000
ノーリツ	1,200	1,960.00	2,352,000
長府製作所	700	2,858.00	2,000,600
リンナイ	1,100	9,040.00	9,944,000
ダイニチ工業	300	787.00	236,100
日東精工	1,000	383.00	383,000
岡部	1,200	1,155.00	1,386,000
東プレ	1,200	1,899.00	2,278,800
高周波熱錬	1,100	857.00	942,700
東京製網	4,000	193.00	772,000
パイオラックス	300	5,530.00	1,659,000
日本発條	5,400	1,274.00	6,879,600
中央発條	1,000	334.00	334,000
三益半導体工業	500	1,393.00	696,500
日本ドライケミカル	100	2,368.00	236,800
日本製鋼所	9,000	536.00	4,824,000
三浦工業	2,800	1,360.00	3,808,000
タクマ	2,000	924.00	1,848,000
ツガミ	2,000	713.00	1,426,000
オークマ	4,000	1,247.00	4,988,000
東芝機械	3,000	523.00	1,569,000
アマダホールディングス	9,200	1,160.00	10,672,000
アイダエンジニアリング	1,300	1,419.00	1,844,700
滝澤鉄工所	2,000	229.00	458,000
富士機械製造	2,000	1,424.00	2,848,000
牧野フライス製作所	3,000	1,047.00	3,141,000

オーエスジー	2,800	2,520.00	7,056,000
旭ダイヤモンド工業	1,700	1,426.00	2,424,200
D M G 森精機	3,900	1,988.00	7,753,200
ディスコ	700	11,230.00	7,861,000
日東工器	400	2,385.00	954,000
パンチ工業	200	1,300.00	260,000
豊和工業	300	745.00	223,500
大阪機工	2,000	158.00	316,000
津田駒工業	1,000	154.00	154,000
島精機製作所	900	2,136.00	1,922,400
日阪製作所	800	1,167.00	933,600
やまびこ	200	5,440.00	1,088,000
ペガサスマシン製造	500	606.00	303,000
ナブテスコ	3,800	3,240.00	12,312,000
三井海洋開発	600	1,986.00	1,191,600
レオン自動機	500	473.00	236,500
S M C	1,800	35,345.00	63,621,000
新川	500	804.00	402,000
ホソカワミクロン	1,000	624.00	624,000
ユニオンツール	300	3,605.00	1,081,500
オイレス工業	800	2,262.00	1,809,600
日精エー・エス・ビー機械	200	2,305.00	461,000
サトーホールディングス	800	2,705.00	2,164,000
日精樹脂工業	400	1,277.00	510,800
小松製作所	30,600	2,547.00	77,938,200
住友重機械工業	17,000	806.00	13,702,000
日立建機	2,800	2,224.00	6,227,200
日工	1,000	471.00	471,000
巴工業	200	1,805.00	361,000
井関農機	6,000	242.00	1,452,000
T O W A	500	698.00	349,000
丸山製作所	1,000	230.00	230,000
北川鉄工所	3,000	265.00	795,000
クボタ	30,000	1,898.00	56,940,000
荏原実業	200	1,445.00	289,000
三菱化工機	2,000	416.00	832,000
月島機械	1,100	1,210.00	1,331,000
帝国電機製作所	400	1,117.00	446,800
新東工業	1,400	998.00	1,397,200
澁谷工業	500	2,445.00	1,222,500
アイチ コーポレーション	900	605.00	544,500
小森コーポレーション	1,500	1,427.00	2,140,500
鶴見製作所	500	1,800.00	900,000

住友精密工業	1,000	472.00	472,000
酒井重工業	1,000	294.00	294,000
荏原製作所	13,000	522.00	6,786,000
石井鐵工所	1,000	222.00	222,000
西島製作所	600	887.00	532,200
北越工業	500	953.00	476,500
ダイキン工業	8,600	7,966.00	68,507,600
オルガノ	1,000	517.00	517,000
トーヨーカネツ	4,000	226.00	904,000
栗田工業	3,500	3,005.00	10,517,500
椿本チエイン	3,000	982.00	2,946,000
大同工業	1,000	262.00	262,000
日本コンベヤ	2,000	214.00	428,000
木村化工機	600	538.00	322,800
アネスト岩田	900	767.00	690,300
ダイフク	2,900	1,609.00	4,666,100
加藤製作所	1,000	797.00	797,000
油研工業	1,000	255.00	255,000
タダノ	3,000	1,594.00	4,782,000
フジテック	1,700	1,322.00	2,247,400
C K D	1,700	1,093.00	1,858,100
キトー	600	1,180.00	708,000
平和	1,300	2,454.00	3,190,200
理想科学工業	700	2,034.00	1,423,800
S A N K Y O	1,800	4,465.00	8,037,000
日本金銭機械	500	1,783.00	891,500
マースエンジニアリング	300	2,106.00	631,800
福島工業	300	1,926.00	577,800
ダイコク電機	200	1,725.00	345,000
アマノ	2,000	1,462.00	2,924,000
J U K I	4,000	367.00	1,468,000
サンデンホールディングス	4,000	564.00	2,256,000
蛇の目マシン工業	6,000	138.00	828,000
マックス	1,000	1,393.00	1,393,000
グローリー	1,900	3,295.00	6,260,500
新晃工業	400	1,231.00	492,400
大和冷機工業	900	814.00	732,600
セガサミーホールディングス	6,300	1,683.00	10,602,900
日本ピストンリング	2,000	242.00	484,000
リケン	3,000	455.00	1,365,000
T P R	700	3,105.00	2,173,500
ホシザキ電機	1,300	7,460.00	9,698,000
大豊工業	500	1,446.00	723,000

日本精工	12,100	1,820.00	22,022,000
NTN	14,000	640.00	8,960,000
ジェイテクト	6,300	1,829.00	11,522,700
不二越	5,000	700.00	3,500,000
日本トムソン	2,000	670.00	1,340,000
THK	3,900	3,065.00	11,953,500
ユーシン精機	300	2,479.00	743,700
前澤給装工業	200	1,502.00	300,400
イーグル工業	800	2,434.00	1,947,200
日本ピラー工業	600	1,070.00	642,000
キッツ	2,600	599.00	1,557,400
日立工機	1,600	983.00	1,572,800
マキタ	3,800	6,250.00	23,750,000
日立造船	4,600	653.00	3,003,800
三菱重工業	99,000	659.50	65,290,500
IHI	42,000	525.00	22,050,000
イビデン	3,900	2,039.00	7,952,100
コニカミノルタ	14,000	1,324.00	18,536,000
ブラザー工業	7,600	1,900.00	14,440,000
ミネベア	9,000	1,799.00	16,191,000
日立製作所	141,000	798.30	112,560,300
東芝	124,000	479.50	59,458,000
三菱電機	59,000	1,514.50	89,355,500
富士電機	16,000	577.00	9,232,000
東洋電機製造	1,000	432.00	432,000
安川電機	7,000	1,716.00	12,012,000
シンフォニアテクノロジー	4,000	208.00	832,000
明電舎	5,000	390.00	1,950,000
オリジン電気	1,000	496.00	496,000
山洋電気	1,000	906.00	906,000
デンヨー	500	1,822.00	911,000
東芝テック	4,000	672.00	2,688,000
芝浦メカトロニクス	1,000	298.00	298,000
マブチモーター	1,800	6,560.00	11,808,000
日本電産	6,400	8,160.00	52,224,000
東光高岳	300	1,628.00	488,400
ダイヘン	3,000	575.00	1,725,000
JVCケンウッド	4,300	392.00	1,685,600
第一精工	200	2,355.00	471,000
日新電機	1,000	775.00	775,000
大崎電気工業	1,000	814.00	814,000
オムロン	6,400	5,330.00	34,112,000
日東工業	900	2,165.00	1,948,500

I D E C	700	1,066.00	746,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11,000	567.00	6,237,000	
サクサホールディングス	1,000	227.00	227,000	
メルコホールディングス	300	2,226.00	667,800	
テクノメディカ	100	2,550.00	255,000	
日本電気	76,000	388.00	29,488,000	
富士通	57,000	789.30	44,990,100	
沖電気工業	20,000	247.00	4,940,000	
岩崎通信機	3,000	94.00	282,000	
電気興業	2,000	559.00	1,118,000	
サンケン電気	3,000	830.00	2,490,000	
ナカヨ	1,000	362.00	362,000	
アイホン	300	2,007.00	602,100	
ルネサスエレクトロニクス	3,000	862.00	2,586,000	
セイコーエプソン	8,000	2,126.00	17,008,000	
ワコム	4,600	628.00	2,888,800	
アルバック	1,000	1,965.00	1,965,000	
アクセル	300	1,583.00	474,900	
E I Z O	500	2,689.00	1,344,500	
ジャパンディスプレイ	9,100	498.00	4,531,800	
日本信号	1,600	1,142.00	1,827,200	
京三製作所	1,000	385.00	385,000	
能美防災	800	1,536.00	1,228,800	
ホーチキ	400	820.00	328,000	
エレコム	200	2,701.00	540,200	
日本無線	1,000	433.00	433,000	
パナソニック	71,800	1,588.00	114,018,400	代用有価証券 7,500株
シャープ	50,000	257.00	12,850,000	
アンリツ	3,500	828.00	2,898,000	
富士通ゼネラル	2,000	1,553.00	3,106,000	
日立国際電気	2,000	1,506.00	3,012,000	
ソニー	38,500	3,616.00	139,216,000	代用有価証券 3,700株
T D K	3,600	8,250.00	29,700,000	
帝国通信工業	1,000	240.00	240,000	
ミツミ電機	2,100	913.00	1,917,300	
タムラ製作所	2,000	513.00	1,026,000	
アルプス電気	4,700	2,927.00	13,756,900	
池上通信機	2,000	185.00	370,000	
パイオニア	8,900	233.00	2,073,700	
日本電波工業	500	996.00	498,000	
日本トリム	100	3,380.00	338,000	
ローランド ディー . ジー .	200	3,215.00	643,000	

フォスター電機	600	2,960.00	1,776,000
クラリオン	3,000	353.00	1,059,000
S M K	2,000	521.00	1,042,000
ヨコオ	500	740.00	370,000
東光	1,000	343.00	343,000
ホシデン	1,800	715.00	1,287,000
ヒロセ電機	1,000	16,510.00	16,510,000
日本航空電子工業	2,000	2,724.00	5,448,000
T O A	600	1,201.00	720,600
日立マクセル	900	1,922.00	1,729,800
古野電気	700	1,006.00	704,200
ユニデン	2,000	220.00	440,000
アルパイン	1,400	2,299.00	3,218,600
スミダコーポレーション	500	695.00	347,500
アイコム	300	3,095.00	928,500
リオン	200	1,585.00	317,000
船井電機	600	1,396.00	837,600
横河電機	5,900	1,414.00	8,342,600
新電元工業	2,000	605.00	1,210,000
アズビル	1,900	3,185.00	6,051,500
日本光電工業	2,500	3,205.00	8,012,500
チノー	200	1,186.00	237,200
共和電業	700	486.00	340,200
堀場製作所	1,100	4,445.00	4,889,500
アドバンテスト	4,000	1,447.00	5,788,000
小野測器	300	1,002.00	300,600
エスペック	700	1,296.00	907,200
パナソニック デバイス S U N X	500	854.00	427,000
キーエンス	1,300	62,700.00	81,510,000
日置電機	300	2,344.00	703,200
シスメックス	4,600	6,510.00	29,946,000
メガチップス	600	1,393.00	835,800
O B A R A G R O U P	400	7,310.00	2,924,000
コーセル	900	1,420.00	1,278,000
オブテックス	400	2,575.00	1,030,000
千代田インテグレ	300	3,035.00	910,500
レーザーテック	600	1,551.00	930,600
スタンレー電気	4,200	2,751.00	11,554,200
岩崎電気	2,000	236.00	472,000
ウシオ電機	3,600	1,593.00	5,734,800
日本セラミック	300	1,697.00	509,100
遠藤照明	300	1,436.00	430,800
日本デジタル研究所	500	1,682.00	841,000

山一電機	700	948.00	663,600	
図研	400	1,103.00	441,200	
日本電子	3,000	600.00	1,800,000	
カシオ計算機	5,900	2,364.00	13,947,600	
ファナック	6,100	25,625.00	156,312,500	
日本シイエムケイ	1,500	308.00	462,000	
エンプラス	300	5,010.00	1,503,000	
大真空	1,000	333.00	333,000	
ローム	2,900	7,840.00	22,736,000	
浜松ホトニクス	4,900	3,500.00	17,150,000	
三井ハイテック	800	909.00	727,200	
新光電気工業	2,200	853.00	1,876,600	
京セラ	9,700	6,807.00	66,027,900	
太陽誘電	3,100	1,788.00	5,542,800	
村田製作所	6,200	16,635.00	103,137,000	
ユーシン	800	806.00	644,800	
双葉電子工業	1,000	1,989.00	1,989,000	
北陸電気工業	3,000	185.00	555,000	
ニチコン	1,900	1,106.00	2,101,400	
日本ケミコン	5,000	366.00	1,830,000	
K O A	800	1,205.00	964,000	
市光工業	1,000	269.00	269,000	
小糸製作所	3,500	3,630.00	12,705,000	
ミツバ	1,100	2,544.00	2,798,400	
スター精密	1,100	1,935.00	2,128,500	
S C R E E Nホールディングス	6,000	816.00	4,896,000	
キャノン電子	500	2,411.00	1,205,500	
キャノン	34,200	4,490.50	153,575,100	4,100株 代用有価証券
リコー	17,700	1,330.50	23,549,850	
M U T O Hホールディングス	1,000	437.00	437,000	
東京エレクトロン	5,000	7,676.00	38,380,000	
トヨタ紡織	2,100	1,546.00	3,246,600	
鬼怒川ゴム工業	1,000	534.00	534,000	
ユニプレス	1,100	2,409.00	2,649,900	
豊田自動織機	5,400	7,330.00	39,582,000	
モリタホールディングス	1,000	1,127.00	1,127,000	
三櫻工業	700	879.00	615,300	
デンソー	14,600	5,661.00	82,650,600	
東海理化電機製作所	1,600	2,766.00	4,425,600	
三井造船	23,000	207.00	4,761,000	
川崎重工業	43,000	601.00	25,843,000	
名村造船所	1,600	1,093.00	1,748,800	
日本車輛製造	2,000	355.00	710,000	

ニチユ三菱フォークリフト	700	675.00	472,500	
近畿車輛	1,000	384.00	384,000	
日産自動車	82,700	1,266.00	104,698,200	
いすゞ自動車	18,600	1,566.00	29,127,600	
トヨタ自動車	81,300	8,262.00	671,700,600	代用有価証券 9,000株
日野自動車	8,400	1,652.00	13,876,800	
三菱自動車工業	21,600	1,105.00	23,868,000	
エフテック	300	1,200.00	360,000	
武蔵精密工業	600	2,437.00	1,462,200	
日産車体	2,600	1,544.00	4,014,400	
新明和工業	2,000	1,171.00	2,342,000	
極東開発工業	1,100	1,343.00	1,477,300	
日信工業	1,100	1,887.00	2,075,700	
トピー工業	5,000	294.00	1,470,000	
ティラド	2,000	254.00	508,000	
曙ブレーキ工業	2,500	418.00	1,045,000	
タチエス	900	1,853.00	1,667,700	
NOK	2,900	3,690.00	10,701,000	
フタバ産業	1,800	580.00	1,044,000	
カヤバ工業	7,000	452.00	3,164,000	
シロキ工業	1,000	343.00	343,000	
大同メタル工業	800	1,303.00	1,042,400	
プレス工業	2,900	504.00	1,461,600	
カルソニックカンセイ	4,000	832.00	3,328,000	
太平洋工業	1,200	1,003.00	1,203,600	
ケーヒン	1,400	1,903.00	2,664,200	
河西工業	700	1,004.00	702,800	
アイシン精機	5,400	4,585.00	24,759,000	
富士機工	700	559.00	391,300	
マツダ	17,600	2,352.00	41,395,200	
ダイハツ工業	7,000	1,760.00	12,320,000	
今仙電機製作所	500	1,442.00	721,000	
本田技研工業	53,000	4,177.50	221,407,500	代用有価証券 6,000株
スズキ	12,300	3,771.50	46,389,450	
富士重工業	20,100	3,994.50	80,289,450	
ヤマハ発動機	9,000	2,918.00	26,262,000	
ショーワ	1,400	1,272.00	1,780,800	
T B K	800	636.00	508,800	
エクセディ	800	2,940.00	2,352,000	
豊田合成	1,900	2,735.00	5,196,500	
愛三工業	900	1,124.00	1,011,600	
ヨロズ	600	2,441.00	1,464,600	

エフ・シー・シー	900	1,952.00	1,756,800
シマノ	2,500	16,840.00	42,100,000
タカタ	1,100	1,383.00	1,521,300
テイ・エス テック	1,200	3,425.00	4,110,000
テルモ	9,000	3,150.00	28,350,000
クリエートメディック	200	1,043.00	208,600
日機装	1,900	1,108.00	2,105,200
島津製作所	7,000	1,372.00	9,604,000
JMS	1,000	300.00	300,000
長野計器	400	736.00	294,400
プイ・テクノロジー	100	2,762.00	276,200
東京計器	2,000	269.00	538,000
愛知時計電機	1,000	328.00	328,000
東京精密	1,100	2,474.00	2,721,400
マニー	200	8,290.00	1,658,000
ニコン	11,000	1,691.00	18,601,000
トプコン	1,800	2,902.00	5,223,600
オリンパス	8,800	4,420.00	38,896,000
理研計器	500	1,395.00	697,500
タムロン	500	2,524.00	1,262,000
H O Y A	14,000	4,567.00	63,938,000
ノーリツ鋼機	500	692.00	346,000
エー・アンド・デイ	500	480.00	240,000
シチズンホールディングス	7,300	930.00	6,789,000
リズム時計工業	3,000	168.00	504,000
大研医器	400	1,333.00	533,200
松風	300	1,359.00	407,700
セイコーホールディングス	4,000	615.00	2,460,000
ニプロ	3,800	1,166.00	4,430,800
パラマウントベッドホールディングス	600	3,210.00	1,926,000
前田工織	600	1,162.00	697,200
永大産業	1,000	458.00	458,000
アートネイチャー	400	1,126.00	450,400
ダンロップスポーツ	400	1,245.00	498,000
バンダイナムコホールディングス	6,500	2,498.00	16,237,000
共立印刷	1,100	295.00	324,500
フランスベッドホールディングス	4,000	178.00	712,000
パイロットコーポレーション	500	6,470.00	3,235,000
トッパン・フォームズ	1,100	1,404.00	1,544,400
フジシールインターナショナル	700	3,590.00	2,513,000
タカラトミー	2,100	787.00	1,652,700
廣済堂	500	675.00	337,500
アーク	1,900	133.00	252,700

プロネクサス	600	798.00	478,800
ウッドワン	1,000	274.00	274,000
大建工業	2,000	271.00	542,000
凸版印刷	17,000	977.00	16,609,000
大日本印刷	18,000	1,226.50	22,077,000
図書印刷	1,000	370.00	370,000
共同印刷	2,000	370.00	740,000
日本写真印刷	1,000	2,286.00	2,286,000
宝印刷	300	1,065.00	319,500
アシックス	5,900	3,060.00	18,054,000
ツツミ	300	2,877.00	863,100
小松ウオール工業	200	2,521.00	504,200
ヤマハ	4,300	2,221.00	9,550,300
河合楽器製作所	200	2,350.00	470,000
クリナップ	500	943.00	471,500
ピジョン	1,100	9,260.00	10,186,000
キングジム	500	849.00	424,500
リンテック	1,400	3,005.00	4,207,000
イトーキ	1,200	742.00	890,400
任天堂	3,600	20,245.00	72,882,000
三菱鉛筆	500	4,545.00	2,272,500
タカラスタANDARD	2,000	979.00	1,958,000
コクヨ	3,100	1,195.00	3,704,500
ナカバヤシ	1,000	222.00	222,000
グローブライド	3,000	195.00	585,000
岡村製作所	2,300	941.00	2,164,300
美津濃	3,000	615.00	1,845,000
アデランス	700	1,138.00	796,600
東京電力	50,000	475.00	23,750,000
中部電力	18,000	1,447.50	26,055,000
関西電力	24,000	1,171.00	28,104,000
中国電力	8,100	1,640.00	13,284,000
北陸電力	5,800	1,636.00	9,488,800
東北電力	14,700	1,389.00	20,418,300
四国電力	5,300	1,523.00	8,071,900
九州電力	13,000	1,192.00	15,496,000
北海道電力	5,500	1,047.00	5,758,500
沖縄電力	400	4,425.00	1,770,000
電源開発	4,300	4,005.00	17,221,500
東京瓦斯	72,000	731.50	52,668,000
大阪瓦斯	61,000	492.00	30,012,000
東邦瓦斯	15,000	681.00	10,215,000
北海道瓦斯	1,000	282.00	282,000

西部瓦斯	7,000	264.00	1,848,000
静岡ガス	1,700	779.00	1,324,300
SBSホールディングス	400	962.00	384,800
東武鉄道	31,000	580.00	17,980,000
相鉄ホールディングス	10,000	570.00	5,700,000
東京急行電鉄	32,000	773.00	24,736,000
京浜急行電鉄	16,000	933.00	14,928,000
小田急電鉄	19,000	1,224.00	23,256,000
京王電鉄	16,000	931.00	14,896,000
京成電鉄	9,000	1,476.00	13,284,000
富士急行	2,000	1,176.00	2,352,000
新京成電鉄	1,000	415.00	415,000
東日本旅客鉄道	10,800	10,625.00	114,750,000
西日本旅客鉄道	5,700	6,564.00	37,414,800
東海旅客鉄道	5,300	21,660.00	114,798,000
西武ホールディングス	4,700	3,450.00	16,215,000
鴻池運輸	700	1,272.00	890,400
西日本鉄道	8,000	538.00	4,304,000
ハマキョウレックス	200	4,340.00	868,000
サカイ引越センター	100	3,885.00	388,500
近鉄グループホールディングス	59,000	424.00	25,016,000
阪急阪神ホールディングス	40,000	723.00	28,920,000
南海電気鉄道	13,000	546.00	7,098,000
京阪電気鉄道	13,000	705.00	9,165,000
神戸電鉄	1,000	355.00	355,000
名古屋鉄道	21,000	482.00	10,122,000
山陽電気鉄道	2,000	474.00	948,000
日本通運	23,000	716.00	16,468,000
ヤマトホールディングス	10,400	2,730.50	28,397,200
山九	7,000	552.00	3,864,000
丸全昭和運輸	2,000	414.00	828,000
センコー	3,000	773.00	2,319,000
トナミホールディングス	1,000	432.00	432,000
日本梱包運輸倉庫	1,900	2,094.00	3,978,600
福山通運	4,000	677.00	2,708,000
セイノーホールディングス	4,600	1,360.00	6,256,000
神奈川中央交通	1,000	583.00	583,000
日立物流	1,200	2,055.00	2,466,000
日本郵船	50,000	354.00	17,700,000
商船三井	31,000	413.00	12,803,000
川崎汽船	26,000	317.00	8,242,000
NSユニテッド海運	3,000	287.00	861,000
飯野海運	3,000	631.00	1,893,000

第一中央汽船	7,000	43.00	301,000	
日本航空	11,300	3,925.00	44,352,500	
A N Aホールディングス	116,000	333.90	38,732,400	
パスコ	1,000	337.00	337,000	
トランコム	200	5,440.00	1,088,000	
日新	2,000	317.00	634,000	
三菱倉庫	4,000	1,862.00	7,448,000	
三井倉庫ホールディングス	3,000	420.00	1,260,000	
住友倉庫	4,000	703.00	2,812,000	
澁澤倉庫	2,000	356.00	712,000	
東陽倉庫	1,000	294.00	294,000	
乾汽船	400	999.00	399,600	
日本トランスシティ	1,000	388.00	388,000	
中央倉庫	300	970.00	291,000	
安田倉庫	500	1,003.00	501,500	
東洋埠頭	2,000	202.00	404,000	
宇徳	500	583.00	291,500	
上組	7,000	1,175.00	8,225,000	
キューソー流通システム	200	1,668.00	333,600	
郵船ロジスティクス	500	1,499.00	749,500	
近鉄エクスプレス	500	5,720.00	2,860,000	
エーアイティー	300	1,165.00	349,500	
N E C ネットエスアイ	700	2,497.00	1,747,900	
システナ	600	883.00	529,800	
デジタルアーツ	300	1,170.00	351,000	
新日鉄住金ソリューションズ	500	3,670.00	1,835,000	
I Tホールディングス	1,900	2,377.00	4,516,300	
電算システム	200	1,592.00	318,400	
グリー	3,500	828.00	2,898,000	
コーエーテクモホールディングス	1,300	1,840.00	2,392,000	
三菱総合研究所	200	2,759.00	551,800	
K L a b	600	1,498.00	898,800	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	400	1,030.00	412,000	
ネクソン	5,500	1,632.00	8,976,000	
エイチーム	100	5,210.00	521,000	
e n i s h	200	1,569.00	313,800	
コロブラ	1,000	2,554.00	2,554,000	
モバイルクリエイト	300	785.00	235,500	
ブロードリーフ	500	2,244.00	1,122,000	
ハーツユナイテッドグループ	200	1,801.00	360,200	
ティーガイア	600	1,648.00	988,800	
豆蔵ホールディングス	500	613.00	306,500	
G M O ペイメントゲートウェイ	500	3,005.00	1,502,500	

インターネットイニシアティブ	900	2,035.00	1,831,500	
ビットアイル	700	522.00	365,400	
S R Aホールディングス	300	1,642.00	492,600	
朝日ネット	600	526.00	315,600	
パナソニック インフォメーションシステムズ	100	3,955.00	395,500	
野村総合研究所	3,300	4,530.00	14,949,000	
サイバネットシステム	500	477.00	238,500	
インテージホールディングス	300	2,111.00	633,300	
ソースネクスト	300	760.00	228,000	
フジ・メディア・ホールディングス	6,100	1,753.00	10,693,300	
オービック	2,000	4,840.00	9,680,000	
ジャストシステム	800	758.00	606,400	
ヤフー	41,700	511.00	21,308,700	
トレンドマイクロ	3,100	4,125.00	12,787,500	
日本オラクル	900	5,430.00	4,887,000	
アルファシステムズ	200	1,787.00	357,400	
フューチャーアーキテクト	600	710.00	426,000	
C A C Holdings	400	1,082.00	432,800	
ソフトバンク・テクノロジー	200	1,196.00	239,200	
オービックビジネスコンサルタント	400	4,510.00	1,804,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,300	2,556.00	3,322,800	
アイティフォー	700	461.00	322,700	
大塚商会	1,600	5,370.00	8,592,000	
サイボウズ	800	356.00	284,800	
電通国際情報サービス	400	1,208.00	483,200	
ウェザーニューズ	200	3,595.00	719,000	
C I J	500	499.00	249,500	
WOWOW	300	3,940.00	1,182,000	
ネットワンシステムズ	2,400	802.00	1,924,800	
アルゴグラフィックス	200	1,808.00	361,600	
マーベラス	1,000	1,566.00	1,566,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,200	1,874.00	2,248,800	
日本ユニシス	1,600	1,144.00	1,830,400	
兼松エレクトロニクス	400	1,765.00	706,000	
東京放送ホールディングス	3,500	1,592.00	5,572,000	
日本テレビホールディングス	5,300	2,117.00	11,220,100	
朝日放送	600	1,172.00	703,200	
テレビ朝日ホールディングス	1,600	2,199.00	3,518,400	
スカパーJ S A Tホールディングス	4,400	768.00	3,379,200	
テレビ東京ホールディングス	500	2,212.00	1,106,000	
コネクシオ	400	1,193.00	477,200	
日本電信電話	22,800	8,171.00	186,298,800	代用有価証券 3,200株

KDDI	59,100	2,878.00	170,089,800
光通信	500	8,290.00	4,145,000
NTTドコモ	47,900	2,228.50	106,745,150
GMOインターネット	1,900	1,501.00	2,851,900
KADOKAWA・DWANGO	1,400	1,909.00	2,672,600
学研ホールディングス	2,000	255.00	510,000
ゼンリン	800	1,409.00	1,127,200
昭文社	300	902.00	270,600
アイネット	300	950.00	285,000
松竹	4,000	1,082.00	4,328,000
東宝	4,100	3,160.00	12,956,000
東映	2,000	896.00	1,792,000
エヌ・ティ・ティ・データ	3,600	5,500.00	19,800,000
DTS	600	2,334.00	1,400,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,200	2,551.00	5,612,200
シーイーシー	400	911.00	364,400
カプコン	1,500	2,251.00	3,376,500
ジャステック	300	920.00	276,000
SCSK	1,400	3,495.00	4,893,000
アイネス	800	972.00	777,600
TKC	500	2,820.00	1,410,000
富士ソフト	800	2,443.00	1,954,400
NSD	1,400	1,705.00	2,387,000
コナミ	2,400	2,267.00	5,440,800
JBCホールディングス	500	858.00	429,000
ミロク情報サービス	400	687.00	274,800
ソフトバンク	30,800	7,583.00	233,556,400
高千穂交易	200	1,026.00	205,200
伊藤忠食品	100	4,255.00	425,500
エレマテック	300	3,220.00	966,000
JALUX	200	2,239.00	447,800
あらた	1,000	326.00	326,000
双日	38,900	221.00	8,596,900
アルフレッサホールディングス	6,900	1,751.00	12,081,900
横浜冷凍	1,400	827.00	1,157,800
アルコニックス	300	1,810.00	543,000
神戸物産	200	5,020.00	1,004,000
あいホールディングス	900	2,138.00	1,924,200
ダイワボウホールディングス	5,000	199.00	995,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,000	1,456.00	1,456,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,100	886.00	974,600
八洲電機	400	582.00	232,800
UKCホールディングス	400	2,245.00	898,000

TO K A Iホールディングス	2,800	496.00	1,388,800	
三洋貿易	300	1,376.00	412,800	
ウイン・パートナーズ	200	1,417.00	283,400	
シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,943.00	3,237,300	
小野建	500	1,059.00	529,500	
佐島電機	500	829.00	414,500	
伯東	400	1,433.00	573,200	
コンドーテック	400	781.00	312,400	
中山福	300	895.00	268,500	
ナガイレーベン	800	2,263.00	1,810,400	
三菱食品	600	2,515.00	1,509,000	
松田産業	400	1,577.00	630,800	
メディバルホールディングス	5,800	1,636.00	9,488,800	
アドヴァン	300	1,580.00	474,000	
S P K	100	2,322.00	232,200	
アズワン	400	3,705.00	1,482,000	
シモジマ	400	1,075.00	430,000	
ドウシシャ	800	1,829.00	1,463,200	
小津産業	100	2,419.00	241,900	
高速	300	896.00	268,800	
黒田電気	1,000	2,068.00	2,068,000	
丸文	500	791.00	395,500	
ハビネット	400	1,403.00	561,200	
橋本総業	100	1,438.00	143,800	
エクセル	300	1,332.00	399,600	
マルカキカイ	200	2,015.00	403,000	
ガリバーインターナショナル	1,800	898.00	1,616,400	
日本エム・ディ・エム	500	524.00	262,000	
進和	300	1,839.00	551,700	
シークス	400	3,260.00	1,304,000	
オーハシテクニカ	400	1,507.00	602,800	
伊藤忠商事	48,700	1,429.50	69,616,650	
丸紅	50,900	711.30	36,205,170	
高島	1,000	265.00	265,000	
長瀬産業	3,500	1,568.00	5,488,000	
蝶理	400	1,801.00	720,400	
豊田通商	6,500	3,220.00	20,930,000	
三共生興	1,000	504.00	504,000	
兼松	12,000	182.00	2,184,000	
三井物産	49,300	1,619.50	79,841,350	
日本紙パルプ商事	3,000	327.00	981,000	
日立ハイテクノロジーズ	2,000	3,240.00	6,480,000	
カメイ	800	898.00	718,400	

OUGホールディングス	1,000	241.00	241,000	
スターゼン	2,000	391.00	782,000	
山善	2,200	1,045.00	2,299,000	
住友商事	34,300	1,346.00	46,167,800	
内田洋行	1,000	396.00	396,000	
三菱商事	44,600	2,484.50	110,808,700	代用有価証券 5,200株
第一実業	1,000	615.00	615,000	
キヤノンマーケティングジャパン	1,700	2,399.00	4,078,300	
西華産業	2,000	338.00	676,000	
佐藤商事	500	822.00	411,000	
菱洋エレクトロ	700	1,448.00	1,013,600	
東京産業	600	492.00	295,200	
ユアサ商事	500	2,562.00	1,281,000	
神鋼商事	1,000	266.00	266,000	
阪和興業	6,000	493.00	2,958,000	
カナデン	500	866.00	433,000	
菱電商事	1,000	859.00	859,000	
フルサト工業	300	1,753.00	525,900	
岩谷産業	6,000	833.00	4,998,000	
すてきナイスグループ	2,000	196.00	392,000	
昭光通商	2,000	153.00	306,000	
イワキ	1,000	245.00	245,000	
三愛石油	1,000	793.00	793,000	
稲畑産業	1,400	1,223.00	1,712,200	
G S Iクレオス	2,000	139.00	278,000	
ワキタ	1,200	1,181.00	1,417,200	
東邦ホールディングス	2,000	2,050.00	4,100,000	
サンゲツ	2,100	1,889.00	3,966,900	
ミツウロコグループホールディングス	900	583.00	524,700	
シナネン	1,000	467.00	467,000	
伊藤忠エネクス	1,300	1,025.00	1,332,500	
サンリオ	1,600	3,275.00	5,240,000	
サンワテクノス	400	1,167.00	466,800	
リョーサン	1,000	2,904.00	2,904,000	
新光商事	700	1,201.00	840,700	
トーヨー	1,000	458.00	458,000	
三信電気	800	981.00	784,800	
東陽テクニカ	900	1,149.00	1,034,100	
モスフードサービス	800	2,440.00	1,952,000	
加賀電子	500	1,463.00	731,500	
ソーダニッカ	600	551.00	330,600	
立花エレテック	400	1,426.00	570,400	
P a l t a c	900	1,716.00	1,544,400	

太平洋興発	2,000	96.00	192,000
ヤマタネ	3,000	189.00	567,000
日鉄住金物産	4,000	401.00	1,604,000
トラスコ中山	700	3,930.00	2,751,000
オートバックスセブン	2,100	1,936.00	4,065,600
加藤産業	800	2,539.00	2,031,200
イノテック	500	497.00	248,500
イエローハット	500	2,661.00	1,330,500
J Kホールディングス	600	593.00	355,800
日伝	200	2,733.00	546,600
杉本商事	300	1,235.00	370,500
因幡電機産業	900	4,405.00	3,964,500
ミスミグループ本社	2,200	4,480.00	9,856,000
タキヒヨー	1,000	468.00	468,000
スズケン	2,600	3,785.00	9,841,000
ジェコス	400	1,317.00	526,800
ルネサスイーストン	300	604.00	181,200
ローソン	2,200	8,360.00	18,392,000
サンエー	400	4,515.00	1,806,000
カワチ薬品	400	2,119.00	847,600
エービーシー・マート	800	6,790.00	5,432,000
ハードオフコーポレーション	300	1,214.00	364,200
アスクル	600	2,800.00	1,680,000
ゲオホールディングス	1,100	1,302.00	1,432,200
アダストリアホールディングス	500	3,580.00	1,790,000
くらコーポレーション	300	4,700.00	1,410,000
キャンドゥ	300	1,538.00	461,400
パル	300	3,705.00	1,111,500
エディオン	2,700	872.00	2,354,400
サーラコーポレーション	500	593.00	296,500
あみやき亭	100	4,905.00	490,500
ひらまつ	800	641.00	512,800
ゲンキー	100	11,230.00	1,123,000
大黒天物産	100	5,070.00	507,000
ハニーズ	500	1,004.00	502,000
アルペン	500	1,934.00	967,000
クオール	600	1,037.00	622,200
ジェイアイエヌ	400	4,595.00	1,838,000
ビックカメラ	2,500	1,187.00	2,967,500
D C Mホールディングス	2,800	933.00	2,612,400
Monotaro	1,100	3,960.00	4,356,000
アーランドサービス	100	5,080.00	508,000
J . フロント リテイリング	7,400	1,920.00	14,208,000

ドトール・日レスホールディングス	1,000	2,318.00	2,318,000
マツモトキヨシホールディングス	1,300	4,275.00	5,557,500
ブロンコビリー	100	4,670.00	467,000
スタートトゥデイ	1,800	2,992.00	5,385,600
物語コーポレーション	200	3,930.00	786,000
ココカラファイン	600	3,440.00	2,064,000
三越伊勢丹ホールディングス	11,600	2,086.00	24,197,600
ウエルシアホールディングス	500	4,475.00	2,237,500
クリエイティブSDホールディングス	300	5,130.00	1,539,000
丸善CHホールディングス	700	371.00	259,700
チムニー	100	3,025.00	302,500
ジョイフル本田	300	4,745.00	1,423,500
すかいらーく	2,100	1,551.00	3,257,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,900	1,090.00	2,071,000
ブックオフコーポレーション	300	904.00	271,200
あさひ	400	1,064.00	425,600
日本調剤	100	5,890.00	589,000
コスモス薬品	300	15,980.00	4,794,000
トーエル	300	873.00	261,900
セブン&アイ・ホールディングス	24,300	5,259.00	127,793,700
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	400	2,165.00	866,000
ツルハホールディングス	1,200	8,580.00	10,296,000
サンマルクホールディングス	400	3,995.00	1,598,000
トリドール	600	1,692.00	1,015,200
クスリのアオキ	200	8,720.00	1,744,000
総合メディカル	300	3,135.00	940,500
カップ・クリエイティブホールディングス	900	1,131.00	1,017,900
ライトオン	400	870.00	348,000
良品計画	700	18,550.00	12,985,000
三城ホールディングス	700	483.00	338,100
コナカ	700	745.00	521,500
イオン北海道	400	660.00	264,000
コジマ	900	329.00	296,100
コーナン商事	900	1,309.00	1,178,100
ワタミ	700	1,189.00	832,300
ドンキホーテホールディングス	1,900	9,560.00	18,164,000
西松屋チェーン	1,100	1,108.00	1,218,800
ゼンショーホールディングス	3,000	1,118.00	3,354,000
幸楽苑	400	1,534.00	613,600
サイゼリヤ	900	2,446.00	2,201,400
ユナイテッドアローズ	800	3,875.00	3,100,000
ハイデイ日高	400	2,981.00	1,192,400

京都きもの友禅	400	1,000.00	400,000
コロワイド	1,900	1,609.00	3,057,100
壱番屋	300	5,260.00	1,578,000
スギホールディングス	1,000	5,840.00	5,840,000
スクロール	800	278.00	222,400
ヨンドシーホールディングス	400	2,663.00	1,065,200
ファミリーマート	2,000	5,240.00	10,480,000
木曽路	700	2,023.00	1,416,100
サトレストランシステムズ	500	1,055.00	527,500
千趣会	1,000	912.00	912,000
ケーヨー	1,100	555.00	610,500
上新電機	1,000	943.00	943,000
日本瓦斯	900	2,831.00	2,547,900
ベスト電器	1,900	145.00	275,500
ロイヤルホールディングス	1,000	2,166.00	2,166,000
いなげや	600	1,346.00	807,600
島忠	1,400	3,060.00	4,284,000
チヨダ	700	2,581.00	1,806,700
ライフコーポレーション	400	2,077.00	830,800
リンガーハット	600	2,241.00	1,344,600
AOKIホールディングス	1,300	1,649.00	2,143,700
オークワ	1,000	955.00	955,000
コメリ	1,000	2,810.00	2,810,000
青山商事	1,500	3,935.00	5,902,500
しまむら	700	11,460.00	8,022,000
CFSコーポレーション	400	999.00	399,600
高島屋	8,000	1,159.00	9,272,000
松屋	1,200	1,906.00	2,287,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,700	2,232.00	6,026,400
近鉄百貨店	2,000	335.00	670,000
ニッセンホールディングス	1,200	264.00	316,800
パルコ	600	1,154.00	692,400
丸井グループ	7,000	1,408.00	9,856,000
アクシアル リテイリング	400	3,435.00	1,374,000
イオン	24,000	1,523.00	36,552,000
ユニグループ・ホールディングス	5,600	699.00	3,914,400
イズミ	1,300	4,780.00	6,214,000
東武ストア	1,000	363.00	363,000
平和堂	1,200	2,919.00	3,502,800
フジ	600	2,158.00	1,294,800
ヤオコー	700	4,405.00	3,083,500
ゼビオ	800	2,034.00	1,627,200
ケーブホールディングス	1,300	3,780.00	4,914,000

Olympicグループ	300	793.00	237,900
日産東京販売ホールディングス	1,000	348.00	348,000
アインファーマシーズ	700	4,420.00	3,094,000
元気寿司	200	2,474.00	494,800
ヤマダ電機	23,000	486.00	11,178,000
アークランドサカモト	400	2,838.00	1,135,200
ニトリホールディングス	2,500	8,660.00	21,650,000
吉野家ホールディングス	1,600	1,332.00	2,131,200
松屋フーズ	300	2,313.00	693,900
サガミチェーン	1,000	1,171.00	1,171,000
関西スーパーマーケット	400	794.00	317,600
王将フードサービス	400	4,220.00	1,688,000
プレナス	600	2,305.00	1,383,000
ミニストップ	400	1,747.00	698,800
アークス	1,000	2,576.00	2,576,000
バロー	1,300	2,585.00	3,360,500
ベルク	300	3,495.00	1,048,500
大庄	300	1,490.00	447,000
ファーストリテイリング	1,200	48,075.00	57,690,000
サンドラッグ	1,200	6,080.00	7,296,000
サックスパー ホールディングス	400	2,124.00	849,600
ベルーナ	1,400	584.00	817,600
じもとホールディングス	4,200	231.00	970,200
足利ホールディングス	3,700	503.00	1,861,100
東京TYフィナンシャルグループ	700	3,460.00	2,422,000
新生銀行	55,000	248.00	13,640,000
あおぞら銀行	39,000	454.00	17,706,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	466,600	826.40	385,598,240
りそなホールディングス	68,000	635.40	43,207,200
三井住友トラスト・ホールディングス	129,000	535.50	69,079,500
三井住友フィナンシャルグループ	44,000	4,958.00	218,152,000
第四銀行	7,000	453.00	3,171,000
北越銀行	6,000	240.00	1,440,000
西日本シティ銀行	20,000	373.00	7,460,000
千葉銀行	22,000	990.00	21,780,000
横浜銀行	39,000	780.90	30,455,100
常陽銀行	21,000	658.00	13,818,000
群馬銀行	14,000	863.00	12,082,000
武蔵野銀行	900	4,380.00	3,942,000
千葉興業銀行	1,200	842.00	1,010,400
筑波銀行	2,400	413.00	991,200
七十七銀行	10,000	693.00	6,930,000
青森銀行	5,000	394.00	1,970,000

秋田銀行	4,000	366.00	1,464,000
山形銀行	3,000	544.00	1,632,000
岩手銀行	400	5,560.00	2,224,000
東邦銀行	5,000	509.00	2,545,000
東北銀行	3,000	172.00	516,000
みちのく銀行	3,000	211.00	633,000
ふくおかフィナンシャルグループ	24,000	688.00	16,512,000
静岡銀行	17,000	1,292.00	21,964,000
十六銀行	7,000	471.00	3,297,000
スルガ銀行	6,100	2,694.00	16,433,400
八十二銀行	11,000	918.00	10,098,000
山梨中央銀行	4,000	550.00	2,200,000
大垣共立銀行	7,000	412.00	2,884,000
福井銀行	5,000	270.00	1,350,000
北國銀行	6,000	436.00	2,616,000
清水銀行	200	3,110.00	622,000
滋賀銀行	6,000	630.00	3,780,000
南都銀行	6,000	436.00	2,616,000
百五銀行	6,000	592.00	3,552,000
京都銀行	11,000	1,317.00	14,487,000
紀陽銀行	2,300	1,739.00	3,999,700
三重銀行	3,000	283.00	849,000
ほくほくフィナンシャルグループ	40,000	288.00	11,520,000
広島銀行	17,000	688.00	11,696,000
山陰合同銀行	4,000	1,086.00	4,344,000
中国銀行	4,200	1,877.00	7,883,400
鳥取銀行	2,000	261.00	522,000
伊予銀行	6,200	1,488.00	9,225,600
百十四銀行	6,000	413.00	2,478,000
四国銀行	4,000	255.00	1,020,000
阿波銀行	5,000	720.00	3,600,000
鹿児島銀行	4,000	851.00	3,404,000
大分銀行	4,000	478.00	1,912,000
宮崎銀行	4,000	479.00	1,916,000
肥後銀行	5,000	771.00	3,855,000
佐賀銀行	4,000	315.00	1,260,000
十八銀行	4,000	383.00	1,532,000
沖縄銀行	500	5,230.00	2,615,000
琉球銀行	1,200	1,799.00	2,158,800
セブン銀行	19,600	614.00	12,034,400
みずほフィナンシャルグループ	807,500	222.90	179,991,750
高知銀行	2,000	180.00	360,000
山口フィナンシャルグループ	6,000	1,522.00	9,132,000

長野銀行	2,000	199.00	398,000
名古屋銀行	5,000	426.00	2,130,000
北洋銀行	8,800	470.00	4,136,000
愛知銀行	200	5,990.00	1,198,000
第三銀行	3,000	195.00	585,000
中京銀行	2,000	225.00	450,000
東日本銀行	3,000	414.00	1,242,000
大光銀行	2,000	239.00	478,000
愛媛銀行	3,000	250.00	750,000
トマト銀行	2,000	204.00	408,000
みなと銀行	5,000	293.00	1,465,000
京葉銀行	5,000	729.00	3,645,000
関西アーバン銀行	800	1,320.00	1,056,000
栃木銀行	3,000	630.00	1,890,000
北日本銀行	200	3,350.00	670,000
東和銀行	8,000	100.00	800,000
福島銀行	7,000	93.00	651,000
大東銀行	4,000	173.00	692,000
トモニホールディングス	4,500	576.00	2,592,000
フィデアホールディングス	3,300	232.00	765,600
池田泉州ホールディングス	4,800	546.00	2,620,800
F P G	1,500	1,291.00	1,936,500
S B Iホールディングス	7,000	1,551.00	10,857,000
日本アジア投資	4,000	76.00	304,000
ジャフコ	800	4,715.00	3,772,000
大和証券グループ本社	54,000	955.90	51,618,600
野村ホールディングス	118,900	717.80	85,346,420
岡三証券グループ	5,000	943.00	4,715,000
丸三証券	1,800	1,199.00	2,158,200
東洋証券	2,000	374.00	748,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,700	924.00	6,190,800
光世証券	1,000	228.00	228,000
水戸証券	1,800	444.00	799,200
いちよし証券	1,200	1,287.00	1,544,400
松井証券	3,000	1,098.00	3,294,000
マネックスグループ	6,800	313.00	2,128,400
カブドットコム証券	2,600	836.00	2,173,600
極東証券	800	1,790.00	1,432,000
岩井コスモホールディングス	600	1,624.00	974,400
マネースクウェアHD	200	1,386.00	277,200
マネーパートナーズグループ	600	369.00	221,400
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	12,900	3,860.00	49,794,000
アニコム ホールディングス	200	2,326.00	465,200

MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	18,500	3,349.00	61,956,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	5,600	2,072.00	11,603,200
第一生命保険	37,300	1,898.00	70,795,400
東京海上ホールディングス	23,900	4,774.00	114,098,600
T & Dホールディングス	21,200	1,697.50	35,987,000
全国保証	1,500	4,430.00	6,645,000
クレディセゾン	4,700	2,183.00	10,260,100
芙蓉総合リース	600	5,020.00	3,012,000
興銀リース	1,100	2,640.00	2,904,000
東京センチュリーリース	1,400	3,800.00	5,320,000
日本証券金融	2,700	796.00	2,149,200
アイフル	9,700	424.00	4,112,800
ポケットカード	400	503.00	201,200
リコーリース	500	3,595.00	1,797,500
イオンフィナンシャルサービス	3,800	3,040.00	11,552,000
アコム	11,700	376.00	4,399,200
ジャックス	3,000	603.00	1,809,000
オリエントコーポレーション	13,400	192.00	2,572,800
日立キャピタル	1,100	2,735.00	3,008,500
アプラスフィナンシャル	2,800	132.00	369,600
オリックス	41,200	1,804.00	74,324,800
三菱UFJリース	14,800	648.00	9,590,400
日本取引所グループ	8,500	3,585.00	30,472,500
イー・ギャランティ	200	1,901.00	380,200
NECキャピタルソリューション	200	1,871.00	374,200
日本駐車場開発	6,300	203.00	1,278,900
ヒューリック	9,800	1,314.00	12,877,200
三栄建築設計	200	933.00	186,600
野村不動産ホールディングス	3,500	2,395.00	8,382,500
プレサンスコーポレーション	200	3,935.00	787,000
常和ホールディングス	200	4,995.00	999,000
日本管理センター	300	1,763.00	528,900
フージャースホールディングス	900	595.00	535,500
オープンハウス	400	3,070.00	1,228,000
東急不動産ホールディングス	15,200	866.00	13,163,200
飯田グループホールディングス	3,800	1,639.00	6,228,200
パーク24	2,900	2,366.00	6,861,400
三井不動産	31,000	3,570.50	110,685,500
三菱地所	43,000	2,804.00	120,572,000
平和不動産	1,100	1,685.00	1,853,500
東京建物	13,000	892.00	11,596,000
ダイビル	1,500	1,242.00	1,863,000
京阪神ビルディング	1,000	707.00	707,000

住友不動産	14,000	4,686.50	65,611,000
大京	9,000	184.00	1,656,000
テーオーシー	2,000	965.00	1,930,000
東京楽天地	1,000	495.00	495,000
レオパレス21	6,400	743.00	4,755,200
スターツコーポレーション	700	1,927.00	1,348,900
フジ住宅	700	665.00	465,500
空港施設	700	689.00	482,300
住友不動産販売	400	3,245.00	1,298,000
ゴールドクレスト	500	2,325.00	1,162,500
日本エスリード	200	1,209.00	241,800
日神不動産	800	472.00	377,600
タカラレーベン	2,600	725.00	1,885,000
サンヨーハウジング名古屋	300	1,222.00	366,600
イオンモール	3,800	2,299.00	8,736,200
ファースト住建	200	1,500.00	300,000
トーセイ	800	882.00	705,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,600	1,271.00	4,575,600
サンフロンティア不動産	600	1,189.00	713,400
エフ・ジェー・ネクスト	400	537.00	214,800
日本空港ビルデング	2,000	7,100.00	14,200,000
日本工営	2,000	498.00	996,000
ネクスト	700	1,102.00	771,400
日本M&Aセンター	1,000	4,000.00	4,000,000
アコーディア・ゴルフ	2,300	1,194.00	2,746,200
タケエイ	600	1,051.00	630,600
パソナグループ	500	803.00	401,500
GCAサヴィアン	500	1,362.00	681,000
エス・エム・エス	700	1,505.00	1,053,500
テンプホールディングス	1,200	3,910.00	4,692,000
クックパッド	400	5,500.00	2,200,000
エスクリ	200	1,291.00	258,200
学情	200	1,325.00	265,000
スタジオアリス	300	2,196.00	658,800
シミックホールディングス	200	1,662.00	332,400
総合警備保障	2,100	3,975.00	8,347,500
カカクコム	4,100	1,923.00	7,884,300
アイロムホールディングス	200	1,726.00	345,200
ルネサンス	300	1,272.00	381,600
ディップ	100	7,630.00	763,000
オプトホールディング	300	676.00	202,800
新日本科学	600	801.00	480,600
ツクイ	700	930.00	651,000

エムスリー	5,300	2,300.00	12,190,000
ツカダ・グローバルホールディング	400	812.00	324,800
アウトソーシング	200	1,619.00	323,800
ディー・エヌ・エー	3,000	2,497.00	7,491,000
博報堂D Yホールディングス	8,500	1,317.00	11,194,500
ぐるなび	700	2,290.00	1,603,000
一休	500	2,362.00	1,181,000
ファンコミュニケーションズ	1,100	1,018.00	1,119,800
P G Mホールディングス	900	1,277.00	1,149,300
バリューコマース	500	617.00	308,500
J Pホールディングス	1,500	345.00	517,500
E P Sホールディングス	800	1,415.00	1,132,000
プレステージ・インターナショナル	500	859.00	429,500
アミューズ	200	3,240.00	648,000
ドリームインキュベータ	200	2,577.00	515,400
クイック	200	890.00	178,000
ケネディクス	8,700	490.00	4,263,000
電通	6,900	5,600.00	38,640,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	945.00	189,000
びあ	200	2,220.00	444,000
イオンファンタジー	200	1,996.00	399,200
みらかホールディングス	1,600	5,870.00	9,392,000
アルプス技研	200	2,259.00	451,800
サニックス	700	371.00	259,700
日本空調サーピス	300	831.00	249,300
オリエンタルランド	6,700	8,506.00	56,990,200
ダスキン	1,700	2,065.00	3,510,500
明光ネットワークジャパン	600	1,431.00	858,600
ファルコホールディングス	300	1,356.00	406,800
ラウンドワン	1,700	639.00	1,086,300
リゾートトラスト	2,300	3,165.00	7,279,500
ビー・エム・エル	400	3,560.00	1,424,000
もしもしホットライン	1,100	1,318.00	1,449,800
ユー・エス・エス	7,500	2,097.00	15,727,500
サイバーエージェント	1,100	6,250.00	6,875,000
楽天	26,800	2,144.50	57,472,600
セントラルスポーツ	200	2,201.00	440,200
フルキャストホールディングス	600	785.00	471,000
リブセンス	400	617.00	246,800
ジャパンマテリアル	300	1,614.00	484,200
アサンテ	200	1,382.00	276,400
リクルートホールディングス	7,000	4,040.00	28,280,000
リロ・ホールディング	200	10,880.00	2,176,000

東祥	100	2,823.00	282,300
エイチ・アイ・エス	1,000	3,995.00	3,995,000
共立メンテナンス	300	5,610.00	1,683,000
イチネンホールディングス	600	1,074.00	644,400
建設技術研究所	400	1,266.00	506,400
スペース	300	1,296.00	388,800
東京テアトル	2,000	140.00	280,000
よみうりランド	1,000	461.00	461,000
東京都競馬	4,000	290.00	1,160,000
常磐興産	2,000	153.00	306,000
カナモト	900	3,375.00	3,037,500
東京ドーム	4,000	498.00	1,992,000
西尾レントオール	500	3,270.00	1,635,000
トランス・コスモス	800	2,645.00	2,116,000
乃村工藝社	1,200	1,268.00	1,521,600
藤田観光	2,000	470.00	940,000
KNT - CTホールディングス	3,000	168.00	504,000
日本管財	300	2,816.00	844,800
トーカイ	300	3,970.00	1,191,000
セコム	6,000	8,581.00	51,486,000
セントラル警備保障	300	1,367.00	410,100
丹青社	700	986.00	690,200
メイテック	800	3,920.00	3,136,000
アサツー ディ・ケイ	1,200	3,305.00	3,966,000
応用地質	600	1,541.00	924,600
船井総研ホールディングス	700	1,227.00	858,900
ベネッセホールディングス	2,200	3,630.00	7,986,000
イオンディライト	600	3,050.00	1,830,000
ナック	400	1,027.00	410,800
ニチイ学館	1,200	1,163.00	1,395,600
ダイセキ	1,000	2,141.00	2,141,000
合 計	9,703,500		13,565,779,760

(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10月20日現在	平成27年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	331,031,630	1,068,675,638
コール・ローン	10,605,070	6,860,058
株式	11,406,730,598	11,399,949,591
投資信託受益証券	1,952,808	1,570,602
投資証券	283,941,608	281,458,009
派生商品評価勘定	7,047	9,793,658
未収入金	3,142,440	3,088,491
未収配当金	10,226,360	17,274,301
未収利息	9	7
差入委託証拠金	144,906,526	211,544,087
流動資産合計	12,192,544,096	13,000,214,442
資産合計	12,192,544,096	13,000,214,442
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,098,571	244,545
未払解約金	4,000,000	3,400,000
流動負債合計	29,098,571	3,644,545
負債合計	29,098,571	3,644,545
純資産の部		
元本等		
元本	7,489,665,114	6,571,028,589
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,673,780,411	6,425,541,308
元本等合計	12,163,445,525	12,996,569,897
純資産合計	12,163,445,525	12,996,569,897
負債純資産合計	12,192,544,096	13,000,214,442

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10月21日 至 平成27年 4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10月20日現在	平成27年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 7,489,665,114口	1. 計算日における受益権の総数 6,571,028,589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 1.6240円 (1万口当たり純資産額) (16,240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 1.9779円 (1万口当たり純資産額) (19,779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26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 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10月20日現在	平成27年 4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 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。 投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	8,292,700,405円	7,489,665,114円
期中追加設定元本額	93,351,001円	61,424,329円
期中一部解約元本額	896,386,292円	980,060,854円
同期末における元本の内訳		
新光7資産バランスファンド	631,083,609円	550,960,391円
新光外国株式インデックスVA	3,417,844,015円	2,942,414,922円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関 投資家私募）	802,745,348円	740,836,319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）	617,545,402円	557,513,295円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家 私募）	241,075,858円	125,984,108円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関 投資家私募）	1,147,597,833円	1,059,310,207円

ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	617,160,659円	575,305,622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）	3,902,699円	3,900,412円
グローバル・ナビ	10,709,691円	14,803,313円
合計	7,489,665,114円	6,571,028,589円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	307,635,025	640,838,333
投資信託受益証券	130,187	33,898
投資証券	26,512,151	15,756,154
合計	334,016,989	656,628,385

(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10月20日現在				平成27年 4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	450,546,519	-	425,399,738	25,146,781	1,292,410,563	-	1,301,833,828	9,423,265
S&P500 EMINI	253,512,025	-	241,858,980	11,653,045	896,587,442	-	901,038,890	4,451,448
S&P/TSE 601X	33,254,640	-	31,106,274	2,148,366	50,745,770	-	52,343,865	1,598,095
DJ EURO ST50	61,573,397	-	56,436,450	5,136,947	171,701,150	-	171,418,854	282,296
LIFFE FTSE	69,524,252	-	64,973,986	4,550,266	132,683,304	-	136,119,446	3,436,142
SWISS MKT IX	19,894,727	-	18,717,098	1,177,629	-	-	-	-
SPI 200	12,787,478	-	12,306,950	480,528	40,692,897	-	40,912,773	219,876
合計	450,546,519	-	425,399,738	25,146,781	1,292,410,563	-	1,301,833,828	9,423,265

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10月20日現在				平成27年 4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	8,354,020	-	8,354,300	280
米ドル	18,217,285	-	18,213,800	3,485	3,567,900	-	3,567,900	0
ユーロ	-	-	-	-	3,856,200	-	3,856,500	300
スウェーデンクローナ	1,833,600	-	1,830,038	3,562	-	-	-	-
オーストラリアドル	-	-	-	-	929,920	-	929,900	20
合計	20,050,885	-	20,043,838	7,047	8,354,020	-	8,354,300	280

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	1,574	93.68	147,452.32	
	ANTERO RESOURCES CORPORATION	240	41.47	9,952.80	
	APACHE CORP	1,170	70.38	82,344.60	
	BAKER HUGHES INC	1,345	66.98	90,088.10	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,382	32.87	45,426.34	
	CAMERON INTERNATIONAL CORPORATION	663	49.78	33,004.14	
	CHENIERE ENERGY INC	699	76.80	53,683.20	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,800	15.45	27,810.00	
	CHEVRON CORP	5,875	109.11	641,021.25	
	CIMAREX ENERGY CO	300	128.20	38,460.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	1,000	10.64	10,640.00	
	CONCHO RESOURCES INC	351	124.75	43,787.25	
	CONOCOPHILLIPS	3,825	67.69	258,914.25	
	CONSOL ENERGY INC	801	31.14	24,943.14	
	CONTINENTAL RESOURCES INC	289	51.53	14,892.17	
	CORE LABORATORIES NV	136	121.57	16,533.52	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,261	65.92	83,125.12	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC	300	30.44	9,132.00	
	ENERGEN CORPORATION	227	69.37	15,746.99	
	ENSCO PLC-CLASS A	845	24.85	20,998.25	
	EOG RESOURCES INC	1,703	97.23	165,582.69	
	EQT CORPORATION	510	87.38	44,563.80	
	EXXON MOBIL CORP	13,159	86.93	1,143,911.87	
	FMC TECHNOLOGIES INC	766	39.31	30,111.46	
	HALLIBURTON CO	2,634	46.89	123,508.26	
	HELMERICH & PAYNE INC	336	73.64	24,743.04	
	HESS CORPORATION	836	77.46	64,756.56	
	HOLLYFRONTIER CORPORATION	578	37.92	21,917.76	
	KINDER MORGAN INC	5,595	43.90	245,620.50	
	MARATHON OIL CORP	2,097	30.52	64,000.44	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	871	98.72	85,985.12	
	MURPHY OIL CORPORATION	593	49.64	29,436.52	
	NABORS INDUSTRIES LTD	946	14.72	13,925.12	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,338	54.59	73,041.42	
NOBLE CORPORATION PLC	908	16.94	15,381.52		
NOBLE ENERGY INC	1,154	52.10	60,123.40		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,423	80.53	195,124.19		
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	400	56.81	22,724.00		
ONEOK INC	672	49.54	33,290.88		
PHILLIPS 66	1,720	78.01	134,177.20		

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	461	177.93	82,025.73
QEP RESOURCES INC	558	22.71	12,672.18
RANGE RESOURCES CORP	524	60.73	31,822.52
SCHLUMBERGER LIMITED	3,999	92.86	371,347.14
SOUTHWESTERN ENERGY CO	1,224	27.16	33,243.84
SPECTRA ENERGY CORPORATION	2,085	37.85	78,917.25
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	604	24.30	14,677.20
TESORO CORPORATION	392	84.79	33,237.68
VALERO ENERGY CORP	1,620	57.56	93,247.20
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	2,647	13.74	36,369.78
WHITING PETROLEUM CORPORATION	517	34.95	18,069.15
WILLIAMS COS INC	2,207	51.72	114,146.04
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	664	149.85	99,500.40
AIRGAS INC	209	104.74	21,890.66
ALBEMARLE CORPORATION	350	59.05	20,667.50
ALCOA INC	3,923	13.46	52,803.58
ASHLAND INC	205	126.06	25,842.30
AVERY DENNISON CORPORATION	283	51.07	14,452.81
BALL CORPORATION	456	71.80	32,740.80
CELANESE CORP-SERIES A	477	67.18	32,044.86
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	155	291.23	45,140.65
CROWN HOLDINGS INC	498	54.33	27,056.34
DOW CHEMICAL	3,662	49.66	181,854.92
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	2,815	71.55	201,413.25
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	500	75.86	37,930.00
ECOLAB INC	839	115.20	96,652.80
FMC CORPORATION	414	58.02	24,020.28
FREEMONT-MCMORAN INC	3,229	20.67	66,743.43
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	252	116.28	29,302.56
INTERNATIONAL PAPER CO	1,251	54.05	67,616.55
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	1,322	95.65	126,449.30
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	200	140.24	28,048.00
MEADWESTVACO CORPORATION	557	47.19	26,284.83
MONSANTO CO	1,504	116.70	175,516.80
NEWMONT MINING CORP	1,700	23.57	40,069.00
NUCOR CORP	991	46.41	45,992.31
OWENS-ILLINOIS INC	583	24.20	14,108.60
PPG INDUSTRIES INC	426	226.61	96,535.86
PRAXAIR INC	905	120.45	109,007.25
ROCK-TENN COMPANY-CL A	435	60.96	26,517.60
SEALED AIR CORPORATION	623	44.05	27,443.15
SIGMA-ALDRICH	370	138.39	51,204.30

THE MOSAIC COMPANY	995	45.32	45,093.40
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	264	282.14	74,484.96
VULCAN MATERIALS CO	409	81.93	33,509.37
WESTLAKE CHEMICAL CORPORATION	145	76.43	11,082.35
3M CO	1,892	161.71	305,955.32
AGCO CORPORATION	319	48.09	15,340.71
AMETEK INC	764	51.71	39,506.44
B/E AEROSPACE INC	366	61.61	22,549.26
BOEING CO	2,105	149.60	314,908.00
CATERPILLAR INC	1,787	83.28	148,821.36
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	303	50.14	15,192.42
CUMMINS INC	552	133.84	73,879.68
DANAHER CORP	1,965	84.22	165,492.30
DEERE & CO	1,058	87.51	92,585.58
DOVER CORP	514	72.13	37,074.82
EATON CORPORATION PLC	1,475	69.11	101,937.25
EMERSON ELECTRIC CO	2,156	58.43	125,975.08
FASTENAL CO	875	40.54	35,472.50
FLOWSERVE CORPORATION	424	57.24	24,269.76
FLUOR CORP	485	59.52	28,867.20
GENERAL DYNAMICS CORP	875	131.27	114,861.25
GENERAL ELECTRIC CO(US)	31,207	27.25	850,390.75
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,311	101.70	235,028.70
ILLINOIS TOOL WORKS	1,154	95.87	110,633.98
INGERSOLL-RAND PLC	878	67.34	59,124.52
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	500	47.46	23,730.00
JOY GLOBAL INC	305	40.80	12,444.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	265	122.44	32,446.60
LOCKHEED MARTIN CORP	835	194.82	162,674.70
MASCO CORP	1,200	25.65	30,780.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	596	160.16	95,455.36
PACCAR INC	1,100	62.77	69,047.00
PALL CORPORATION	332	98.08	32,562.56
PARKER HANNIFIN CORP	462	121.47	56,119.14
PENTAIR PLC	580	63.59	36,882.20
PRECISION CASTPARTS CORP	443	201.15	89,109.45
QUANTA SERVICES INC	796	29.11	23,171.56
RAYTHEON COMPANY	958	107.72	103,195.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	422	112.31	47,394.82
ROCKWELL COLLINS INC.	372	95.03	35,351.16
ROPER INDUSTRIES INC	311	167.08	51,961.88
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	498	58.15	28,958.70

SNAP-ON INC	200	146.16	29,232.00
SPX CORP	108	83.60	9,028.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	462	96.25	44,467.50
TEXTRON INC	858	44.81	38,446.98
TRANSDIGM GROUP INC	155	219.38	34,003.90
UNITED RENTALS INC	310	96.46	29,902.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	2,691	115.11	309,761.01
WABTEC CORPORATION	299	95.09	28,431.91
MW GRAINGER INC	191	239.33	45,712.03
XYLEM INC	565	35.14	19,854.10
CINTAS CORPORATION	309	81.38	25,146.42
DUN & BRADSTREET CORP	112	131.25	14,700.00
EQUIFAX INC	375	91.84	34,440.00
IHS INC-CLASS A	212	123.85	26,256.20
MANPOWER GROUP	281	83.33	23,415.73
NIELSEN NV	1,100	44.21	48,631.00
REPUBLIC SERVICES INC	884	39.36	34,794.24
ROBERT HALF INTL INC	423	58.72	24,838.56
STERICYCLE INC	264	138.06	36,447.84
THE ADT CORPORATION	573	40.63	23,280.99
TOWERS WATSON & COMPANY-CL A	217	129.58	28,118.86
TYCO INTERNATIONAL PLC	1,300	42.43	55,159.00
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	500	71.84	35,920.00
WASTE MANAGEMENT INC	1,352	52.88	71,493.76
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	623	48.19	30,022.37
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	474	68.57	32,502.18
CSX CORP	3,093	33.30	102,996.90
DELTA AIR LINES INC	700	44.76	31,332.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	600	45.60	27,360.00
FEDEX CORP	836	168.00	140,448.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,500	21.05	31,575.00
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	291	90.18	26,242.38
KANSAS CITY SOUTHERN	343	104.49	35,840.07
NORFOLK SOUTHERN CORP	962	100.65	96,825.30
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	605	41.79	25,282.95
UNION PACIFIC CORP	2,763	108.42	299,564.46
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	287	61.49	17,647.63
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,183	95.38	208,214.54
AUTOLIV INC	281	123.09	34,588.29
BORGWARNER INC	707	60.72	42,929.04
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	920	83.27	76,608.40
FORD MOTOR CO	11,153	15.76	175,771.28

GENERAL MOTORS CO	3,994	36.64	146,340.16
HARLEY-DAVIDSON INC	666	60.60	40,359.60
JOHNSON CONTROLS INC	2,070	50.54	104,617.80
TESLA MOTORS INC	262	206.79	54,178.98
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORPORATION	344	104.91	36,089.04
COACH INC	856	42.40	36,294.40
DR HORTON INC	1,076	28.27	30,418.52
FOSSIL GROUP INC	143	82.45	11,790.35
GARMIN LIMITED	374	46.67	17,454.58
HANESBRANDS INC	1,240	33.58	41,639.20
HASBRO INC	373	65.89	24,576.97
JARDEN CORPORATION	568	51.87	29,462.16
LEGGETT & PLATT INC	508	43.53	22,113.24
LENNAR CORPORATION-CLASS A	600	48.58	29,148.00
LULULEMON ATHLETICA INC	334	66.70	22,277.80
MATTEL INC	1,207	26.74	32,281.21
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	640	63.25	40,480.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	193	177.10	34,180.30
NEWELL RUBBERMAID INC	842	38.71	32,593.82
NIKE INC -CL B	2,125	98.55	209,418.75
POLARIS INDUSTRIES INC	196	142.55	27,939.80
PULTEGROUP INC	1,201	22.19	26,650.19
PVH CORPORATION	256	103.74	26,557.44
RALPH LAUREN CORPORATION	191	133.78	25,551.98
TOLL BROTHERS INC	600	38.35	23,010.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	558	85.14	47,508.12
VF CORP	1,074	73.74	79,196.76
WHIRLPOOL CORP	242	189.60	45,883.20
CARNIVAL CORP(US)	1,282	47.01	60,266.82
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	96	683.95	65,659.20
DARDEN RESTAURANTS INC	470	64.94	30,521.80
H&R BLOCK INC	855	31.23	26,701.65
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	1,300	29.60	38,480.00
LAS VEGAS SANDS CORP	1,246	55.16	68,729.36
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	704	77.64	54,658.56
MCDONALD'S CORP	3,024	94.88	286,917.12
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,287	21.43	27,580.41
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	284	52.21	14,827.64
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	550	79.03	43,466.50
STARBUCKS CORP	4,650	47.62	221,433.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	555	81.89	45,448.95
WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	383	89.32	34,209.56

WYNN RESORTS LTD	254	125.50	31,877.00
YUM! BRANDS INC	1,360	79.75	108,460.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	700	18.26	12,782.00
CBS CORP-CLASS B	1,493	60.68	90,595.24
CHARTER COMMUNICATION INC-A	238	186.74	44,444.12
COMCAST CORP-CL A	6,682	58.42	390,362.44
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	1,294	57.73	74,702.62
DIRECTV	1,483	86.60	128,427.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	848	31.15	26,415.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	450	32.80	14,760.00
DISH NETWORK CORPORATION-A	691	69.25	47,855.20
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	1,385	20.83	28,849.55
LIBERTY GLOBAL PLC-A	770	50.56	38,935.05
LIBERTY GLOBAL PLC-C	1,976	48.70	96,231.20
LIBERTY MEDIA CORPORATION	400	38.08	15,232.00
LIBERTY MEDIA CORPORATION-C	700	37.90	26,530.00
NEWS CORPRATION-CLASS A	1,325	15.59	20,656.75
OMNICOM GROUP	771	76.94	59,320.74
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	240	68.56	16,454.40
SIRIUS XM HOLDINGS INC	8,516	3.88	33,042.08
THE WALT DISNEY CO.	5,006	106.69	534,090.14
TIME WARNER CABLE INC	872	149.61	130,459.92
TIME WARNER INC	2,606	83.40	217,340.40
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	4,219	33.43	141,041.17
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	1,365	32.62	44,526.30
VIACOM INC-CLASS B	1,117	69.14	77,229.38
ADVANCE AUTO PARTS INC	227	149.80	34,004.60
AMAZON.COM INC	1,223	375.56	459,309.88
AUTONATION INC	255	63.52	16,197.60
AUTOZONE INC	100	683.43	68,343.00
BED BATH & BEYOND INC	576	71.46	41,160.96
BEST BUY CO INC	1,000	36.46	36,460.00
CARMAX INC	669	70.61	47,238.09
DICK'S SPORTING GOODS INC	357	55.28	19,734.96
DOLLAR GENERAL CORPORATION	943	74.42	70,178.06
DOLLAR TREE INC	639	79.14	50,570.46
EXPEDIA INC	318	96.09	30,558.21
FAMILY DOLLAR STORES	320	78.75	25,200.00
FOOT LOCKER INC	500	59.31	29,655.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	400	39.66	15,864.00
GAP INC/THE	842	40.63	34,210.46
GENUINE PARTS CO	475	91.67	43,543.25

HOME DEPOT INC	4,095	112.10	459,049.50
KOHL'S CORP	671	74.47	49,969.37
L BRANDS INC	772	89.44	69,047.68
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	1,389	28.79	39,989.31
LKQ CORPORATION	969	25.22	24,438.18
LOWE'S COS INC	3,068	72.55	222,583.40
MACY'S INC	1,075	66.45	71,433.75
NETFLIX INC	178	571.55	101,735.90
NORDSTROM INC	443	76.43	33,858.49
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	315	214.05	67,425.75
PRICELINE GROUP INC/THE	163	1,187.53	193,567.39
ROSS STORES INC	677	100.40	67,970.80
SIGNET JEWELERS LTD	237	132.41	31,381.17
STAPLES INC	2,189	16.03	35,089.67
TARGET CORP	1,880	80.02	150,437.60
TIFFANY & CO	402	84.59	34,005.18
TJX COMPANIES INC	2,153	65.25	140,483.25
TRACTOR SUPPLY COMPANY	422	87.00	36,714.00
TRIPADVISOR INC	400	80.71	32,284.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	190	152.05	28,889.50
URBAN OUTFITTERS INC	398	42.00	16,716.00
COSTCO WHOLESALE CORP	1,360	144.57	196,615.20
CVS HEALTH CORPORATION	3,562	100.39	357,589.18
KROGER CO	1,450	71.84	104,168.00
SYSCO CORP	1,827	37.33	68,201.91
WAL-MART STORES INC	5,007	77.88	389,945.16
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,710	86.96	235,661.60
WHOLE FOODS MARKET INC	1,118	48.81	54,569.58
ALTRIA GROUP INC	6,142	51.75	317,848.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,001	48.28	96,608.28
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	381	92.51	35,246.31
BUNGE LIMITED	496	85.55	42,432.80
CAMPBELL SOUP COMPANY	635	46.19	29,330.65
COCA-COLA CO/THE	12,250	40.30	493,675.00
COCA-COLA ENTERPRISES INC	714	45.09	32,194.26
CONAGRA FOODS INC	1,320	37.30	49,236.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	527	115.98	61,121.46
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	604	76.98	46,495.92
GENERAL MILLS INC	1,876	56.09	105,224.84
HERSHEY CO/THE	473	100.27	47,427.71
HORMEL FOODS CORPORATION	498	56.35	28,062.30
KELLOGG COMPANY	873	64.39	56,212.47

KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	378	112.80	42,638.40
KRAFT FOODS GROUP INC	1,830	86.73	158,715.90
LORILLARD INC	1,119	70.68	79,090.92
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	385	76.47	29,440.95
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	628	100.16	62,900.48
MOLSON COORS BREWING CO-B	475	76.97	36,560.75
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	5,221	36.96	192,994.26
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	443	136.90	60,648.91
PEPSICO INC	4,651	95.81	445,612.31
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	4,828	85.26	411,635.28
REYNOLDS AMERICAN INC	991	74.70	74,027.70
THE JM SMUCKER COMPANY	316	117.42	37,104.72
TYSON FOODS INC-CL A	950	39.03	37,078.50
AVON PRODUCTS INC	1,516	8.74	13,249.84
CHURCH & DWIGHT CO INC	416	85.06	35,384.96
CLOROX COMPANY	402	109.26	43,922.52
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,832	69.28	196,200.96
ENERGIZER HOLDINGS INC	193	139.70	26,962.10
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	719	82.82	59,547.58
KIMBERLY-CLARK CORP	1,162	106.78	124,078.36
PROCTER & GAMBLE CO	8,397	82.53	693,004.41
ABBOTT LABORATORIES	4,679	46.25	216,403.75
AETNA INC	1,093	107.72	117,737.96
AMERISOURCEBERGEN CORP	680	112.61	76,574.80
ANTHEM INC	839	152.48	127,930.72
BARD (C.R.) INC	233	171.06	39,856.98
BAXTER INTERNATIONAL INC.	1,684	69.91	117,728.44
BECTON DICKINSON & CO	647	141.53	91,569.91
BOSTON SCIENTIFIC CORP	4,122	18.40	75,844.80
CARDINAL HEALTH INC	1,028	89.55	92,057.40
CERNER CORPORATION	955	71.81	68,578.55
CIGNA CORP	813	131.13	106,608.69
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	534	81.26	43,392.84
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	500	50.36	25,180.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	332	139.94	46,460.08
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	2,281	85.55	195,139.55
HCA HOLDINGS INC	1,000	78.04	78,040.00
HENRY SCHEIN INC	262	138.27	36,226.74
HOLOGIC INC	794	32.46	25,777.21
HUMANA INC	477	177.48	84,657.96
INTUITIVE SURGICAL INC	113	540.70	61,099.10
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	300	124.41	37,323.00

MCKESSON CORP	721	228.03	164,409.63
MEDTRONIC PLC	4,401	76.49	336,632.49
OMNICARE INC	352	76.81	27,037.12
PATTERSON COMPANIES INC	259	46.95	12,160.05
QUEST DIAGNOSTICS	464	75.33	34,953.12
RESMED INC	433	71.88	31,124.04
ST JUDE MEDICAL INC	889	67.76	60,238.64
STRYKER CORP	1,058	92.50	97,865.00
THE COOPER COS INC	150	180.32	27,048.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,983	118.71	354,111.93
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	285	119.78	34,137.30
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	311	93.78	29,165.58
ZIMMER HOLDINGS INC	526	114.61	60,284.86
ABBVIE INC	4,951	62.29	308,397.79
ACTAVIS PLC	1,165	297.05	346,063.25
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,147	42.98	49,298.06
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	616	181.34	111,705.44
ALKERMES PLC	454	62.79	28,506.66
AMGEN INC	2,364	163.58	386,703.12
BIOGEN INC	734	419.44	307,868.96
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	492	120.91	59,487.72
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,155	65.35	336,879.25
CELGENE CORP	2,482	113.47	281,632.54
ELI LILLY & CO	3,114	72.47	225,671.58
ENDO INTERNATIONAL PLC	549	93.34	51,243.66
GILEAD SCIENCES INC	4,688	101.38	475,269.44
HOSPIRA INC	526	87.46	46,003.96
ILLUMINA INC	441	191.16	84,301.56
INCYTE CORP	500	101.66	50,830.00
ISIS PHARMACEUTICALS INC	367	65.33	23,976.11
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	200	187.18	37,436.00
JOHNSON & JOHNSON	8,699	99.58	866,246.42
MALLINCKRODT PLC	361	122.38	44,179.18
MEDIVATION INC	241	127.68	30,770.88
MERCK & CO. INC.	8,859	56.88	503,899.92
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	89	320.54	28,528.06
MYLAN NV	1,163	69.81	81,194.84
PERRIGO CO PLC	462	198.98	91,928.76
PFIZER INC	19,580	35.04	686,083.20
PHARMACYCLICS INC	200	257.45	51,490.00
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	267	66.69	17,806.23
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	248	447.52	110,984.96

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,243	132.10	164,200.30
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	747	125.07	93,427.29
WATERS CORP	259	124.41	32,222.19
ZOETIS INC	1,558	46.77	72,867.66
BANK OF AMERICA CORPORATION	32,681	15.56	508,516.36
BB&T CORPORATION	2,238	38.52	86,207.76
CIT GROUP INC	569	47.31	26,919.39
CITIGROUP INC	9,414	53.07	499,600.98
COMERICA INC	609	46.00	28,014.00
FIFTH THIRD BANCORP	2,561	18.90	48,415.70
FIRST REPUBLIC BANK/CA	408	58.89	24,027.12
HUDSON CITY BANCORP INC	1,600	9.50	15,200.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,700	11.11	29,997.00
JPMORGAN CHASE & CO	11,617	62.84	730,012.28
KEYCORP	2,930	14.09	41,283.70
M & T BANK CORP	400	120.81	48,324.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	1,457	16.78	24,448.46
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	1,060	15.04	15,942.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,635	90.93	148,670.55
REGIONS FINANCIAL CORP	4,576	9.59	43,883.84
SUNTRUST BANKS INC	1,620	41.41	67,084.20
US BANCORP	5,561	42.44	236,008.84
WELLS FARGO & COMPANY	15,315	54.05	827,775.75
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	173	218.02	37,717.46
ALLY FINANCIAL INC	1,200	20.73	24,876.00
AMERICAN EXPRESS CO	2,894	77.32	223,764.08
AMERIPRISE FINANCIAL INC	573	129.19	74,025.87
BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	3,498	40.50	141,669.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,590	140.70	505,113.00
BLACKROCK INC	411	365.40	150,179.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,728	82.00	141,696.00
CME GROUP INC	994	89.91	89,370.54
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,409	59.08	83,243.72
EATON VANCE CORPORATION	429	42.24	18,120.96
FRANKLIN RESOURCES INC	1,257	51.18	64,333.26
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,218	197.35	240,372.30
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	350	223.67	78,284.50
INVESCO LIMITED	1,339	39.88	53,399.32
LEGG MASON INC	386	53.47	20,639.42
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,100	22.71	24,981.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	844	102.86	86,813.84
MOODY'S CORP	583	104.40	60,865.20

MORGAN STANLEY	4,562	36.75	167,653.50
NASDAQ OMX GROUP INC	439	48.67	21,368.32
NAVIENT CORPORATION	1,408	19.93	28,061.44
NORTHERN TRUST CORP	695	69.83	48,531.85
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	396	56.41	22,338.36
SEI INVESTMENTS COMPANY	487	43.81	21,335.47
STATE STREET CORP	1,297	75.68	98,156.96
SYNCHRONY FINANCIAL	600	30.52	18,312.00
T ROWE PRICE GROUP INC	806	82.42	66,430.52
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	845	36.50	30,842.50
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	3,652	30.25	110,473.00
VOYA FINANCIAL INC	639	42.93	27,432.27
ACE LIMITED	1,031	110.14	113,554.34
AFLAC INC	1,467	63.98	93,858.66
ALLEGHANY CORPORATION	50	476.91	23,845.50
ALLSTATE CORP	1,303	70.87	92,343.61
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	4,350	57.43	249,820.50
AON PLC	842	96.17	80,975.14
ARCH CAPITAL GROUP LTD	401	61.60	24,701.60
ASSURANT INC	218	60.92	13,280.56
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	350	52.77	18,469.50
CHUBB CORP	733	100.33	73,541.89
CINCINNATI FINANCIAL CORP	483	52.56	25,386.48
EVEREST RE GROUP LTD	141	180.99	25,519.59
FNF GROUP	777	36.71	28,523.67
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	1,668	8.02	13,377.36
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,341	41.90	56,187.90
LINCOLN NATIONAL CORP	862	56.79	48,952.98
LOEWS CORPORATION	1,046	41.84	43,764.64
MARSH & MCLENNAN COS	1,681	56.19	94,455.39
METLIFE INC	3,001	50.50	151,550.50
PARTNERRE LTD	137	129.43	17,731.91
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	913	50.77	46,353.01
PROGRESSIVE CORP	1,735	26.75	46,411.25
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,417	79.13	112,127.21
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	120	101.55	12,186.00
TORCHMARK CORPORATION	400	56.49	22,596.00
TRAVELERS COS INC/THE	1,030	105.40	108,562.00
UNUM GROUP	853	33.49	28,566.97
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	495	48.88	24,195.60
WR BERKLEY CORP	400	50.19	20,076.00
XL GROUP PLC	802	37.30	29,914.60

CBRE GROUP INC	1,040	38.42	39,956.80
REALOGY HOLDINGS CORPORATION	500	45.10	22,550.00
ACCENTURE PLC	1,950	92.39	180,160.50
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,710	22.80	38,996.55
ADOBE SYSTEMS INC	1,472	73.15	107,676.80
AKAMAI TECHNOLOGIES	600	71.90	43,140.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	199	294.67	58,639.33
ANSYS INC	286	86.33	24,690.38
AUTODESK INC	706	60.35	42,607.10
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,498	83.53	125,127.94
CA INC	1,037	31.20	32,354.40
CITRIX SYSTEMS INC	500	64.02	32,010.00
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	1,892	60.70	114,844.40
COMPUTER SCIENCES CORP	437	65.60	28,667.20
EBAY INC	3,475	55.79	193,870.25
ELECTRONIC ARTS INC	966	56.03	54,124.98
FACEBOOK INC-A	6,220	80.77	502,420.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	882	63.33	55,857.06
FIREEYE INC	296	40.84	12,088.64
FISERV INC	758	77.43	58,691.94
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	242	156.22	37,805.24
GOOGLE INC-CL A	885	532.74	471,474.90
GOOGLE INC-CL C	896	524.05	469,548.80
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	2,922	160.67	469,477.74
INTUIT INC	843	95.58	80,573.94
LINKEDIN CORPORATION-A	337	253.75	85,513.75
MASTERCARD INC.-CLASS A	3,113	86.93	270,613.09
MICROSOFT CORP	24,335	41.61	1,012,701.02
NETSUITE INC	107	93.23	9,975.61
NUANCE COMMUNICATIONS INC	898	13.87	12,455.26
ORACLE CORPORATION	11,017	43.00	473,731.00
PAYCHEX INC	1,015	48.28	49,004.20
RACKSPACE HOSTING INC	379	52.05	19,726.95
RED HAT INC	584	73.93	43,175.12
SALESFORCE COM INC	1,863	65.81	122,604.03
SERVICENOW INC	460	73.29	33,713.40
SYMANTEC CORP	2,258	24.24	54,733.92
SYNOPSYS INC	484	46.48	22,496.32
TERADATA CORPORATION	567	43.10	24,437.70
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	520	38.11	19,817.20
TWITTER INC	1,183	50.66	59,930.78
VANTIV INC-CLASS A	461	38.49	17,743.89

VERISIGN INC	355	66.05	23,449.52
VISA INC-CLASS A SHARES	6,132	64.52	395,636.64
VMWARE INC-CLASS A	300	85.07	25,521.00
WESTERN UNION COMPANY	1,834	20.63	37,835.42
WORKDAY INC-CLASS A	307	84.37	25,901.59
XEROX CORPORATION	3,370	12.89	43,439.30
YAHOO! INC	2,797	44.45	124,326.65
ZILLOW GROUP INC	152	96.08	14,604.16
AMPHENOL CORPORATION-CL A	962	57.96	55,757.52
APPLE INC	18,226	124.75	2,273,693.50
ARROW ELECTRONICS INC	301	60.75	18,285.75
AVNET INC	500	43.89	21,945.00
CISCO SYSTEMS INC	15,891	27.91	443,597.26
CORNING INC	3,983	22.46	89,458.18
EMC CORP/MASSACHUSETTS	6,324	26.61	168,281.64
F5 NETWORKS INC	229	116.22	26,614.38
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	1,960	12.35	24,206.00
FLIR SYSTEMS INC	473	30.09	14,232.57
HARRIS CORPORATION	325	78.55	25,528.75
HEWLETT-PACKARD COMPANY	5,800	32.53	188,674.00
JUNIPER NETWORKS INC	1,210	23.73	28,713.30
MOTOROLA SOLUTIONS INC	700	60.68	42,476.00
NETAPP INC	969	35.97	34,854.93
PALO ALTO NETWORKS INC	213	142.50	30,352.50
QUALCOMM INC	5,167	67.11	346,783.20
SANDISK CORP	686	67.00	45,965.43
SEAGATE TECHNOLOGY	1,017	57.43	58,406.31
TE CONNECTIVITY LIMITED	1,264	69.78	88,201.92
TRIMBLE NAVIGATION LIMITED	886	25.02	22,167.72
WESTERN DIGITAL CORPORATION	686	99.44	68,215.84
AT&T INC	16,119	32.51	524,028.69
CENTURYLINK INC	1,774	34.68	61,522.32
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	3,419	7.02	24,001.38
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	959	52.12	49,983.08
SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	401	119.75	48,019.75
SPRINT CORPORATION	2,709	5.11	13,842.99
T-MOBILE US INC	750	32.09	24,067.50
VERIZON COMMUNICATIONS INC	12,896	48.90	630,614.40
WINDSTREAM HOLDINGS INC	1,993	7.69	15,326.17
AES CORP	2,257	13.16	29,702.12
ALLIANT ENERGY CORP	369	62.15	22,933.35
AMEREN CORPORATION	754	41.13	31,012.02

AMERICAN ELECTRIC POWER	1,520	55.73	84,709.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	600	53.60	32,160.00
CALPINE CORPORATION	1,200	22.61	27,132.00
CENTERPOINT ENERGY INC	1,381	20.90	28,862.90
CMS ENERGY CORPORATION	858	34.50	29,601.00
CONSOLIDATED EDISON INC	910	60.94	55,455.40
DOMINION RESOURCES INC/VA	1,815	71.47	129,718.05
DTE ENERGY COMPANY	550	80.70	44,385.00
DUKE ENERGY CORPORATION	2,198	77.31	169,927.38
EDISON INTERNATIONAL	962	61.07	58,749.34
ENTERGY CORP	580	77.29	44,828.20
EVERSOURCE ENERGY	984	50.05	49,249.20
EXELON CORP	2,671	32.99	88,116.29
FIRSTENERGY CORP	1,308	35.07	45,871.56
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	248	72.28	17,925.44
MDU RESOURCES GROUP INC	700	22.42	15,694.00
NEXTERA ENERGY INC	1,356	103.15	139,871.40
NISOURCE INC	1,067	43.15	46,041.05
NRG ENERGY INC	1,166	24.96	29,103.36
OGE ENERGY CORPORATION	703	32.67	22,967.01
P G & E CORPORATION	1,476	52.36	77,283.36
PEPCO HOLDINGS INC	783	26.57	20,804.31
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	365	62.65	22,867.25
PPL CORPORATION	2,067	33.29	68,810.43
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	1,573	40.98	64,461.54
SCANA CORPORATION	421	54.05	22,755.05
SEMPRA ENERGY	727	106.67	77,549.09
SOUTHERN CO	2,796	44.11	123,331.56
WISCONSIN ENERGY CORPORATION	701	49.54	34,727.54
XCEL ENERGY INC	1,676	34.37	57,604.12
ALTERA CORPORATION	1,051	44.02	46,265.02
ANALOG DEVICES INC	976	63.42	61,897.92
APPLIED MATERIALS INC	3,786	21.49	81,361.14
AVAGO TECHNOLOGIES LIMITED	786	121.85	95,774.10
BROADCOM CORP-CL A	1,684	43.59	73,405.56
CREE INC	397	35.16	13,958.52
INTEL CORP	15,025	32.47	487,861.75
KLA-TENCOR CORPORATION	575	57.99	33,347.12
LAM RESEARCH CORP	494	70.66	34,906.04
LINEAR TECHNOLOGY CORP	741	46.16	34,208.26
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,274	15.01	19,122.74
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	1,000	34.58	34,580.00

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	700	49.20	34,440.00
	MICRON TECHNOLOGY INC	3,336	28.02	93,474.72
	NVIDIA CORP	1,801	22.20	39,982.20
	QORVO INC	457	70.07	32,021.99
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	592	94.28	55,813.76
	TEXAS INSTRUMENTS INC	3,283	57.33	188,214.39
	XILINX INC	822	43.58	35,826.87
	米ドル 建小計	980,332		59,181,520.55 (7,039,050,054)
カナダドル	ALTAGAS LIMITED	479	41.92	20,079.68
	ARC RESOURCES LIMITED	1,119	25.00	27,975.00
	BAYTEX ENERGY CORPORATION	625	23.13	14,456.25
	CAMECO CORP (CA)	1,372	19.70	27,028.40
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,395	41.25	140,043.75
	CANADIAN OIL SANDS LIMITED	1,728	12.96	22,394.88
	CENOVUS ENERGY INC	2,296	23.07	52,968.72
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,393	32.38	45,105.34
	ENBRIDGE INC	2,585	64.82	167,559.70
	ENCANA CORP	2,496	15.95	39,811.20
	ENERPLUS CORP	653	15.57	10,167.21
	HUSKY ENERGY INC	1,200	27.54	33,048.00
	IMPERIAL OIL LTD	997	54.54	54,376.38
	INTER PIPELINE LIMITED	1,090	31.25	34,062.50
	KEYERA CORP	510	45.43	23,169.30
	MEG ENERGY CORPORATION	585	24.53	14,350.05
	PARAMOUNT RESOURCES LTD	200	37.00	7,400.00
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	1,067	42.20	45,027.40
	PEYTO EXPLORATION & DEVELOPMENT CORP	500	37.07	18,535.00
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	500	33.09	16,545.00
	SUNCOR ENERGY INC	4,427	40.12	177,611.24
	TALISMAN ENERGY INC	3,475	9.61	33,394.75
	TOURMALINE OIL CORPORATION	600	42.40	25,440.00
	TRANSCANADA CORPORATION	2,162	56.42	121,980.04
	VERMILION ENERGY INC	354	58.73	20,790.42
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	731	36.99	27,039.69
	AGRIUM INC	424	130.06	55,145.44
	BARRICK GOLD CORP	3,916	15.62	61,167.92
	ELDORADO GOLD CORPORATION	2,400	6.04	14,496.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	2,000	15.55	31,100.00
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	521	60.09	31,306.89
	GOLDCORP INC	2,534	24.21	61,348.14
	KINROSS GOLD CORP	3,830	2.80	10,724.00

METHANEX CORPORATION	334	67.97	22,701.98
NEW GOLD INC	1,700	4.33	7,361.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	2,594	39.99	103,734.06
SILVER WHEATON CORPORATION	1,209	23.79	28,762.11
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	1,897	16.50	31,300.50
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	2,700	4.93	13,311.00
WEST FRASER TIMBER CO LIMITED	200	60.81	12,162.00
YAMANA GOLD INC	3,000	4.92	14,760.00
BOMBARDIER INC 'B'	4,812	2.67	12,848.04
CAE INC	904	14.60	13,198.40
FINNING INTERNATIONAL INC	637	24.70	15,733.90
SNC-LAVALIN GROUP INC	441	43.73	19,284.93
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,506	81.20	203,487.20
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	541	232.13	125,582.33
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,210	65.58	79,351.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	642	38.84	24,935.28
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	600	47.10	28,260.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,191	27.39	32,621.49
THOMSON REUTERS CORP(CA)	1,233	50.40	62,143.20
CANADIAN TIRE CORP -CL A	226	132.02	29,836.52
DOLLARAMA INC	400	70.78	28,312.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,415	48.94	69,250.10
EMPIRE COMPANY LIMITED A	150	90.05	13,507.50
GEORGE WESTON LIMITED	200	103.87	20,774.00
JEAN COUTU GROUP INC A	300	25.60	7,680.00
LOBLAW COMPANIES LTD	713	63.09	44,983.17
METRO INC	813	36.15	29,389.95
SAPUTO INC	900	35.54	31,986.00
CATAMARAN CORPORATION	635	72.45	46,005.75
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	984	251.15	247,131.60
BANK OF MONTREAL	2,007	79.33	159,215.31
BANK OF NOVA SCOTIA	3,793	65.88	249,882.84
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,192	95.99	114,420.08
NATIONAL BANK OF CANADA	1,100	48.87	53,757.00
ROYAL BANK OF CANADA	4,433	80.76	358,009.08
TORONTO-DOMINION BANK(CA)	5,662	55.75	315,656.50
CI FINANCIAL CORPORATION	783	35.42	27,733.86
IGM FINANCIAL INC	393	45.05	17,704.65
ONEX CORPORATION	300	72.07	21,621.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	88	665.49	58,563.12
GREAT-WEST LIFECO INC	1,000	36.90	36,900.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	442	44.40	19,624.80

	INTACT FINANCIAL CORPORATION	400	93.75	37,500.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	6,160	22.00	135,520.00
	POWER CORP OF CANADA	1,129	33.52	37,844.08
	POWER FINANCIAL CORP	873	37.34	32,597.82
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,850	39.16	72,446.00
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,735	70.15	121,710.25
	FIRST CAPITAL REALTY INC	400	19.89	7,956.00
	CGI GROUP INC -CL A	677	55.16	37,343.32
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	100	491.30	49,130.00
	OPEN TEXT CORPORATION	389	70.00	27,230.00
	BLACKBERRY LIMITED	1,700	12.10	20,570.00
	BCE INC	436	53.97	23,530.92
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,183	41.54	49,141.82
	TELUS CORPORATION	744	42.07	31,300.08
	ATCO LIMITED	294	46.48	13,665.12
	CANADIAN UTILITIES LTD A	328	40.00	13,120.00
	FORTIS INC	800	39.27	31,416.00
	TRANSALTA CORP	881	12.15	10,704.15
	カナダドル 建小計	128,523		5,091,857.90 (496,659,819)
ユーロ	ENI SPA	7,901	16.86	133,210.86
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,261	12.00	15,132.00
	KONINKLIJKE VOPAK NV	230	50.61	11,640.30
	NESTE OIL OYJ	420	24.79	10,411.80
	OMV AG	482	28.00	13,496.00
	REPSOL SA	3,310	18.10	59,927.55
	SAIPEM	866	11.67	10,106.22
	TECHNIP S.A.	335	64.31	21,543.85
	TENARIS SA	1,544	14.60	22,542.40
	TOTAL SA	6,648	48.87	324,887.76
	AIR LIQUIDE SA	1,070	119.85	128,239.50
	AKZO NOBEL	794	70.67	56,111.98
	ARCELORMITTAL	3,266	8.91	29,100.06
	ARKEMA	214	71.23	15,243.22
	BASF SE	2,853	89.18	254,430.54
	CRH PLC(IE)	2,530	25.43	64,350.55
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	228	38.06	8,678.82
	HEIDELBERGCEMENT AG	461	72.53	33,436.33
	IMERYS SA	113	70.99	8,021.87
	K+S AG	564	30.75	17,345.82
	KONINKLIJKE DSM NV	564	51.26	28,910.64
	LAFARGE SA	611	64.21	39,232.31

LANXESS AG	300	48.87	14,661.00
LINDE AG	577	183.35	105,792.95
SOLVAY SA	194	134.05	26,005.70
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	1,799	10.53	18,943.47
SYMRISE AG	404	57.29	23,145.16
THYSSENKRUPP AG	1,480	24.32	35,993.60
UMICORE	353	41.16	14,531.24
UPM-KYMMENE OYJ	1,740	18.47	32,137.80
VOESTALPINE AG	367	36.99	13,577.16
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	573	31.75	18,195.61
AIRBUS GROUP NV	1,828	62.18	113,665.04
ALSTOM	708	29.01	20,539.08
ANDRITZ AG	238	55.60	13,232.80
BOSKALIS WESTMINSTER NV	282	46.76	13,186.32
BOUYGUES SA	549	37.00	20,313.00
BRENTAG AG	505	55.68	28,118.40
CNH INDUSTRIAL NV	3,097	8.04	24,915.36
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,396	40.61	56,691.56
FERROVIAL SA	1,362	20.18	27,485.16
FINMECCANICA SPA	1,323	11.36	15,029.28
GEA GROUP AG	598	44.09	26,368.81
KONE OYJ-B	1,023	42.08	43,047.84
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,903	26.45	76,784.35
LEGRAND SA	866	50.88	44,062.08
MAN SE	116	98.27	11,399.32
METSO OYJ	369	27.40	10,110.60
OSRAM LICHT AG	291	46.77	13,610.07
PRYSMIAN SPA	667	18.39	12,266.13
REXEL SA	912	16.63	15,166.56
SAFRAN SA	886	67.21	59,548.06
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,631	69.62	113,550.22
SIEMENS AG-REG	2,463	98.95	243,713.85
THALES SA	305	53.73	16,387.65
VALLOUREC SA	358	24.87	8,903.46
VINCI SA	1,466	55.80	81,802.80
WARTSILA OYJ-B SHARES	484	42.63	20,632.92
ZARDOYA OTIS SA	569	11.87	6,754.03
ZODIAC AEROSPACE	608	30.00	18,240.00
BUREAU VERITAS SA	723	20.80	15,038.40
EDENRED	674	24.53	16,533.22
RANDSTAD HOLDING NV	413	54.70	22,591.10
SOCIETE BIC SA	94	139.15	13,080.10

ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,322	16.42	21,713.85
AENA SA	186	90.50	16,833.00
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	98	112.10	10,985.80
ATLANTIA SPA	1,350	24.72	33,372.00
BOLLORE	1,800	4.89	8,803.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	689	12.20	8,405.80
DEUTSCHE POST AG-REG	3,006	29.50	88,677.00
FRAPORT AG	121	56.05	6,782.05
GROUPE EUROTUNNEL SE	1,528	13.87	21,193.36
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	2,534	7.83	19,851.35
TNT EXPRESS NV	1,434	7.58	10,871.15
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,028	110.40	113,491.20
BMW-PFD	178	85.10	15,147.80
CONTINENTAL AG	342	220.45	75,393.90
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	2,990	84.81	253,581.90
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	2,863	14.94	42,773.22
MICHELIN (CGDE)-B	610	95.87	58,480.70
NOKIAN RENKAAT OYJ	371	28.39	10,532.69
PEUGEOT SA	1,280	16.45	21,056.00
PIRELLI & C SPA	778	15.36	11,950.08
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	501	88.72	44,448.72
RENAULT SA	629	90.41	56,867.89
VALEO SA	247	141.65	34,987.55
VOLKSWAGEN AG	97	228.60	22,174.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	505	235.00	118,675.00
ADIDAS AG	684	73.35	50,171.40
CHRISTIAN DIOR SE	179	179.10	32,058.90
HERMES INTERNATIONAL	82	335.10	27,478.20
HUGO BOSS AG-ORD	175	116.40	20,370.00
KERING	248	175.35	43,486.80
LUXOTTICA GROUP SPA	550	59.15	32,532.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	867	165.45	143,445.15
ACCOR SA	565	49.39	27,908.17
SODEXO	309	91.38	28,236.42
ALTICE SA	284	100.65	28,584.60
AXEL SPRINGER SE	130	53.81	6,995.30
EUTELSAT COMMUNICATIONS	504	31.58	15,916.32
JC DECAUX SA	220	32.49	7,148.90
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	73	121.80	8,891.40
LAGARDERE S.C.A.	386	28.58	11,031.88
NUMERICABLE GROUP	302	49.84	15,051.68
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	716	46.19	33,072.04

PUBLICIS GROUPE	610	72.81	44,414.10
REED ELSEVIER NV(NL)	2,287	22.88	52,326.56
RTL GROUP SA	127	91.49	11,619.23
SES	994	34.04	33,835.76
TELENET GROUP HOLDING NV	172	52.49	9,028.28
VIVENDI	3,769	23.43	88,307.67
WOLTERS KLUWER NV-CVA	987	30.58	30,182.46
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	3,388	29.42	99,691.90
CARREFOUR SA	2,042	32.01	65,374.63
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	185	81.15	15,012.75
COLRUYT SA	230	43.35	9,971.65
DELHAIZE GROUP	336	83.08	27,914.88
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	2,022	7.19	14,556.37
JERONIMO MARTINS SGPS SA	823	11.80	9,711.40
KONINKLIJKE AHOLD NV	2,924	18.49	54,064.76
METRO AG	530	33.31	17,654.30
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	2,497	114.25	285,282.25
DANONE	1,800	66.08	118,944.00
HEINEKEN HOLDING NV	330	66.65	21,994.50
HEINEKEN NV	754	73.19	55,185.26
KERRY GROUP PLC-A	491	68.25	33,510.75
PERNOD-RICARD SA	659	112.50	74,137.50
REMY COINTREAU SA	80	72.06	5,764.80
UNILEVER NV-CVA	5,059	41.26	208,734.34
BEIERSDORF AG	330	80.82	26,670.60
HENKEL AG & CO KGAA	383	94.33	36,128.39
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	583	108.10	63,022.30
L'OREAL	781	176.30	137,690.30
CELESIO AG	167	27.05	4,517.35
ESSILOR INTERNATIONAL SA	668	109.25	72,979.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	710	77.60	55,096.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,238	54.04	66,901.52
BAYER AG	2,568	133.50	342,828.00
GRIFOLS SA	488	40.43	19,729.84
MERCK KGAA	423	104.90	44,372.70
ORION OYJ-CLASS B	327	27.25	8,910.75
QIAGEN NV	761	23.19	17,647.59
SANOFI	3,709	95.65	354,765.85
UCB SA	414	68.97	28,553.58
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	14,215	0.57	8,187.84
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	19,403	9.19	178,488.19
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-R	115,136	0.08	9,302.98

BANCO DE SABADELL SA	11,150	2.23	24,920.25
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.00	0.00
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	1,184	13.56	16,055.04
BANCO POPULAR ESPANOL SA	5,839	4.48	26,182.07
BANCO SANTANDER SA	43,725	6.55	286,704.82
BANK OF IRELAND	85,435	0.35	30,243.99
BANKIA SA	15,058	1.22	18,461.10
BANKINTER SA	2,204	6.92	15,258.29
BNP PARIBAS	3,290	55.11	181,311.90
CAIXABANK	7,399	4.24	31,438.35
COMMERZBANK AG	3,163	12.26	38,778.38
CREDIT AGRICOLE SA	3,369	13.40	45,144.60
ERSTE GROUP BANK AG	914	23.83	21,780.62
ING GROEP NV-CVA	11,984	13.45	161,184.80
INTESA SANPAOLO	39,371	2.98	117,483.06
INTESA SANPAOLO-RSP	3,048	2.75	8,388.09
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
KBC GROEP NV	819	57.02	46,699.38
NATIXIS SA	3,056	7.16	21,905.40
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	384	14.81	5,687.04
SOCIETE GENERALE	2,251	44.83	100,912.33
UNICREDIT SPA	13,657	5.99	81,805.43
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	2,800	7.07	19,810.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,284	30.70	131,518.80
DEUTSCHE BOERSE AG	631	75.91	47,899.21
EURAZEO	125	63.85	7,981.25
EXOR SPA	322	42.35	13,636.70
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	264	78.56	20,739.84
MEDIOBANCA SPA	1,972	8.53	16,821.16
WENDEL	104	110.75	11,518.00
AEGON NV	5,962	7.29	43,510.67
AGEAS	718	33.74	24,225.32
ALLIANZ SE-REG	1,419	161.25	228,813.75
ASSICURAZIONI GENERALI	3,817	17.77	67,828.09
AXA	5,643	23.43	132,243.70
CNP ASSURANCES	562	16.74	9,410.69
DELTA LLOYD NV	652	17.94	11,696.88
HANNOVER RUECK SE	198	98.17	19,437.66
MAPFRE SA	3,020	3.51	10,600.20
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	537	195.70	105,090.90
NN GROUP NV	401	26.09	10,464.09
SAMPO OYJ-A SHS	1,462	45.51	66,535.62

SCOR SE	502	32.50	16,315.00
UNIPOLSAI SPA	2,976	2.64	7,880.44
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG	126	40.74	5,133.87
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN SE	1,071	31.15	33,361.65
DEUTSCHE WOHNEN AG	936	24.21	22,665.24
IMMOFINANZ AG	3,137	2.75	8,636.16
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	1,390	39.88	55,440.15
ATOS	264	67.20	17,740.80
CAP GEMINI SA	468	77.09	36,078.12
DASSAULT SYSTEMES SA	418	62.35	26,062.30
GEMALTO NV	259	80.40	20,823.60
SAP SE	2,862	66.61	190,637.82
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	403	41.37	16,672.11
ALCATEL-LUCENT	9,198	3.70	34,041.79
NOKIA OYJ	11,631	7.15	83,161.65
BELGACOM SA	498	33.37	16,618.26
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	9,860	16.32	160,964.50
ELISA OYJ	465	25.69	11,945.85
ILIAD SA	86	216.05	18,580.30
KONINKLIJKE KPN NV	10,468	3.16	33,173.09
ORANGE	5,759	15.40	88,717.39
TELECOM ITALIA SPA	33,022	1.08	35,663.76
TELECOM ITALIA-RSP	19,696	0.87	17,184.76
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,945	5.25	10,222.92
TELEFONICA SA	13,084	13.47	176,306.90
E.ON SE	6,215	14.45	89,837.82
ELECTRICITE DE FRANCE	791	22.92	18,129.72
ENAGAS SA	664	27.96	18,565.44
ENDESA SA	986	18.69	18,433.27
ENEL GREEN POWER SPA	5,720	1.76	10,072.92
ENEL SPA	20,443	4.26	87,168.95
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	7,570	3.59	27,244.43
FORTUM OYJ	1,452	18.67	27,108.84
GAS NATURAL SDG SA	1,145	21.83	24,995.35
GDF SUEZ	4,496	19.31	86,840.24
IBERDROLA SA	16,492	6.00	98,984.98
RED ELECTRICA CORPORACION SA	354	78.00	27,612.00
RWE AG	1,600	24.24	38,784.00
SNAM SPA	6,632	4.73	31,395.88
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	972	17.13	16,650.36
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	4,928	4.18	20,599.04
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,379	18.99	26,187.21

	ASML HOLDING NV	1,087	88.22	95,895.14
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,686	11.23	41,412.21
	STMICROELECTRONICS NV	2,084	8.50	17,732.75
	ユーロ 建小計	829,965		11,602,000.64 (1,491,437,182)
英ボンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	1,278	9.39	12,006.81
	BG GROUP PLC	10,601	11.92	126,416.92
	BP PLC	56,647	4.79	271,537.39
	PETROFAC LIMITED	856	10.14	8,679.84
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	12,143	20.89	253,667.27
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	7,579	21.20	160,712.69
	TULLOW OIL PLC	3,003	3.98	11,951.94
	ANGLO AMERICAN PLC	4,338	10.10	43,835.49
	ANTOFAGASTA PLC	1,301	7.32	9,523.32
	BHP BILLITON PLC(UK)	6,559	14.46	94,843.14
	CRODA INTERNATIONAL PLC	448	28.48	12,759.04
	FRESNILLO PLC	729	7.28	5,310.76
	GLENCORE PLC	32,715	2.98	97,670.63
	JOHNSON MATTHEY PLC	676	34.30	23,186.80
	RANDGOLD RESOURCES LIMITED	291	50.45	14,680.95
	REXAM PLC	2,322	5.80	13,467.60
	RIO TINTO PLC(UK)	3,952	28.01	110,695.52
	ASHTED GROUP PLC	1,660	11.12	18,459.20
	BAE SYSTEMS PLC	9,795	5.13	50,248.35
	BUNZL PLC	1,103	18.46	20,361.38
	COBHAM PLC	3,755	2.99	11,238.71
	IMI PLC	896	12.50	11,200.00
	MEGGITT PLC	2,657	5.40	14,361.08
	MELROSE INDUSTRIES PLC	3,281	2.71	8,898.07
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	5,859	9.78	57,330.31
	SMITHS GROUP PLC	1,301	11.15	14,506.15
	THE WEIR GROUP PLC	704	18.72	13,178.88
	TRAVIS PERKINS PLC	815	19.76	16,104.40
	WOLSELEY PLC	810	40.49	32,796.90
	AGGREKO PLC	845	16.00	13,520.00
	BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	828	10.33	8,553.24
	CAPITA PLC	2,180	11.21	24,437.80
	EXPERIAN PLC	3,267	11.81	38,583.27
	G4S PLC	5,117	2.98	15,258.89
	INTERTEK GROUP PLC	533	26.19	13,959.27
	ROYAL MAIL PLC	2,144	4.45	9,553.66
	GKN PLC	5,413	3.61	19,557.16

BURBERRY GROUP PLC	1,464	17.94	26,264.16
PERSIMMON PLC	1,009	17.33	17,485.97
CARNIVAL PLC(UK)	606	32.17	19,495.02
COMPASS GROUP PLC	5,180	11.62	60,191.60
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	779	27.22	21,204.38
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	1,672	4.47	7,477.18
TUI AG	1,406	11.96	16,815.76
WHITBREAD PLC	599	52.40	31,387.60
WILLIAM HILL PLC	2,886	3.71	10,721.49
ITV PLC	12,630	2.64	33,343.20
PEARSON PLC	2,703	13.55	36,625.65
REED ELSEVIER PLC(UK)	3,528	11.30	39,866.40
SKY PLC	3,405	10.52	35,820.60
WPP PLC	4,087	15.43	63,062.41
DIXONS CARPHONE PLC	3,226	4.41	14,236.33
KINGFISHER PLC	7,810	3.54	27,686.45
MARKS & SPENCER GROUP PLC	5,392	5.64	30,410.88
NEXT PLC	506	72.20	36,533.20
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	889	6.57	5,840.73
SAINSBURY (J) PLC	4,101	2.75	11,285.95
TESCO PLC	25,227	2.36	59,712.30
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	6,930	1.97	13,700.61
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,175	29.06	34,145.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	5,789	37.24	215,582.36
COCA-COLA HBC AG-CDI	661	13.58	8,976.38
DIAGEO PLC	7,807	18.76	146,498.35
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	2,972	32.31	96,025.32
SABMILLER PLC	3,006	36.23	108,922.41
TATE & LYLE PLC	1,542	6.53	10,069.26
UNILEVER PLC	3,986	29.92	119,261.12
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,008	59.40	119,275.20
SMITH & NEPHEW PLC	2,945	11.36	33,455.20
ASTRAZENECA PLC	3,922	47.50	186,295.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	15,096	15.75	237,837.48
SHIRE PLC	1,831	54.30	99,423.30
BARCLAYS PLC	51,101	2.55	130,460.85
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	59,600	6.00	357,600.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	177,327	0.78	139,645.01
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	8,338	3.49	29,116.29
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	7,678	10.50	80,619.00
3I GROUP PLC	3,206	4.95	15,872.90
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	3,034	4.80	14,587.47

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	782	12.09	9,454.38
	ICAP PLC	1,818	5.41	9,835.38
	INVESTEC PLC	1,821	5.91	10,762.11
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	744	24.91	18,533.04
	SCHRODERS PLC	410	32.59	13,361.90
	ADMIRAL GROUP PLC	639	15.91	10,166.49
	AVIVA PLC	12,615	5.43	68,499.45
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	4,946	3.24	16,049.77
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	18,451	2.78	51,312.23
	OLD MUTUAL PLC	16,176	2.36	38,240.06
	PRUDENTIAL PLC	7,971	16.36	130,445.41
	RSA INSURANCE GROUP PLC	3,344	4.25	14,232.06
	STANDARD LIFE PLC	6,452	4.61	29,769.52
	SAGE GROUP PLC (THE)	3,578	4.69	16,791.55
	BT GROUP PLC	25,290	4.50	113,805.00
	INMARSAT PLC	1,405	9.51	13,368.57
	VODAFONE GROUP PLC	82,326	2.26	186,386.06
	CENTRICA PLC	15,436	2.60	40,149.03
	NATIONAL GRID PLC	11,690	8.87	103,760.44
	SEVERN TRENT PLC	790	21.34	16,858.60
	SSE PLC	3,215	15.59	50,121.85
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,249	9.59	21,579.15
	ARM HOLDINGS PLC	4,359	11.27	49,125.93
	英ボンド 建小計	883,967		5,518,497.08 (983,065,069)
スイスフラン	TRANSOCEAN LIMITED(CHF)	1,183	17.44	20,631.52
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	27	388.75	10,496.25
	GIVAUDAN-REG	34	1,751.00	59,534.00
	HOLCIM LTD-REG	833	74.10	61,725.30
	SIKA AG-BR	8	3,347.00	26,776.00
	SYNGENTA AG(CH)	324	328.10	106,304.40
	ABB LIMITED-REG	7,654	20.79	159,126.66
	GEBERIT AG-REG	138	359.80	49,652.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	67	156.90	10,512.30
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	146	159.20	23,243.20
	SULZER AG-REG	79	107.50	8,492.50
	ADECCO SA-REG	619	78.20	48,405.80
	SGS SA-REG	18	1,837.00	33,066.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	177	140.50	24,868.50
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	1,817	82.05	149,084.85
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	163	84.50	13,773.50
	THE SWATCH GROUP AG-B	113	432.50	48,872.50

	ARYZTA AG	285	64.75	18,453.75	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	8	1,144.00	9,152.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	3	5,210.00	15,630.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	11,225	75.95	852,538.75	
	SONOVA HOLDING AG-REG	176	132.80	23,372.80	
	ACTELION LTD-REG	374	115.10	43,047.40	
	LONZA GROUP AG-REG	173	125.00	21,625.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	8,007	97.20	778,280.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,445	270.20	660,639.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5,315	26.61	141,432.15	
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	814	50.10	40,781.40	
	PARGESA HOLDING SA-BR	101	67.10	6,777.10	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	57	289.25	16,487.25	
	UBS GROUP AG	12,712	18.85	239,621.20	
	BALOISE HOLDING AG-REG	156	126.30	19,702.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	105	241.00	25,305.00	
	SWISS RE LIMITED	1,225	94.25	115,456.25	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	521	301.60	157,133.60	
	SWISS PRIME SITE AG-REG	188	82.30	15,472.40	
	SWISSCOM AG-REG	86	541.00	46,526.00	
	スイスフラン 建小計	57,376		4,101,999.93 (512,708,971)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	714	136.30	97,318.20	
	BOLIDEN AB	897	184.50	165,496.50	
	ALFA LAVAL AB	1,032	168.40	173,788.80	
	ASSA ABLOY AB-B	1,096	519.50	569,372.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,201	282.20	621,122.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,279	254.60	325,633.40	
	SANDVIK AB	3,495	94.10	328,879.50	
	SKANSKA AB-B SHS	1,246	185.50	231,133.00	
	SKF AB-B SHARES	1,299	207.00	268,893.00	
	VOLVO AB-B SHS	5,030	97.45	490,173.50	
	SECURITAS AB-B SHS	1,027	127.50	130,942.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	789	228.00	179,892.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,338	58.50	78,273.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,948	349.00	1,028,852.00	
	ICA GRUPPEN AB	254	303.70	77,139.80	
	SWEDISH MATCH AB	658	262.90	172,988.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	1,927	207.00	398,889.00	
	ELEKTA AB-B SHS	1,209	83.80	101,314.20	
	GETINGE AB-B SHS	656	229.00	150,224.00	
	NORDEA BANK AB	9,430	106.90	1,008,067.00	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	4,979	100.70	501,385.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,636	375.10	613,663.60	
	SWEDBANK AB-A SHARES	2,969	199.20	591,424.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	537	163.10	87,584.70	
	INVESTOR AB-B SHS	1,493	343.30	512,546.90	
	KINNEVIK INVESTMENT AB	772	288.70	222,876.40	
	ERICSSON LM-B SHS	9,448	107.10	1,011,880.80	
	HEXAGON AB-B SHS	837	318.80	266,835.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	217	619.00	134,323.00	
	TELE2 AB-B SHS	1,047	104.50	109,411.50	
	TELIASONERA AB	7,806	50.60	394,983.60	
	スウェーデンクローナ 建小計	70,266		11,045,308.00 (152,093,891)	
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LIMITED	1,298	95.70	124,218.60	
	STATOIL ASA	3,673	156.30	574,089.90	
	SUBSEA 7 SA	927	83.50	77,404.50	
	NORSK HYDRO ASA	4,426	42.79	189,388.54	
	YARA INTERNATIONAL ASA	591	416.30	246,033.30	
	ORKLA ASA	2,683	61.35	164,602.05	
	DNB ASA	3,216	135.10	434,481.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	659	141.40	93,182.60	
	TELENOR ASA	2,471	167.80	414,633.80	
	ノルウェークローネ 建小計	19,944		2,318,034.89 (35,164,589)	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	783	329.90	258,311.70	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	733	303.50	222,465.50	
	ISS A/S	304	223.00	67,792.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	13	13,390.00	174,070.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	22	13,800.00	303,600.00	
	DSV A/S	579	225.10	130,332.90	
	PANDORA A/S	377	662.50	249,762.50	
	CARLSBERG AS-B	350	601.00	210,350.00	
	COLOPLAST A/S	364	556.00	202,384.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	75	570.50	42,787.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	6,232	376.90	2,348,840.80	
	DANSKE BANK A/S	2,144	187.20	401,356.80	
	TRYG A/S	69	775.50	53,509.50	
	TDC A/S	2,655	51.95	137,927.25	
	デンマーククローネ 建小計	14,700		4,803,490.45 (82,812,175)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	445	34.93	15,543.85	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	3,633	12.54	45,557.82	
	SANTOS LTD	3,221	7.96	25,639.16	

WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,292	35.42	81,182.64
WORLEYPARSONS LIMITED	691	10.96	7,573.36
ALUMINA LIMITED	8,314	1.63	13,551.82
AMCOR LTD	3,973	14.40	57,211.20
BHP BILLITON LIMITED(AU)	9,929	29.97	297,572.13
BORAL LIMITED	2,577	6.49	16,724.73
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	5,125	1.87	9,583.75
ILUKA RESOURCES LIMITED	1,379	7.62	10,507.98
INCITEC PIVOT LIMITED	5,448	4.13	22,500.24
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,465	15.89	23,278.85
NEWCREST MINING LIMITED	2,524	14.18	35,790.32
ORICA LTD	1,227	20.46	25,104.42
RIO TINTO LIMITED(AU)	1,347	55.09	74,206.23
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	335	20.75	6,951.25
ALS LIMITED	1,310	4.67	6,117.70
BRAMBLES LTD	5,147	11.57	59,550.79
SEEK LIMITED	1,065	16.79	17,881.35
ASCIANO LIMITED	3,211	6.46	20,743.06
AURIZON HOLDINGS LIMITED	7,036	4.67	32,858.12
QANTAS AIRWAYS LTD	1,808	3.31	5,984.48
SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	3,575	5.37	19,197.75
TOLL HOLDINGS LIMITED	2,244	8.98	20,151.12
TRANSURBAN GROUP	5,962	9.77	58,248.74
CROWN RESORTS LIMITED	1,199	13.24	15,874.76
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	183	40.50	7,411.50
TABCORP HOLDINGS LIMITED	2,512	4.71	11,831.52
TATTS GROUP LTD	4,723	4.00	18,892.00
REA GROUP LIMITED	174	47.61	8,284.14
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,749	4.32	7,555.68
WESFARMERS LIMITED	3,473	43.00	149,339.00
WOOLWORTHS LIMITED	3,905	28.53	111,409.65
COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,886	10.65	20,085.90
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	2,144	5.64	12,092.16
COCHLEAR LIMITED	188	88.75	16,685.00
HEALTHSCOPE LTD	3,707	2.93	10,861.51
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	433	65.63	28,417.79
SONIC HEALTHCARE LTD	1,254	20.58	25,807.32
CSL LIMITED	1,468	94.06	138,080.08
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	8,522	35.60	303,383.20
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	1,194	13.52	16,142.88
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	1,477	12.35	18,240.95
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	5,012	92.08	461,504.96

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	7,315	38.72	283,236.80	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	9,611	38.90	373,867.90	
	ASX LTD	638	42.38	27,038.44	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	952	81.21	77,311.92	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT LIMITED	720	7.91	5,695.20	
	AMP LIMITED	9,737	6.66	64,848.42	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	7,709	6.04	46,562.36	
	MEDIBANK PRIVATE LIMITED	8,514	2.32	19,752.48	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	4,418	13.67	60,394.06	
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,236	13.93	59,007.48	
	LEND LEASE GROUP	1,806	17.04	30,774.24	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,557	12.62	19,649.34	
	TELSTRA CORPORATION	13,228	6.14	81,219.92	
	TPG TELECOM LIMITED	915	9.38	8,582.70	
	AGL ENERGY LIMITED	2,081	14.98	31,173.38	
	APA GROUP	3,445	9.18	31,625.10	
	AUSNET SERVICES	5,638	1.51	8,513.38	
	オーストラリアドル 建小計	213,006		3,620,365.98 (336,730,239)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	2,266	8.35	18,921.10	
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	3,137	4.64	14,555.68	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	1,235	8.35	10,312.25	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	6,022	2.89	17,403.58	
	CONTACT ENERGY LIMITED	1,208	5.86	7,078.88	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,134	1.97	8,164.65	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	2,306	3.01	6,941.06	
	ニュージーランドドル 建小計	20,308		83,377.20 (7,649,024)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	6,629	111.80	741,122.20	
	NWS HOLDINGS LIMITED	4,500	13.28	59,760.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	4,000	19.58	78,320.00	
	MTR CORPORATION	4,903	38.55	189,010.65	
	LI & FUNG LIMITED	20,000	8.03	160,600.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED	4,773	26.70	127,439.10	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	2,338	28.65	66,983.70	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	7,537	38.55	290,551.35	
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	3,355	15.04	50,459.20	
	SANDS CHINA LIMITED	8,174	34.00	277,916.00	
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	3,813	11.40	43,468.20	
	SJM HOLDINGS LIMITED	7,000	10.28	71,960.00	
	WYNN MACAU LIMITED	5,099	17.72	90,354.28	
	WH GROUP LTD	12,500	5.26	65,750.00	

	BANK OF EAST ASIA	4,467	33.25	148,527.75	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	12,684	29.85	378,617.40	
	HANG SENG BANK LTD	2,600	145.00	377,000.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	8,000	7.62	60,960.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	3,466	283.60	982,957.60	
	AIA GROUP LIMITED	37,351	53.25	1,988,940.75	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	4,000	164.50	658,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	7,864	23.60	185,590.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	2,950	59.20	174,640.00	
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	2,000	34.90	69,800.00	
	KERRY PROPERTIES LIMITED	2,452	30.50	74,786.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	17,562	9.66	169,648.92	
	SINO LAND CO	10,576	13.30	140,660.80	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	5,000	125.80	629,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,000	105.40	210,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	4,032	24.20	97,574.40	
	WHARF HOLDINGS LTD	5,000	55.85	279,250.00	
	WHELOCK AND COMPANY LTD	3,000	41.50	124,500.00	
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	9,080	10.34	93,887.20	
	PCCW LIMITED	13,884	5.05	70,114.20	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	2,000	65.20	130,400.00	
	CLP HOLDINGS LTD	5,735	67.90	389,406.50	
	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	20,688	18.80	388,934.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	4,067	78.25	318,242.75	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	800	79.90	63,920.00	
	香港ドル 建小計	285,879		10,519,853.75 (161,479,755)	
シンガポールドル	KEPPEL CORPORATION LIMITED	4,900	9.25	45,325.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	14,636	0.88	12,952.86	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	4,000	4.71	18,840.00	
	SEMBCORP MARINE LIMITED	2,987	3.08	9,199.96	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	6,000	3.81	22,860.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	7,069	1.41	9,967.29	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	7,000	3.00	21,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,000	11.94	23,880.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	21,000	1.03	21,735.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	6,000	4.13	24,780.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	300	42.48	12,744.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	24,000	0.44	10,560.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	7,000	3.26	22,820.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,400	21.19	114,426.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,300	10.89	101,277.00	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	4,000	24.11	96,440.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	3,000	8.26	24,780.00	
	CAPITALAND LTD	9,000	3.68	33,120.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,300	10.63	13,819.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	11,000	2.69	29,590.00	
	UOL GROUP LIMITED	2,000	7.98	15,960.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	24,700	4.46	110,162.00	
	STARHUB LIMITED	2,000	4.40	8,800.00	
	シンガポールドル 建小計	178,592		805,038.11 (71,294,175)	
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LIMITED	16	1,091.00	17,456.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	1,458	27.80	40,532.40	
	THE ISRAEL CORPORATION LIMITED	9	1,440.00	12,960.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	2,680	249.50	668,660.00	
	BANK HAPOLIM BM	3,465	19.44	67,359.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,349	14.70	63,930.30	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	454	41.95	19,045.30	
	NICE SYSTEMS LIMITED	187	229.90	42,991.30	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	6,284	7.71	48,449.64	
	イスラエルシュケル 建小計	18,902		981,384.54 (29,804,648)	
	合 計	3,701,760		11,399,949,591 (11,399,949,591)	

(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	19,000	13,205.00	
		投資信託受益証券 小計	19,000	13,205.00 (1,570,602)	
	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORPORATION	1,222	26,395.20	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	2,950	27,730.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	1,232	118,395.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	3,206	32,989.74	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	410	69,007.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	476	65,021.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	300	22,791.00	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	1,037	89,016.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	421	27,495.51	
		DUKE REALTY CORP	1,175	24,064.00	

		EQUINIX INC	171	40,379.94
		EQUITY RESIDENTIAL	1,070	80,592.40
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	199	44,269.54
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	212	29,472.24
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	1,768	50,494.08
		HCP INC	1,427	61,674.94
		HEALTH CARE REIT INC	1,052	79,173.52
		HOST HOTELS & RESORTS	2,480	51,088.00
		IRON MOUNTAIN INC	512	18,882.56
		KIMCO REALTY CORP	1,392	35,217.60
		LIBERTY PROPERTY TRUST	500	17,525.00
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	600	25,362.00
		PROLOGIS INC	1,554	66,635.52
		PUBLIC STORAGE	456	86,671.92
		RAYONIER INC	533	14,044.55
		REALTY INCOME CORP	692	34,087.92
		REGENCY CENTERS CORPORATION	290	18,939.90
		SIMON PROPERTY GROUP	966	181,859.16
		SL GREEN REALTY CORPORATION	300	38,004.00
		THE MACERICH COMPANY	469	38,701.88
		UDR INC	900	29,322.00
		VENTAS INC	1,040	75,826.40
		VORNADO REALTY TRUST	525	56,169.75
		WEYERHAEUSER COMPANY	1,630	51,426.50
		投資証券 小計	33,167	1,728,726.75 (205,614,759)
米ドル建小計			52,167	1,741,931.75 (207,185,361)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	500	11,840.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	497	14,621.74
カナダドル建小計			997	26,461.74 (2,581,078)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	93	8,907.54
		GECINA SA	93	11,885.40
		ICADE	121	9,636.44
		KLEPIERRE	537	23,950.20
		UNIBAIL-RODAMCO SE	304	75,969.60
ユーロ建小計			1,148	130,349.18 (16,756,387)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	3,185	26,976.95
		HAMMERSON PLC	2,587	17,410.51
		INTU PROPERTIES PLC	3,027	10,570.28
		LAND SECURITIES GROUP PLC	2,607	33,030.69

		SEGRO PLC	2,448	10,514.16	
英ポンド建小計			13,854	98,502.59 (17,547,251)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	2,981	22,506.55	
		FEDERATION CENTRES	4,700	14,194.00	
		GOODMAN GROUP	5,746	36,257.26	
		GPT GROUP	5,549	25,580.89	
		MIRVAC GROUP	12,171	24,281.14	
		NOVION PROPERTY GROUP	7,029	17,713.08	
		SCENTRE GROUP	17,527	65,726.25	
		STOCKLAND	7,732	34,794.00	
		WESTFIELD CORPORATION	6,499	62,975.31	
オーストラリアドル建小計			69,934	304,028.48 (28,277,688)	
香港ドル	投資証券	THE LINK REIT	7,107	334,384.35	
香港ドル建小計			7,107	334,384.35 (5,132,799)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,000	18,410.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	6,669	11,437.33	
		CAPITAMALL TRUST	8,000	18,000.00	
		SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,000	14,800.00	
シンガポールドル建小計			29,669	62,647.33 (5,548,047)	
合計				283,028,611 (283,028,611)	

(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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	株式 593銘柄	54.2%			60.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 34銘柄			1.6%	1.8%
カナダドル	株式 93銘柄	3.8%			4.3%
	投資証券 2銘柄			0.0%	0.0%
ユーロ	株式 235銘柄	11.5%			12.8%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.1%
英ポンド	株式 102銘柄	7.6%			8.4%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.2%

スイスフラン	株式	37銘柄	3.9%			4.4%
スウェーデンクローナ	株式	31銘柄	1.2%			1.3%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	0.3%			0.3%
デンマーククローネ	株式	14銘柄	0.6%			0.7%
オーストラリアドル	株式	62銘柄	2.6%			2.9%
	投資証券	9銘柄			0.2%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	0.1%			0.1%
香港ドル	株式	39銘柄	1.2%			1.4%
	投資証券	1銘柄			0.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	23銘柄	0.5%			0.6%
	投資証券	4銘柄			0.0%	0.0%
イスラエルシケル	株式	9銘柄	0.2%			0.3%

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

新光日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,425,396	16,951,174
国債証券	14,103,924,700	14,115,165,800
地方債証券	1,278,090,100	1,248,218,400
特殊債券	1,445,383,700	1,348,705,600
社債券	843,720,000	742,150,000
未収入金	-	10,687,000
未収利息	42,804,713	40,334,636
前払費用	1,126,860	622,641
流動資産合計	17,749,475,469	17,522,835,251
資産合計	17,749,475,469	17,522,835,251
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	6,060,000
流動負債合計	-	6,060,000

	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
負債合計	-	6,060,000
純資産の部		
元本等		
元本	14,916,956,426	14,429,316,960
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,832,519,043	3,087,458,291
元本等合計	17,749,475,469	17,516,775,251
純資産合計	17,749,475,469	17,516,775,251
負債純資産合計	17,749,475,469	17,522,835,251

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10月21日 至 平成27年 4月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配は使用いたしません。)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 14,916,956,426口	1. 計算日における受益権の総数 14,429,316,960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 1.1899円 (1万口当たり純資産額) (11,899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 1.2140円 (1万口当たり純資産額) (12,140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26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券であり、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	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10月20日現在	平成27年 4月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 2.時価の算定方法	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法

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26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	15,004,175,198円	14,916,956,426円
期中追加設定元本額	446,536,796円	525,868,840円
期中一部解約元本額	533,755,568円	1,013,508,306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）	107,521,879円	116,031,169円
新光7資産バランスファンド	920,382,291円	886,444,703円
日本債券ファンド	612,910,571円	701,634,431円
新光日本債券インデックスVA	3,043,967,034円	2,543,991,201円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,301,927,154円	2,418,972,286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）	2,815,825,560円	2,707,846,994円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	287,829,924円	166,136,729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	3,349,638,531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	1,506,277,990円
グローバル・ナビ	20,701,933円	32,342,926円

合計	14,916,956,426円	14,429,316,960円
----	-----------------	-----------------

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	87,706,900	162,592,400
地方債証券	2,079,400	1,077,800
特殊債券	4,106,000	3,275,800
社債券	3,207,000	150,000
合計	97,099,300	167,096,000

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

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97回利付国債(5年)	190,000,000	190,881,600	
	第98回利付国債(5年)	170,000,000	170,591,600	
	第99回利付国債(5年)	250,000,000	251,412,500	
	第101回利付国債(5年)	360,000,000	362,394,000	
	第103回利付国債(5年)	250,000,000	251,430,000	
	第105回利付国債(5年)	120,000,000	120,518,400	
	第106回利付国債(5年)	60,000,000	60,289,200	
	第107回利付国債(5年)	110,000,000	110,570,900	
	第109回利付国債(5年)	130,000,000	130,358,800	
	第112回利付国債(5年)	100,000,000	101,232,000	

第113回利付国債(5年)	40,000,000	40,366,400	
第114回利付国債(5年)	150,000,000	151,458,000	
第116回利付国債(5年)	180,000,000	181,119,600	
第117回利付国債(5年)	200,000,000	201,288,000	
第118回利付国債(5年)	180,000,000	181,157,400	
第120回利付国債(5年)	110,000,000	110,677,600	
第122回利付国債(5年)	210,000,000	210,291,900	
第123回利付国債(5年)	60,000,000	60,073,200	
第1回利付国債(40年)	10,000,000	12,815,900	
第2回利付国債(40年)	20,000,000	24,583,400	
第3回利付国債(40年)	30,000,000	36,926,400	
第4回利付国債(40年)	40,000,000	49,295,600	
第5回利付国債(40年)	40,000,000	47,042,000	
第6回利付国債(40年)	40,000,000	45,861,600	
第7回利付国債(40年)	40,000,000	43,405,200	
第280回利付国債(10年)	150,000,000	153,310,500	
第282回利付国債(10年)	70,000,000	71,682,100	
第283回利付国債(10年)	50,000,000	51,272,000	
第284回利付国債(10年)	110,000,000	113,109,700	
第285回利付国債(10年)	170,000,000	175,518,200	
第286回利付国債(10年)	100,000,000	103,890,000	
第288回利付国債(10年)	30,000,000	31,230,900	
第289回利付国債(10年)	100,000,000	103,980,000	
第290回利付国債(10年)	180,000,000	187,304,400	
第291回利付国債(10年)	40,000,000	41,506,800	
第293回利付国債(10年)	130,000,000	137,376,200	
第296回利付国債(10年)	110,000,000	115,552,800	
第297回利付国債(10年)	110,000,000	115,535,200	
第299回利付国債(10年)	90,000,000	94,444,200	
第300回利付国債(10年)	80,000,000	84,575,200	
第301回利付国債(10年)	120,000,000	127,251,600	
第302回利付国債(10年)	10,000,000	10,562,800	
第303回利付国債(10年)	240,000,000	254,212,800	
第305回利付国債(10年)	40,000,000	42,296,400	
第306回利付国債(10年)	230,000,000	244,966,100	
第308回利付国債(10年)	220,000,000	233,855,600	
第309回利付国債(10年)	20,000,000	21,054,000	
第310回利付国債(10年)	150,000,000	157,438,500	
第311回利付国債(10年)	20,000,000	20,776,200	
第312回利付国債(10年)	170,000,000	180,783,100	
第313回利付国債(10年)	190,000,000	203,632,500	
第315回利付国債(10年)	190,000,000	202,984,600	
第317回利付国債(10年)	70,000,000	74,508,000	

第318回利付国債(10年)	130,000,000	137,542,600	
第319回利付国債(10年)	80,000,000	85,323,200	
第320回利付国債(10年)	80,000,000	84,793,600	
第321回利付国債(10年)	40,000,000	42,470,000	
第322回利付国債(10年)	60,000,000	63,293,400	
第323回利付国債(10年)	220,000,000	232,102,200	
第325回利付国債(10年)	130,000,000	136,245,200	
第326回利付国債(10年)	60,000,000	62,428,800	
第327回利付国債(10年)	60,000,000	62,883,000	
第328回利付国債(10年)	10,000,000	10,327,500	
第329回利付国債(10年)	120,000,000	125,832,000	
第330回利付国債(10年)	110,000,000	115,364,700	
第332回利付国債(10年)	120,000,000	123,823,200	
第333回利付国債(10年)	120,000,000	123,768,000	
第334回利付国債(10年)	230,000,000	237,102,400	
第335回利付国債(10年)	220,000,000	224,644,200	
第336回利付国債(10年)	110,000,000	112,223,100	
第338回利付国債(10年)	40,000,000	40,365,200	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	24,335,000	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	24,636,800	
第10回利付国債(30年)	30,000,000	30,949,200	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	22,568,000	
第12回利付国債(30年)	20,000,000	23,885,200	
第13回利付国債(30年)	30,000,000	35,272,800	
第15回利付国債(30年)	40,000,000	50,418,400	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	62,114,500	
第19回利付国債(30年)	20,000,000	24,444,400	
第20回利付国債(30年)	20,000,000	25,171,200	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	24,452,200	
第22回利付国債(30年)	20,000,000	25,209,800	
第23回利付国債(30年)	30,000,000	37,826,400	
第24回利付国債(30年)	30,000,000	37,836,300	
第26回利付国債(30年)	40,000,000	49,706,800	
第27回利付国債(30年)	30,000,000	37,926,900	
第28回利付国債(30年)	40,000,000	50,664,000	
第29回利付国債(30年)	50,000,000	62,450,500	
第30回利付国債(30年)	50,000,000	61,533,000	
第31回利付国債(30年)	50,000,000	60,584,500	
第32回利付国債(30年)	60,000,000	74,149,800	
第33回利付国債(30年)	60,000,000	70,306,200	
第34回利付国債(30年)	70,000,000	85,181,600	
第35回利付国債(30年)	60,000,000	70,403,400	
第36回利付国債(30年)	70,000,000	82,142,900	

第37回利付国債(30年)	70,000,000	80,522,400	
第38回利付国債(30年)	40,000,000	45,064,800	
第39回利付国債(30年)	30,000,000	34,492,500	
第40回利付国債(30年)	40,000,000	45,037,600	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	44,077,200	
第42回利付国債(30年)	50,000,000	55,070,000	
第43回利付国債(30年)	40,000,000	44,034,800	
第44回利付国債(30年)	40,000,000	44,012,800	
第45回利付国債(30年)	30,000,000	31,486,500	
第46回利付国債(30年)	30,000,000	31,495,500	
第45回利付国債(20年)	30,000,000	33,428,100	
第47回利付国債(20年)	60,000,000	66,895,800	
第48回利付国債(20年)	60,000,000	68,227,800	
第50回利付国債(20年)	30,000,000	33,233,700	
第51回利付国債(20年)	10,000,000	11,184,600	
第52回利付国債(20年)	20,000,000	22,579,000	
第53回利付国債(20年)	30,000,000	34,005,000	
第55回利付国債(20年)	30,000,000	33,924,600	
第57回利付国債(20年)	30,000,000	33,803,700	
第58回利付国債(20年)	30,000,000	33,874,200	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	44,663,200	
第61回利付国債(20年)	10,000,000	10,643,600	
第63回利付国債(20年)	30,000,000	33,895,200	
第64回利付国債(20年)	20,000,000	22,803,800	
第65回利付国債(20年)	90,000,000	102,940,200	
第69回利付国債(20年)	40,000,000	46,550,800	
第70回利付国債(20年)	30,000,000	35,808,900	
第72回利付国債(20年)	30,000,000	35,120,400	
第76回利付国債(20年)	60,000,000	69,338,400	
第78回利付国債(20年)	40,000,000	46,310,800	
第81回利付国債(20年)	50,000,000	58,494,500	
第84回利付国債(20年)	80,000,000	93,712,800	
第85回利付国債(20年)	50,000,000	59,194,500	
第88回利付国債(20年)	50,000,000	60,408,500	
第90回利付国債(20年)	60,000,000	71,985,000	
第92回利付国債(20年)	80,000,000	95,260,800	
第94回利付国債(20年)	60,000,000	71,514,000	
第95回利付国債(20年)	50,000,000	60,876,000	
第97回利付国債(20年)	60,000,000	72,429,600	
第99回利付国債(20年)	70,000,000	83,786,500	
第100回利付国債(20年)	80,000,000	96,844,800	
第103回利付国債(20年)	60,000,000	73,427,400	
第105回利付国債(20年)	60,000,000	71,977,200	

第108回利付国債（20年）	70,000,000	82,217,800	
第111回利付国債（20年）	70,000,000	85,062,600	
第113回利付国債（20年）	70,000,000	84,096,600	
第114回利付国債（20年）	10,000,000	12,021,500	
第116回利付国債（20年）	90,000,000	109,481,400	
第118回利付国債（20年）	90,000,000	106,841,700	
第121回利付国債（20年）	90,000,000	105,539,400	
第123回利付国債（20年）	90,000,000	108,243,000	
第125回利付国債（20年）	80,000,000	97,387,200	
第128回利付国債（20年）	60,000,000	70,300,200	
第130回利付国債（20年）	80,000,000	92,411,200	
第132回利付国債（20年）	90,000,000	102,436,200	
第134回利付国債（20年）	90,000,000	103,713,300	
第137回利付国債（20年）	90,000,000	102,222,000	
第140回利付国債（20年）	90,000,000	102,068,100	
第141回利付国債（20年）	90,000,000	101,904,300	
第143回利付国債（20年）	70,000,000	77,977,900	
第145回利付国債（20年）	50,000,000	56,464,000	
第146回利付国債（20年）	80,000,000	90,108,800	
第147回利付国債（20年）	100,000,000	110,742,000	
第148回利付国債（20年）	90,000,000	97,934,400	
第149回利付国債（20年）	120,000,000	130,275,600	
第150回利付国債（20年）	40,000,000	42,635,600	
第151回利付国債（20年）	100,000,000	102,779,000	
第152回利付国債（20年）	20,000,000	20,510,800	
国債証券 小計	13,030,000,000	14,115,165,800	
地方債証券			
第18回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,560,000	
第654回東京都公募公債	100,000,000	104,030,000	
第678回東京都公募公債	80,000,000	84,680,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	31,101,000	
第164回神奈川県公募公債	100,000,000	105,870,000	
第87回大阪府公募公債（5年）	50,000,000	50,160,000	
第110回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	100,110,000	
第302回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	41,428,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	10,000,000	10,227,000	
平成20年度第1回愛知県公募公債（10年）	48,000,000	50,606,400	
平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	68,917,200	
平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	103,250,000	
第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,010,000	
第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	53,010,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	39,000,000	39,994,500	
第485回名古屋市公募公債（10年）	30,000,000	30,951,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	31,329,000	

	平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,534,300	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	103,450,000	
地方債証券 小計		1,186,000,000	1,248,218,400	
特殊債券	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,930,000	
	第33回日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,430,000	
	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	104,730,000	
	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	119,450,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,310,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,130,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,160,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,150,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	104,999,600	
	第188回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,420,000	
	い第736号商工債券	70,000,000	70,322,000	
	い第759号農林債	20,000,000	20,154,000	
	第274回信金中金債（5年）	100,000,000	100,430,000	
	第13回中日本高速道路社債（財投機関債）	100,000,000	106,090,000	
特殊債券 小計		1,291,000,000	1,348,705,600	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	104,300,000	
	第30回新日鐵住金社債	100,000,000	107,220,000	
	第1回日本電産社債	100,000,000	100,600,000	
	第8回トヨタ自動車社債	100,000,000	106,910,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,210,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	105,810,000	
	第524回東京電力社債	100,000,000	101,100,000	
社債券 小計		700,000,000	742,150,000	
合計		16,207,000,000	17,454,239,800	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

貸借対照表

	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,151,770	22,587,687
投資証券	1,062,842,850	1,470,215,500
未収入金	44,705,376	-
未収配当金	7,359,776	8,164,744
未収利息	3	23
流動資産合計	1,119,059,775	1,500,967,954
資産合計	1,119,059,775	1,500,967,954
負債の部		
流動負債		
未払解約金	41,100,000	100,000
流動負債合計	41,100,000	100,000
負債合計	41,100,000	100,000
純資産の部		
元本等		
元本	773,206,973	922,067,792
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	304,752,802	578,800,162
元本等合計	1,077,959,775	1,500,867,954
純資産合計	1,077,959,775	1,500,867,954
負債純資産合計	1,119,059,775	1,500,967,954

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10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 773,206,973口	1. 計算日における受益権の総数 922,067,792口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額 1.3941円	1口当たり純資産額 1.6277円
(1万口当たり純資産額) (13,941円)	(1万口当たり純資産額) (16,277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26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	コンプライアンス・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10月20日現在	平成27年 4月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左

2.時価の算定方法 投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2.時価の算定方法 同左
---	-----------------

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	917,907,152円	773,206,973円
期中追加設定元本額	4,478,428円	245,282,664円
期中一部解約元本額	149,178,607円	96,421,845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	765,275,608円	669,236,233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）	3,583,455円	3,433,388円
グローバル・ナビ	4,347,910円	6,044,546円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	- 円	243,353,625円
合計	773,206,973円	922,067,792円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	99,689,605	140,365,880
合計	99,689,605	140,365,880

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	66	31,614,000	
	M I Dリート投資法人	25	9,012,500	
	森ヒルズリート投資法人	213	34,846,800	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	22	15,114,000	
	産業ファンド投資法人	48	27,888,000	
	大和ハウスリート投資法人	47	24,910,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	177	50,922,900	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	47	16,802,500	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	38	41,610,000	
	G L P 投資法人	325	40,592,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	64	16,083,200	
	日本プロロジスリート投資法人	235	61,758,000	
	野村不動産マスタ - ファンド投資法人	226	34,442,400	
	屋野リゾート・リート投資法人	6	8,646,000	
	S I A 不動産投資法人	10	5,190,000	
	イオンリート投資法人	148	24,420,000	
	ヒューリックリート投資法人	106	19,800,800	
	日本リート投資法人	41	13,509,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	59	6,944,300	
	日本ヘルスケア投資法人	8	2,275,200	
	積水ハウス・リート投資法人	86	12,298,000	
	ト - セイ・リート投資法人	13	1,768,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	35	10,335,500	
	日本ビルファンド投資法人	192	114,048,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	177	100,005,000	
	日本リテールファンド投資法人	330	82,500,000	
	オリックス不動産投資法人	303	53,358,300	
	日本プライムリアルティ投資法人	112	47,264,000	
	プレミア投資法人	36	23,256,000	
	東急リアル・エステート投資法人	133	20,748,000	

グローバル・ワン不動産投資法人	26	11,258,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人	51	29,427,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	359	68,676,700	
森トラスト総合リート投資法人	179	42,405,100	
インヴィンシブル投資法人	363	23,014,200	
フロンティア不動産投資法人	67	38,324,000	
平和不動産リート投資法人	129	12,216,300	
日本ロジスティクスファンド投資法人	113	28,170,900	
福岡リート投資法人	94	20,463,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	55	36,465,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	138	18,712,800	
いちご不動産投資法人	154	14,676,200	
大和証券オフィス投資法人	60	39,420,000	
阪急リート投資法人	81	12,166,200	
スタートアップリート投資法人	24	5,102,400	
トップリート投資法人	24	12,384,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	102	27,458,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	408	34,761,600	
日本賃貸住宅投資法人	200	17,360,000	
ジャパンエクセレント投資法人	165	25,789,500	
合計	6,120	1,470,215,500	

(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10月20日現在	平成27年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	6,897,080	2,430,810
コール・ローン	6,264,849	11,216,943
投資証券	1,084,628,074	1,035,470,706
未収配当金	816,246	861,210
未収利息	5	11
流動資産合計	1,098,606,254	1,049,979,680
資産合計	1,098,606,254	1,049,979,680

平成26年10月20日現在

平成27年 4月20日現在

負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	950,000
流動負債合計	-	950,000
負債合計	-	950,000
純資産の部		
元本等		
元本	905,073,922	707,635,787
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	193,532,332	341,393,893
元本等合計	1,098,606,254	1,049,029,680
純資産合計	1,098,606,254	1,049,029,680
負債純資産合計	1,098,606,254	1,049,979,680

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10月21日 至 平成27年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 905,073,922口	1. 計算日における受益権の総数 707,635,787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 1.2138円 (1万口当たり純資産額) (12,138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 1.4824円 (1万口当たり純資産額) (14,824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26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日

1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、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10月20日現在	平成27年 4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 投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成26年 4月22日 至 平成26年10月20日	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	1,072,870,103円	905,073,922円
期中追加設定元本額	8,120,641円	3,001,420円
期中一部解約元本額	175,916,822円	200,439,555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	893,747,978円	695,618,948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)	6,229,480円	5,621,812円
グローバル・ナビ	5,096,464円	6,395,027円
合計	905,073,922円	707,635,787円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成26年10月20日現在	平成27年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	70,376,196	73,709,274

合計	70,376,196	73,709,274
----	------------	------------

(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	700	22,729.00	
		AGREE REALTY CORPORATION	200	6,370.00	
		ALEXANDER'S INC	20	8,760.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	700	65,016.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	400	16,472.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,100	45,199.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	1,600	27,312.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	9,700	91,180.00	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	200	3,730.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	4,400	422,840.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	1,600	59,936.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	300	3,102.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	200	3,174.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,000	9,450.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	600	14,520.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,400	235,634.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	2,100	44,121.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,600	218,560.00	
		BRANDYWINE REALTY	1,900	28,424.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,600	39,648.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	900	68,373.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	700	4,536.00	

CARETRUST REIT INC	300	4,020.00	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	300	3,438.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,800	34,218.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	900	6,588.00	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	2,500	19,500.00	
CHATHAM LODGING TRUST	400	11,544.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	600	18,960.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1,300	34,736.00	
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	500	3,485.00	
CORESITE REALTY CORPORATION	200	9,692.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,000	28,410.00	
CORRECTIONS CORPORATION OF AMERICA	1,200	46,932.00	
COUSINS PROPERTIES INC	2,200	22,440.00	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3,500	300,440.00	
CUBESMART	1,700	38,692.00	
CYRUSONE INC	400	12,368.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	900	29,817.00	
DDR CORPORATION	3,200	57,056.00	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	2,000	27,680.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,400	91,434.00	
DOUGLAS EMMETT INC	1,400	40,460.00	
DUKE REALTY CORP	3,600	73,728.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	700	22,736.00	
EASTGROUP PROPERTIES	300	18,012.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	500	17,165.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	800	14,360.00	
EPR PROPERTIES	600	35,448.00	
EQUINIX INC	600	141,684.00	
EQUITY COMMONWEALTH	1,300	33,735.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	800	41,920.00	
EQUITY ONE INC	600	15,414.00	
EQUITY RESIDENTIAL	3,700	278,684.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	700	155,722.00	
EXCEL TRUST INC	600	9,504.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,100	72,402.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT	700	97,314.00	
FELCOR LODGING TRUST	1,300	14,664.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY	1,100	22,055.00	
FIRST POTOMAC REALTY	600	6,744.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES	900	11,250.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	900	32,841.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	5,300	151,368.00	

GETTY REALTY CORP	300	5,256.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	200	3,700.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	700	15,631.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	500	14,030.00	
HCP INC	4,800	207,456.00	
HEALTH CARE REIT INC	3,600	270,936.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,000	26,310.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,300	34,710.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,800	11,502.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,000	44,790.00	
HOME PROPERTIES INC	600	40,176.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1,600	50,880.00	
HOST HOTELS & RESORTS	7,900	162,740.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	700	21,924.00	
INLAND REAL ESTATE CORP	900	9,459.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,300	9,347.00	
IRON MOUNTAIN INC	1,900	70,072.00	
KILROY REALTY CORP	900	65,790.00	
KIMCO REALTY CORP	4,300	108,790.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	900	24,669.00	
LAMAR ADVERTISING COMPANY	800	47,728.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,200	44,748.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	2,400	22,824.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,500	52,575.00	
LTC PROPERTIES INC	400	17,852.00	
MACK-CALI REALTY CORP	900	16,533.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,200	32,494.00	
MID-AMERICA APARTMENT	800	59,968.00	
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	600	6,288.00	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	1,800	16,938.00	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	400	27,172.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,400	57,134.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	700	11,473.00	
NEW YORK REIT INC	1,700	17,102.00	
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORPORATION	3,400	62,900.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	1,670	63,126.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	100	2,335.00	
OUTFRONT MEDIA INC	1,400	40,432.00	
PARAMOUNT GROUP INC	1,500	28,140.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	800	13,496.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	700	31,150.00	
PENN REAL ESTATE INVESTMENT	700	15,050.00	

PHYSICIANS REALTY TRUST	700	12,019.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	1,600	29,216.00	
PLUM CREEK TIMBER COMPANY	1,800	76,086.00	
POST PROPERTIES INC	600	33,204.00	
POTLATCH CORPORATION	400	15,240.00	
PROLOGIS INC	5,300	227,264.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	200	15,906.00	
PUBLIC STORAGE	1,500	285,105.00	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	200	7,376.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	800	14,512.00	
RAYONIER INC	1,300	34,255.00	
REALTY INCOME CORP	2,300	113,298.00	
REGENCY CENTERS CORPORATION	1,000	65,310.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	1,000	17,440.00	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	2,500	38,250.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	600	9,276.00	
RLJ LODGING TRUST	1,400	42,910.00	
ROUSE PROPERTIES INC	400	7,240.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	500	29,575.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	600	18,390.00	
SAUL CENTERS INC	100	5,343.00	
SELECT INCOME REIT	700	16,821.00	
SENIOR HOUSING PROPERTIES	2,500	53,725.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORPORATION	400	6,296.00	
SIMON PROPERTY GROUP	3,200	602,432.00	
SL GREEN REALTY CORPORATION	1,000	126,680.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	400	35,848.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4,000	47,200.00	
STAG INDUSTRIAL INC	700	15,491.00	
STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL	400	10,316.00	
STORE CAPITAL CORPORATION	300	6,837.00	
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	2,900	34,626.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	900	11,727.00	
SUN COMMUNITIES INC	500	31,380.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	2,100	34,125.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,000	34,470.00	
TAUBMAN CENTERS INC	700	51,485.00	
TERRENO REALTY CORP	400	8,916.00	
THE GEO GROUP INC	700	29,442.00	
THE MACERICH COMPANY	1,600	132,032.00	
UDR INC	2,700	87,966.00	
UMH PROPERTIES INC	200	2,034.00	
	100	5,267.00	

	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST			
	URBAN EDGE PROPERTIES	900	21,213.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	300	6,339.00	
	VENTAS INC	3,500	255,185.00	
	VORNADO REALTY TRUST	1,700	181,883.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	700	18,305.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1,100	37,477.00	
	WEYERHAEUSER COMPANY	5,500	173,525.00	
	WHITESTONE REIT	200	3,096.00	
	WINTHROP REALTY TRUST INC	300	4,884.00	
	WP CAREY INC	900	58,878.00	
	WP GLIMCHER INC	1,900	29,336.00	
米ドル建小計		219,790	8,705,824.00 (1,035,470,706)	
	合計		1,035,470,706 (1,035,470,706)	

(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 160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27年 4月30日現在）

資産総額	7,685,928,124円
負債総額	15,452,230円
純資産総額（ - ）	7,670,475,894円
発行済口数	8,236,118,151口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9313円
（1万口当たり純資産額）	（9,313円）

（参考）海外国債マザーファンド

（平成27年 4月30日現在）

資産総額	47,515,212,139円
負債総額	141,160,650円
純資産総額（ - ）	47,374,051,489円
発行済口数	20,491,450,292口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3119円
（1万口当たり純資産額）	（23,119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27年 4月30日現在）

資産総額	14,345,806,444円
負債総額	283,837,827円
純資産総額（ - ）	14,061,968,617円
発行済口数	7,225,778,364口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9461円
（1万口当たり純資産額）	（19,461円）

（参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

（平成27年 4月30日現在）

資産総額	13,134,001,900円
負債総額	7,252,787円
純資産総額（ - ）	13,126,749,113円
発行済口数	6,546,875,909口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0050円
（1万口当たり純資産額）	（20,050円）

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

（平成27年 4月30日現在）

資産総額	17,458,283,254円
負債総額	4,200,000円
純資産総額（ - ）	17,454,083,254円
発行済口数	14,412,998,338口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2110円
（1万口当たり純資産額）	（12,110円）

（参考）新光J-REITマザーファンド

（平成27年 4月30日現在）

資産総額	1,524,345,966円
負債総額	13,828,390円
純資産総額（ - ）	1,510,517,576円
発行済口数	928,266,497口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6272円
（1万口当たり純資産額）	（16,272円）

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成27年 4月30日現在）

資産総額	1,037,038,236円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	1,037,038,236円
発行済口数	707,655,914口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4655円
（1万口当たり純資産額）	（14,655円）

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

a．資本金の額（平成26年10月末現在）

（略）

<訂正後>

a．資本金の額（平成27年4月末現在）

（略）

b．委託会社の機構

<更新後>

（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。

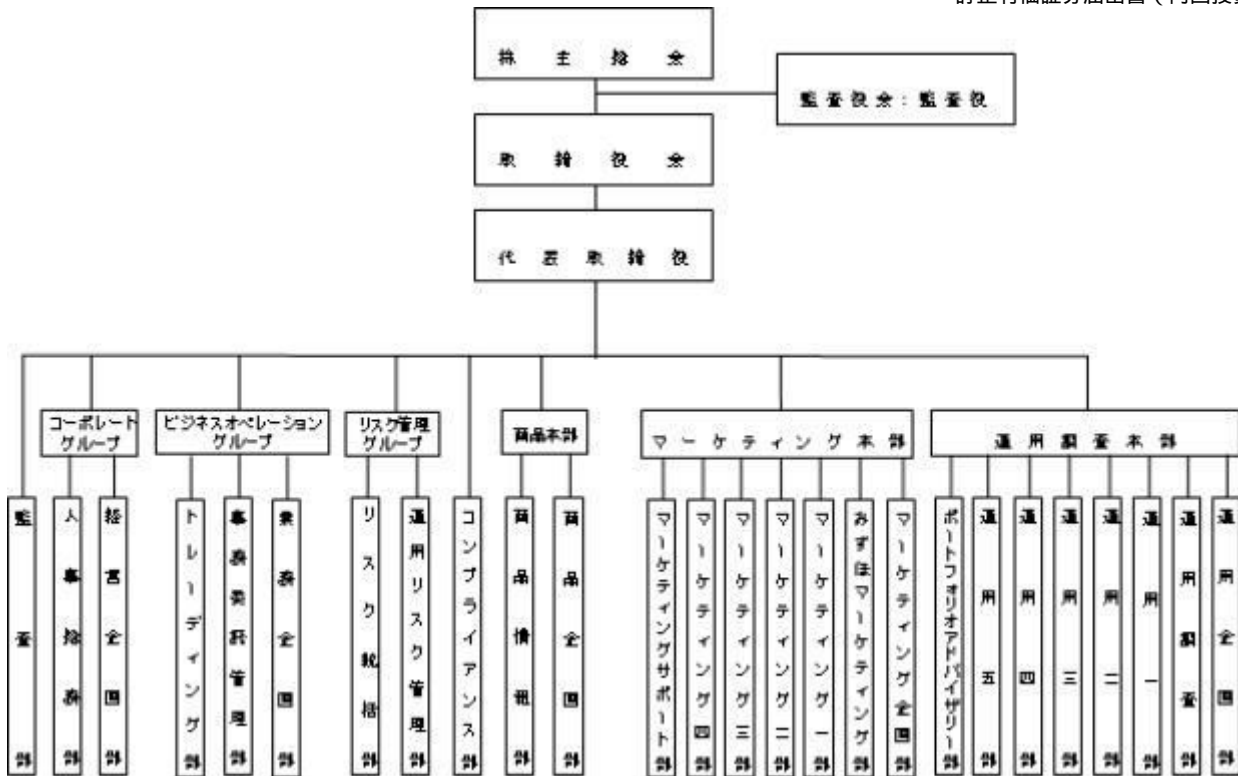
取締役会の決議により、取締役の中から会長1名、社長1名、副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

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。

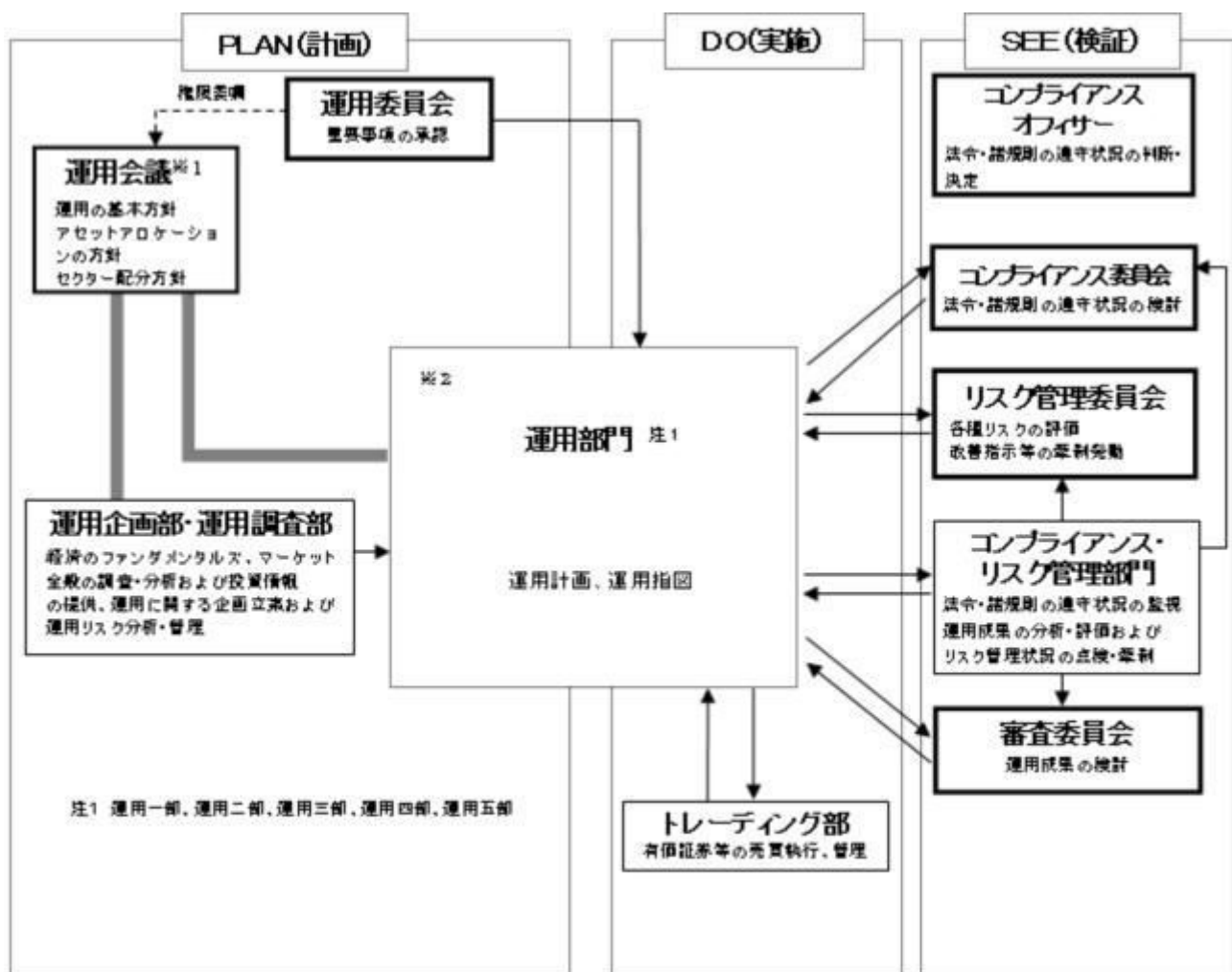
代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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



(八) 投資運用の意思決定機構



実績の矢印は情報の流れを示します。

※1 運用会議は運用企画部・運用調査部、運用部門(運用一部～五部)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】

<更新後>

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

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27年4月30日現在）

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	302	4,220,976
株式投資信託（合計）	274	3,414,296
単位型	41	158,846
追加型	233	3,255,449
公社債投資信託（合計）	28	806,679
単位型	1	209
追加型	27	806,470

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1．財務諸表の作成方法について

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

なお、財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,492,111	13,427,042
有価証券	3,291,156	3,200,000

貯蔵品	5,188	5,117
立替金	15,778	23,184
前払金	38,614	64,821
前払費用	16,530	18,242
未収入金	-	872
未収委託者報酬	2,654,090	3,187,770
未収運用受託報酬	117,049	99,054
未収収益	6,509	6,338
繰延税金資産	283,616	372,215
流動資産合計	19,920,646	20,404,659
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 12,380	2 12,687
構築物（純額）	2 1,650	2 1,444
器具・備品（純額）	2 99,960	2 86,688
リース資産（純額）	2 340	-
有形固定資産合計	114,332	100,820
無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	74,851	85,517
ソフトウェア仮勘定	11,885	669
無形固定資産合計	86,827	86,278
投資その他の資産		
投資有価証券	3,213,218	5,101,854
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,152	124,246
長期繰延税金資産	63,925	-
前払年金費用	374,562	396,211
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	3,859,590	5,706,044
固定資産合計	4,060,749	5,893,143
資産合計	23,981,396	26,297,802

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	21,303	17,893
リース債務	810	345
未払金		
未払収益分配金	177	160
未払償還金	10,100	5,083
未払手数料	1 1,296,830	1 1,558,682

その他未払金	513,148	952,018
未払金合計	1,820,257	2,515,945
未払費用	548,430	722,806
未払法人税等	1,462,380	1,222,883
賞与引当金	362,800	451,000
役員賞与引当金	44,200	66,000
外国税支払損失引当金	-	184,111
訴訟損失引当金	-	30,000
流動負債合計	4,260,181	5,210,985
固定負債		
繰延税金負債	-	89,752
長期リース債務	345	-
退職給付引当金	172,959	155,806
役員退職慰労引当金	31,708	39,333
執行役員退職慰労引当金	102,083	63,916
固定負債合計	307,096	348,809
負債合計	4,567,278	5,559,794
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	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	2,889,165	3,981,245
利益剰余金合計	12,149,658	13,241,738
自己株式	72,415	72,415
株主資本合計	19,363,242	20,455,322
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	50,874	282,685
評価・換算差額等合計	50,874	282,685
純資産合計	19,414,117	20,738,008
負債純資産合計	23,981,396	26,297,802

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

前事業年度	当事業年度
(自 平成25年4月 1日	(自 平成26年4月 1日
至 平成26年3月31日)	至 平成27年3月31日)

営業収益			
委託者報酬		29,107,010	35,876,795
運用受託報酬		261,777	238,412
営業収益合計		29,368,787	36,115,207
営業費用			
支払手数料	1	15,428,327	18,252,669
広告宣伝費		336,593	456,430
公告費		2,919	548
調査費			
調査費		339,210	623,792
委託調査費		4,188,805	5,966,340
図書費		4,862	5,254
調査費合計		4,532,878	6,595,388
委託計算費		1,151,067	1,352,318
営業雑経費			
通信費		37,016	32,335
印刷費		160,606	103,093
協会費		14,992	18,150
諸会費		3,153	3,300
その他		27,521	41,594
営業雑経費合計		243,290	198,475
営業費用合計		21,695,077	26,855,830
一般管理費			
給料			
役員報酬		89,886	96,445
給料・手当		1,326,658	1,368,552
賞与		332,688	336,076
給料合計		1,749,233	1,801,073
交際費		9,349	11,426
寄付金		3,066	3,198
旅費交通費		78,321	100,386
租税公課		65,510	68,508
不動産賃借料		205,792	206,753
賞与引当金繰入		362,800	451,000
役員賞与引当金繰入		44,200	66,000
役員退職慰労引当金繰入		39,756	24,930
退職給付費用		182,850	191,900
減価償却費		63,615	70,676
諸経費		585,445	573,824
一般管理費合計		3,389,942	3,569,678
営業利益		4,283,768	5,689,698

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	143,049	163,006
有価証券利息	6,052	3,853
受取利息	14,495	10,741
時効成立分配金・償還金	4,450	5,080
雑益	20,588	487
営業外収益合計	188,635	183,170
営業外費用		
支払利息	59	26
時効成立後支払分配金・償還金	1,557	3,083
雑損	8,673	3,261
営業外費用合計	10,290	6,371
経常利益	4,462,113	5,866,496
特別利益		
投資有価証券売却益	158,386	68,179
特別利益合計	158,386	68,179
特別損失		
固定資産除却損	3,210	3,177
ゴルフ会員権売却損	2,795	-
投資有価証券売却損	42,388	54,613
投資有価証券評価損	10,974	10,952
外国税支払損失引当金繰入額	-	184,111
訴訟損失引当金繰入額	-	30,000
その他特別損失	-	22,227
特別損失合計	59,368	305,082
税引前当期純利益	4,561,131	5,629,593
法人税、住民税及び事業税	1,905,519	2,111,379
法人税等調整額	113,958	66,999
法人税等合計	1,791,560	2,044,380
当期純利益	2,769,571	3,585,212

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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	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

当事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27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	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
当期変動額					
別途積立金取崩					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
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	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	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	3,585,212		3,585,212		3,585,212
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）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

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、支給見込額の当事業年度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、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(3) 外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

(4) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(5) 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、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。

(6) 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、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(7) 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、規程に基づく当事業年度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、当事業年度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27年3月26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事業年度より適用し、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、当事業年度の期首において、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、当事業年度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、当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払手数料	760,018千円	777,631千円

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	599,157千円	573,602千円

（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25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
支払手数料	8,738,779千円	9,189,399千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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26年12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

(リース取引関係)

ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

(1)リース資産の内容

有形固定資産

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

(2)リース資産の減価償却方法

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（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（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先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、資金運用スケジュールを作成し、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 その他有価証券	6,305,322	6,305,322	-
(3) 未収委託者報酬	2,654,090	2,654,090	-

当事業年度（平成27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	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
非上場株式	276,151	276,151

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

(注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成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 其他有価証券	3,291,156	380,080	1,261,941	269,692
(3) 未収委託者報酬	2,654,090	-	-	-

当事業年度（平成27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	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有 価証券 其他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

(有価証券関係)

1. 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、記載していません。

2. その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,920,996	1,709,935	211,061
	小計	1,920,996	1,709,935	211,061
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	4,384,326	4,516,340	132,014
	小計	4,384,326	4,516,340	132,014
合計		6,305,322	6,226,275	79,047

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

当事業年度（平成27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	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
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	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
	合計	8,102,802	7,685,493	417,309

(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。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(平成27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	503,565	68,179	54,613
合計	503,565	68,179	54,613

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,974千円(その他有価証券)減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について10,952千円(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)

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

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,281,738	1,424,739
会計方針の変更による累積的影響額	-	71,902
会計方針の変更を反映した期首残高	1,281,738	1,352,836
勤務費用	80,449	90,967
利息費用	19,226	9,476
数理計算上の差異の発生額	91,561	31,927
退職給付の支払額	48,235	73,269
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,424,739	1,348,083

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
年金資産の期首残高	1,018,974	1,157,054
期待運用収益	20,379	23,141
数理計算上の差異の発生額	70,810	108,961
事業主からの拠出額	78,919	78,464
退職給付の支払額	32,029	38,450
年金資産の期末残高	1,157,054	1,329,170

(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

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,187,071	1,111,797
年金資産	1,157,054	1,329,170
	30,017	217,373
非積立型制度の退職給付債務	237,668	236,285
未積立退職給付債務	267,685	18,912
未認識数理計算上の差異	496,048	270,020
未認識過去勤務費用	26,759	10,703
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	201,603	240,404
退職給付引当金	172,959	155,806
前払年金費用	374,562	396,211
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	201,603	240,404

額

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用(注1)	110,782	119,135
利息費用	19,226	9,476
期待運用収益	20,379	23,141
数理計算上の差異の費用処理額	72,344	85,138
過去勤務費用の費用処理額	16,055	16,055
確定給付制度に係る退職給付費用	165,917	174,553

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額（前事業年度30,333千円、当事業年度28,168千円）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

	前事業年度	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
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%	39.4%
債券	25.6%	27.3%
共同運用資産	18.3%	21.0%
生命保険一般勘定	11.2%	10.6%
現金及び預金	3.3%	1.4%
合計	100%	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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.0720% ~ 1.625%
長期期待運用収益率	2.0%	2.0%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度16,933千円 当事業年度17,347千円であります。

(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

当事業年度

（平成26年3月31日）

（平成27年3月31日）

繰延税金資産		
賞与引当金	145,054千円	170,920千円
減価償却超過額	1,076	896
退職給付引当金	98,025	70,882
役員退職慰労引当金	11,300	12,688
投資有価証券評価損	12,705	15,033
非上場株式評価損	28,430	25,733
未払事業税	103,536	90,342
外国税支払損失引当金	-	60,867
訴訟損失引当金	-	9,918
その他	109,079	87,621
繰延税金資産小計	509,208	544,905
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	509,208	544,905
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	28,172	134,624
前払年金費用	133,494	127,817
繰延税金負債合計	161,666	262,442
繰延税金資産の純額	347,542	282,463

(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	283,616千円	372,215千円
固定資産 - 長期繰延税金資産	63,925	-
固定負債 - 長期繰延税金負債	-	89,752

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

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。

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27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については、繰延税金資産及び繰延税金負債を計算する法定実効税率の変更等を行っております。

その結果、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）が19,637千円減少し、その他有価証券評価差額金が14,105千円、法人税等調整額が33,742千円、それぞれ増加しております。

（セグメント情報等）

セグメント情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）及び

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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25年4月1日 至 平成26年3月31日）及び

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金又は出 資金（千円）	事業の 内容又は 職業	議決権等の 所有(被所 有)割合 (%)	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)

親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,738,779	未払手数料	760,018
-----	-----------	---------	-------------	---------	-----------------------------	-----------------------------	--------------------------------	-----------	-------	---------

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接77.05 間接 7.74	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	9,189,399	未払手数料	777,631

(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	みずほ証券プロバ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 ハウジングサービス料支払	105,424 16,824	その他未払金 その他未払金	8,030 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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	175,210	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	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

(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) 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。
- (2) 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。
- (3) 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25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	当事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	10,703円18銭	11,433円05銭
1株当たり当期純利益金額	1,526円89銭	1,976円56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25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	当事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益金額（千円）	2,769,571	3,585,212
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）	2,769,571	3,585,212
期中平均株式数（千株）	1,813	1,813

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

5【その他】

b．訴訟事件その他の重要事項

<訂正前>

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

なお、「委託会社等の経理状況 中間財務諸表」の注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、平成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。

<訂正後>

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(3) 販売会社

<訂正前>

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
(略)		
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。

<訂正後>

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
(略)		
立花証券株式会社	6,695	同上
高木証券株式会社	11,069	同上

第3【その他】

<訂正前>

- (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。

(略)

- ・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

(略)

<訂正後>

- (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。

(略)

- ・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)に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

(略)

独立監査人の監査報告書

平成27年6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10月21日から平成27年4月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの平成27年4月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成27年6月12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27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。