

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年1月20日提出
【発行者名】	新光投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 後藤 修一
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目17番10号
【事務連絡者氏名】	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28年1月21日から平成29年1月20日まで) 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

新光7資産バランスファンド

愛称として「七重奏」という名称を用いることがあります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

（イ）追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

（ロ）当初元本は1口当たり1円です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

（イ）発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

### （５）【申込手数料】

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

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

#### (6) 【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

#### (7) 【申込期間】

平成28年1月21日から平成29年1月20日までです。

なお、申込期間は原則として更新されます。

#### (8) 【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所(販売会社)については、下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 商品分類の定義

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

#### 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

### 属性区分の定義

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

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

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

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

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



## b. ファンドの特色

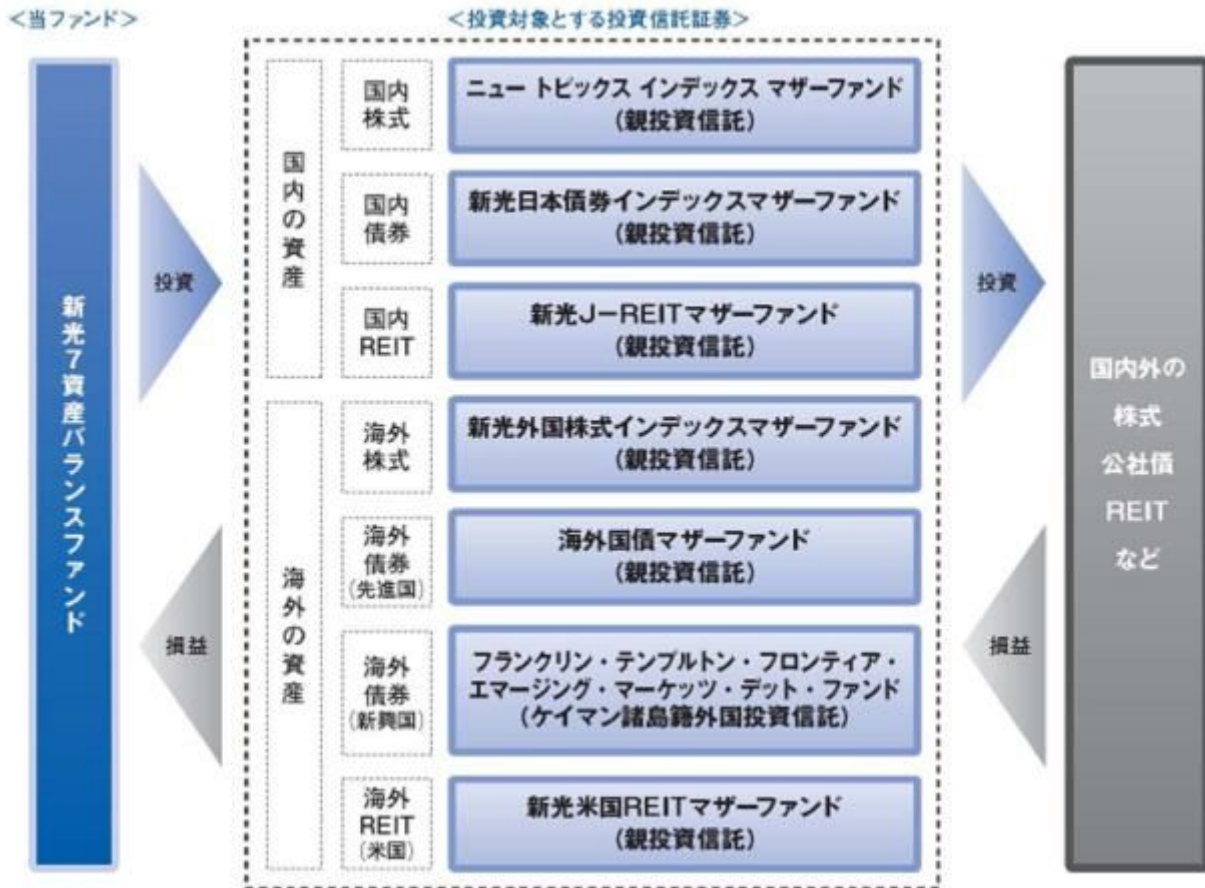
### 1. 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産(株式、公社債、不動産投資信託証券)にバランスよく分散投資します。

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

投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とします。

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

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



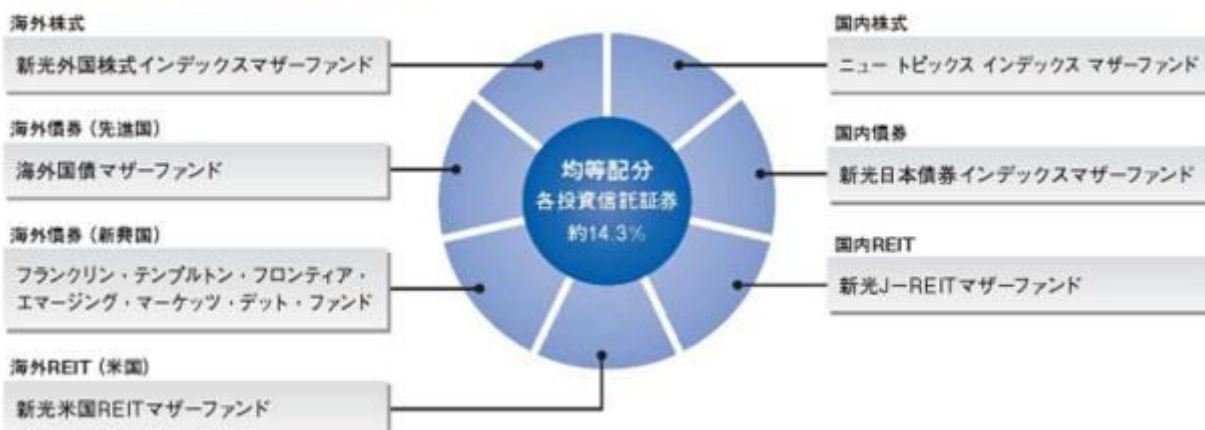
## 2. 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。 基本投資配分比率は均等とします。

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

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

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

### <基本投資配分比率のイメージ図>



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



## 主な投資制限

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

## 分配方針

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



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

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

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

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

運用状況により分配金額は変動します。

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

## 収益分配金に関する留意事項

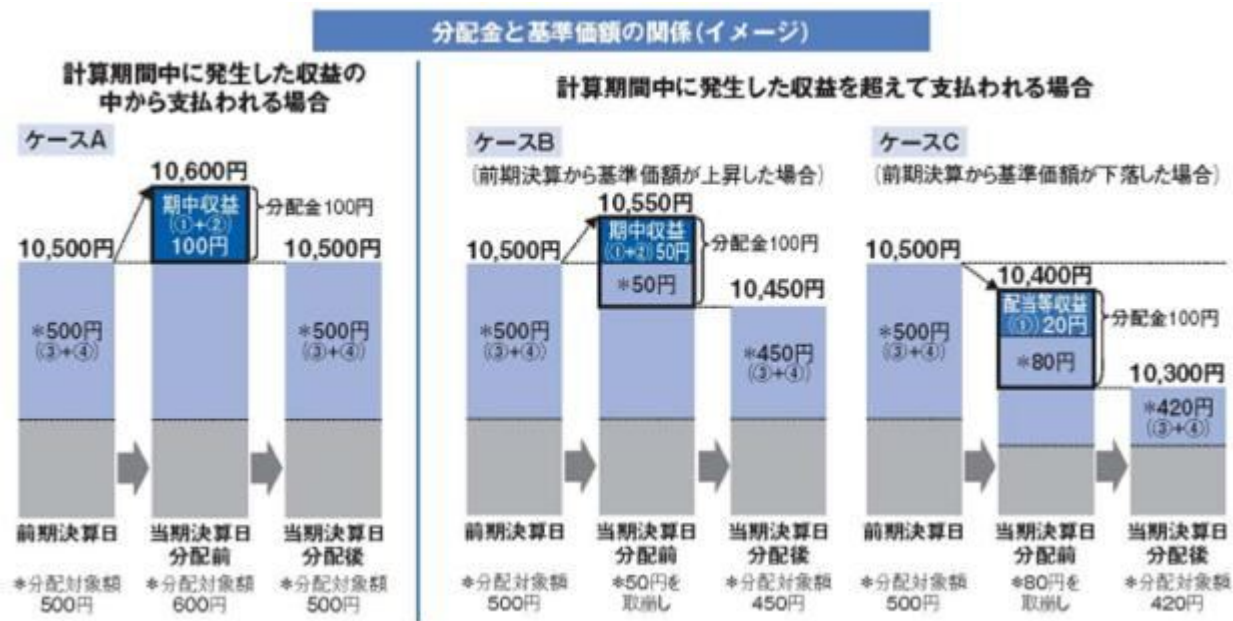
投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。



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

することになります。

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



分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

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

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

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

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

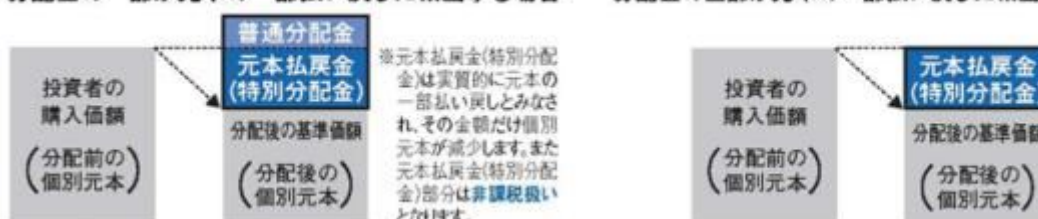
A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

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

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

**分配金の一部が元本の一部払い戻しに相当する場合**

**分配金の全部が元本の一部払い戻しに相当する場合**



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

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

### c. 信託金限度額

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成18年9月29日

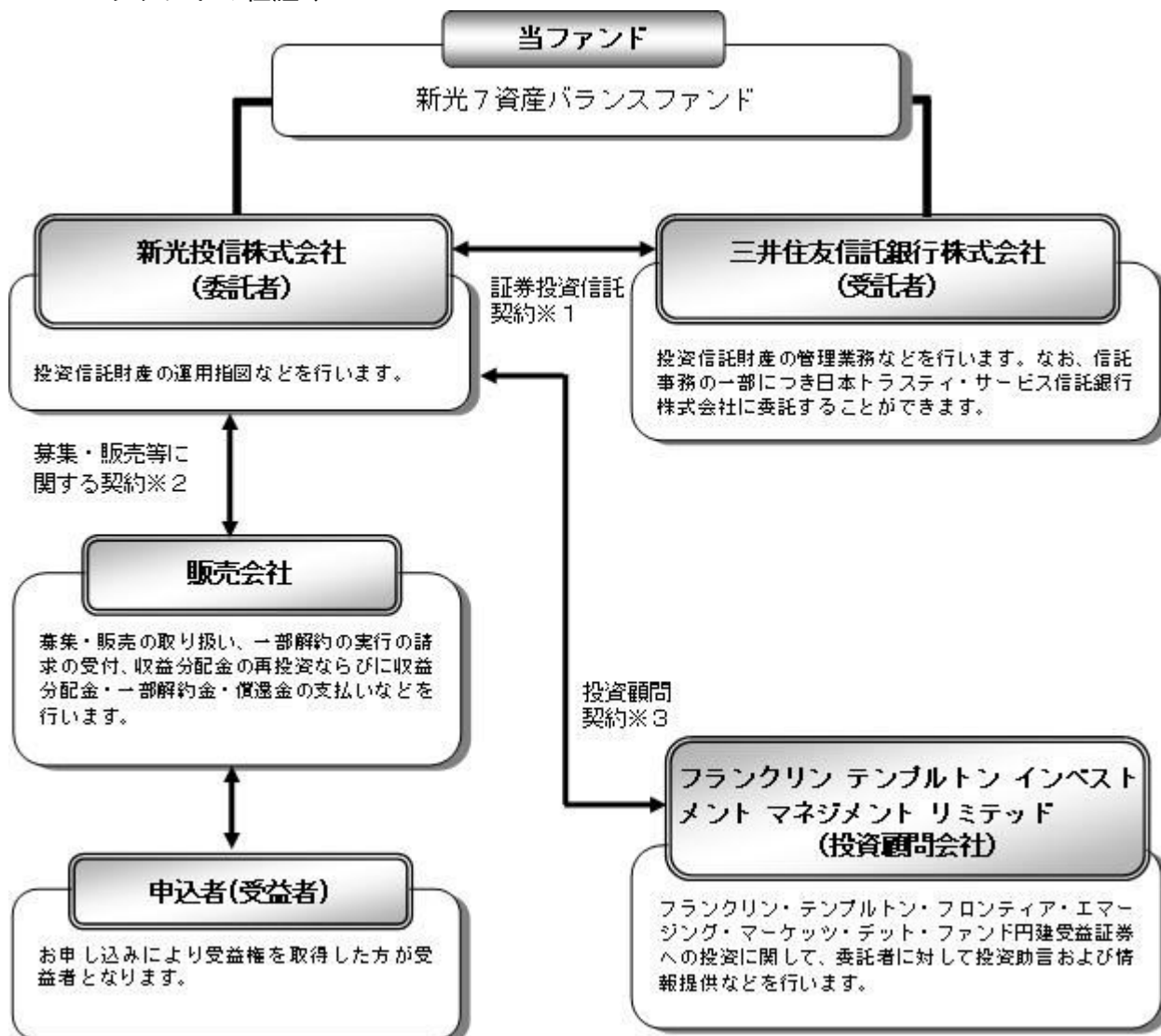
関東財務局長に対して有価証券届出書提出

平成18年10月31日

投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

### a. ファンドの仕組み



### 1 証券投資信託契約

委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・

管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

## 2 募集・販売等に関する契約

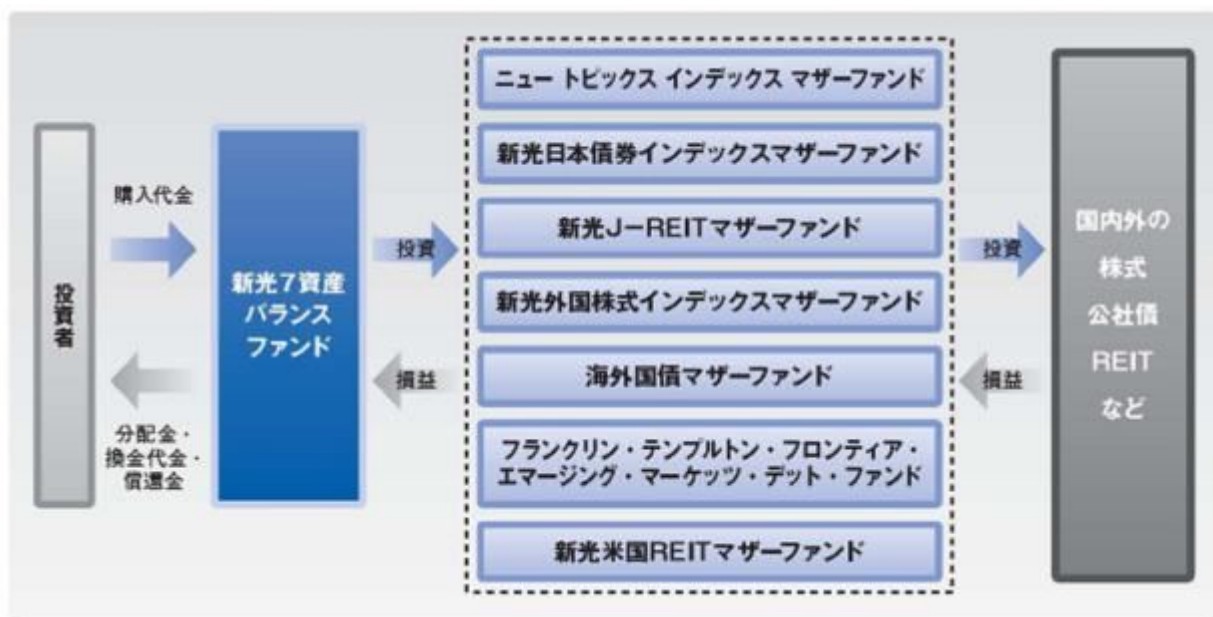
委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

## 3 投資顧問契約

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

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

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



## b. 委託会社の概況

### (イ) 資本金の額（平成27年10月末現在）

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

### (ロ) 委託会社の沿革

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

### (ハ) 大株主の状況

（平成27年10月末現在）

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### a. 基本方針

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

#### b. 運用の方法

##### (イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

##### (ロ) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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



## （八）主な投資制限

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

### a．投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

### b．運用の指図範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

8．コマーシャル・ペーパー

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

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

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

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

## 当ファンドが投資する投資信託証券の概要

### 1．ニュー トピックス インデックス マザーファンドの概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年1月14日

収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成14年1月15日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

#### 東証株価指数について

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

## 2. 新光日本債券インデックスマザーファンドの概要

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



## NOMURA - B P I総合について

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

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

### 3. 新光J - R E I Tマザーファンドの概要

ファンド名	新光J - R E I Tマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として東証R E I T指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証R E I T指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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R E I T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。</li> <li>・外貨建資産への直接投資は行いません。</li> </ul>
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）
収益配分方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成18年10月31日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

### 東証R E I T指数（配当込み）について

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

#### 4．新光外国株式インデックスマザーファンドの概要

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成17年8月17日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

#### MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

#### 5．海外国債マザーファンドの概要

ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託

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

#### シティ世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）について

シティ世界国債インデックスとは、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均して指数化したもので、Citigroup Index LLCが開発した指数です。

同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産です。同社は、各指数の算出、公表、利用など各指数に関する一切の権利を有しています。同社は、当ファンドの運用成績などに関する一切の責任を負いません。

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

ファンド名	フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド （以下、当概要において「ファンド」といいます。）
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。

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

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（F T I M L社）は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンプルトン インベストメンツ（設立：1947年、運用総資産：約92.3兆円）の一員です。F T I M L社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2015年9月末現在、1米ドル=119.765円で換算

### 7. 新光米国R E I Tマザーファンドの概要

ファンド名	新光米国R E I Tマザーファンド
形態	親投資信託

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。</li> <li>・REITの組入比率は原則として高位を保ちます。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・REITおよび短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。</li> <li>・REITへの投資割合には制限を設けません。</li> <li>・同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成18年10月31日
委託会社	新光投信株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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

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

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

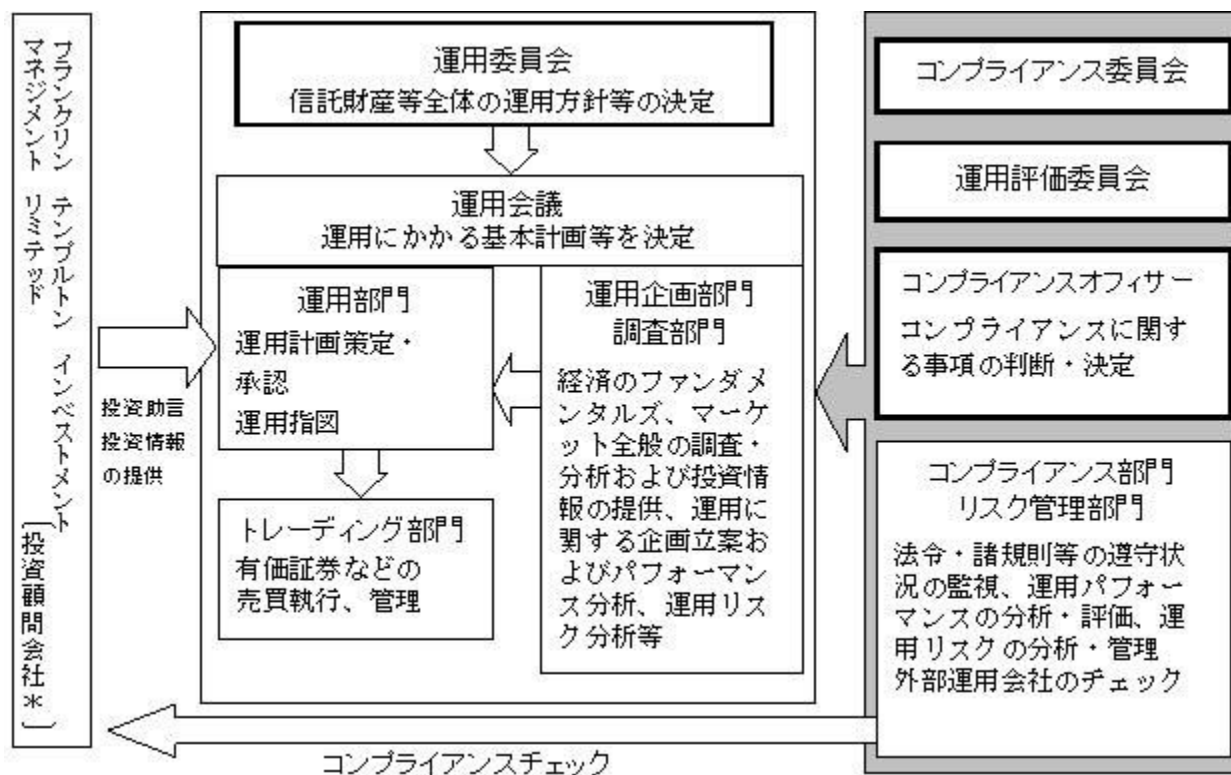
FTSE<sup>(R)</sup>は、London Stock Exchange PlcおよびThe Financial Times Limitedの登録商標であり、許諾のもとにFTSEにより使用されます。NAREIT<sup>(R)</sup>は、全米不動産投資信託協会の登録商標です。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成28年1月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

### （3）【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



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

上記運用体制は、今後変更になることがあります。

#### PLAN

- 運用委員会において決定された信託財産等全体の運用方針等に基づき、運用会議を運用部署全体（運用部門、運用企画部門、調査部門）で開催し、運用にかかる基本計画を決定します。
- 運用担当者はこの運用の基本計画を踏まえ、投資顧問会社からの投資助言および提供された情報等を参考に運用計画を作成します。
- 運用計画は運用調査本部長および副本部長により承認されます。

#### DO

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

#### SEE

- コンプライアンス部門・リスク管理部門（20名程度）は日々の運用指図および売買執行について法令・諸規則等の遵守状況の点検を行い、必要に応じて運用部門を牽制します。
- リスク管理部門は日々の運用リスク等の分析・管理のほか、投資信託財産のパフォーマンス分析を行います。
- コンプライアンス部門・リスク管理部門およびコンプライアンスオフィサー（1名）は、原則として3ヵ月毎に開催されるコンプライアンス委員会、運用評価委員会において運用成果、法令・諸規則等の遵守状況、運用リスク管理状況等について検証・報告を行います。
- コンプライアンス部門は、投資信託証券の運用会社に対して、継続的なコンプライアンスチェックを行っております。

< 受託者に対する管理体制 >

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

b．運用体制に関する社内規則

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

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

(4)【分配方針】

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

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

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

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

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

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

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

(5)【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

c．公社債の借り入れ

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借り入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借り入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 借り入れの指図は、当該借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d．同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

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

f．外国為替予約の指図

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

g．資金の借り入れ

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借り入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

h．受託者の自己または利害関係人等との取引

- (イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図によ



り、受託者および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に定める範囲内での資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

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

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】

#### (1) ファンドのもつリスク

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

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

a . 資産配分リスク

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

b . 株価変動リスク

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

c . REITの価格変動リスク

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

d . 為替変動リスク

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

することがあります。その場合、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

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

#### e．カントリーリスク

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

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

#### f．金利変動リスク

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

#### g．信用リスク

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

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

#### h．流動性リスク

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

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

#### i．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

(イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

(ロ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。

(ハ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。

(ニ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。

(ホ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入る有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。

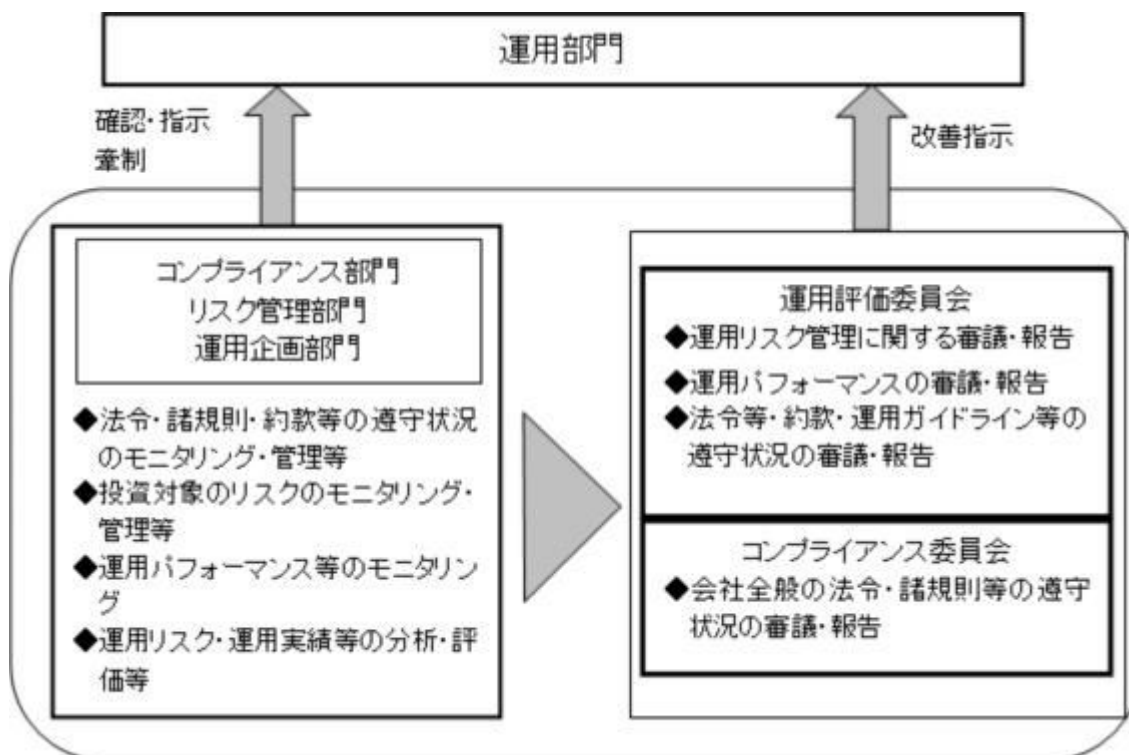
（ヘ）証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。

（ト）投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券（ベビーファンド）が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券（ベビーファンド）の価額が変動する可能性があります。

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

## （２）リスク管理体制

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



上記リスク管理体制は、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

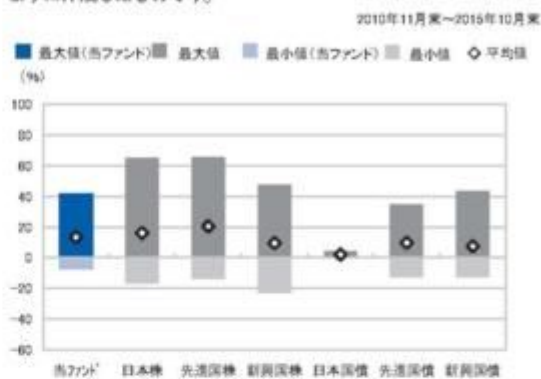


\* 分配金再投資基準価額は、2010年11月末の基準価額を10,000として指数化しております。

\* 年間騰落率は、2010年11月から2015年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	42.1	65.0	65.7	47.4	4.5	34.9	43.7
最小値	△7.2	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△12.7	△12.4
平均値	13.5	16.2	20.6	9.6	2.3	10.0	7.6

\* 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。

\* 2010年11月から2015年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

\* 決算日に対応した数値とは異なります。

\* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

\* 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。

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

## （2）【換金（解約）手数料】

### a．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

### b．信託財産留保額

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

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

## （3）【信託報酬等】

日々のファンドの純資産総額に年率1.026%（税抜0.95%）を乗じて得た額とします。

なお、投資対象とする投資信託証券の信託報酬を含めた実質的な信託報酬の総額は、ファンドの純資産総額に対して年率1.10465%（税抜1.02865%）程度となります。

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産から支払われます。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< ファンド・オブ・ファンズの信託報酬の配分 >

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

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

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

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

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

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

a. 個人の受益者の場合

(イ) 収益分配金の取扱い

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

( 配当控除の適用はありません。 ) ・ 申告分離課税のいずれかを選択することもできます。

( 口 ) 一部解約金・償還金の取り扱い

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

( 八 ) 損益通算について

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 少額投資非課税制度「愛称：N I S A ( ニーサ ) 」をご利用の場合 >

少額投資非課税制度「N I S A ( 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。N I S A 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。

b . 法人の受益者の場合

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

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

なお、益金不算入制度は適用されません。

c . 個別元本について

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

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

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

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

d . 収益分配金の課税について

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

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

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

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

上記は平成28年1月1日現在のものです。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10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	942,645,000	13.49
親投資信託受益証券	日本	5,878,540,251	84.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		165,263,053	2.36
純資産総額		6,986,448,304	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10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	17,630,207,593	43.09
	カナダ	609,125,717	1.48
	ドイツ	3,640,181,309	8.89
	イタリア	6,916,484,635	16.90
	フランス	6,725,628,094	16.43
	イギリス	4,786,993,009	11.70



	小計	40,308,620,357	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		604,356,291	1.47
純資産総額		40,912,976,648	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10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	12,640,100,990	95.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		663,259,124	4.98
純資産総額		13,303,360,114	100.00

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

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成27年10月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	6,166,327,088	51.07
	カナダ	406,736,708	3.36
	モーリシャス	809,078	0.00
	パナマ	7,630,163	0.06
	ドイツ	395,824,839	3.27
	イタリア	102,029,788	0.84
	フランス	406,362,369	3.36
	オランダ	171,883,161	1.42
	スペイン	150,397,866	1.24
	ベルギー	60,193,505	0.49
	オーストリア	8,533,190	0.07
	ルクセンブルグ	11,633,377	0.09
	フィンランド	39,998,890	0.33
	アイルランド	177,569,450	1.47
	ポルトガル	7,218,348	0.05
	イギリス	771,750,250	6.39
	スイス	505,460,956	4.18
	スウェーデン	143,462,642	1.18
	ノルウェー	27,120,525	0.22
	デンマーク	83,800,091	0.69
ケイマン諸島	30,811,039	0.25	
リベリア	5,850,622	0.04	

	オーストラリア	255,482,974	2.11
	バミューダ諸島	43,637,849	0.36
	ニュージーランド	6,883,732	0.05
	香港	116,891,619	0.96
	シンガポール	68,230,745	0.56
	イスラエル	31,959,910	0.26
	キュラソー	33,935,086	0.28
	ジャージー	41,975,353	0.34
	英ヴァージン諸島	2,610,113	0.02
	マン島	1,461,268	0.01
	小計	10,284,472,594	85.17
投資信託受益証券	シンガポール	1,251,919	0.01
投資証券	アメリカ	201,480,250	1.66
	カナダ	2,150,473	0.01
	フランス	16,090,385	0.13
	イギリス	15,515,509	0.12
	オーストラリア	24,812,896	0.20
	香港	5,880,817	0.04
	シンガポール	4,783,873	0.03
	小計	270,714,203	2.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,517,375,618	12.56
純資産総額		12,073,814,334	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10月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	13,011,429,700	79.62
地方債証券	日本	1,192,507,600	7.29
特殊債券	日本	1,323,428,600	8.09
社債券	日本	737,510,000	4.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		75,309,382	0.46
純資産総額		16,340,185,282	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10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	2,140,366,435	97.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		45,907,731	2.09
純資産総額		2,186,274,166	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10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	996,705,959	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,551,487	1.14
純資産総額		1,008,257,446	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10月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	新光J-REITマザーファンド	659,199,851	1.4944	985,108,257	1.5257	1,005,741,212	14.39
2	日本	親投資信託 受益証券	新光米国REITマザーファンド	661,059,740	1.5010	992,250,669	1.5168	1,002,695,413	14.35
3	日本	親投資信託 受益証券	ニュー トビックス インデック ス マザーファンド	510,414,876	1.8493	943,910,230	1.9222	981,119,474	14.04
4	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式インデックスマザー ファンド	497,173,395	1.9125	950,844,117	1.9660	977,442,894	13.99
5	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	786,651,829	1.2172	957,512,606	1.2185	958,535,253	13.71
6	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	408,157,097	2.3492	958,842,653	2.3349	953,006,005	13.64
7	ケイマン 諸島	投資信託受 益証券	フランクリン・テンブルトン・フ ロンティア・エマージング・マー ケッツ・デット・ファンド	165,000	5.641	930,765,000	5.713	942,645,000	13.49

(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10月30日現在)

種類	投資比率(%)
----	---------

投資信託受益証券	13.49
親投資信託受益証券	84.14
合計	97.63

## (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10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	13,700,000	12,428.06	1,702,644,616	12,338.4117	1,690,362,412	2.3750	2024.08.15	4.13
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,400,000	12,552.43	1,682,026,389	12,473.4796	1,671,446,278	2.5000	2024.05.15	4.08
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,700,000	12,547.95	1,719,069,298	12,193.8984	1,670,564,085	2.2500	2024.11.15	4.08
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,800,000	11,987.40	1,654,261,477	12,037.1062	1,661,120,662	2.1250	2025.05.15	4.06
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,700,000	11,986.52	1,642,153,625	11,922.8180	1,633,426,070	2.0000	2025.02.15	3.99
6	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	8,900,000	17,008.33	1,513,741,822	17,245.2887	1,534,830,703	4.2500	2023.10.25	3.75
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,900,000	12,796.54	1,522,789,243	12,738.8930	1,515,928,268	2.7500	2023.11.15	3.70
8	イギリス	国債証券	TSY	7,000,000	19,678.04	1,377,463,459	19,942.2169	1,395,955,184	2.7500	2024.09.07	3.41
9	イギリス	国債証券	TSY	7,000,000	18,842.76	1,318,993,306	19,279.0768	1,349,535,381	2.2500	2023.09.07	3.29
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,300,000	12,721.59	1,310,324,023	12,727.5586	1,310,938,541	2.7500	2024.02.15	3.20
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,500,000	12,007.38	1,260,775,179	12,141.0046	1,274,805,490	2.0000	2023.02.15	3.11
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,700,000	11,785.38	1,261,035,663	11,881.2586	1,271,294,676	1.7500	2023.05.15	3.10
13	イギリス	国債証券	TSY	5,000,000	24,216.26	1,210,813,419	23,662.6234	1,183,131,171	5.0000	2025.03.07	2.89
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	12,485.69	1,136,198,668	12,529.2070	1,140,157,844	2.5000	2023.08.15	2.78
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	11,947.18	1,123,035,377	11,902.0383	1,118,791,604	2.0000	2025.08.15	2.73
16	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,000,000	14,255.95	997,917,060	14,553.9503	1,018,776,527	1.7500	2023.05.25	2.49
17	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,800,000	14,285.20	971,393,697	14,498.1576	985,874,717	1.7500	2024.11.25	2.40
18	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000	17,719.02	974,546,122	17,350.2324	954,262,782	5.0000	2025.03.01	2.33
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000	16,031.06	913,770,493	16,731.1980	953,678,286	4.7500	2023.08.01	2.33
20	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,300,000	14,626.96	921,498,859	15,095.9376	951,044,069	2.2500	2024.05.25	2.32
21	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,800,000	12,723.34	865,187,585	13,020.9768	885,426,423	0.5000	2025.05.25	2.16
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000	15,759.02	835,228,312	16,571.7900	878,304,870	4.5000	2024.03.01	2.14
23	イギリス	国債証券	TSY	4,600,000	18,913.48	870,020,439	18,660.2450	858,371,273	2.0000	2025.09.07	2.09

24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,900,000	16,634.94	815,112,085	17,198.7948	842,740,946	5.5000	2022.11.01	2.05
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	11,742.48	833,716,199	11,860.4789	842,094,005	1.6250	2022.11.15	2.05
26	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,600,000	14,675.36	821,820,505	15,004.2780	840,239,568	2.2500	2022.10.25	2.05
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000	14,923.11	686,463,453	15,837.1848	728,510,501	3.7500	2024.09.01	1.78
28	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,200,000	15,727.99	660,575,593	16,412.3820	689,320,044	4.5000	2023.05.01	1.68
29	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000	14,269.31	670,657,619	14,471.5895	680,164,711	2.5000	2024.12.01	1.66
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,192.76	609,638,250	12,148.5609	607,428,047	2.0000	2016.01.31	1.48

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年10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10月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.52
合計	98.52

(参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年10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	70,400	7,403.83	521,229,632	7,469.00	525,817,600	3.95
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	437,500	627.46	274,513,750	790.60	345,887,500	2.60
3	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	43,700	4,088.16	178,652,700	4,860.00	212,382,000	1.59
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	30,900	6,953.99	214,878,500	6,797.00	210,027,300	1.57
5	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	49,700	3,562.83	177,072,651	4,044.00	200,986,800	1.51
6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	767,900	197.78	151,875,262	250.30	192,205,370	1.44
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	42,100	3,295.08	138,722,868	4,486.00	188,860,600	1.41
8	日本	株式	KDDI	情報・通信業	55,400	2,556.04	141,604,616	2,946.00	163,208,400	1.22
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	36,600	3,282.22	120,129,252	4,211.00	154,122,600	1.15
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	23,000	5,185.20	119,259,800	5,930.00	136,390,000	1.02
11	日本	株式	ソニー	電気機器	39,000	2,558.74	99,790,860	3,480.00	135,720,000	1.02

12	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	22,800	4,233.18	96,516,504	5,511.00	125,650,800	0.94
13	日本	株式	ファナック	電気機器	5,700	18,976.84	108,167,988	21,555.00	122,863,500	0.92
14	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	10,100	9,055.91	91,464,691	11,570.00	116,857,000	0.87
15	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	64,800	1,732.68	112,277,664	1,765.00	114,372,000	0.85
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	4,900	18,207.25	89,215,525	22,200.00	108,780,000	0.81
17	日本	株式	キヤノン	電気機器	29,700	3,736.95	110,987,415	3,640.00	108,108,000	0.81
18	日本	株式	三菱地所	不動産業	41,000	2,399.11	98,363,510	2,607.00	106,887,000	0.80
19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	22,100	3,849.22	85,067,762	4,692.00	103,693,200	0.77
20	日本	株式	村田製作所	電気機器	5,800	13,401.77	77,730,266	17,355.00	100,659,000	0.75
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	141,000	859.13	121,138,400	702.90	99,108,900	0.74
22	日本	株式	N T Tドコモ	情報・通信業	42,000	1,918.36	80,571,120	2,357.50	99,015,000	0.74
23	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	77,500	1,003.55	77,775,125	1,266.50	98,153,750	0.73
24	日本	株式	花王	化学	15,600	4,943.86	77,124,216	6,239.00	97,328,400	0.73
25	日本	株式	三井不動産	不動産業	29,000	3,094.26	89,733,540	3,310.00	95,990,000	0.72
26	日本	株式	パナソニック	電気機器	63,100	1,339.72	84,536,332	1,435.00	90,548,500	0.68
27	日本	株式	三菱商事	卸売業	40,900	2,064.33	84,431,097	2,212.50	90,491,250	0.68
28	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	19,500	4,256.38	82,999,410	4,476.00	87,282,000	0.65
29	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	17,500	4,163.03	72,853,025	4,728.00	82,740,000	0.62
30	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	52,501.84	68,252,400	63,580.00	82,654,000	0.62

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成27年10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	0.07
		鉱業	0.33
		建設業	2.70
		食料品	4.13
		繊維製品	0.67
		パルプ・紙	0.26
		化学	5.69
		医薬品	4.80
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	0.87
		鉄鋼	1.16
		非鉄金属	0.86
		金属製品	0.61
		機械	4.32
		電気機器	11.39
輸送用機器	10.27		

	精密機器	1.42
	その他製品	1.53
	電気・ガス業	2.16
	陸運業	4.18
	海運業	0.25
	空運業	0.64
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	6.94
	卸売業	3.90
	小売業	4.41
	銀行業	8.90
	証券、商品先物取引業	1.20
	保険業	2.45
	その他金融業	1.31
	不動産業	2.75
	サービス業	3.15
合計		95.01

## (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10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	16,186	13,179.30	213,320,295	14,572.0769	235,863,638	1.95
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	21,592	5,885.41	127,077,816	6,451.2240	139,294,829	1.15
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	11,747	11,677.73	137,178,306	9,941.6069	116,784,057	0.96
4	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	11,010	8,673.25	95,492,561	9,290.2399	102,285,542	0.84
5	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO (US)	資本財	28,309	3,192.96	90,389,760	3,547.2060	100,417,855	0.83
6	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,791	13,081.38	101,917,032	12,255.6330	95,483,637	0.79
7	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	13,744	6,509.25	89,463,214	6,660.3809	91,540,276	0.75
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	7,768	11,078.12	86,054,883	11,038.2720	85,745,297	0.71
9	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,112	36,253.07	40,313,418	75,749.8947	84,233,883	0.69
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	10,427	7,431.72	77,490,576	7,883.8890	82,205,311	0.68

11	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	2,399	34,179.40	81,996,384	32,796.9920	78,679,984	0.65
12	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェ ア・サービ ス	6,003	9,162.63	55,003,271	12,679.9920	76,117,992	0.63
13	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェ ア・サービ ス	866	65,252.14	56,508,360	86,675.6281	75,061,094	0.62
14	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェ ア・サービ ス	810	66,715.03	54,039,181	90,052.3654	72,942,416	0.60
15	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	17,301	3,617.32	62,583,392	4,203.6930	72,728,093	0.60
16	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	7,622	10,775.81	82,133,278	9,311.7180	70,973,915	0.58
17	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	17,272	4,152.91	71,729,148	4,056.1949	70,058,600	0.58
18	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信 サービス	11,459	6,148.97	70,461,093	5,609.7600	64,282,240	0.53
19	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	4,529	10,881.00	49,280,049	13,908.3360	62,990,854	0.52
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	29,507	2,098.82	61,930,000	2,066.1810	60,966,803	0.50
21	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバコ	11,634	5,116.48	59,525,221	5,173.3109	60,186,300	0.49
22	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	5,283	14,362.91	75,879,306	10,867.7009	57,414,064	0.47
23	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	8,525	6,498.37	55,398,647	6,487.4939	55,305,886	0.45
24	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	13,329	4,059.82	54,113,368	4,114.2270	54,838,532	0.45
25	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	3,276	17,362.44	56,879,383	16,670.9010	54,613,872	0.45
26	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	3,650	11,805.88	43,091,481	14,946.8671	54,556,065	0.45
27	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	4,129	12,869.80	53,139,425	13,203.4889	54,517,206	0.45
28	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	7,938	7,174.20	56,948,847	6,633.7829	52,658,969	0.43
29	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	5,500	7,628.79	41,958,346	9,491.8590	52,205,225	0.43
30	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバコ	4,147	11,703.11	48,532,838	12,428.5198	51,541,072	0.42

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年10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。

#### □.種類別及び業種別の投資比率

(平成27年10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	6.22



	素材	3.96
	資本財	6.23
	商業・専門サービス	0.76
	運輸	1.69
	自動車・自動車部品	1.47
	耐久消費財・アパレル	1.65
	消費者サービス	1.60
	メディア	2.69
	小売	3.47
	食品・生活必需品小売り	1.84
	食品・飲料・タバコ	5.45
	家庭用品・パーソナル用品	1.87
	ヘルスケア機器・サービス	3.06
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.94
	銀行	7.97
	各種金融	3.61
	保険	3.90
	不動産	0.65
	ソフトウェア・サービス	7.20
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.79
	電気通信サービス	2.71
	公益事業	2.80
	半導体・半導体製造装置	1.53
投資信託受益証券		0.01
投資証券		2.24
合計		87.43

（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10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)	280,000,000	100.76	282,128,700	100.45	281,260,000	0.4000	2016.12.20	1.72
2	日本	国債証券	第103回利付 国債(5年)	260,000,000	100.58	261,512,200	100.41	261,068,600	0.3000	2017.03.20	1.59
3	日本	国債証券	第308回利付 国債(10年)	220,000,000	106.42	234,129,000	105.84	232,848,000	1.3000	2020.06.20	1.42
4	日本	国債証券	第105回利付 国債(5年)	220,000,000	100.41	220,909,000	100.32	220,712,800	0.2000	2017.06.20	1.35
5	日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	200,000,000	106.74	213,481,500	105.98	211,964,000	1.4000	2020.03.20	1.29
6	日本	国債証券	第323回利付 国債(10年)	200,000,000	104.68	209,365,500	105.47	210,946,000	0.9000	2022.06.20	1.29

7	日本	国債証券	第334回利付 国債（10年）	200,000,000	101.56	203,134,000	103.39	206,782,000	0.6000	2024.06.20	1.26
8	日本	国債証券	第313回利付 国債（10年）	190,000,000	107.03	203,368,900	106.72	202,779,400	1.3000	2021.03.20	1.24
9	日本	国債証券	第123回利付 国債（5年）	190,000,000	100.01	190,037,600	100.32	190,621,300	0.1000	2020.03.20	1.16
10	日本	国債証券	第303回利付 国債（10年）	180,000,000	106.20	191,161,800	105.34	189,621,000	1.4000	2019.09.20	1.16
11	日本	国債証券	第335回利付 国債（10年）	180,000,000	101.01	181,833,100	102.48	184,467,600	0.5000	2024.09.20	1.12
12	日本	国債証券	第315回利付 国債（10年）	170,000,000	106.64	181,302,300	106.45	180,965,000	1.2000	2021.06.20	1.10
13	日本	国債証券	第124回利付 国債（5年）	180,000,000	100.06	180,121,700	100.32	180,581,400	0.1000	2020.06.20	1.10
14	日本	国債証券	第285回利付 国債（10年）	170,000,000	103.93	176,689,500	102.33	173,966,100	1.7000	2017.03.20	1.06
15	日本	国債証券	第338回利付 国債（10年）	170,000,000	100.22	170,379,700	101.32	172,255,900	0.4000	2025.03.20	1.05
16	日本	国債証券	第118回利付 国債（5年）	160,000,000	100.42	160,673,700	100.68	161,100,800	0.2000	2019.06.20	0.98
17	日本	国債証券	第312回利付 国債（10年）	150,000,000	106.22	159,331,400	105.93	158,901,000	1.2000	2020.12.20	0.97
18	日本	国債証券	第310回利付 国債（10年）	150,000,000	105.01	157,518,700	104.69	157,047,000	1.0000	2020.09.20	0.96
19	日本	国債証券	第122回利付 国債（5年）	150,000,000	100.17	150,269,000	100.32	150,493,500	0.1000	2019.12.20	0.92
20	日本	国債証券	第290回利付 国債（10年）	140,000,000	104.53	146,344,400	103.30	144,632,600	1.4000	2018.03.20	0.88
21	日本	国債証券	第117回利付 国債（5年）	140,000,000	100.43	140,611,900	100.64	140,896,000	0.2000	2019.03.20	0.86
22	日本	国債証券	第116回利付 国債（5年）	140,000,000	100.47	140,658,000	100.59	140,830,200	0.2000	2018.12.20	0.86
23	日本	国債証券	第106回利付 国債（5年）	140,000,000	100.42	140,598,800	100.37	140,525,000	0.2000	2017.09.20	0.85
24	日本	国債証券	第293回利付 国債（10年）	130,000,000	106.25	138,131,500	104.71	136,123,000	1.8000	2018.06.20	0.83
25	日本	国債証券	第114回利付 国債（5年）	130,000,000	100.88	131,148,000	100.83	131,084,200	0.3000	2018.09.20	0.80
26	日本	国債証券	第109回利付 国債（5年）	130,000,000	100.16	130,217,100	100.22	130,292,500	0.1000	2018.03.20	0.79
27	日本	国債証券	第332回利付 国債（10年）	120,000,000	101.89	122,268,000	103.52	124,234,800	0.6000	2023.12.20	0.76
28	日本	地方債証券	第18回東京都 公募公債（20 年）	100,000,000	118.47	118,470,000	119.67	119,670,000	2.2200	2029.03.19	0.73
29	日本	特殊債券	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	116.84	116,840,000	119.05	119,050,000	2.1000	2029.12.28	0.72
30	日本	国債証券	第318回利付 国債（10年）	110,000,000	105.37	115,907,400	105.53	116,088,500	1.0000	2021.09.20	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。

#### 口.種類別投資比率

(平成27年10月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.62
地方債証券	7.29
特殊債券	8.09

社債券	4.51
合計	99.53

## (参考) 新光J - R E I T マザーファンド

## イ. 評価額上位銘柄明細

(平成27年10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	292	571,274.39	166,812,123	575,000	167,900,000	7.67
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	271	558,214.16	151,276,040	560,000	151,760,000	6.94
3	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	527	229,831.81	121,121,364	234,600	123,634,200	5.65
4	日本	投資証券	野村不動産マスタ - ファンド投資法人	752.15	146,468.94	110,166,541	152,900	115,003,735	5.26
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	568	167,149.51	94,940,925	168,100	95,480,800	4.36
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	479	156,794.15	75,104,398	163,000	78,077,000	3.57
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	358	215,626.52	77,194,295	213,300	76,361,400	3.49
8	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	180	392,554.29	70,659,773	394,500	71,010,000	3.24
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	269	255,718.88	68,788,379	258,500	69,536,500	3.18
10	日本	投資証券	G L P 投資法人	536	118,276.35	63,396,128	120,400	64,534,400	2.95
11	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	100	617,779.88	61,777,988	619,000	61,900,000	2.83
12	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	115	509,961.71	58,645,597	514,000	59,110,000	2.70
13	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	273	205,627.61	56,136,338	214,400	58,531,200	2.67
14	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	650	80,780.03	52,507,025	84,100	54,665,000	2.50
15	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	102	474,816.5	48,431,283	490,000	49,980,000	2.28
16	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	324	145,863.49	47,259,772	150,000	48,600,000	2.22
17	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	660	70,376.96	46,448,794	71,900	47,454,000	2.17
18	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	84	559,082.22	46,962,907	555,000	46,620,000	2.13
19	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	100	415,606.77	41,560,677	417,500	41,750,000	1.90
20	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	182	220,450.23	40,121,943	226,400	41,204,800	1.88
21	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	73	534,080.35	38,987,866	548,000	40,004,000	1.82

22	日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	154	243,051	37,429,855	245,200	37,760,800	1.72
23	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	72	471,493.41	33,947,526	487,000	35,064,000	1.60
24	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	261	132,095.54	34,476,938	132,700	34,634,700	1.58
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人	225	138,515.59	31,166,008	144,400	32,490,000	1.48
26	日本	投資証券	プレミア投資法人	272	120,153.1	32,681,645	118,800	32,313,600	1.47
27	日本	投資証券	福岡リート投資法人	154	189,351.41	29,160,118	197,500	30,415,000	1.39
28	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	202	145,455.2	29,381,951	146,800	29,653,600	1.35
29	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	339	79,735.75	27,030,420	81,000	27,459,000	1.25
30	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	161	147,285.87	23,713,026	159,000	25,599,000	1.17

(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10月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	97.90
合計	97.90

#### (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10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	3,040	24,496.05	74,468,016	24,710.7509	75,120,683	7.45
2	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	4,100	11,701.91	47,977,835	12,326.9639	50,540,552	5.01
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	1,400	27,313.72	38,239,219	27,674.0100	38,743,614	3.84
4	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3,300	9,993.04	32,977,047	10,357.5030	34,179,760	3.38
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	3,500	9,687.71	33,907,010	9,447.1260	33,064,941	3.27
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,300	22,397.93	29,117,314	21,514.1546	27,968,401	2.77
7	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3,400	8,479.92	28,831,748	8,094.2550	27,520,467	2.72
8	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	5,100	5,114.07	26,081,757	5,218.0439	26,612,024	2.63
9	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1,500	15,003.69	22,505,535	14,844.1020	22,266,153	2.20
10	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	600	35,146.83	21,088,103	35,412.8183	21,247,691	2.10
11	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	3,200	7,015.82	22,450,646	6,634.9918	21,231,974	2.10
12	アメリカ	投資証券	HCP INC	4,500	4,749.81	21,374,153	4,623.2160	20,804,472	2.06
13	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1,700	12,121.43	20,606,438	12,174.6300	20,696,871	2.05
14	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	5,100	3,536.23	18,034,774	3,526.6529	17,985,930	1.78

15	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	640	28,698.52	18,367,055	27,353.6250	17,506,320	1.73
16	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	4,900	3,359.81	16,463,073	3,510.9359	17,203,586	1.70
17	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	1,500	10,154.39	15,231,586	10,374.4286	15,561,643	1.54
18	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	7,400	2,138.05	15,821,578	2,084.3159	15,423,938	1.52
19	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	1,000	14,387.10	14,387,100	14,408.8620	14,408,862	1.42
20	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2,300	5,909.59	13,592,062	6,006.3121	13,814,518	1.37
21	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	4,000	3,165.16	12,660,648	3,277.5990	13,110,396	1.30
22	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	700	17,563.14	12,294,200	17,358.8214	12,151,175	1.20
23	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,300	8,652.81	11,248,657	8,686.6653	11,292,665	1.12
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	2,600	4,396.38	11,430,612	4,252.0530	11,055,338	1.09
25	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,100	9,616.38	10,578,025	9,769.9290	10,746,922	1.06
26	アメリカ	投資証券	VEREIT INC	8,800	1,020.36	8,979,243	1,013.1420	8,915,650	0.88
27	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	3,400	2,544.69	8,651,966	2,531.6458	8,607,596	0.85
28	アメリカ	投資証券	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	1,700	4,972.61	8,453,449	4,935.1382	8,389,735	0.83
29	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE	700	11,414.16	7,989,918	10,918.4785	7,642,935	0.75
30	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORPORATION	900	8,076.12	7,268,508	8,276.8144	7,449,133	0.73

(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10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10月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.85
合計	98.85

#### 【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10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	42	日本円	621,175,360	654,570,000	4.92

（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10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	83	米ドル	8,094,761.5	978,656,665	8,644,450	1,045,114,005	8.65
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 601X	買建	2	カナダドル	315,008	28,964,986	324,760	29,861,682	0.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO ST50	買建	40	ユーロ	1,260,600	167,458,104	1,361,200	180,821,808	1.49
	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	378,661	32,553,486	393,000	33,786,210	0.27
	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	18	英ポンド	1,102,478	204,388,396	1,146,060	212,468,063	1.75

（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10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
第18特定期間末（平成27年10月20日）	6,937,097,365	6,952,525,025	0.8993	0.9013
平成26年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
5月末日	7,743,855,118		0.9554
6月末日	7,417,352,476		0.9279
7月末日	7,427,081,272		0.9388
8月末日	7,009,215,823		0.8938
9月末日	6,751,169,555		0.8709
10月末日	6,986,448,304		0.9123

(注)表中の(分配)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
第18特定期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	0.0120

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

### 【収益率の推移】

#### 新光7資産バランスファンド



期	計算期間	収益率（％）
第1特定期間	平成18年10月31日～平成19年 4月20日	10.4
第2特定期間	平成19年 4月21日～平成19年10月22日	6.0
第3特定期間	平成19年10月23日～平成20年 4月21日	7.8
第4特定期間	平成20年 4月22日～平成20年10月20日	25.3
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年 4月20日	4.4
第6特定期間	平成21年 4月21日～平成21年10月20日	13.2
第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年 4月20日	7.0
第8特定期間	平成22年 4月21日～平成22年10月20日	5.7
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年 4月20日	6.7
第10特定期間	平成23年 4月21日～平成23年10月20日	9.8
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年 4月20日	12.0
第12特定期間	平成24年 4月21日～平成24年10月22日	1.8
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年 4月22日	33.6
第14特定期間	平成25年 4月23日～平成25年10月21日	0.1
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年 4月21日	4.7
第16特定期間	平成26年 4月22日～平成26年10月20日	5.1
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4月20日	13.9
第18特定期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	1.8

(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
第18特定期間	平成27年 4月21日 ~ 平成27年10月20日	10,689,548	583,223,930

(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10月30日現在

## ＜基準価額・純資産の推移＞（2006年10月31日～2015年10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、15日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10月	20円
2015年9月	20円
2015年8月	20円
2015年7月	20円
2015年6月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	3,200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J-REITマザーファンド	14.39%
新光米国REITマザーファンド	14.35%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	14.04%
新光外国株式インデックスマザーファンド	13.99%
新光日本債券インデックスマザーファンド	13.71%
海外国債マザーファンド	13.64%
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	13.49%
合計	97.63%

## 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	3.95%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.60%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.59%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.57%
本田技研工業	輸送用機器	1.51%

※東証33業種分類にしたがって記載しています。  
 ※純資産比率は、マザーファンドの純資産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%	1.72%
第103回利付国債(5年)	2017/03/20	0.300%	1.59%
第308回利付国債(10年)	2020/06/20	1.300%	1.42%
第105回利付国債(5年)	2017/06/20	0.200%	1.35%
第306回利付国債(10年)	2020/03/20	1.400%	1.29%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

## 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	7.67%
ジャパリアルエステイト投資法人	6.94%
日本リテールファンド投資法人	5.65%
野村不動産マスターファンド投資法人	5.26%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.36%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

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

2015年10月30日現在

## 外国株式等の組入上位5銘柄（新光外国株式インデックスマザーファンド）

銘柄名	国・地域	業種	純資産比率
APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.95%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.15%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	0.96%
NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	0.84%
GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	資本財	0.83%

※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	4.13%
US TREASURY N/B	2024/05/15	2.500%	米ドル	4.08%
US TREASURY N/B	2024/11/15	2.250%	米ドル	4.08%
US TREASURY N/B	2025/05/15	2.125%	米ドル	4.06%
US TREASURY N/B	2025/02/15	2.000%	米ドル	3.99%

※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・エマーシング・マーケット・デット・ファンドの状況（現地2015年10月14日現在）

## ①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	62.6%
ユーロ	4.5%
メキシコペソ	3.7%
インドルピー	3.6%
ウルグアイペソ	3.3%

## ②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
その他(国際機関債)	6.4%
ナイジェリア	6.2%
ロシア	5.9%
トルコ	5.7%
ウクライナ	4.3%

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

## 米国REITの組入上位5銘柄（新光米国REITマザーファンド）

銘柄名	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	7.45%
AMERICAN TOWER CORPORATION	5.01%
PUBLIC STORAGE	3.84%
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3.38%
EQUITY RESIDENTIAL	3.27%

※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。

## &lt;年間収益率の推移&gt;

暦年ベース



※割引後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、年時から10月末までの収益率を記載しています。

・当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。  
 ・表中の純資産比率は小数第2位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。  
 ・最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認ください。

17

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

## 2【換金(解約)手続等】

一部解約(解約請求によるご解約)

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

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

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

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

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

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

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク  
フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

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

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

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

当ファンドの主な投資対象の評価方法は以下のとおりです。

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

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

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

#### b. 投資信託約款の変更

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

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

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

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

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

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

#### c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

#### d. 運用報告書

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



受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

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

e．公告

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

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

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

f．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

g．信託事務処理の再信託

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

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

h．信託業務の委託等

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

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

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

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

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

i．関係法人との契約の更改

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

思表示のないときは自動的に1年間更新されるものとし、その後も同様とします。

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

#### 4【受益者の権利等】

##### a．収益分配金請求権

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

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

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

##### b．一部解約請求権

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

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

##### c．償還金請求権

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

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期特定期間（平成27年4月21日から平成27年10月20日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【新光7資産バランスファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期特定期間末 平成27年 4月20日現在	第18期特定期間末 平成27年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	215,640,249	173,670,989
投資信託受益証券	1,035,448,000	930,765,000
親投資信託受益証券	6,478,161,182	5,862,446,488
未収利息	224	255
流動資産合計	7,729,249,655	6,966,882,732
資産合計		
	7,729,249,655	6,966,882,732
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	16,572,729	15,427,660
未払解約金	13,243,800	9,310,720
未払受託者報酬	570,669	421,903
未払委託者報酬	6,206,022	4,588,176
その他未払費用	49,924	36,908
流動負債合計	36,643,144	29,785,367
負債合計		
	36,643,144	29,785,367
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,286,364,635	7,713,830,253
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	593,758,124	776,732,888
（分配準備積立金）	219,272,756	231,284,580
元本等合計	7,692,606,511	6,937,097,365
純資産合計		
	7,692,606,511	6,937,097,365
負債純資産合計		
	7,729,249,655	6,966,882,732

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期特定期間		第18期特定期間	
	自	平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日	自	平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
営業収益				
受取配当金		78,075,000		75,337,500
受取利息		49,960		51,373
有価証券売買等損益		1,008,943,027		170,887,694
営業収益合計		1,087,067,987		95,498,821
営業費用				
受託者報酬		3,444,357		3,166,569
委託者報酬		37,457,284		34,436,381
その他費用		245,362		277,014
営業費用合計		41,147,003		37,879,964
営業利益		1,045,920,984		133,378,785
経常利益		1,045,920,984		133,378,785
当期純利益		1,045,920,984		133,378,785
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		13,356,887		2,966,448
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,616,813,740		593,758,124
剰余金増加額又は欠損金減少額		95,757,575		43,294,851
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		95,757,575		43,294,851
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,229,348		880,165
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,229,348		880,165
分配金		104,036,708		94,977,113
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		593,758,124		776,732,888

## （ 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18期特定期間 自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

第17期特定期間末 平成27年 4月20日現在	第18期特定期間末 平成27年10月20日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 8,286,364,635口	1. 特定期間末日における受益権の総数 7,713,830,253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 593,758,124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 776,732,888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)	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 0.8993円 (1万口当たり純資産額) (8,993円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

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	第18期特定期間 自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日

分配金の計算過程	<p>第95期(自平成26年10月21日至平成26年11月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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101期(自平成27年4月21日至平成27年5月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(23,645,360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(3,377,821円)及び分配準備積立金(215,828,082円)より分配対象収益は242,851,263円(1万口当たり298.15円)であり、うち16,289,657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)</p> <p>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102期(自平成27年5月21日至平成27年6月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,376,883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(3,392,953円)及び分配準備積立金(220,639,238円)より分配対象収益は242,409,074円(1万口当たり301.29円)であり、うち16,090,617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)</p> <p>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103期(自平成27年6月23日至平成27年7月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,043,239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(3,387,248円)及び分配準備積立金(220,314,924円)より分配対象収益は241,745,411円(1万口当たり304.35円)であり、うち15,885,181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104期(自平成27年7月22日至平成27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(16,226,591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(3,390,809円)及び分配準備積立金(220,174,451円)より分配対象収益は239,791,851円(1万口当たり305.32円)であり、うち15,706,588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105期(自平成27年8月21日至平成27年9月24日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,549,386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(3,430,102円)及び分配準備積立金(218,981,098円)より分配対象収益は239,960,586円(1万口当たり308.08円)であり、うち15,577,410円(1万口当たり20円)を分配しております。</p>

第100期（自 平成27年 3月21日 至 平成27年 4月20日）	第106期（自 平成27年 9月25日 至 平成27年10月20日）
計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（27,790,274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（3,463,071円）及び分配準備積立金（218,921,966円）より分配対象収益は250,175,311円（1万口当たり324.29円）であり、うち15,427,660円（1万口当たり20円）を分配しております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第17期特定期間 自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日	第18期特定期間 自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、投資信託受益証券、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左



3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

第17期特定期間末 平成27年 4月20日現在	第18期特定期間末 平成27年10月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2.時価の算定方法 投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して おります。</p> <p>親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	第17期特定期間 自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日	第18期特定期間 自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第17期特定期間末 平成27年 4月20日現在	第18期特定期間末 平成27年10月20日現在
期首元本額	9,261,582,919円	8,286,364,635円
期中追加設定元本額	13,815,643円	10,689,548円
期中一部解約元本額	989,033,927円	583,223,930円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第17期特定期間末 平成27年 4月20日現在	第18期特定期間末 平成27年10月20日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当特定期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	14,400,500	9,075,000
親投資信託受益証券	20,548,329	209,074,419
合計	6,147,829	199,999,419

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	165,000	930,765,000	
投資信託受益証券 小計		165,000	930,765,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	439,647,799	1,032,820,609	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	510,414,876	943,910,230	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	497,173,395	950,844,117	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	786,651,829	957,512,606	
	新光J - R E I Tマザーファンド	659,199,851	985,108,257	
	新光米国R E I Tマザーファンド	661,059,740	992,250,669	
親投資信託受益証券 小計		3,554,147,490	5,862,446,488	
合計		3,554,312,490	6,793,211,488	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### (参考)

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

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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

「フランクリン・テンプレート・フロンティア・エマージング・マーケッツ・デット・ファンド」は、ケイマン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの平成27年5月31日現在の財務書類は、国際財務報告基準に従い作成されており、独立監査人の監査を受けております。

同ファンドの財政状態計算書、包括利益計算書、受益証券保有者に帰属する純資産変動計算書、キャッシュ・フロー計算書及び財務書類に対する注記は、同ファンドの副管理事務代行会社であるザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店から入手した財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋したものであります。

(1) 財政状態計算書  
2015年5月31日現在

	注記	2015年5月31日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
<b>資産</b>			
<b>流動資産</b>			
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	4(a)	38,340,660,126	42,740,987,754
ブローカーに対する債権		-	288,324,826
発行に係る未収入金		-	62,340,480
現金および現金同等物	5	4,796,975,748	1,492,885,496
その他の債権	6(d)	8,387,306	6,720,638
<b>資産合計</b>		<b>43,146,023,180</b>	<b>44,591,259,194</b>
<b>負債</b>			
<b>流動負債</b>			
償還に係る未払金		989,922,180	67,437,408
ブローカーに対する債務		54,095,601	99,129,427
未払費用	7	43,262,820	47,134,875
<b>負債合計</b>		<b>1,087,280,601</b>	<b>213,701,710</b>
<b>受益証券保有者に帰属する純資産</b>	8	<b>42,058,742,579</b>	<b>44,377,557,484</b>

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  
2015年5月31日終了会計年度

	注記	2015年5月31日 終了会計年度 (日本円)	2014年5月31日 終了会計年度 (日本円)
<b>収益</b>			
受取利息		207,559	303,373
為替差益純額		178,609,345	45,959,709
受取配当金		923,217,408	880,511,910
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	4(b)	5,660,946,095	2,131,476,680
<b>純収益合計</b>		<b>6,762,980,407</b>	<b>3,058,251,672</b>
<b>費用</b>			
運用報酬	6(a)	161,724,130	223,746,038
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	6(b)	40,661,896	58,347,362
保管受託銀行報酬	6(c)	19,963,973	22,997,135
費用の払戻し	6(d)	(8,387,306)	(6,720,638)
監査報酬		7,323,727	5,846,953
当座借越利息		72,585	47,768
その他の営業費用		2,418,573	537,182
<b>営業費用合計</b>		<b>223,777,578</b>	<b>304,801,800</b>
<b>税引前利益</b>		<b>6,539,202,829</b>	<b>2,753,449,872</b>
源泉税		(18,770,503)	(12,521,389)
<b>営業による受益証券保有者に帰属する純資産の増加額</b>		<b>6,520,432,326</b>	<b>2,740,928,483</b>

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

2015年5月31日終了会計年度

	注記 2015年5月31日終了会計年度 受益証券口数 (日本円)		2014年5月31日終了会計年度 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	-	6,520,432,326	-	2,740,928,483	
当期分配金	10	(5,964,159,300)	-	(8,910,457,680)	
受益証券の発行		1,874,875	11,434,372,092	2,243,149	14,408,531,803
受益証券の償還		(2,306,180)	(14,309,460,023)	(4,852,302)	(30,840,560,182)
受益証券保有者に 帰属する純資産期 末残高		6,590,677	42,058,742,579	7,021,982	44,377,557,484

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

2015年5月31日終了会計年度

	注記	2015年5月31日 終了会計年度 (日本円)	2014年5月31日 終了会計年度 (日本円)
営業活動によるキャッシュ・フロー			
投資の購入		(8,259,325,091)	(22,249,709,796)
投資の処分		16,102,173,590	34,745,891,167
受取配当金		923,217,408	880,511,910
受取利息		207,559	303,373
投資収益の受取		2,461,716,224	3,507,603,188
運用報酬支払		(165,653,416)	(236,647,215)
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬支払		(40,628,478)	(59,790,253)
保管受託銀行報酬支払		(20,780,031)	(21,040,548)
監査報酬支払		(6,483,856)	(5,707,566)
弁護士費用および専門家報酬支払		(1,796,238)	-
銀行手数料		(9,216)	-
その他の営業費用支払		(613,119)	(537,182)
払戻費用の受取		6,720,638	-
源泉税支払		(18,770,503)	(12,521,389)
営業活動による正味キャッシュ収入		10,979,975,471	16,548,355,689
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		(5,964,159,300)	(8,910,457,680)
受益証券の発行による収入		11,496,712,572	15,993,135,063
受益証券の償還による支払		(13,386,975,251)	(30,914,983,909)
当座借越利息		(72,585)	(47,768)
財務活動による正味キャッシュ支出		(7,854,494,564)	(23,832,354,294)
現金および現金同等物の純増加/(減少)額		3,125,480,907	(7,283,998,605)
現金および現金同等物期首残高		1,492,885,496	8,730,924,392
外国為替レート変動の影響額		178,609,345	45,959,709
現金および現金同等物期末残高	5	4,796,975,748	1,492,885,496

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

2015年5月31日終了会計年度

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

## 1 一般的情報

フランクリン・テンプレートン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド（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。

ルクセンブルグ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 インターナショナル S.a.r.l.は、当ファンドの管理会社として、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。)に当ファンドに関するポートフォリオ管理サービスを委任しました。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。

本財務書類に対する注記において、純資産と表記されているものはすべて、別途記載がない限り、当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産を指しています。

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。

本財務書類は、2015年8月27日に受託会社によって公表を承認されました。

## 2 重要な会計方針の要約

本財務書類の作成に際して適用された主要な会計方針は以下のとおりです。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。資本金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。

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、年度末日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、各年度末日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、特に金融市場が予測不可能であることに焦点を当て、当ファンドの財務業績に対する潜在的な悪影響を最小限にするよう努めています。

### 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%

投資	2015年5月31日現在		2014年5月31日現在	
	公正価値 (日本円)	純資産比率 (%)	公正価値 (日本円)	純資産比率 (%)
債券				
アンゴラ	851,832,527	2.03	-	-
アルメニア	437,794,547	1.04	-	-
アゼルバイジャン	1,132,567,953	2.69	930,097,730	2.10
ボスニア・ヘルツェゴビナ	1,173,070,634	2.79	1,323,244,904	2.98
ブラジル	425,602,334	1.01	-	-
中国	746,416,859	1.77	1,553,181,713	3.50
コロンビア	1,237,365,510	2.94	506,080,356	1.14
コスタリカ	680,676,600	1.62	1,253,139,934	2.82
ドミニカ共和国	-	-	497,130,064	1.12
エチオピア	647,750,231	1.54	-	-



有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

エルサルバドル	1,339,239,171	3.18	1,351,450,677	3.05
マケドニア旧ユーゴスラビア共和国	-	-	730,068,455	1.65
ジョージア	1,407,568,331	3.35	1,637,861,679	3.69
ガーナ	980,419,191	2.33	822,301,572	1.85
ホンジュラス	510,125,771	1.21	452,090,544	1.02
インドネシア	-	-	290,688,944	0.66
イラク	846,996,263	2.01	-	-
ヨルダン	534,407,813	1.27	2,016,620,202	4.54
カザフスタン	927,240,746	2.20	937,760,200	2.11
ケニア	710,483,386	1.69	547,915,158	1.23
マケドニア	703,431,473	1.67	-	-
メキシコ	1,426,287,842	3.39	1,384,028,602	3.12
モンゴル	925,958,103	2.20	759,487,371	1.71
モンテネグロ	402,654,539	0.96	618,426,806	1.39
モザンビーク	881,096,011	2.09	938,216,431	2.11
ナイジェリア	-	-	1,265,913,926	2.85
パラグアイ	454,468,940	1.08	479,267,408	1.08
ロシア	2,152,747,673	5.12	2,830,035,879	6.38
ルワンダ	190,927,791	0.45	472,006,071	1.06
セルビア	665,593,319	1.58	822,258,051	1.85
南アフリカ	1,237,988,909	2.94	1,496,862,753	3.37
スリランカ	589,466,932	1.40	701,972,836	1.58
国際機関	3,382,733,857	8.04	3,477,005,213	7.84
トリニダード・トバゴ	1,351,037,918	3.21	1,783,502,367	4.02
チュニジア	111,427,647	0.26	1,116,164,612	2.52
トルコ	2,120,556,534	5.04	2,078,186,493	4.68
ウガンダ	615,702,711	1.46	587,655,684	1.32
ウクライナ	1,440,208,241	3.42	1,756,694,676	3.96
ウルグアイ	1,509,020,787	3.59	1,525,887,179	3.44
ザンビア	629,013,585	1.50	-	-
債券合計	35,379,880,679	84.07	38,943,204,490	87.74

投資	2015年5月31日現在		2014年5月31日現在	
	公正価値 (日本円)	純資産比率 (%)	公正価値 (日本円)	純資産比率 (%)
原油ワラント				
ナイジェリア	2,154,027,554	5.12	2,072,559,300	4.67
ベネズエラ	806,751,893	1.92	1,725,223,964	3.89
原油ワラント合計	2,960,779,447	7.04	3,797,783,264	8.56
投資合計	38,340,660,126	91.11	42,740,987,754	96.30

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。

2015年5月31日および2014年5月31日の感応度分析は、VaRモデルを使用して実施されました。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。

2015年5月31日現在

2014年5月31日現在

VaR(%)	6.910%	7.341%
VaR(金額)	2,906,259,112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、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。

2015年5月31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「OIP0」といいます。)にも投資を行っています。これらのOIP0は相対的に流動性が低いため、有価証券の価格が毎日定期的に変動しないことから、リスクの見積りおよび感応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、当レビュー年度中における月次総利回りの最大値、最小値および中央値に着目することです。

以下の表は、OIP0から導出された当年度中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			
	2015年5月31日現在		2014年5月31日現在	
	(%)	(日本円)	(%)	(日本円)
<u>ナイジェリア原油ワラント</u>				
月次総利回り中央値	0.32	6,816,543	0.00	-
月次総利回り最小値	(4.55)	(97,910,343)	(1.65)	(34,197,228)
月次総利回り最大値	6.23	134,133,584	1.68	34,818,996
<u>ベネズエラ原油ワラント</u>				
月次総利回り中央値	(1.02)	(8,208,597)	(0.75)	(12,939,180)
月次総利回り最小値	(30.77)	(248,231,352)	(8.42)	(145,263,858)
月次総利回り最大値	11.11	89,639,099	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	1ヶ月以上 1年未満	1年以上 5年未満	5年以上	無利息	合計
	(日本円)	(日本円)	(日本円)	(日本円)	(日本円)	(日本円)
2015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	1,173,070,634	4,128,943,014	14,086,216,635	15,991,650,396	2,960,779,447	38,340,660,126
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	4,796,975,748	-	-	-	-	4,796,975,748
その他の債権	-	-	-	-	8,387,306	8,387,306
資産合計	5,970,046,382	4,128,943,014	14,086,216,635	15,991,650,396	2,969,166,753	43,146,023,180
負債						
償還に係る未払金	-	-	-	-	989,922,180	989,922,180
ブローカーに対する債務	-	-	-	-	54,095,601	54,095,601
未払費用	-	-	-	-	43,262,820	43,262,820
負債合計	-	-	-	-	1,087,280,601	1,087,280,601

## 金利感応度ギャップ合計

5,970,046,382 4,128,943,014 14,086,216,635 15,991,650,396

	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、2015年5月31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。

	2015年5月31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	1,946,128,503	2,319,227,818
コロンビア・ペソ	812,850,919	506,080,356
コスタリカ・コロン	680,676,600	1,253,139,934
ドイツ・マルク	1,173,070,634	1,323,244,904
ドミニカ・ペソ	-	497,130,064
ユーロ	1,217,513,659	3,402,420,073
ガーナ・セディ	980,419,191	822,301,572
インド・ルピー	1,308,389,139	1,157,777,395
日本円	1,520,445,851	157,532,380
ケニア・シリング	710,483,386	547,915,158
メキシコ・ヌエボ・ペソ	1,427,617,477	1,384,028,602
新トルコ・リラ	842,303,565	1,048,432,057
ナイジェリア・ナイラ	128,216,215	1,266,058,479
ロシア・ルーブル	-	935,988,745

セルビア・ディナール	665,593,319	822,258,051
南アフリカ・ランド	1,237,994,281	1,598,026,185
ウガンダ・シリング	687,792,229	591,745,878
ウルグアイ・ペソ	1,509,020,787	1,525,887,179
米ドル	25,666,031,524	23,432,064,364
ザンビア・クワチャ	631,475,901	-
資産合計	43,146,023,180	44,591,259,194
負債		
日本円	1,016,924,438	98,368,952
シンガポール・ドル	5,523,845	4,869,735
南アフリカ・ランド	-	99,129,427
ウガンダ・シリング	54,095,601	-
米ドル	10,736,717	11,333,596
負債合計	1,087,280,601	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、2015年5月31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。2015年5月31日現在、当ファンドの有価証券の平均信用格付は、BB（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）	2015年5月31日現在 純資産比率 （%）	2014年5月31日現在 純資産比率 （%）
Aaa / AAA	8.04	7.84
Baa1 / BBB+	6.33	6.49
Baa2 / BBB	1.01	3.46
Baa3 / BBB-	14.25	14.32
Ba1 / BB+	6.11	3.08
Ba2 / BB	2.70	2.82
Ba3 / BB-	7.90	22.55
B1 / B+	18.81	9.82
B2 / B	12.32	11.96
B3 / B-	8.35	4.00
Caa1 / CCC+	-	3.89
Caa3 / CCC-	1.92	3.96
Ca/ CC	3.42	-
D（スタンダード・アンド・プアーズのみ）	-	2.11
その他の純資産*	8.84	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。

	2015年5月31日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
債券	35,379,880,679	38,943,204,490
デリバティブ資産	2,960,779,447	3,797,783,264
ブローカーに対する債権	-	288,324,826
発行に係る未収入金	-	62,340,480
現金および現金同等物	4,796,975,748	1,492,885,496
その他の債権	8,387,306	6,720,638
合計	43,146,023,180	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。

	2015年5月31日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
Astana Finance 7.875% 08/06/2010	-	937,760,200
Astana Finance JSC ADR (ISIN: US46630H2022)	-	-
Astana Finance JSC ADR* (ISIN: US46630H3012)	-	-
Astana Finance JSC 0.000001% due 22/12/2024 REGS*	-	-
	-	937,760,200

2015年5月31日現在、上記のAstana Finance証券はゼロ評価されました。

\* Astana Finance 7.875% 08/06/2010のリストラクチャリングの結果、これらの証券を2015年5月22日のコーポレートアクションにより受け取りました。

上記の投資は、不履行となっている支払を2015年5月31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、2015年5月31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
2015年5月31日現在		
銀行		
バンク オブ ニューヨーク メロン	11.41	A1
保管受託銀行		
バンク オブ ニューヨーク メロン	91.16	A1
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)
2015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			
ブローカーに対する債権	38,340,660,126	-	38,340,660,126
発行に係る未収入金	-	-	-
現金および現金同等物	4,796,975,748	-	4,796,975,748
その他の債権	-	8,387,306	8,387,306
合計	43,137,635,874	8,387,306	43,146,023,180
負債			
償還に係る未払金	989,922,180	-	989,922,180
ブローカーに対する債務	54,095,601	-	54,095,601
未払費用	-	43,262,820	43,262,820
合計	1,044,017,781	43,262,820	1,087,280,601

	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			
ブローカーに対する債権	42,740,987,754	-	42,740,987,754
発行に係る未収入金	288,324,826	-	288,324,826
現金および現金同等物	62,340,480	-	62,340,480
その他の債権	1,492,885,496	-	1,492,885,496
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、受益証券保有者の間で比例償還され、償還されなかった受益証券は、同様の制限を条件

として、次回取引日に償還が繰り越されます。

年度末日現在、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71%（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ます。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、日々増価する当初購入水準から額面への割引分を短期証券の最終満期日まで償却する実効金利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。当会計年度末日現在、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、年度末日現在、公正価値で測定した当ファンドの金融資産および負債を（種類別に）公正価値ヒエラルキーの範囲内で分析したものです。

	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)
2015年5月31日現在				
資産				
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	-	35,379,880,679	-	35,379,880,679
- デリバティブ資産	-	2,960,779,447	-	2,960,779,447
資産合計	-	38,340,660,126	-	38,340,660,126

	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)
2014年5月31日現在				
資産				
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、2015年5月31日および2014年5月31日終了年度に係るレベル3の商品の変動を示したものです。

	債券 2015年5月31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)

2015年5月31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

	2015年5月31日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
純損益を通じて公正価値で測定するものとして指定された金融資産		
債券	35,379,880,679	38,943,204,490
原油ワラント	2,960,779,447	3,797,783,264
合計	38,340,660,126	42,740,987,754

##### (b) 投資ポートフォリオ - 年間の損益

	2015年5月31日 (日本円)	2014年5月31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純変動額		
- 実現	(2,585,690,268)	4,957,959,568
- 未実現の変動額	8,246,636,363	(2,826,482,888)
利益合計	5,660,946,095	2,131,476,680

#### 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。

	2015年5月31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	4,796,975,748	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、当年度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、各年度における関連当事者との取引の詳細です。

	費用		債務	
	2015年5月31日 現在 (日本円)	2014年5月31日 現在 (日本円)	2015年5月31日 現在 (日本円)	2014年5月31日 現在 (日本円)
(a) 運用報酬	161,724,130	223,746,038	27,002,258	30,931,544
(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	40,661,896	58,347,362	6,662,805	6,629,387
(c) 保管受託銀行報酬	19,963,973	22,997,135	3,267,160	4,083,218
費用合計	222,349,999	305,090,535	36,932,223	41,644,149
			債権	
(d) 費用 払戻し	(8,387,306)	(6,720,638)	8,387,306	6,720,638

#### 7 未払費用

	2015年5月31日現在 (日本円)	2014年5月31日現在 (日本円)
未払運用報酬	27,002,258	30,931,544
未払受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	6,662,805	6,629,387
未払保管受託銀行報酬	3,267,160	4,083,218
未払監査報酬	6,330,597	5,490,726
	43,262,820	47,134,875

未払費用の帳簿価額は、年度末日現在の公正価値に近似していました。

#### 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42,058,742,579円（2014年：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。

## 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。

当年度中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)
2015年5月31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
受益証券1口当たり分配金75円	2014年12月3日	461,270,250
受益証券1口当たり分配金75円	2015年1月5日	451,257,375
受益証券1口当たり分配金75円	2015年2月3日	531,299,775
受益証券1口当たり分配金75円	2015年3月3日	513,737,850
受益証券1口当たり分配金75円	2015年4月7日	492,909,900
受益証券1口当たり分配金75円	2015年5月7日	511,162,950
		5,964,159,300
2014年5月31日		
受益証券1口当たり分配金90円	2013年6月3日	866,802,150
受益証券1口当たり分配金90円	2013年7月3日	878,482,440
受益証券1口当たり分配金90円	2013年8月5日	874,547,820
受益証券1口当たり分配金90円	2013年9月3日	870,175,440
受益証券1口当たり分配金90円	2013年10月3日	853,929,450
受益証券1口当たり分配金90円	2013年11月5日	864,047,880
受益証券1口当たり分配金75円	2013年12月3日	689,247,600
受益証券1口当たり分配金75円	2014年1月6日	644,656,725
受益証券1口当たり分配金75円	2014年2月3日	629,664,075
受益証券1口当たり分配金75円	2014年3月3日	613,503,000
受益証券1口当たり分配金75円	2014年4月3日	587,025,300
受益証券1口当たり分配金75円	2014年5月7日	538,375,800
		8,910,457,680

## 投資ポートフォリオ(無監査)

2015年5月31日終了会計年度

以下の表は、保有する金融資産の要約です。

	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)	公正価値 2014年5月31日 現在 (日本円)
債券 アンゴラ		

Republic of Angola (Northern Lights Iii Bv) 7.00% due 16/08/2019 REGS	851,832,527	-
アンゴラ合計	851,832,527	-
<b>アルメニア</b>		
Republic of Armenia 7.15% due 26/03/2025 REGS	437,794,547	-
アルメニア合計	437,794,547	-
<b>アゼルバイジャン</b>		
Rubrika Finance Co Ltd (International Bank Of AZ) 7.20% due 31/10/2016 REGS	1,132,567,953	930,097,730
アゼルバイジャン合計	1,132,567,953	930,097,730
<b>ボスニア・ヘルツェゴビナ</b>		
Bosnia and Herzegovina 0% due 11/12/2021	1,173,070,634	1,323,244,904
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	1,173,070,634	1,323,244,904
<b>ブラジル</b>		
Caixa Economica Federal 4.25% due 13/05/2019 REGS	425,602,334	-
ブラジル合計	425,602,334	-
<b>中国</b>		
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	746,416,859	569,019,712
中国合計	746,416,859	1,553,181,713
<b>コロンビア</b>		
Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS	267,111,292	-
Ecopetrol SA 4.125% due 16/01/2025	424,514,591	-
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	545,739,627	506,080,356
コロンビア合計	1,237,365,510	506,080,356
<b>コスタリカ</b>		
Costa Rica Government International Bond 10.58% due 23/09/2015 REGS	680,676,600	872,961,390
Republic of Costa Rica 10.58% due 22/06/2016 REGS	-	380,178,544
コスタリカ合計	680,676,600	1,253,139,934
<b>ドミニカ共和国</b>		
Dominican Republic 11.7% due 06/06/2014 REGS	-	497,130,064
ドミニカ共和国合計	-	497,130,064
	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)	公正価値 2014年5月31日 現在 (日本円)
<b>債券(続き)</b>		
<b>エチオピア</b>		
Federal Democratic Republic Of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	647,750,231	-
エチオピア合計	647,750,231	-
<b>エルサルバドル</b>		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	1,339,239,171	1,351,450,677
エルサルバドル合計	1,339,239,171	1,351,450,677
<b>マケドニア旧ユーゴスラビア共和国</b>		
Former Yugoslav Republic of Macedonia 4.625% due 08/12/2015	-	730,068,455
マケドニア旧ユーゴスラビア共和国合計	-	730,068,455

<b>ジョージア</b>		
Georgian Oil & Gas Corp 6.875% due 16/05/2017 REGS	471,265,213	610,625,016
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022	168,932,192	378,911,172
Republic of Georgia 6.875% due 12/04/2021 REGS	767,370,926	648,325,491
<b>ジョージア合計</b>	<b>1,407,568,331</b>	<b>1,637,861,679</b>
<b>ガーナ</b>		
Ghana Govt 23.00% due 21/08/2017	980,419,191	822,301,572
<b>ガーナ合計</b>	<b>980,419,191</b>	<b>822,301,572</b>
<b>ホンジュラス</b>		
Honduras Government 7.50% due 15/03/2024 REGS	510,125,771	393,930,910
Republic of Honduras 8.75% due 16/12/2020 REGS	-	58,159,634
<b>ホンジュラス合計</b>	<b>510,125,771</b>	<b>452,090,544</b>
<b>インドネシア</b>		
Indonesia Republic 3.375% due 15/04/2023 REGS	-	290,688,944
<b>インドネシア合計</b>	<b>-</b>	<b>290,688,944</b>
<b>イラク</b>		
Republic of Iraq 5.8% due 15/01/2028 REGS	846,996,263	-
<b>イラク合計</b>	<b>846,996,263</b>	<b>-</b>
<b>ヨルダン</b>		
Dev Inv Jordan Arm Force 6.14% due 16/12/2019	534,407,813	2,016,620,202
<b>ヨルダン合計</b>	<b>534,407,813</b>	<b>2,016,620,202</b>
	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)	公正価値 2014年5月31日 現在 (日本円)
<b>債券(続き)</b>		
<b>カザフスタン</b>		
Astana Finance 7.875% due 08/06/2010 (Note 3.5)	-	937,760,200
Astana Finance JSC ADR REGS# (ISIN: US46630H2022) (Note 3.5)	-	-
Astana Finance JSC ADR REGS# (ISIN: US46630H3012) (Note 3.5)	-	-
Astana Finance JSC 0.000001% due 22/12/2024 REGS# (Note 3.5)	-	-
Kazakhstan Temir Zholy Finance Bv 6.375% due 06/10/2020 REGS	927,240,746	-
<b>カザフスタン合計</b>	<b>927,240,746</b>	<b>937,760,200</b>
<b>ケニア</b>		
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	710,483,386	383,697,828
Kenya T-Bill 0% due 11/08/2014	-	164,217,330
<b>ケニア合計</b>	<b>710,483,386</b>	<b>547,915,158</b>
<b>マケドニア</b>		
Former Yugoslav Republic of Macedonia 4.625% due 08/12/2015	703,431,473	-
<b>マケドニア合計</b>	<b>703,431,473</b>	<b>-</b>
<b>メキシコ</b>		
Mexican Udibonos 4.00% due 15/11/2040 Index Linked	1,426,287,842	1,384,028,602
<b>メキシコ合計</b>	<b>1,426,287,842</b>	<b>1,384,028,602</b>
<b>モンゴル</b>		
Mongolia Government International Bond 5.125% due 05/12/2022 REGS	925,958,103	759,487,371

モンゴル合計	925,958,103	759,487,371
モンテネグロ		
Republic of Montenegro 7.875% due 14/09/2015	402,654,539	618,426,806
モンテネグロ合計	402,654,539	618,426,806
モザンビーク		
Ematum Via Mozambique Ematum Finance 2020 BV 6.305% due 11/09/2020 REGS	881,096,011	938,216,431
モザンビーク合計	881,096,011	938,216,431

# 2015年5月31日および2014年5月31日現在、当該証券はゼロ評価でした。

	公正価値 2015年5月31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)		
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	-	566,349,206
Nigeria Treasury Bill 0% due 21/05/2015	-	325,935,663
ナイジェリア合計	-	1,265,913,926
パラグアイ		
Republic of Paraguay 4.625% due 25/01/2023 REGS	454,468,940	479,267,408
パラグアイ合計	454,468,940	479,267,408
ロシア		
Federal Grid Co OJSC/Finance Ltd 8.446% due 13/03/2019 REGS	-	440,390,374
RSHB Capital (RUSS AGRIC BK) 6.00% due 03/06/2021 REGS	1,481,113,731	1,310,275,204
RZD Capital Ltd 8.30% due 02/04/2019 REGS	-	495,598,371
RZD Capital Ltd 5.70% due 05/04/2022 REGS	671,633,942	583,771,930
ロシア合計	2,152,747,673	2,830,035,879
ルワンダ		
Republic of Rwanda 6.625% due 02/05/2023 REGS	190,927,791	472,006,071
ルワンダ合計	190,927,791	472,006,071
セルビア		
Serbia Treasury Bill 0% due 19/09/2014	-	822,258,051
Serbia Treasury Bonds 10.00% due 27/02/2017	665,593,319	-
セルビア合計	665,593,319	822,258,051
南アフリカ		
Republic of South Africa 2.25% due 31/01/2038 Index Linked	-	536,794,450
South Africa Republic of 8.00% due 21/12/2018	1,237,988,909	960,068,303
南アフリカ合計	1,237,988,909	1,496,862,753
スリランカ		
National Savings Bank 8.875% due 18/09/2018 REGS	589,466,932	701,972,836
スリランカ合計	589,466,932	701,972,836
	公正価値 2015年5月31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 10.00% due 28/10/2015	128,216,215	-

International Bank Recon & Dev 9.50% due 02/03/2017	1,946,128,503	2,319,227,818
International Finance Corp 7.75% due 03/12/2016	1,308,389,139	1,157,777,395
国際機関合計	3,382,733,857	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	1,351,037,918	1,783,502,367
トリニダード・トバゴ合計	1,351,037,918	1,783,502,367
チュニジア		
Banque Cent de Tunisie 4.50% due 22/06/2020 REGS	111,427,647	1,116,164,612
チュニジア合計	111,427,647	1,116,164,612
トルコ		
Turkey Government Bond 4.00% due 29/04/2015 Index Linked	-	534,766,472
Turkey Government Bond 8.20% due 16/11/2016	367,766,376	-
Turkey Government Bond FRN due 04/01/2017	474,537,189	503,375,821
Turkiye Halk Bankasi As 3.875% due 05/02/2020 REGS	1,278,252,969	1,040,044,200
トルコ合計	2,120,556,534	2,078,186,493
ウガンダ		
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 01/01/2015	-	256,389,508
Republic of Uganda Government Bonds 10.00% due 21/05/2015	-	100,572,993
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 21/04/2016	127,883,881	115,607,944
Republic Of Uganda Government Bonds 16.75% due 23/02/2017	110,595,565	-
Republic of Uganda Government Bonds 10.75% due 22/02/2018	110,534,705	115,085,239
Uganda Treasury Bills due 26/05/2016	266,688,560	-
ウガンダ合計	615,702,711	587,655,684
ウクライナ		
City of KYIV (CSFB) 8.00% due 06/11/2015	235,874,946	354,397,276
State Savings Bank of Ukraine 8.25% due 10/03/2016	746,654,586	947,902,881
State Savings Bank Of Ukraine 8.875% due 20/03/2018 REGS	457,678,709	454,394,519
ウクライナ合計	1,440,208,241	1,756,694,676
ウルグアイ		
Uruguay Republic Of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked	1,509,020,787	1,525,887,179
ウルグアイ合計	1,509,020,787	1,525,887,179
	公正価値 2015年5月31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)		
ザンビア		
Zambia Treasury Bill 0% due 13/07/2015	242,819,427	-
Zambia Treasury Bill 0% due 24/08/2015	45,054,783	-
Zambia Treasury Bill 0% due 07/09/2015	68,489,789	-
Zambia Treasury Bill 0% due 05/10/2015	70,239,918	-
Zambia Treasury Bill 0% due 19/10/2015	16,202,578	-
Zambia Treasury Bill 0% due 05/02/2016	186,207,090	-
ザンビア合計	629,013,585	-
債券合計	35,379,880,679	38,943,204,490
原油ワラント		
ナイジェリア		
Nigeria Central Bank of Wrd Exp 15/11/2020	2,154,027,554	2,072,559,300

ナイジェリア合計	2,154,027,554	2,072,559,300
ベネズエラ Venezuela Rep Of Exp 4/15/20 Par/Disc/Flirb Ser A&B Oil Index Wts	806,751,893	1,725,223,964
ベネズエラ合計	806,751,893	1,725,223,964
原油ワラント合計	2,960,779,447	3,797,783,264
投資ポートフォリオ	38,340,660,126	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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	771,176,922	417,583,171
国債証券	46,562,778,164	40,825,610,798
未収利息	365,168,928	326,961,381
前払費用	49,781,599	28,497,454
流動資産合計	47,748,905,613	41,598,652,804
資産合計	47,748,905,613	41,598,652,804
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	60,650,000
流動負債合計	-	60,650,000
負債合計	-	60,650,000
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	20,725,705,706	17,681,628,940
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	27,023,199,907	23,856,373,864
元本等合計	47,748,905,613	41,538,002,804
純資産合計	47,748,905,613	41,538,002,804
負債純資産合計	47,748,905,613	41,598,652,804

### 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27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

区分	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。 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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数  20,725,705,706口	1. 計算日における受益権の総数  17,681,628,940口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.3038円 (1万口当たり純資産額) (23,038円)	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.3492円 (1万口当たり純資産額) (23,492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10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左



区分	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
国債証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

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

（その他の注記）

#### 1 元本の移動

区分	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	24,333,561,079円	20,725,705,706円
期中追加設定元本額	143,505,827円	14,688,809円
期中一部解約元本額	3,751,361,200円	3,058,765,575円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	13,173,751,227円	11,816,367,337円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	1,703,288,970円	1,562,725,993円
新光7資産バランスファンド	472,102,025円	439,647,799円
海外国債ファンド（1年決算型）	36,408,901円	39,221,620円
海外国債ファンド（変額年金）	5,324,728,631円	3,804,619,847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）	2,777,885円	2,749,327円
グローバル・ナビ	12,648,067円	16,297,017円
合計	20,725,705,706円	17,681,628,940円

#### 2 有価証券関係

##### 売買目的有価証券

種類	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,609,065,346	533,673,602
合計	1,609,065,346	533,673,602

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

### 3 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

#### 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.0%-16/01/31	7,000,000.00	7,038,281.25	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	7,100,000.00	7,042,312.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	10,500,000.00	10,660,781.25	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	10,700,000.00	10,641,484.37	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	1,400,000.00	1,855,656.24	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	9,100,000.00	9,537,937.50	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	11,900,000.00	12,693,023.49	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	10,300,000.00	10,967,085.98	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	13,400,000.00	13,985,203.18	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	13,700,000.00	14,138,828.11	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	13,700,000.00	13,977,211.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	13,700,000.00	13,677,523.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	13,800,000.00	13,913,203.18	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	9,400,000.00	9,372,828.17	
米ドル建小計			145,700,000.00	149,501,359.72 (17,871,392,540)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	2,200,000.00	2,239,710.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	2,100,000.00	2,296,455.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	2,000,000.00	2,142,000.00	
カナダドル建小計			6,300,000.00	6,678,165.00 (612,921,983)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	2,900,000.00	3,172,600.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	2,900,000.00	3,174,630.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	2,900,000.00	3,289,760.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	1,600,000.00	2,373,920.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	2,900,000.00	3,237,560.00	

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	2,900,000.00	3,176,660.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	2,900,000.00	3,046,160.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	3,700,000.00	3,697,780.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,100,000.00	2,187,780.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	4,900,000.00	6,299,930.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	4,200,000.00	5,152,980.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	5,700,000.00	7,126,710.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	2,800,000.00	4,415,600.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01	5,300,000.00	6,552,920.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01	4,600,000.00	5,437,200.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01	4,700,000.00	5,069,890.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	5,500,000.00	7,124,700.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	4,500,000.00	4,463,550.00	
	FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	5,600,000.00	6,301,680.00	
	FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	2,400,000.00	3,827,280.00	
	FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	7,000,000.00	7,642,600.00	
	FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	8,900,000.00	11,473,880.00	
	FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	6,300,000.00	7,130,970.00	
	FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	6,800,000.00	7,388,200.00	
	FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	6,800,000.00	6,581,720.00	
ユーロ建小計		110,800,000.00	129,346,660.00 (17,525,178,963)	
英ポンド	国債証券	TSY-2.25%-23/09/07	7,000,000.00	7,326,389.00
		TSY-2.75%-24/09/07	7,000,000.00	7,593,880.00
		TSY-5.0%-25/03/07	5,000,000.00	6,432,650.00
		TSY-2.0%-25/09/07	4,600,000.00	4,674,520.00
英ポンド建小計		23,600,000.00	26,027,439.00 (4,816,117,312)	
合計			40,825,610,798 (40,825,610,798)	

## 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 14銘柄	43.0%	43.8%
カナダドル	債券 3銘柄	1.5%	1.5%
ユーロ	債券 25銘柄	42.2%	42.9%
英ポンド	債券 4銘柄	11.6%	11.8%

（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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	590,352,578	659,795,751
株式	13,565,779,760	12,387,766,180
派生商品評価勘定	1,407,440	25,755,080
未収配当金	113,102,581	93,655,756
未収利息	615	970
流動資産合計	14,270,642,974	13,166,973,737
資産合計	14,270,642,974	13,166,973,737
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,063,880	41,080
前受金	4,120,000	23,603,000
未払解約金	-	350,000
流動負債合計	6,183,880	23,994,080
負債合計	6,183,880	23,994,080
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,378,969,384	7,107,026,833
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,885,489,710	6,035,952,824
元本等合計	14,264,459,094	13,142,979,657
純資産合計	14,264,459,094	13,142,979,657
負債純資産合計	14,270,642,974	13,166,973,737

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

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
1. 担保資産 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 株式 198,369,650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 151,908,900円
2. 計算日における受益権の総数 7,378,969,384口	2. 計算日における受益権の総数 7,107,026,833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 1.9331円 (1万口当たり純資産額) (19,331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 1.8493円 (1万口当たり純資産額) (18,493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10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。	同左

区分	自 平成26年10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に</p> <p>近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま</p> <p>す。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

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

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,932,703,871円	7,378,969,384円
期中追加設定元本額	133,008,790円	598,638,681円
期中一部解約元本額	1,686,743,277円	870,581,232円
同期末における元本の内訳		
ニュー トピックス インデックス	394,530,301円	384,993,689円
新光7資産バランスファンド	571,177,263円	510,414,876円
ニュー トピックス インデックス（変額年金）	508,657,020円	334,449,197円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	1,889,544,971円	1,924,591,535円
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	1,686,095,397円	1,652,193,247円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	51,835,805円	50,797,273円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,614,549,339円	1,604,036,323円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	601,408,452円	586,762,298円



区分	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
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）	5,192,880円	2,088,264円
グローバル・ナビ	26,399,517円	26,476,445円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,675,321円	5,924,337円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	19,473,742円	19,734,333円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	4,429,376円	4,565,016円
合計	7,378,969,384円	7,107,026,833円

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,928,020,661	1,070,836,454
合計	1,928,020,661	1,070,836,454

(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27年 4月20日現在				平成27年10月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	680,271,440	-	679,615,000	656,440	723,286,000	-	749,000,000	25,714,000
東証株価指数先物	680,271,440	-	679,615,000	656,440	723,286,000	-	749,000,000	25,714,000
合計	680,271,440	-	679,615,000	656,440	723,286,000	-	749,000,000	25,714,000

### 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)

	評価額

銘柄	株式数	単価	金額	備考
極洋	3,000	263.00	789,000	
日本水産	7,800	385.00	3,003,000	
マルハニチロ	1,300	1,751.00	2,276,300	
サカタのタネ	1,000	2,421.00	2,421,000	
ホクト	700	2,311.00	1,617,700	
住石ホールディングス	1,800	118.00	212,400	
日鉄鉱業	2,000	528.00	1,056,000	
三井松島産業	4,000	120.00	480,000	
国際石油開発帝石	33,400	1,190.50	39,762,700	
日本海洋掘削	200	2,695.00	539,000	
石油資源開発	900	3,665.00	3,298,500	
K&Oエナジーグループ	400	1,527.00	610,800	
ショーボンドホールディングス	600	4,725.00	2,835,000	
ミライト・ホールディングス	2,000	1,115.00	2,230,000	
タマホーム	500	440.00	220,000	
安藤・間	4,200	781.00	3,280,200	
東急建設	2,300	968.00	2,226,400	
コムシスホールディングス	2,800	1,575.00	4,410,000	
ミサワホーム	700	745.00	521,500	
高松コンストラクショングループ	500	2,449.00	1,224,500	
東建コーポレーション	200	9,030.00	1,806,000	
大成建設	33,000	790.00	26,070,000	
大林組	19,000	1,076.00	20,444,000	
清水建設	19,000	1,042.00	19,798,000	
飛島建設	4,900	222.00	1,087,800	
長谷工コーポレーション	7,900	1,248.00	9,859,200	
松井建設	700	695.00	486,500	
銭高組	1,000	677.00	677,000	
鹿島建設	28,000	702.00	19,656,000	
不動テトラ	4,800	158.00	758,400	
大末建設	200	808.00	161,600	
鉄建建設	4,000	324.00	1,296,000	
西松建設	7,000	502.00	3,514,000	
三井住友建設	25,700	115.00	2,955,500	
大豊建設	2,000	530.00	1,060,000	
前田建設工業	4,000	924.00	3,696,000	
佐田建設	400	557.00	222,800	
奥村組	6,000	651.00	3,906,000	
東鉄工業	800	2,644.00	2,115,200	
イチケン	1,000	450.00	450,000	
浅沼組	2,000	326.00	652,000	

戸田建設	8,000	660.00	5,280,000
熊谷組	8,000	384.00	3,072,000
青木あすなろ建設	400	879.00	351,600
北野建設	1,000	318.00	318,000
植木組	1,000	247.00	247,000
三井ホーム	1,000	560.00	560,000
矢作建設工業	800	1,132.00	905,600
ピーエス三菱	700	408.00	285,600
日本ハウスホールディングス	1,300	516.00	670,800
大東建託	2,400	12,810.00	30,744,000
新日本建設	800	566.00	452,800
N I P P O	1,000	2,129.00	2,129,000
東亜道路工業	1,000	481.00	481,000
前田道路	2,000	2,183.00	4,366,000
日本道路	2,000	674.00	1,348,000
東亜建設工業	5,000	301.00	1,505,000
若築建設	4,000	157.00	628,000
東洋建設	1,900	548.00	1,041,200
五洋建設	7,000	573.00	4,011,000
大林道路	1,000	882.00	882,000
世紀東急工業	900	598.00	538,200
福田組	1,000	1,209.00	1,209,000
住友林業	4,700	1,432.00	6,730,400
日本基礎技術	800	548.00	438,400
日成ビルド工業	2,000	374.00	748,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	3,000	87.00	261,000
巴コーポレーション	800	360.00	288,000
パナホーム	2,000	804.00	1,608,000
大和ハウス工業	18,700	3,028.00	56,623,600
ライト工業	1,000	1,196.00	1,196,000
積水ハウス	20,000	1,921.50	38,430,000
日特建設	800	554.00	443,200
ユアテック	1,000	1,105.00	1,105,000
西部電気工業	1,000	423.00	423,000
四電工	1,000	419.00	419,000
中電工	900	2,541.00	2,286,900
関電工	3,000	852.00	2,556,000
きんでん	4,200	1,549.00	6,505,800
東京エネシス	1,000	1,010.00	1,010,000
トーエネック	1,000	889.00	889,000
住友電設	500	1,492.00	746,000
日本電設工業	1,000	2,202.00	2,202,000

協和エクシオ	2,700	1,277.00	3,447,900
新日本空調	500	1,020.00	510,000
N D S	1,000	297.00	297,000
九電工	1,000	2,046.00	2,046,000
三機工業	1,300	875.00	1,137,500
日揮	6,000	1,853.00	11,118,000
中外炉工業	2,000	228.00	456,000
ヤマト	600	441.00	264,600
太平電業	1,000	1,291.00	1,291,000
高砂熱学工業	1,700	1,721.00	2,925,700
朝日工業社	1,000	442.00	442,000
明星工業	1,000	546.00	546,000
大気社	900	2,880.00	2,592,000
ダイダン	1,000	868.00	868,000
日比谷総合設備	800	1,411.00	1,128,800
東芝プラントシステム	1,000	1,297.00	1,297,000
O S J Bホールディングス	900	230.00	207,000
東洋エンジニアリング	3,000	303.00	909,000
千代田化工建設	5,000	903.00	4,515,000
新興プランテック	1,300	964.00	1,253,200
日本製粉	4,000	740.00	2,960,000
日清製粉グループ本社	7,000	1,695.00	11,865,000
昭和産業	3,000	449.00	1,347,000
鳥越製粉	500	767.00	383,500
中部飼料	600	1,085.00	651,000
フィード・ワン	3,800	142.00	539,600
日本甜菜製糖	3,000	190.00	570,000
三井製糖	2,000	495.00	990,000
塩水港精糖	700	234.00	163,800
森永製菓	6,000	585.00	3,510,000
中村屋	1,000	453.00	453,000
江崎グリコ	1,500	5,420.00	8,130,000
名糖産業	300	1,300.00	390,000
不二家	4,000	194.00	776,000
山崎製パン	5,000	2,006.00	10,030,000
モロゾフ	1,000	405.00	405,000
亀田製菓	400	4,740.00	1,896,000
寿スピリッツ	200	3,785.00	757,000
カルビー	2,300	3,975.00	9,142,500
森永乳業	6,000	478.00	2,868,000
六甲バター	300	1,710.00	513,000
ヤクルト本社	3,400	6,100.00	20,740,000

明治ホールディングス	3,800	8,940.00	33,972,000
雪印メグミルク	1,500	2,217.00	3,325,500
プリマハム	4,000	329.00	1,316,000
日本ハム	5,000	2,489.00	12,445,000
伊藤ハム	3,000	621.00	1,863,000
丸大食品	3,000	448.00	1,344,000
米久	200	2,223.00	444,600
S Foods	400	2,161.00	864,400
サッポロホールディングス	10,000	474.00	4,740,000
アサヒグループホールディングス	11,900	3,608.00	42,935,200
キリンホールディングス	25,700	1,636.00	42,045,200
宝ホールディングス	5,000	845.00	4,225,000
オエノンホールディングス	2,000	221.00	442,000
コカ・コーラウエスト	2,100	2,223.00	4,668,300
コカ・コーライーストジャパン	2,200	1,620.00	3,564,000
サントリー食品インターナショナル	4,300	4,620.00	19,866,000
ダイドードリンコ	300	5,110.00	1,533,000
伊藤園	1,900	2,441.00	4,637,900
キーコーヒー	600	1,990.00	1,194,000
日清オイリオグループ	3,000	437.00	1,311,000
不二製油グループ本社	1,700	1,640.00	2,788,000
J-オイルミルズ	3,000	334.00	1,002,000
キッコーマン	5,000	3,540.00	17,700,000
味の素	15,000	2,553.50	38,302,500
キューピー	3,200	2,703.00	8,649,600
ハウス食品グループ本社	2,300	2,010.00	4,623,000
カゴメ	2,300	1,981.00	4,556,300
焼津水産化学工業	300	988.00	296,400
アリアケジャパン	600	5,400.00	3,240,000
ニチレイ	7,000	757.00	5,299,000
東洋水産	3,300	4,405.00	14,536,500
日清食品ホールディングス	2,700	5,550.00	14,985,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,040.00	1,040,000
フジッコ	600	2,214.00	1,328,400
ロック・フィールド	300	2,902.00	870,600
日本たばこ産業	37,500	4,049.00	151,837,500
ケンコーマヨネーズ	200	1,579.00	315,800
わらべや日洋	400	2,213.00	885,200
なとり	300	1,517.00	455,100
ユーグレナ	2,100	1,641.00	3,446,100
ミヨシ油脂	2,000	134.00	268,000
片倉工業	700	1,247.00	872,900

グンゼ	5,000	382.00	1,910,000
東洋紡	23,000	176.00	4,048,000
ユニチカ	17,000	61.00	1,037,000
富士紡ホールディングス	3,000	226.00	678,000
倉敷紡績	6,000	219.00	1,314,000
シキボウ	3,000	125.00	375,000
日本毛織	2,000	951.00	1,902,000
トーア紡コーポレーション	300	622.00	186,600
ダイドーリミテッド	700	494.00	345,800
帝国繊維	600	1,461.00	876,600
帝人	24,000	395.00	9,480,000
東レ	46,000	1,063.50	48,921,000
サカイオーベックス	2,000	191.00	382,000
住江織物	1,000	338.00	338,000
芦森工業	1,000	193.00	193,000
アツギ	5,000	112.00	560,000
ダイニック	1,000	162.00	162,000
セーレン	1,500	1,352.00	2,028,000
小松精練	1,000	672.00	672,000
ワコールホールディングス	4,000	1,470.00	5,880,000
ホギメディカル	400	5,480.00	2,192,000
T S Iホールディングス	2,600	812.00	2,111,200
三陽商会	3,000	354.00	1,062,000
オンワードホールディングス	4,000	758.00	3,032,000
ルック	1,000	181.00	181,000
ゴールドウイン	300	5,610.00	1,683,000
デサント	1,400	1,552.00	2,172,800
特種東海製紙	3,000	362.00	1,086,000
王子ホールディングス	24,000	598.00	14,352,000
日本製紙	2,900	2,114.00	6,130,600
三菱製紙	9,000	83.00	747,000
北越紀州製紙	3,700	780.00	2,886,000
中越パルプ工業	2,000	205.00	410,000
大王製紙	3,000	1,106.00	3,318,000
レンゴー	5,000	550.00	2,750,000
トーモク	2,000	253.00	506,000
ザ・バック	400	2,666.00	1,066,400
クラレ	9,400	1,481.00	13,921,400
旭化成	37,000	700.50	25,918,500
共和レザー	400	1,108.00	443,200
昭和電工	39,000	147.00	5,733,000
住友化学	44,000	683.00	30,052,000

住友精化	1,000	811.00	811,000	
日産化学工業	3,800	2,800.00	10,640,000	
ラサ工業	2,000	135.00	270,000	
クレハ	4,000	455.00	1,820,000	
テイカ	1,000	489.00	489,000	
石原産業	10,000	112.00	1,120,000	
日本曹達	4,000	914.00	3,656,000	
東ソー	16,000	639.00	10,224,000	
トクヤマ	9,000	210.00	1,890,000	
セントラル硝子	6,000	586.00	3,516,000	
東亜合成	3,700	938.00	3,470,600	
大阪ソーダ	2,000	423.00	846,000	
関東電化工業	1,000	879.00	879,000	
デンカ	12,000	529.00	6,348,000	
信越化学工業	10,600	6,674.00	70,744,400	
日本カーバイド工業	2,000	183.00	366,000	
堺化学工業	2,000	353.00	706,000	
エア・ウォーター	5,000	1,892.00	9,460,000	
大陽日酸	7,600	1,209.00	9,188,400	
日本化学工業	2,000	258.00	516,000	
日本パーカライジング	2,800	1,020.00	2,856,000	
高压ガス工業	1,000	626.00	626,000	
四国化成工業	1,000	1,016.00	1,016,000	
戸田工業	1,000	312.00	312,000	
ステラ ケミファ	300	1,173.00	351,900	
保土谷化学工業	2,000	166.00	332,000	
日本触媒	900	8,890.00	8,001,000	
大日精化工業	2,000	536.00	1,072,000	
カネカ	8,000	994.00	7,952,000	
三菱瓦斯化学	10,000	644.00	6,440,000	
三井化学	27,000	439.00	11,853,000	
J S R	5,900	1,873.00	11,050,700	
東京応化工業	1,200	3,695.00	4,434,000	
大阪有機化学工業	400	624.00	249,600	
三菱ケミカルホールディングス	37,100	704.80	26,148,080	
日本合成化学工業	1,000	829.00	829,000	
ダイセル	8,300	1,531.00	12,707,300	
住友ベークライト	6,000	491.00	2,946,000	
積水化学工業	14,000	1,294.00	18,116,000	
日本ゼオン	5,000	1,011.00	5,055,000	
アイカ工業	1,800	2,353.00	4,235,400	
宇部興産	30,000	233.00	6,990,000	

積水樹脂	900	1,552.00	1,396,800
タキロン	1,000	520.00	520,000
旭有機材工業	2,000	218.00	436,000
日立化成	2,900	1,883.00	5,460,700
ニチバン	1,000	563.00	563,000
リケンテクノス	1,000	387.00	387,000
大倉工業	1,000	328.00	328,000
積水化成成品工業	2,000	378.00	756,000
群栄化学工業	2,000	288.00	576,000
タイガースポリマー	300	690.00	207,000
ミライアル	200	1,180.00	236,000
ダイキョーニシカワ	200	6,470.00	1,294,000
日本化薬	4,000	1,197.00	4,788,000
カーリットホールディングス	500	519.00	259,500
日本精化	500	864.00	432,000
A D E K A	2,700	1,642.00	4,433,400
日油	5,000	853.00	4,265,000
新日本理化	900	202.00	181,800
ハリマ化成グループ	500	455.00	227,500
花王	15,900	5,764.00	91,647,600
第一工業製薬	1,000	354.00	354,000
三洋化成工業	2,000	837.00	1,674,000
大日本塗料	3,000	163.00	489,000
日本ペイントホールディングス	5,100	2,419.00	12,336,900
関西ペイント	7,000	1,742.00	12,194,000
中国塗料	2,000	848.00	1,696,000
日本特殊塗料	500	1,023.00	511,500
藤倉化成	800	569.00	455,200
太陽ホールディングス	500	3,875.00	1,937,500
D I C	24,000	319.00	7,656,000
サカタインクス	1,200	1,048.00	1,257,600
東洋インキS Cホールディングス	6,000	483.00	2,898,000
T & K T O K A	200	2,187.00	437,400
富士フイルムホールディングス	13,600	4,607.00	62,655,200
資生堂	10,500	2,843.50	29,856,750
ライオン	7,000	1,128.00	7,896,000
高砂香料工業	400	3,095.00	1,238,000
マンダム	600	4,420.00	2,652,000
ミルボン	300	4,320.00	1,296,000
ファンケル	1,400	1,894.00	2,651,600
コーセー	1,000	11,350.00	11,350,000
コタ	200	1,217.00	243,400



ドクターシーラボ	800	2,252.00	1,801,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	600	7,570.00	4,542,000	
ノエビアホールディングス	400	2,947.00	1,178,800	
エステー	400	1,019.00	407,600	
コニシ	500	2,165.00	1,082,500	
長谷川香料	800	1,551.00	1,240,800	
星光P M C	300	1,089.00	326,700	
小林製薬	1,000	8,830.00	8,830,000	
荒川化学工業	500	1,179.00	589,500	
メック	500	742.00	371,000	
日本高純度化学	200	2,192.00	438,400	
J C U	200	4,240.00	848,000	
新田ゼラチン	400	773.00	309,200	
アース製薬	400	4,605.00	1,842,000	
イハラケミカル工業	900	1,347.00	1,212,300	
北興化学工業	1,000	445.00	445,000	
大成ラミック	200	2,814.00	562,800	
クミアイ化学工業	1,200	988.00	1,185,600	
日本農薬	1,400	888.00	1,243,200	
アキレス	5,000	148.00	740,000	
有沢製作所	1,000	749.00	749,000	
日東電工	4,600	7,623.00	35,065,800	
レック	200	1,336.00	267,200	
きもと	1,100	260.00	286,000	
藤森工業	500	3,240.00	1,620,000	
前澤化成工業	400	1,052.00	420,800	
J S P	400	2,398.00	959,200	
エフピコ	500	4,750.00	2,375,000	
天馬	500	1,970.00	985,000	
信越ポリマー	1,200	589.00	706,800	
東リ	2,000	345.00	690,000	
ニフコ	1,300	4,610.00	5,993,000	
日本バルカー工業	2,000	292.00	584,000	
ユニ・チャーム	12,000	2,359.00	28,308,000	
協和発酵キリン	7,000	1,931.00	13,517,000	
武田薬品工業	22,200	5,689.00	126,295,800	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	66,400	1,655.50	109,925,200	
大日本住友製薬	4,200	1,331.00	5,590,200	
塩野義製薬	9,300	4,270.00	39,711,000	
田辺三菱製薬	6,900	2,022.00	13,951,800	
あすか製薬	700	1,356.00	949,200	
日本新薬	1,000	4,610.00	4,610,000	

ピオフェルミン製薬	100	3,300.00	330,000
中外製薬	5,900	3,890.00	22,951,000
科研製薬	1,000	8,610.00	8,610,000
エーザイ	7,800	6,996.00	54,568,800
ロート製薬	2,700	1,909.00	5,154,300
小野薬品工業	2,700	14,910.00	40,257,000
久光製薬	1,700	4,510.00	7,667,000
持田製薬	400	6,880.00	2,752,000
参天製薬	10,900	1,650.00	17,985,000
扶桑薬品工業	2,000	278.00	556,000
日本ケミファ	1,000	601.00	601,000
ツムラ	1,900	2,857.00	5,428,300
日医工	1,400	3,260.00	4,564,000
キッセイ薬品工業	1,000	2,965.00	2,965,000
生化学工業	1,100	1,476.00	1,623,600
栄研化学	500	2,055.00	1,027,500
日水製薬	200	1,328.00	265,600
鳥居薬品	400	2,855.00	1,142,000
JCRファーマ	500	2,432.00	1,216,000
東和薬品	300	7,790.00	2,337,000
富士製薬工業	200	2,014.00	402,800
沢井製薬	900	7,720.00	6,948,000
ゼリア新薬工業	1,200	1,666.00	1,999,200
第一三共	19,900	2,331.50	46,396,850
キョーリン製薬ホールディングス	1,600	1,930.00	3,088,000
大幸薬品	300	1,891.00	567,300
ダイト	300	2,906.00	871,800
大塚ホールディングス	12,700	3,786.00	48,082,200
大正製薬ホールディングス	1,400	7,220.00	10,108,000
日本コークス工業	5,300	100.00	530,000
昭和シェル石油	6,000	1,054.00	6,324,000
ニチレキ	1,000	965.00	965,000
東燃ゼネラル石油	9,000	1,225.00	11,025,000
ユシロ化学工業	300	1,347.00	404,100
ピーピー・カストロール	200	1,235.00	247,000
富士石油	1,400	375.00	525,000
MORESCO	200	1,596.00	319,200
出光興産	2,800	1,987.00	5,563,600
JXホールディングス	65,800	476.40	31,347,120
コスモエネルギーホールディングス	1,600	1,631.00	2,609,600
横浜ゴム	3,600	2,264.00	8,150,400
東洋ゴム工業	2,700	2,438.00	6,582,600

ブリヂストン	20,000	4,236.00	84,720,000
住友ゴム工業	5,500	1,707.00	9,388,500
藤倉ゴム工業	500	585.00	292,500
オカモト	2,000	1,225.00	2,450,000
フコク	200	970.00	194,000
ニッタ	600	3,080.00	1,848,000
住友理工	1,100	1,065.00	1,171,500
三ツ星ベルト	1,000	926.00	926,000
バンドー化学	2,000	493.00	986,000
日東紡績	4,000	344.00	1,376,000
旭硝子	31,000	726.00	22,506,000
日本板硝子	29,000	112.00	3,248,000
日本山村硝子	2,000	175.00	350,000
日本電気硝子	12,000	572.00	6,864,000
住友大阪セメント	11,000	465.00	5,115,000
太平洋セメント	37,000	386.00	14,282,000
デイ・シイ	600	373.00	223,800
日本ヒューム	600	733.00	439,800
日本コンクリート工業	1,000	430.00	430,000
三谷セキサン	300	1,655.00	496,500
アジアパイルホールディングス	800	801.00	640,800
東海カーボン	5,000	310.00	1,550,000
日本カーボン	3,000	312.00	936,000
東洋炭素	300	1,704.00	511,200
ノリタケカンパニーリミテド	3,000	268.00	804,000
TOTO	4,400	3,920.00	17,248,000
日本碍子	7,000	2,436.00	17,052,000
日本特殊陶業	5,100	2,875.00	14,662,500
MARUWA	200	2,687.00	537,400
品川リフラクトリーズ	1,000	266.00	266,000
黒崎播磨	1,000	238.00	238,000
フジインコーポレーテッド	600	1,786.00	1,071,600
ニチアス	3,000	748.00	2,244,000
ニチハ	800	1,747.00	1,397,600
新日鐵住金	25,300	2,404.00	60,821,200
神戸製鋼所	102,000	147.00	14,994,000
中山製鋼所	4,000	78.00	312,000
合同製鐵	3,000	205.00	615,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,100	1,801.50	27,202,650
日新製鋼	2,500	1,206.00	3,015,000
東京製鐵	3,000	693.00	2,079,000
共英製鋼	600	2,118.00	1,270,800

大和工業	1,300	2,785.00	3,620,500
東京鐵鋼	1,000	539.00	539,000
大阪製鐵	400	2,031.00	812,400
淀川製鋼所	800	2,342.00	1,873,600
東洋鋼鈹	1,400	395.00	553,000
丸一鋼管	1,800	3,045.00	5,481,000
モリ工業	1,000	358.00	358,000
大同特殊鋼	10,000	416.00	4,160,000
日本高周波鋼業	2,000	101.00	202,000
日本冶金工業	4,600	178.00	818,800
山陽特殊製鋼	4,000	506.00	2,024,000
愛知製鋼	3,000	501.00	1,503,000
日立金属	6,000	1,575.00	9,450,000
日本金属	2,000	135.00	270,000
大平洋金属	4,000	308.00	1,232,000
新日本電工	3,400	240.00	816,000
栗本鐵工所	3,000	204.00	612,000
三菱製鋼	4,000	244.00	976,000
日亜鋼業	800	265.00	212,000
シンニッタン	600	550.00	330,000
新家工業	1,000	143.00	143,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	329.00	329,000
日本輕金属ホールディングス	14,400	196.00	2,822,400
三井金属鉱業	16,000	246.00	3,936,000
東邦亜鉛	3,000	324.00	972,000
三菱マテリアル	37,000	416.00	15,392,000
住友金属鉱山	16,000	1,477.50	23,640,000
D O W Aホールディングス	7,000	1,017.00	7,119,000
古河機械金属	9,000	278.00	2,502,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	3,180.00	1,908,000
東邦チタニウム	1,000	1,487.00	1,487,000
U A C J	7,000	212.00	1,484,000
古河電気工業	17,000	210.00	3,570,000
住友電気工業	22,300	1,635.50	36,471,650
フジクラ	8,000	550.00	4,400,000
昭和電線ホールディングス	7,000	78.00	546,000
タツタ電線	1,100	458.00	503,800
リョービ	3,000	421.00	1,263,000
アーレスティ	700	801.00	560,700
アサヒホールディングス	900	1,882.00	1,693,800
稲葉製作所	300	1,251.00	375,300
宮地エンジニアリンググループ	2,000	220.00	440,000

トーカロ	400	2,356.00	942,400
アルファC o	200	1,304.00	260,800
SUMCO	4,600	1,152.00	5,299,200
川田テクノロジーズ	100	4,695.00	469,500
東洋製罐グループホールディングス	4,200	2,132.00	8,954,400
ホッカンホールディングス	1,000	302.00	302,000
コロナ	300	1,118.00	335,400
横河ブリッジホールディングス	1,100	1,111.00	1,222,100
駒井ハルテック	1,000	218.00	218,000
三和ホールディングス	5,600	854.00	4,782,400
文化シャッター	1,600	939.00	1,502,400
三協立山	800	1,715.00	1,372,000
LIXILグループ	8,800	2,523.00	22,202,400
日本フィルコン	400	503.00	201,200
ノーリツ	1,200	1,949.00	2,338,800
長府製作所	600	2,279.00	1,367,400
リンナイ	1,100	9,710.00	10,681,000
ダイニチ工業	300	714.00	214,200
日東精工	1,000	297.00	297,000
岡部	1,200	990.00	1,188,000
東プレ	1,100	2,414.00	2,655,400
高周波熱錬	1,000	877.00	877,000
東京製網	4,000	182.00	728,000
パイオラックス	300	5,710.00	1,713,000
日本発條	5,100	1,179.00	6,012,900
中央発條	1,000	285.00	285,000
三益半導体工業	400	1,139.00	455,600
日本ドライケミカル	100	2,184.00	218,400
日本製鋼所	8,000	439.00	3,512,000
三浦工業	2,600	1,392.00	3,619,200
タクマ	2,000	967.00	1,934,000
ツガミ	2,000	538.00	1,076,000
オークマ	4,000	850.00	3,400,000
東芝機械	3,000	390.00	1,170,000
アマダホールディングス	8,800	1,015.00	8,932,000
アイダエンジニアリング	1,300	1,099.00	1,428,700
滝澤鉄工所	2,000	178.00	356,000
富士機械製造	1,900	1,089.00	2,069,100
牧野フライス製作所	3,000	822.00	2,466,000
オーエスジー	2,700	2,148.00	5,799,600
旭ダイヤモンド工業	1,600	1,238.00	1,980,800
D M G 森精機	3,700	1,629.00	6,027,300

ディスコ	700	10,270.00	7,189,000
日東工器	300	2,425.00	727,500
パンチ工業	200	887.00	177,400
豊和工業	300	692.00	207,600
OKK	2,000	142.00	284,000
津田駒工業	1,000	117.00	117,000
島精機製作所	800	1,769.00	1,415,200
日阪製作所	700	911.00	637,700
やまびこ	900	1,067.00	960,300
ペガサスミシン製造	500	490.00	245,000
ナブテスコ	3,600	2,348.00	8,452,800
三井海洋開発	700	1,675.00	1,172,500
レオン自動機	400	577.00	230,800
SMC	1,800	28,880.00	51,984,000
新川	500	734.00	367,000
ホソカワミクロン	1,000	591.00	591,000
ユニオンツール	300	2,765.00	829,500
オイレス工業	700	1,865.00	1,305,500
日精エー・エス・ピー機械	200	2,422.00	484,400
サトーホールディングス	700	2,371.00	1,659,700
日精樹脂工業	400	1,001.00	400,400
小松製作所	29,000	1,923.00	55,767,000
住友重機械工業	16,000	550.00	8,800,000
日立建機	2,600	1,880.00	4,888,000
日工	1,000	409.00	409,000
巴工業	200	1,665.00	333,000
井関農機	6,000	195.00	1,170,000
TOWA	500	815.00	407,500
丸山製作所	1,000	193.00	193,000
北川鉄工所	3,000	303.00	909,000
クボタ	28,000	1,778.50	49,798,000
荏原実業	200	1,464.00	292,800
三菱化工機	2,000	304.00	608,000
月島機械	1,000	1,078.00	1,078,000
帝国電機製作所	400	843.00	337,200
新東工業	1,300	995.00	1,293,500
澁谷工業	500	1,818.00	909,000
アイチ コーポレーション	800	735.00	588,000
小森コーポレーション	1,400	1,377.00	1,927,800
鶴見製作所	400	2,028.00	811,200
住友精密工業	1,000	475.00	475,000
酒井重工業	1,000	233.00	233,000

荏原製作所	12,000	495.00	5,940,000
石井鐵工所	1,000	190.00	190,000
西島製作所	600	892.00	535,200
北越工業	600	835.00	501,000
ダイキン工業	8,200	7,705.00	63,181,000
オルガノ	1,000	453.00	453,000
トーヨーカネツ	3,000	195.00	585,000
栗田工業	3,400	2,852.00	9,696,800
椿本チエイン	3,000	854.00	2,562,000
大同工業	1,000	202.00	202,000
日本コンベヤ	2,000	183.00	366,000
木村化工機	500	521.00	260,500
アネスト岩田	900	816.00	734,400
ダイフク	2,800	1,689.00	4,729,200
加藤製作所	1,000	514.00	514,000
油研工業	1,000	232.00	232,000
タダノ	3,000	1,351.00	4,053,000
フジテック	1,600	1,227.00	1,963,200
C K D	1,600	988.00	1,580,800
キトー	600	924.00	554,400
平和	1,700	2,199.00	3,738,300
理想科学工業	700	2,054.00	1,437,800
S A N K Y O	1,600	4,545.00	7,272,000
日本金銭機械	500	1,296.00	648,000
マースエンジニアリング	300	2,001.00	600,300
福島工業	300	2,735.00	820,500
ダイコク電機	200	1,614.00	322,800
アマノ	1,900	1,408.00	2,675,200
J U K I	800	1,346.00	1,076,800
サンデンホールディングス	3,000	392.00	1,176,000
蛇の目ミシン工業	500	884.00	442,000
マックス	1,000	1,151.00	1,151,000
グローリー	1,800	3,080.00	5,544,000
新晃工業	400	1,289.00	515,600
大和冷機工業	900	761.00	684,900
セガサミーホールディングス	6,100	1,259.00	7,679,900
日本ピストンリング	200	1,957.00	391,400
リケン	2,000	435.00	870,000
T P R	600	2,842.00	1,705,200
ホシザキ電機	1,200	8,660.00	10,392,000
大豊工業	500	1,346.00	673,000
日本精工	11,600	1,253.00	14,534,800

NTN	13,000	531.00	6,903,000
ジェイテクト	6,000	1,907.00	11,442,000
不二越	5,000	509.00	2,545,000
日本トムソン	2,000	515.00	1,030,000
THK	3,800	2,013.00	7,649,400
ユーシン精機	300	2,174.00	652,200
前澤給装工業	200	1,514.00	302,800
イーグル工業	800	2,263.00	1,810,400
日本ピラー工業	600	987.00	592,200
キッツ	2,500	562.00	1,405,000
日立工機	1,500	873.00	1,309,500
マキタ	3,700	6,610.00	24,457,000
日立造船	4,400	669.00	2,943,600
三菱重工業	95,000	596.90	56,705,500
IHI	41,000	357.00	14,637,000
日清紡ホールディングス	4,000	1,495.00	5,980,000
イビデン	3,700	1,651.00	6,108,700
コニカミノルタ	13,300	1,368.00	18,194,400
ブラザー工業	7,300	1,514.00	11,052,200
ミネベア	8,000	1,312.00	10,496,000
日立製作所	136,000	666.40	90,630,400
東芝	119,000	334.60	39,817,400
三菱電機	57,000	1,198.50	68,314,500
富士電機	16,000	499.00	7,984,000
東洋電機製造	1,000	412.00	412,000
安川電機	6,900	1,256.00	8,666,400
シンフォニアテクノロジー	4,000	187.00	748,000
明電舎	5,000	425.00	2,125,000
オリジン電気	1,000	319.00	319,000
山洋電気	1,000	789.00	789,000
デンヨー	500	1,966.00	983,000
東芝テック	4,000	454.00	1,816,000
芝浦メカトロニクス	1,000	220.00	220,000
マブチモーター	1,600	5,730.00	9,168,000
日本電産	6,300	8,596.00	54,154,800
東光高岳	300	1,385.00	415,500
ダイヘン	3,000	560.00	1,680,000
JVCケンウッド	4,200	325.00	1,365,000
第一精工	200	1,615.00	323,000
日新電機	1,300	747.00	971,100
大崎電気工業	1,000	614.00	614,000
オムロン	6,100	3,950.00	24,095,000



日東工業	900	2,177.00	1,959,300	
I D E C	700	994.00	695,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11,000	513.00	5,643,000	
サクサホールディングス	1,000	237.00	237,000	
メルコホールディングス	300	2,109.00	632,700	
テクノメディカ	100	2,655.00	265,500	
日本電気	73,000	405.00	29,565,000	
富士通	55,000	568.60	31,273,000	
沖電気工業	20,000	189.00	3,780,000	
岩崎通信機	2,000	82.00	164,000	
電気興業	2,000	516.00	1,032,000	
サンケン電気	3,000	426.00	1,278,000	
ナカヨ	1,000	329.00	329,000	
アイホン	300	1,951.00	585,300	
ルネサスエレクトロニクス	2,900	733.00	2,125,700	
セイコーエプソン	7,700	1,939.00	14,930,300	
ワコム	4,500	444.00	1,998,000	
アルバック	1,000	2,076.00	2,076,000	
アクセル	300	1,414.00	424,200	
E I Z O	500	2,768.00	1,384,000	
ジャパンディスプレイ	11,600	378.00	4,384,800	
日本信号	1,600	1,199.00	1,918,400	
京三製作所	1,000	325.00	325,000	
能美防災	700	1,402.00	981,400	
ホーチキ	400	1,145.00	458,000	
エレコム	400	1,439.00	575,600	
日本無線	1,000	406.00	406,000	
パナソニック	69,300	1,295.00	89,743,500	代用有価証券 7,500株
シャープ	48,000	136.00	6,528,000	
アンリツ	3,400	803.00	2,730,200	
富士通ゼネラル	2,000	1,467.00	2,934,000	
日立国際電気	1,000	1,424.00	1,424,000	
ソニー	39,800	3,270.00	130,146,000	代用有価証券 3,700株
T D K	3,400	7,040.00	23,936,000	
帝国通信工業	1,000	190.00	190,000	
ミツミ電機	2,000	678.00	1,356,000	
タムラ製作所	2,000	359.00	718,000	
アルプス電気	4,700	3,270.00	15,369,000	
池上通信機	2,000	149.00	298,000	
パイオニア	8,500	316.00	2,686,000	
日本電波工業	500	825.00	412,500	

日本トリム	100	4,370.00	437,000
ローランド ディー.ジー.	200	2,713.00	542,600
フォスター電機	700	2,674.00	1,871,800
クラリオン	3,000	446.00	1,338,000
S M K	2,000	619.00	1,238,000
ヨコオ	400	649.00	259,600
東光	1,000	306.00	306,000
ホシデン	1,700	720.00	1,224,000
ヒロセ電機	1,000	14,140.00	14,140,000
日本航空電子工業	2,000	2,029.00	4,058,000
T O A	600	1,177.00	706,200
日立マクセル	1,100	1,862.00	2,048,200
古野電気	700	811.00	567,700
ユニデンホールディングス	2,000	193.00	386,000
アルパイン	1,300	1,548.00	2,012,400
スミダコーポレーション	500	825.00	412,500
アイコム	300	2,466.00	739,800
リオン	200	1,757.00	351,400
船井電機	600	1,231.00	738,600
横河電機	5,700	1,283.00	7,313,100
新電元工業	2,000	424.00	848,000
アズビル	1,800	2,931.00	5,275,800
日本光電工業	2,400	2,168.00	5,203,200
チノー	200	1,082.00	216,400
共和電業	700	423.00	296,100
堀場製作所	1,000	4,415.00	4,415,000
アドバンテスト	3,900	983.00	3,833,700
小野測器	300	974.00	292,200
エスベック	600	1,094.00	656,400
パナソニック デバイス S U N X	500	628.00	314,000
キーエンス	1,300	56,840.00	73,892,000
日置電機	300	2,164.00	649,200
シスメックス	4,400	6,480.00	28,512,000
メガチップス	600	1,255.00	753,000
O B A R A G R O U P	400	4,960.00	1,984,000
コーセル	800	1,133.00	906,400
オブテックス	400	2,145.00	858,000
千代田インテグレ	300	2,805.00	841,500
レーザーテック	600	1,266.00	759,600
スタンレー電気	4,100	2,566.00	10,520,600
岩崎電気	2,000	268.00	536,000
ウシオ電機	3,400	1,549.00	5,266,600

日本セラミック	300	1,689.00	506,700	
遠藤照明	300	1,233.00	369,900	
日本デジタル研究所	500	1,594.00	797,000	
山一電機	700	998.00	698,600	
図研	400	1,128.00	451,200	
日本電子	2,000	671.00	1,342,000	
カシオ計算機	5,700	2,169.00	12,363,300	
ファナック	5,900	19,195.00	113,250,500	
日本シイエムケイ	1,400	224.00	313,600	
エンプラス	300	4,500.00	1,350,000	
大真空	1,000	247.00	247,000	
ローム	2,800	5,820.00	16,296,000	
浜松ホトニクス	4,400	2,848.00	12,531,200	
三井ハイテック	700	700.00	490,000	
新光電気工業	2,100	788.00	1,654,800	
京セラ	9,300	5,704.00	53,047,200	
太陽誘電	3,000	1,624.00	4,872,000	
村田製作所	5,900	15,205.00	89,709,500	
ユーシン	700	771.00	539,700	
双葉電子工業	1,000	1,622.00	1,622,000	
北陸電気工業	2,000	151.00	302,000	
ニチコン	1,800	914.00	1,645,200	
日本ケミコン	5,000	269.00	1,345,000	
K O A	800	1,093.00	874,400	
市光工業	1,000	215.00	215,000	
小糸製作所	3,400	4,340.00	14,756,000	
ミツバ	1,000	1,695.00	1,695,000	
スター精密	1,100	1,504.00	1,654,400	
S C R E E Nホールディングス	5,000	628.00	3,140,000	
キャノン電子	500	2,067.00	1,033,500	
キャノン	30,500	3,726.00	113,643,000	代用有価証券 4,100株
リコー	17,000	1,326.50	22,550,500	
M U T O Hホールディングス	1,000	302.00	302,000	
東京エレクトロン	4,800	6,211.00	29,812,800	
トヨタ紡織	2,000	2,438.00	4,876,000	
鬼怒川ゴム工業	1,000	680.00	680,000	
ユニプレス	1,100	2,658.00	2,923,800	
豊田自動織機	5,200	6,090.00	31,668,000	
モリタホールディングス	1,000	1,196.00	1,196,000	
三櫻工業	700	759.00	531,300	
デンソー	14,000	5,587.00	78,218,000	
東海理化電機製作所	1,500	2,689.00	4,033,500	

三井造船	22,000	197.00	4,334,000	
川崎重工業	41,000	464.00	19,024,000	
名村造船所	1,600	1,016.00	1,625,600	
日本車輛製造	2,000	312.00	624,000	
ニチユ三菱フォークリフト	700	496.00	347,200	
近畿車輛	1,000	373.00	373,000	
日産自動車	79,500	1,190.50	94,644,750	
いすゞ自動車	17,900	1,330.00	23,807,000	
トヨタ自動車	78,100	7,320.00	571,692,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	8,100	1,310.00	10,611,000	
三菱自動車工業	20,700	971.00	20,099,700	
エフテック	300	1,101.00	330,300	
武蔵精密工業	600	2,481.00	1,488,600	
日産車体	2,500	1,433.00	3,582,500	
新明和工業	2,000	1,279.00	2,558,000	
極東開発工業	1,100	1,284.00	1,412,400	
日信工業	1,000	1,841.00	1,841,000	
トピー工業	5,000	265.00	1,325,000	
ティラド	2,000	199.00	398,000	
曙ブレーキ工業	2,400	353.00	847,200	
タチエス	900	1,536.00	1,382,400	
N O K	2,700	2,716.00	7,333,200	
フタバ産業	1,700	470.00	799,000	
K Y B	6,000	335.00	2,010,000	
シロキ工業	1,000	319.00	319,000	
大同メタル工業	800	1,111.00	888,800	
プレス工業	2,800	462.00	1,293,600	
カルソニックカンセイ	4,000	934.00	3,736,000	
太平洋工業	1,200	1,332.00	1,598,400	
ケーヒン	1,300	1,893.00	2,460,900	
河西工業	700	1,402.00	981,400	
アイシン精機	5,200	4,370.00	22,724,000	
富士機工	700	484.00	338,800	
マツダ	16,900	2,242.00	37,889,800	
ダイハツ工業	6,800	1,472.00	10,009,600	
今仙電機製作所	500	1,073.00	536,500	
本田技研工業	50,900	3,820.00	194,438,000	代用有価証券 6,000株
スズキ	11,800	3,890.00	45,902,000	
富士重工業	19,300	4,498.00	86,811,400	
ヤマハ発動機	8,000	2,737.00	21,896,000	
ショーワ	1,300	1,015.00	1,319,500	

T B K	700	462.00	323,400
エクセディ	800	2,793.00	2,234,400
豊田合成	1,800	2,628.00	4,730,400
愛三工業	900	1,219.00	1,097,100
ヨロズ	500	2,529.00	1,264,500
エフ・シー・シー	800	2,090.00	1,672,000
シマノ	2,300	18,710.00	43,033,000
タカタ	1,000	1,364.00	1,364,000
テイ・エス テック	1,200	3,315.00	3,978,000
テルモ	8,700	3,360.00	29,232,000
クリエートメディック	200	944.00	188,800
日機装	1,800	929.00	1,672,200
島津製作所	7,000	1,698.00	11,886,000
J M S	1,000	284.00	284,000
長野計器	400	764.00	305,600
ブイ・テクノロジー	100	3,855.00	385,500
東京計器	2,000	225.00	450,000
愛知時計電機	1,000	326.00	326,000
東京精密	1,000	2,606.00	2,606,000
マニー	500	2,124.00	1,062,000
ニコン	10,600	1,542.00	16,345,200
トプコン	1,700	1,671.00	2,840,700
オリンパス	8,400	3,885.00	32,634,000
理研計器	500	1,428.00	714,000
タムロン	500	2,309.00	1,154,500
H O Y A	13,200	4,444.00	58,660,800
ノーリツ鋼機	500	578.00	289,000
エー・アンド・デイ	500	424.00	212,000
シチズンホールディングス	7,000	853.00	5,971,000
リズム時計工業	2,000	170.00	340,000
大研医器	400	1,023.00	409,200
松風	300	1,516.00	454,800
セイコーホールディングス	4,000	708.00	2,832,000
ニプロ	3,600	1,230.00	4,428,000
パラマウントベッドホールディングス	600	3,515.00	2,109,000
前田工織	600	927.00	556,200
永大産業	1,000	413.00	413,000
アートネイチャー	400	1,150.00	460,000
ダンロップスポーツ	400	1,214.00	485,600
バンダイナムコホールディングス	6,200	2,982.00	18,488,400
共立印刷	1,000	310.00	310,000
フランスベッドホールディングス	800	927.00	741,600

パイロットコーポレーション	1,000	4,965.00	4,965,000
トッパン・フォームズ	1,000	1,449.00	1,449,000
フジシールインターナショナル	700	4,140.00	2,898,000
タカラトミー	2,000	590.00	1,180,000
廣濟堂	500	398.00	199,000
アーク	1,800	115.00	207,000
プロネクサス	500	825.00	412,500
ウッドワン	1,000	248.00	248,000
大建工業	2,000	367.00	734,000
凸版印刷	16,000	1,021.00	16,336,000
大日本印刷	17,000	1,206.50	20,510,500
図書印刷	1,000	496.00	496,000
共同印刷	2,000	332.00	664,000
日本写真印刷	900	2,567.00	2,310,300
宝印刷	300	1,296.00	388,800
アシックス	5,300	3,210.00	17,013,000
ツツミ	300	2,358.00	707,400
小松ウオール工業	200	2,018.00	403,600
ヤマハ	4,200	2,839.00	11,923,800
河合楽器製作所	200	2,151.00	430,200
クリナップ	500	782.00	391,000
ピジョン	3,200	3,175.00	10,160,000
キングジム	500	831.00	415,500
リンテック	1,300	2,738.00	3,559,400
イトーキ	1,200	816.00	979,200
任天堂	3,500	23,300.00	81,550,000
三菱鉛筆	400	5,450.00	2,180,000
タカラスタンダード	2,000	899.00	1,798,000
コクヨ	2,900	1,293.00	3,749,700
ナカバヤシ	1,000	302.00	302,000
グローブライド	300	1,535.00	460,500
岡村製作所	2,200	1,080.00	2,376,000
美津濃	3,000	577.00	1,731,000
アデランス	700	926.00	648,200
東京電力	48,000	832.00	39,936,000
中部電力	17,300	1,797.50	31,096,750
関西電力	23,100	1,505.50	34,777,050
中国電力	7,800	1,762.00	13,743,600
北陸電力	5,500	1,710.00	9,405,000
東北電力	14,100	1,717.00	24,209,700
四国電力	5,100	1,993.00	10,164,300
九州電力	12,500	1,430.00	17,875,000

北海道電力	5,300	1,272.00	6,741,600
沖縄電力	600	2,963.00	1,777,800
電源開発	4,100	3,865.00	15,846,500
東京瓦斯	67,000	598.20	40,079,400
大阪瓦斯	59,000	480.40	28,343,600
東邦瓦斯	14,000	748.00	10,472,000
北海道瓦斯	1,000	283.00	283,000
西部瓦斯	6,000	269.00	1,614,000
静岡ガス	1,600	798.00	1,276,800
SBSホールディングス	600	1,060.00	636,000
東武鉄道	30,000	561.00	16,830,000
相鉄ホールディングス	10,000	671.00	6,710,000
東京急行電鉄	31,000	961.00	29,791,000
京浜急行電鉄	16,000	975.00	15,600,000
小田急電鉄	18,000	1,140.00	20,520,000
京王電鉄	16,000	925.00	14,800,000
京成電鉄	8,000	1,372.00	10,976,000
富士急行	2,000	1,196.00	2,392,000
新京成電鉄	1,000	413.00	413,000
東日本旅客鉄道	10,300	11,035.00	113,660,500
西日本旅客鉄道	5,400	7,994.00	43,167,600
東海旅客鉄道	5,100	20,705.00	105,595,500
西武ホールディングス	4,500	2,250.00	10,125,000
鴻池運輸	700	1,434.00	1,003,800
西日本鉄道	7,000	615.00	4,305,000
ハマキョウレックス	400	2,287.00	914,800
サカイ引越センター	100	6,050.00	605,000
近鉄グループホールディングス	57,000	449.00	25,593,000
阪急阪神ホールディングス	38,000	749.00	28,462,000
南海電気鉄道	13,000	635.00	8,255,000
京阪電気鉄道	13,000	817.00	10,621,000
神戸電鉄	1,000	352.00	352,000
名古屋鉄道	21,000	488.00	10,248,000
山陽電気鉄道	2,000	467.00	934,000
日本通運	22,000	597.00	13,134,000
ヤマトホールディングス	9,700	2,507.00	24,317,900
山九	7,000	628.00	4,396,000
丸全昭和運輸	2,000	427.00	854,000
センコー	3,000	856.00	2,568,000
トナミホールディングス	1,000	379.00	379,000
ニッコンホールディングス	1,900	2,217.00	4,212,300
福山通運	3,000	694.00	2,082,000

セイノーホールディングス	4,400	1,288.00	5,667,200
神奈川中央交通	1,000	663.00	663,000
日立物流	1,200	2,072.00	2,486,400
日本郵船	48,000	317.00	15,216,000
商船三井	30,000	319.00	9,570,000
川崎汽船	25,000	271.00	6,775,000
N S ユナイテッド海運	3,000	250.00	750,000
飯野海運	2,900	567.00	1,644,300
乾汽船	400	895.00	358,000
日本航空	10,800	4,310.00	46,548,000
A N A ホールディングス	111,000	347.90	38,616,900
パスコ	1,000	328.00	328,000
トランコム	200	6,060.00	1,212,000
日新	2,000	365.00	730,000
三菱倉庫	4,000	1,657.00	6,628,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	382.00	1,146,000
住友倉庫	4,000	613.00	2,452,000
澁澤倉庫	1,000	309.00	309,000
東陽倉庫	1,000	253.00	253,000
日本トランスシティ	1,000	437.00	437,000
中央倉庫	300	916.00	274,800
安田倉庫	400	935.00	374,000
東洋埠頭	2,000	192.00	384,000
宇徳	500	474.00	237,000
上組	7,000	999.00	6,993,000
キューソー流通システム	200	2,560.00	512,000
郵船ロジスティクス	500	1,316.00	658,000
近鉄エクスプレス	1,000	2,138.00	2,138,000
エーアイティー	300	1,049.00	314,700
N E C ネットエスアイ	700	2,312.00	1,618,400
システナ	500	1,159.00	579,500
デジタルアーツ	300	2,081.00	624,300
新日鉄住金ソリューションズ	500	5,110.00	2,555,000
I T ホールディングス	1,900	2,836.00	5,388,400
電算システム	200	2,020.00	404,000
グリー	3,400	595.00	2,023,000
コーエーテクモホールディングス	1,500	1,645.00	2,467,500
三菱総合研究所	200	2,931.00	586,200
K L a b	900	1,207.00	1,086,300
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	400	1,021.00	408,400
ネクソン	5,300	1,628.00	8,628,400
エイチーム	200	1,855.00	371,000



enish	200	822.00	164,400
コロプラ	1,500	1,945.00	2,917,500
モバイルクリエイト	300	462.00	138,600
ブロードリーフ	600	1,355.00	813,000
ハーツユナイテッドグループ	200	1,783.00	356,600
ティーガイア	600	1,763.00	1,057,800
豆蔵ホールディングス	400	481.00	192,400
GMOペイメントゲートウェイ	500	4,870.00	2,435,000
インターネットイニシアティブ	900	2,362.00	2,125,800
SRAホールディングス	300	2,254.00	676,200
朝日ネット	600	525.00	315,000
野村総合研究所	3,500	4,800.00	16,800,000
サイバネットシステム	500	398.00	199,000
インテージホールディングス	300	1,723.00	516,900
ソースネクスト	300	489.00	146,700
フジ・メディア・ホールディングス	5,800	1,466.00	8,502,800
オービック	1,900	5,760.00	10,944,000
ジャストシステム	1,000	950.00	950,000
ヤフー	40,000	491.00	19,640,000
トレンドマイクロ	2,700	4,310.00	11,637,000
日本オラクル	900	5,300.00	4,770,000
アルファシステムズ	200	1,920.00	384,000
フューチャーアーキテクト	700	685.00	479,500
CAC Holdings	400	996.00	398,400
ソフトバンク・テクノロジー	200	1,230.00	246,000
オービックビジネスコンサルタント	400	6,280.00	2,512,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,300	2,868.00	3,728,400
アイティフォー	700	489.00	342,300
大塚商会	1,500	5,980.00	8,970,000
サイボウズ	700	305.00	213,500
電通国際情報サービス	300	1,730.00	519,000
ウェザーニューズ	200	3,890.00	778,000
CIJ	500	504.00	252,000
WOWOW	300	3,115.00	934,500
ネットワンシステムズ	2,300	712.00	1,637,600
アルゴグラフィックス	200	1,752.00	350,400
マーベラス	900	1,000.00	900,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,100	1,581.00	1,739,100
日本ユニシス	1,500	1,278.00	1,917,000
兼松エレクトロニクス	400	1,763.00	705,200
東京放送ホールディングス	3,300	1,690.00	5,577,000
日本テレビホールディングス	5,100	1,997.00	10,184,700

朝日放送	600	774.00	464,400
テレビ朝日ホールディングス	1,500	1,912.00	2,868,000
スカパーJ S A Tホールディングス	4,200	630.00	2,646,000
テレビ東京ホールディングス	500	2,120.00	1,060,000
コネクシオ	400	1,218.00	487,200
日本電信電話	43,700	4,495.00	196,431,500
K D D I	56,700	2,792.50	158,334,750
光通信	500	8,930.00	4,465,000
N T T ドコモ	43,100	2,234.00	96,285,400
G M O インターネット	2,100	1,637.00	3,437,700
カドカワ	1,400	1,600.00	2,240,000
学研ホールディングス	2,000	235.00	470,000
ゼンリン	700	1,726.00	1,208,200
昭文社	300	718.00	215,400
アイネット	300	1,187.00	356,100
松竹	4,000	1,067.00	4,268,000
東宝	4,000	3,025.00	12,100,000
東映	2,000	1,005.00	2,010,000
エヌ・ティ・ティ・データ	3,500	5,990.00	20,965,000
D T S	600	2,746.00	1,647,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,100	3,230.00	6,783,000
シーイーシー	400	1,026.00	410,400
カプコン	1,400	2,425.00	3,395,000
ジャステック	400	1,121.00	448,400
S C S K	1,300	4,460.00	5,798,000
アイネス	800	1,132.00	905,600
T K C	500	2,877.00	1,438,500
富士ソフト	800	2,206.00	1,764,800
N S D	1,300	1,593.00	2,070,900
コナミホールディングス	2,300	2,705.00	6,221,500
J B C C ホールディングス	500	789.00	394,500
ミロク情報サービス	400	828.00	331,200
ソフトバンクグループ	29,500	6,427.00	189,596,500
高千穂交易	200	956.00	191,200
伊藤忠食品	100	4,010.00	401,000
エレマテック	300	2,741.00	822,300
J A L U X	200	2,192.00	438,400
あらた	300	2,556.00	766,800
双日	37,400	253.00	9,462,200
アルフレッサ ホールディングス	6,600	2,188.00	14,440,800
横浜冷凍	1,400	986.00	1,380,400
アルコニックス	300	1,671.00	501,300

神戸物産	200	9,510.00	1,902,000
あい ホールディングス	900	2,843.00	2,558,700
ダイワボウホールディングス	5,000	235.00	1,175,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,000	1,504.00	1,504,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,000	834.00	834,000
八洲電機	400	586.00	234,400
U K Cホールディングス	400	2,423.00	969,200
T O K A Iホールディングス	2,700	486.00	1,312,200
三洋貿易	300	1,562.00	468,600
ウイン・パートナーズ	200	1,693.00	338,600
シップヘルスケアホールディングス	1,000	2,876.00	2,876,000
小野建	500	1,027.00	513,500
佐島電機	400	790.00	316,000
伯東	400	1,410.00	564,000
コンドーテック	400	755.00	302,000
中山福	300	835.00	250,500
ナガイレーベン	800	1,972.00	1,577,600
三菱食品	600	2,847.00	1,708,200
松田産業	400	1,438.00	575,200
メディバルホールディングス	5,600	1,999.00	11,194,400
アドヴァン	600	996.00	597,600
S P K	100	2,237.00	223,700
アズワン	400	3,870.00	1,548,000
シモジマ	300	1,065.00	319,500
ドウシシャ	700	2,165.00	1,515,500
小津産業	100	2,140.00	214,000
高速	300	889.00	266,700
黒田電気	1,000	2,392.00	2,392,000
丸文	500	862.00	431,000
ハピネット	300	1,223.00	366,900
橋本総業	100	1,293.00	129,300
エクセル	300	1,508.00	452,400
マルカキカイ	200	1,708.00	341,600
ガリバーインターナショナル	1,700	1,145.00	1,946,500
日本エム・ディ・エム	500	625.00	312,500
進和	300	1,688.00	506,400
シークス	400	3,195.00	1,278,000
オーハシテクニカ	300	1,356.00	406,800
伊藤忠商事	46,800	1,460.00	68,328,000
丸紅	48,900	678.30	33,168,870
高島	1,000	257.00	257,000
長瀬産業	3,100	1,451.00	4,498,100

蝶理	400	1,713.00	685,200	
豊田通商	6,200	2,685.00	16,647,000	
三共生興	900	452.00	406,800	
兼松	11,000	194.00	2,134,000	
三井物産	47,400	1,486.50	70,460,100	
日本紙パルプ商事	3,000	328.00	984,000	
日立ハイテクノロジーズ	1,900	2,747.00	5,219,300	
カメイ	700	1,242.00	869,400	
OUGホールディングス	1,000	243.00	243,000	
スターゼン	200	3,120.00	624,000	
山善	2,100	1,026.00	2,154,600	
住友商事	33,000	1,276.00	42,108,000	
内田洋行	1,000	368.00	368,000	
三菱商事	41,900	2,159.50	90,483,050	代用有価証券 5,200株
第一実業	1,000	570.00	570,000	
キャノンマーケティングジャパン	1,600	1,838.00	2,940,800	
西華産業	2,000	263.00	526,000	
佐藤商事	500	717.00	358,500	
菱洋エレクトロ	600	1,487.00	892,200	
東京産業	600	484.00	290,400	
ユアサ商事	500	2,633.00	1,316,500	
神鋼商事	1,000	241.00	241,000	
阪和興業	6,000	475.00	2,850,000	
カナデン	500	902.00	451,000	
菱電商事	1,000	787.00	787,000	
フルサト工業	300	1,768.00	530,400	
岩谷産業	6,000	650.00	3,900,000	
すてきナイスグループ	2,000	171.00	342,000	
昭光通商	2,000	89.00	178,000	
イワキ	1,000	229.00	229,000	
三愛石油	1,000	850.00	850,000	
稲畑産業	1,300	1,326.00	1,723,800	
G S Iクレオス	1,000	115.00	115,000	
ワキタ	1,200	988.00	1,185,600	
東邦ホールディングス	1,900	2,586.00	4,913,400	
サンゲツ	1,900	1,934.00	3,674,600	
ミツウロコグループホールディングス	900	567.00	510,300	
シナネンホールディングス	1,000	445.00	445,000	
伊藤忠エネクス	1,200	919.00	1,102,800	
サンリオ	1,600	3,135.00	5,016,000	
サンワテクノス	400	1,090.00	436,000	
リョーサン	900	2,865.00	2,578,500	

新光商事	700	1,297.00	907,900
トーヨー	300	2,122.00	636,600
三信電気	800	1,256.00	1,004,800
東陽テクニカ	800	976.00	780,800
モスフードサービス	700	2,592.00	1,814,400
加賀電子	500	1,660.00	830,000
ソーダニッカ	600	486.00	291,600
立花エレテック	400	1,349.00	539,600
PALTA C	900	2,184.00	1,965,600
太平洋興発	2,000	86.00	172,000
ヤマタネ	3,000	184.00	552,000
日鉄住金物産	4,000	406.00	1,624,000
トラスコ中山	600	4,100.00	2,460,000
オートバックスセブン	2,000	2,008.00	4,016,000
加藤産業	900	2,922.00	2,629,800
イノテック	500	465.00	232,500
イエローハット	500	2,706.00	1,353,000
J Kホールディングス	600	503.00	301,800
日伝	200	2,885.00	577,000
杉本商事	300	1,261.00	378,300
因幡電機産業	800	3,745.00	2,996,000
ミスミグループ本社	6,300	1,468.00	9,248,400
タキヒヨー	1,000	450.00	450,000
スズケン	2,500	4,330.00	10,825,000
ジェコス	400	1,089.00	435,600
ルネサスイーストン	300	470.00	141,000
ローソン	2,100	8,910.00	18,711,000
サンエー	400	4,830.00	1,932,000
カワチ薬品	400	2,048.00	819,200
エービーシー・マート	900	7,150.00	6,435,000
ハードオフコーポレーション	300	1,527.00	458,100
アスクル	600	4,375.00	2,625,000
ゲオホールディングス	1,100	1,808.00	1,988,800
アダストリア	500	7,230.00	3,615,000
くらコーポレーション	300	3,635.00	1,090,500
キャンドウ	300	1,567.00	470,100
パル	300	2,678.00	803,400
エディオン	2,600	857.00	2,228,200
サーラコーポレーション	500	586.00	293,000
あみやき亭	100	4,440.00	444,000
ひらまつ	800	648.00	518,400
ゲンキー	100	4,905.00	490,500

大黒天物産	100	4,010.00	401,000
ハニーズ	500	1,015.00	507,500
アルペン	500	1,935.00	967,500
クオール	600	1,620.00	972,000
ジェイアイエヌ	400	4,555.00	1,822,000
ビックカメラ	2,900	1,052.00	3,050,800
D C Mホールディングス	2,700	798.00	2,154,600
Monotaro	2,000	2,907.00	5,814,000
アークランドサービス	100	4,790.00	479,000
J.フロント リテイリング	7,100	1,929.00	13,695,900
ドトール・日レスホールディングス	1,000	1,729.00	1,729,000
マツモトキヨシホールディングス	1,200	5,240.00	6,288,000
ブロンコビリー	200	2,365.00	473,000
スタートトゥデイ	1,700	4,110.00	6,987,000
物語コーポレーション	200	4,880.00	976,000
ココカラファイン	600	4,965.00	2,979,000
三越伊勢丹ホールディングス	11,100	1,879.00	20,856,900
ウエルシアホールディングス	600	5,810.00	3,486,000
クリエイティブSDホールディングス	300	7,030.00	2,109,000
丸善C H Iホールディングス	700	348.00	243,600
チムニー	100	2,894.00	289,400
ジョイフル本田	800	2,297.00	1,837,600
すかいらーく	1,700	1,534.00	2,607,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,800	1,101.00	1,981,800
ブックオフコーポレーション	300	927.00	278,100
あさひ	400	1,254.00	501,600
日本調剤	100	4,605.00	460,500
コスモス薬品	300	15,300.00	4,590,000
トーエル	300	627.00	188,100
セブン&アイ・ホールディングス	23,400	5,418.00	126,781,200
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	400	3,345.00	1,338,000
ツルハホールディングス	1,200	9,770.00	11,724,000
サンマルクホールディングス	400	3,490.00	1,396,000
トリドール	600	1,442.00	865,200
クスリのアオキ	400	6,090.00	2,436,000
総合メディカル	300	4,310.00	1,293,000
カッパ・クリエイティブ	800	1,202.00	961,600
ライトオン	400	1,059.00	423,600
良品計画	700	23,780.00	16,646,000
三城ホールディングス	700	460.00	322,000
コナカ	700	623.00	436,100

イオン北海道	400	516.00	206,400
コジマ	800	280.00	224,000
コーナン商事	900	1,726.00	1,553,400
ワタミ	700	927.00	648,900
ドンキホーテホールディングス	3,600	4,355.00	15,678,000
西松屋チェーン	1,100	1,105.00	1,215,500
ゼンショーホールディングス	2,900	1,135.00	3,291,500
幸楽苑ホールディングス	400	1,527.00	610,800
サイゼリヤ	900	2,630.00	2,367,000
ユナイテッドアローズ	700	5,390.00	3,773,000
ハイデイ日高	400	3,030.00	1,212,000
京都きもの友禅	300	991.00	297,300
コロワイド	1,900	1,699.00	3,228,100
壱番屋	300	5,340.00	1,602,000
スギホールディングス	1,000	5,780.00	5,780,000
スクロール	700	571.00	399,700
ヨンドシーホールディングス	400	2,417.00	966,800
ファミリーマート	1,900	5,020.00	9,538,000
木曽路	700	1,998.00	1,398,600
サトレストランシステムズ	600	855.00	513,000
千趣会	1,100	778.00	855,800
ケーヨー	1,000	499.00	499,000
上新電機	1,000	905.00	905,000
日本瓦斯	900	3,190.00	2,871,000
ベスト電器	1,800	139.00	250,200
ロイヤルホールディングス	900	2,102.00	1,891,800
いなげや	600	1,211.00	726,600
島忠	1,400	2,682.00	3,754,800
チヨダ	700	3,775.00	2,642,500
ライフコーポレーション	400	3,075.00	1,230,000
リンガーハット	500	2,492.00	1,246,000
AOKIホールディングス	1,300	1,386.00	1,801,800
オークワ	1,000	1,007.00	1,007,000
コメリ	1,000	2,565.00	2,565,000
青山商事	1,300	4,265.00	5,544,500
しまむら	600	14,380.00	8,628,000
高島屋	8,000	1,033.00	8,264,000
松屋	1,100	1,473.00	1,620,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,600	2,317.00	6,024,200
近鉄百貨店	2,000	322.00	644,000
ニッセンホールディングス	800	197.00	157,600
パルコ	500	1,002.00	501,000

丸井グループ	5,900	1,492.00	8,802,800
アクシアル リテイリング	400	4,200.00	1,680,000
イオン	23,000	1,792.00	41,216,000
ユニーグループ・ホールディングス	5,300	677.00	3,588,100
イズミ	1,200	4,490.00	5,388,000
東武ストア	1,000	300.00	300,000
平和堂	1,100	2,703.00	2,973,300
フジ	600	2,474.00	1,484,400
ヤオコー	600	5,070.00	3,042,000
ゼビオホールディングス	800	2,240.00	1,792,000
ケーズホールディングス	1,300	4,360.00	5,668,000
O l y m p i cグループ	300	575.00	172,500
日産東京販売ホールディングス	900	296.00	266,400
アインファーマシーズ	700	5,870.00	4,109,000
元気寿司	200	2,184.00	436,800
ヤマダ電機	22,100	564.00	12,464,400
アークランドサカモト	400	2,590.00	1,036,000
ニトリホールディングス	2,400	9,320.00	22,368,000
吉野家ホールディングス	1,600	1,495.00	2,392,000
松屋フーズ	300	2,297.00	689,100
サガミチェーン	1,000	1,220.00	1,220,000
関西スーパーマーケット	400	824.00	329,600
王将フードサービス	400	3,980.00	1,592,000
プレナス	600	1,886.00	1,131,600
ミニストップ	400	2,229.00	891,600
アークス	1,000	2,432.00	2,432,000
パローホールディングス	1,200	2,769.00	3,322,800
ベルク	200	4,560.00	912,000
大庄	300	1,387.00	416,100
ファーストリテイリング	1,100	43,200.00	47,520,000
サンドラッグ	1,200	6,430.00	7,716,000
サックスパー ホールディングス	400	2,007.00	802,800
ベルーナ	1,400	684.00	957,600
じもとホールディングス	4,000	205.00	820,000
足利ホールディングス	3,500	496.00	1,736,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	700	3,930.00	2,751,000
九州フィナンシャルグループ	9,400	890.00	8,366,000
新生銀行	53,000	246.00	13,038,000
あおぞら銀行	38,000	431.00	16,378,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	448,200	757.20	339,377,040
りそなホールディングス	65,400	631.00	41,267,400
三井住友トラスト・ホールディングス	123,000	452.40	55,645,200



三井住友フィナンシャルグループ	42,200	4,709.00	198,719,800
第四銀行	7,000	551.00	3,857,000
北越銀行	6,000	240.00	1,440,000
西日本シティ銀行	20,000	345.00	6,900,000
千葉銀行	22,000	855.00	18,810,000
横浜銀行	37,000	748.20	27,683,400
常陽銀行	20,000	620.00	12,400,000
群馬銀行	13,000	751.00	9,763,000
武蔵野銀行	900	4,390.00	3,951,000
千葉興業銀行	1,400	698.00	977,200
筑波銀行	2,300	420.00	966,000
七十七銀行	9,000	658.00	5,922,000
青森銀行	4,000	366.00	1,464,000
秋田銀行	4,000	375.00	1,500,000
山形銀行	3,000	470.00	1,410,000
岩手銀行	400	5,260.00	2,104,000
東邦銀行	5,000	441.00	2,205,000
東北銀行	3,000	149.00	447,000
みちのく銀行	3,000	208.00	624,000
ふくおかフィナンシャルグループ	23,000	619.00	14,237,000
静岡銀行	16,000	1,204.00	19,264,000
十六銀行	7,000	533.00	3,731,000
スルガ銀行	5,900	2,296.00	13,546,400
八十二銀行	10,000	809.00	8,090,000
山梨中央銀行	3,000	586.00	1,758,000
大垣共立銀行	7,000	466.00	3,262,000
福井銀行	5,000	240.00	1,200,000
北國銀行	6,000	484.00	2,904,000
清水銀行	200	2,962.00	592,400
滋賀銀行	6,000	599.00	3,594,000
南都銀行	5,000	382.00	1,910,000
百五銀行	5,000	571.00	2,855,000
京都銀行	11,000	1,202.00	13,222,000
紀陽銀行	2,200	1,865.00	4,103,000
三重銀行	2,000	263.00	526,000
ほくほくフィナンシャルグループ	38,000	264.00	10,032,000
広島銀行	16,000	658.00	10,528,000
山陰合同銀行	3,000	1,113.00	3,339,000
中国銀行	4,000	1,709.00	6,836,000
鳥取銀行	2,000	208.00	416,000
伊予銀行	6,000	1,301.00	7,806,000
百十四銀行	6,000	450.00	2,700,000

四国銀行	4,000	247.00	988,000
阿波銀行	5,000	687.00	3,435,000
大分銀行	3,000	475.00	1,425,000
宮崎銀行	4,000	390.00	1,560,000
佐賀銀行	3,000	268.00	804,000
十八銀行	3,000	362.00	1,086,000
沖縄銀行	400	4,985.00	1,994,000
琉球銀行	1,200	1,745.00	2,094,000
セブン銀行	18,800	539.00	10,133,200
みずほフィナンシャルグループ	785,200	238.80	187,505,760
高知銀行	2,000	142.00	284,000
山口フィナンシャルグループ	6,000	1,438.00	8,628,000
長野銀行	2,000	202.00	404,000
名古屋銀行	5,000	435.00	2,175,000
北洋銀行	8,400	460.00	3,864,000
愛知銀行	200	6,490.00	1,298,000
第三銀行	3,000	178.00	534,000
中京銀行	2,000	240.00	480,000
東日本銀行	2,000	404.00	808,000
大光銀行	2,000	235.00	470,000
愛媛銀行	3,000	247.00	741,000
トマト銀行	2,000	172.00	344,000
みなと銀行	5,000	199.00	995,000
京葉銀行	5,000	597.00	2,985,000
関西アーバン銀行	800	1,352.00	1,081,600
栃木銀行	3,000	669.00	2,007,000
北日本銀行	200	3,185.00	637,000
東和銀行	8,000	106.00	848,000
福島銀行	7,000	95.00	665,000
大東銀行	4,000	175.00	700,000
トモニホールディングス	4,300	466.00	2,003,800
フィデアホールディングス	3,900	234.00	912,600
池田泉州ホールディングス	5,300	520.00	2,756,000
F P G	1,700	902.00	1,533,400
S B Iホールディングス	6,700	1,426.00	9,554,200
日本アジア投資	500	453.00	226,500
ジャフコ	800	4,560.00	3,648,000
大和証券グループ本社	52,000	830.50	43,186,000
野村ホールディングス	114,200	745.80	85,170,360
岡三証券グループ	5,000	739.00	3,695,000
丸三証券	1,800	1,146.00	2,062,800
東洋証券	2,000	388.00	776,000

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,400	713.00	4,563,200
光世証券	1,000	193.00	193,000
水戸証券	1,700	373.00	634,100
いちよし証券	1,200	1,079.00	1,294,800
松井証券	2,800	1,078.00	3,018,400
マネックスグループ	6,600	328.00	2,164,800
カブドットコム証券	5,000	399.00	1,995,000
極東証券	700	1,563.00	1,094,100
岩井コスモホールディングス	600	1,322.00	793,200
マネースクウェアHD	200	1,618.00	323,600
マネーパートナーズグループ	600	427.00	256,200
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	12,400	3,811.00	47,256,400
アニコムホールディングス	300	2,798.00	839,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	17,800	3,459.00	61,570,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	5,400	2,175.00	11,745,000
第一生命保険	35,800	2,035.50	72,870,900
東京海上ホールディングス	22,600	4,511.00	101,948,600
T&Dホールディングス	20,400	1,550.00	31,620,000
全国保証	1,500	4,090.00	6,135,000
クレディセゾン	4,600	2,468.00	11,352,800
芙蓉総合リース	600	5,210.00	3,126,000
興銀リース	1,000	2,420.00	2,420,000
東京センチュリーリース	1,300	3,935.00	5,115,500
日本証券金融	2,500	632.00	1,580,000
アイフル	9,300	483.00	4,491,900
ポケットカード	400	604.00	241,600
リコーリース	400	3,520.00	1,408,000
イオンフィナンシャルサービス	3,700	2,812.00	10,404,400
アコム	11,200	659.00	7,380,800
ジャックス	3,000	503.00	1,509,000
オリエン트コーポレーション	17,300	228.00	3,944,400
日立キャピタル	1,100	3,195.00	3,514,500
アプラスフィナンシャル	2,700	118.00	318,600
オリックス	39,600	1,761.50	69,755,400
三菱UFJリース	14,200	595.00	8,449,000
日本取引所グループ	16,400	1,903.00	31,209,200
イー・ギャランティ	200	2,366.00	473,200
NECキャピタルソリューション	200	1,685.00	337,000
日本駐車場開発	6,100	138.00	841,800
ヒューリック	11,600	1,086.00	12,597,600
三栄建築設計	200	1,262.00	252,400
野村不動産ホールディングス	3,400	2,299.00	7,816,600

プレサンスコーポレーション	200	4,745.00	949,000
ユニゾホールディングス	300	4,980.00	1,494,000
日本管理センター	400	1,298.00	519,200
フージャースホールディングス	800	475.00	380,000
オープンハウス	800	2,188.00	1,750,400
東急不動産ホールディングス	14,600	857.00	12,512,200
飯田グループホールディングス	3,600	2,126.00	7,653,600
パーク24	2,800	2,373.00	6,644,400
三井不動産	30,000	3,262.00	97,860,000
三菱地所	42,000	2,514.00	105,588,000
平和不動産	1,100	1,404.00	1,544,400
東京建物	6,100	1,490.00	9,089,000
ダイビル	1,400	964.00	1,349,600
京阪神ビルディング	900	694.00	624,600
住友不動産	13,000	3,971.00	51,623,000
大京	9,000	204.00	1,836,000
テオーシー	1,900	819.00	1,556,100
東京楽天地	1,000	485.00	485,000
レオパレス21	6,100	610.00	3,721,000
スターツコーポレーション	600	1,881.00	1,128,600
フジ住宅	700	683.00	478,100
空港施設	700	562.00	393,400
住友不動産販売	400	2,982.00	1,192,800
ゴールドクレスト	500	2,228.00	1,114,000
日本エスリード	200	1,127.00	225,400
日神不動産	700	392.00	274,400
タカラレーベン	2,500	600.00	1,500,000
サンヨーハウジング名古屋	300	1,258.00	377,400
イオンモール	3,600	1,923.00	6,922,800
ファースト住建	200	1,378.00	275,600
トーセイ	800	732.00	585,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,500	1,183.00	4,140,500
サンフロンティア不動産	600	898.00	538,800
エフ・ジェー・ネクスト	400	541.00	216,400
日本空港ビルデング	1,900	5,830.00	11,077,000
日本工営	2,000	477.00	954,000
ネクスト	1,400	951.00	1,331,400
日本M&Aセンター	900	4,995.00	4,495,500
アコーディア・ゴルフ	2,200	1,065.00	2,343,000
タケエイ	600	1,177.00	706,200
パソナグループ	400	950.00	380,000
GCAサヴィアン	500	1,497.00	748,500

エス・エム・エス	700	2,202.00	1,541,400
テンプホールディングス	1,200	5,330.00	6,396,000
クックパッド	1,300	2,358.00	3,065,400
エスクリ	200	939.00	187,800
学情	200	1,098.00	219,600
スタジオアリス	300	2,280.00	684,000
シミックホールディングス	300	1,659.00	497,700
総合警備保障	2,000	5,570.00	11,140,000
カカクコム	3,900	2,115.00	8,248,500
アイロムグループ	100	1,376.00	137,600
ルネサンス	300	1,223.00	366,900
ディップ	700	2,221.00	1,554,700
オプトホールディング	400	630.00	252,000
新日本科学	600	595.00	357,000
ツクイ	700	1,223.00	856,100
エムスリー	5,100	2,311.00	11,786,100
ツカダ・グローバルホールディング	400	770.00	308,000
アウトソーシング	300	2,323.00	696,900
ディー・エヌ・エー	2,900	2,351.00	6,817,900
博報堂D Yホールディングス	8,200	1,156.00	9,479,200
ぐるなび	700	2,228.00	1,559,600
一休	500	2,502.00	1,251,000
ファンコミュニケーションズ	1,400	880.00	1,232,000
バリューコマース	500	497.00	248,500
J Pホールディングス	1,500	326.00	489,000
E P Sホールディングス	500	1,152.00	576,000
プレステージ・インターナショナル	500	1,154.00	577,000
アミューズ	200	4,725.00	945,000
ドリームインキュベータ	200	2,038.00	407,600
クイック	300	879.00	263,700
ケネディクス	7,900	442.00	3,491,800
電通	6,600	6,470.00	42,702,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	684.00	136,800
ぴあ	200	2,168.00	433,600
イオンファンタジー	200	1,784.00	356,800
みらかホールディングス	1,500	5,210.00	7,815,000
アルプス技研	200	2,182.00	436,400
サニックス	700	280.00	196,000
日本空調サービス	300	1,109.00	332,700
オリエンタルランド	6,400	6,832.00	43,724,800
ダスキン	1,700	2,042.00	3,471,400
明光ネットワークジャパン	700	1,431.00	1,001,700

ファルコホールディングス	300	1,476.00	442,800
ラウンドワン	1,700	533.00	906,100
リゾートトラスト	2,300	3,110.00	7,153,000
ビー・エム・エル	300	3,425.00	1,027,500
りらいあコミュニケーションズ	1,100	1,111.00	1,222,100
ユー・エス・エス	7,200	2,000.00	14,400,000
サイバーエージェント	1,400	4,900.00	6,860,000
楽天	27,600	1,687.00	46,561,200
セントラルスポーツ	200	2,254.00	450,800
フルキャストホールディングス	500	775.00	387,500
テクノプロ・ホールディングス	800	3,130.00	2,504,000
リブセンス	400	441.00	176,400
ジャパンマテリアル	200	2,056.00	411,200
アサンテ	200	1,446.00	289,200
リクルートホールディングス	8,900	3,695.00	32,885,500
リロ・ホールディング	200	12,650.00	2,530,000
東祥	100	3,380.00	338,000
エイチ・アイ・エス	1,000	4,040.00	4,040,000
共立メンテナンス	400	8,150.00	3,260,000
イチネンホールディングス	600	1,006.00	603,600
建設技術研究所	300	1,229.00	368,700
スペース	300	1,323.00	396,900
東京テアトル	2,000	133.00	266,000
よみうりランド	1,000	421.00	421,000
東京都競馬	4,000	290.00	1,160,000
常磐興産	2,000	152.00	304,000
カナモト	800	2,419.00	1,935,200
東京ドーム	4,000	570.00	2,280,000
西尾レントオール	500	2,711.00	1,355,500
トランス・コスモス	800	3,175.00	2,540,000
乃村工藝社	1,200	1,638.00	1,965,600
藤田観光	2,000	452.00	904,000
KNT-CTホールディングス	3,000	287.00	861,000
日本管財	600	1,829.00	1,097,400
トーカイ	300	3,785.00	1,135,500
セコム	5,700	7,633.00	43,508,100
セントラル警備保障	300	1,432.00	429,600
丹青社	1,000	805.00	805,000
メイテック	800	4,295.00	3,436,000
アサツー ディ・ケイ	1,000	2,838.00	2,838,000
応用地質	600	1,505.00	903,000
船井総研ホールディングス	700	1,628.00	1,139,600

ベネッセホールディングス	2,200	3,200.00	7,040,000	
イオンディライト	600	3,465.00	2,079,000	
ナック	400	838.00	335,200	
ニチイ学館	1,200	851.00	1,021,200	
ダイセキ	1,000	1,892.00	1,892,000	
合 計	9,102,500		12,387,766,180	

## (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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,068,675,638	1,209,638,506
コール・ローン	6,860,058	9,897,264
株式	11,399,949,591	10,009,538,335
投資信託受益証券	1,570,602	1,271,905
投資証券	281,458,009	267,242,651
派生商品評価勘定	9,793,658	57,857,363
未収入金	3,088,491	73,525
未収配当金	17,274,301	9,422,845
未収利息	7	14
差入委託証拠金	211,544,087	399,774,047
流動資産合計	13,000,214,442	11,964,716,455
資産合計	13,000,214,442	11,964,716,455
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	244,545	600
未払解約金	3,400,000	4,550,000
流動負債合計	3,644,545	4,550,600
負債合計	3,644,545	4,550,600
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,571,028,589	6,253,707,132
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,425,541,308	5,706,458,723
元本等合計	12,996,569,897	11,960,165,855

	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
純資産合計	12,996,569,897	11,960,165,855
負債純資産合計	13,000,214,442	11,964,716,455

## 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27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 6,571,028,589口	1. 計算日における受益権の総数 6,253,707,132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	1.9779円	1口当たり純資産額	1.9125円
(1万口当たり純資産額)	(19,779円)	(1万口当たり純資産額)	(19,125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10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスク、為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,489,665,114円	6,571,028,589円
期中追加設定元本額	61,424,329円	376,272,755円
期中一部解約元本額	980,060,854円	693,594,212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	550,960,391円	497,173,395円
新光外国株式インデックスV A	2,942,414,922円	2,716,228,820円
新光世界バランスファンド3 5 V A（適格機関投資家私募）	740,836,319円	728,410,380円
新光ワールドバランスファンドV A（適格機関投資家私募）	557,513,295円	541,089,965円
新光世界バランス3 5 V A T（適格機関投資家私募）	125,984,108円	127,860,117円
ワールドバランスファンド3 0 V A（適格機関投資家私募）	1,059,310,207円	1,051,128,371円
ワールドバランスファンド3 0 V A 2（適格機関投資家私募）	575,305,622円	574,299,806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）	3,900,412円	1,859,736円
グローバル・ナビ	14,803,313円	15,656,542円
合計	6,571,028,589円	6,253,707,132円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	640,838,333	17,719,167
投資信託受益証券	33,898	272,551
投資証券	15,756,154	13,693,364
合計	656,628,385	31,139,980

(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27年 4月20日現在				平成27年10月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超				うち1年超			
市場取引								
株値指数先物取引								
買建	1,292,410,563	-	1,301,833,828	9,423,265	1,598,710,625	-	1,656,392,081	57,681,456
S&P500 EMINI	896,587,442	-	901,038,890	4,451,448	1,108,948,373	-	1,151,188,131	42,239,758
S&P/TSE 601X	50,745,770	-	52,343,865	1,598,095	28,911,433	-	29,604,556	693,123
DJ EURO ST50	171,701,150	-	171,418,854	282,296	201,525,928	-	207,979,859	6,453,931
LIFFE FTSE	132,683,304	-	136,119,446	3,436,142	215,412,280	-	222,125,716	6,713,436
SPI 200	40,692,897	-	40,912,773	219,876	43,912,611	-	45,493,819	1,581,208
合計	1,292,410,563	-	1,301,833,828	9,423,265	1,598,710,625	-	1,656,392,081	57,681,456

## 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27年 4月20日現在				平成27年10月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	8,354,020	-	8,354,300	280	19,206,500	-	19,200,450	6,050
米ドル	3,567,900	-	3,567,900	0	10,757,700	-	10,757,700	0
ユーロ	3,856,200	-	3,856,500	300	4,748,800	-	4,742,150	6,650
英ポンド	-	-	-	-	3,700,000	-	3,700,600	600
オーストラリアドル	929,920	-	929,900	20	-	-	-	-
合計	8,354,020	-	8,354,300	280	19,206,500	-	19,200,450	6,050

## 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	1,471	72.31	106,368.01	
	ANTERO RESOURCES CORPORATION	240	23.24	5,577.60	
	APACHE CORP	1,069	45.33	48,457.77	

BAKER HUGHES INC	1,264	53.33	67,409.12
CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,174	23.11	27,131.14
CAMERON INTERNATIONAL CORPORATION	565	65.34	36,917.10
CHENIERE ENERGY INC	699	47.68	33,328.32
CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,800	8.09	14,562.00
CHEVRON CORP	5,283	90.03	475,628.49
CIMAREX ENERGY CO	300	116.53	34,959.00
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	1,000	7.86	7,860.00
COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	927	21.15	19,606.05
CONCHO RESOURCES INC	351	111.73	39,217.23
CONOCOPHILLIPS	3,464	53.69	185,982.16
CONSOL ENERGY INC	643	10.51	6,757.93
CONTINENTAL RESOURCES INC	289	35.05	10,129.45
CORE LABORATORIES NV	136	112.30	15,272.80
DEVON ENERGY CORPORATION	1,116	45.28	50,532.48
ENERGEN CORPORATION	227	58.71	13,327.17
ENSCO PLC-CLASS A	676	16.08	10,870.08
EOG RESOURCES INC	1,597	84.81	135,441.57
EQT CORPORATION	436	75.15	32,765.40
EXXON MOBIL CORP	11,747	80.99	951,389.53
FMC TECHNOLOGIES INC	766	33.85	25,929.10
HALLIBURTON CO	2,469	37.36	92,241.84
HELMERICH & PAYNE INC	336	55.81	18,752.16
HESS CORPORATION	749	59.82	44,805.18
HOLLYFRONTIER CORPORATION	578	47.65	27,541.70
KINDER MORGAN INC	5,214	31.72	165,388.08
MARATHON OIL CORP	1,933	18.28	35,335.24
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	1,526	49.06	74,865.56
MURPHY OIL CORPORATION	496	27.58	13,679.68
NABORS INDUSTRIES LTD	946	10.08	9,535.68
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,192	38.98	46,464.16
NOBLE ENERGY INC	1,154	36.21	41,786.34
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,158	72.71	156,908.18
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	285	45.98	13,104.30
ONEOK INC	672	38.33	25,757.76
PHILLIPS 66	1,524	81.62	124,388.88
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	421	133.44	56,178.24
RANGE RESOURCES CORP	524	34.49	18,072.76
SCHLUMBERGER LIMITED	3,567	74.14	264,457.38
SOUTHWESTERN ENERGY CO	1,224	12.99	15,899.76
SPECTRA ENERGY CORPORATION	1,945	29.11	56,618.95
TESORO CORPORATION	392	102.54	40,195.68

VALERO ENERGY CORP	1,484	61.43	91,162.12
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	2,157	9.31	20,081.67
WHITING PETROLEUM CORPORATION	517	19.22	9,936.74
WILLIAMS COS INC	2,030	41.93	85,117.90
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	602	138.03	83,094.06
AIRGAS INC	209	91.13	19,046.17
ALBEMARLE CORPORATION	350	52.26	18,291.00
ALCOA INC	3,537	9.42	33,318.54
ASHLAND INC	205	106.45	21,822.25
AVERY DENNISON CORPORATION	283	60.18	17,030.94
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	333	29.28	9,750.24
BALL CORPORATION	381	66.60	25,374.60
CELANESE CORP-SERIES A	477	63.99	30,523.23
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	705	51.48	36,293.40
CROWN HOLDINGS INC	408	51.15	20,869.20
DOW CHEMICAL	3,239	47.39	153,496.21
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	2,543	57.05	145,078.15
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	434	68.99	29,941.66
ECOLAB INC	791	119.38	94,429.58
FMC CORPORATION	414	37.46	15,508.44
FREEMONT-MCMORAN INC	3,229	12.03	38,844.87
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	252	112.96	28,465.92
INTERNATIONAL PAPER CO	1,174	41.51	48,732.74
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	1,130	93.36	105,496.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	166	148.44	24,641.04
MONSANTO CO	1,338	90.83	121,530.54
NEWMONT MINING CORP	1,504	18.55	27,899.20
NUCOR CORP	991	41.14	40,769.74
PACKAGING CORPORATION OF AMERICA	288	69.05	19,886.40
PPG INDUSTRIES INC	804	101.18	81,348.72
PRAXAIR INC	849	109.13	92,651.37
SEALED AIR CORPORATION	623	48.89	30,458.47
SIGMA-ALDRICH	336	139.60	46,905.60
THE MOSAIC COMPANY	995	34.16	33,989.20
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	238	242.87	57,803.06
VULCAN MATERIALS CO	409	89.42	36,572.78
WESTLAKE CHEMICAL CORPORATION	145	58.83	8,530.35
WESTROCK COMPANY	734	54.27	39,834.18
3M CO	1,782	148.00	263,736.00
ACUITY BRANDS INC	125	201.43	25,178.75
AGCO CORPORATION	232	43.86	10,175.52
AMETEK INC	679	54.28	36,856.12

B/E AEROSPACE INC	366	43.61	15,961.26
BOEING CO	1,846	138.42	255,523.32
CATERPILLAR INC	1,642	69.27	113,741.34
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	303	40.60	12,301.80
CUMMINS INC	499	108.57	54,176.43
DANAHER CORP	1,723	89.15	153,605.45
DEERE & CO	936	75.97	71,107.92
DOVER CORP	514	57.71	29,662.94
EATON CORPORATION PLC	1,377	51.27	70,598.79
EMERSON ELECTRIC CO	1,878	45.48	85,411.44
FASTENAL CO	875	37.04	32,410.00
FLOWSERVE CORPORATION	424	41.65	17,659.60
FLUOR CORP	485	44.64	21,650.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	465	48.59	22,594.35
GENERAL DYNAMICS CORP	785	141.25	110,881.25
GENERAL ELECTRIC CO(US)	28,309	28.99	820,677.91
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,086	97.18	202,717.48
ILLINOIS TOOL WORKS	930	84.05	78,166.50
INGERSOLL-RAND PLC	776	53.35	41,399.60
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	376	39.07	14,690.32
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	265	109.93	29,131.45
LOCKHEED MARTIN CORP	755	210.64	159,033.20
MASCO CORP	1,033	26.55	27,426.15
NORTHROP GRUMMAN CORP	517	174.58	90,257.86
PACCAR INC	1,029	52.26	53,775.54
PARKER HANNIFIN CORP	414	100.05	41,420.70
PENTAIR PLC	580	55.21	32,021.80
PRECISION CASTPARTS CORP	388	231.47	89,810.36
QUANTA SERVICES INC	605	19.31	11,682.55
RAYTHEON COMPANY	886	112.89	100,020.54
ROCKWELL AUTOMATION INC	378	103.16	38,994.48
ROCKWELL COLLINS INC.	372	83.52	31,069.44
ROPER TECHNOLOGIES INC	282	174.55	49,223.10
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	498	47.08	23,445.84
SNAP-ON INC	170	159.78	27,162.60
STANLEY BLACK & DECKER INC	462	98.24	45,386.88
TEXTRON INC	858	38.51	33,041.58
TRANSDIGM GROUP INC	155	216.67	33,583.85
UNITED RENTALS INC	256	65.39	16,739.84
UNITED TECHNOLOGIES CORP	2,395	92.05	220,459.75
WABCO HOLDINGS INC	159	108.28	17,216.52
WABTEC CORPORATION	299	89.31	26,703.69



WW GRAINGER INC	169	201.96	34,131.24
XYLEM INC	565	34.64	19,571.60
CINTAS CORPORATION	309	92.67	28,635.03
DUN & BRADSTREET CORP	112	111.76	12,517.12
EQUIFAX INC	375	106.86	40,072.50
IHS INC-CLASS A	212	120.58	25,562.96
MANPOWER GROUP	229	87.33	19,998.57
REPUBLIC SERVICES INC	725	43.26	31,363.50
ROBERT HALF INTL INC	423	52.92	22,385.16
STERICYCLE INC	264	150.84	39,821.76
THE ADT CORPORATION	573	32.55	18,651.15
TOWERS WATSON & COMPANY-CL A	217	119.89	26,016.13
TYCO INTERNATIONAL PLC	1,300	36.15	46,995.00
VERISK ANALYTICS INC	500	79.61	39,805.00
WASTE MANAGEMENT INC	1,352	52.51	70,993.52
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	512	44.45	22,758.40
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	410	71.90	29,479.00
CSX CORP	2,880	27.33	78,710.40
DELTA AIR LINES INC	573	50.27	28,804.71
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	600	49.99	29,994.00
FEDEX CORP	757	152.38	115,351.66
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,115	19.38	21,608.70
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	291	76.10	22,145.10
KANSAS CITY SOUTHERN	343	86.67	29,727.81
NORFOLK SOUTHERN CORP	887	77.77	68,981.99
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	469	41.41	19,421.29
UNION PACIFIC CORP	2,469	92.71	228,900.99
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	287	56.75	16,287.25
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,971	104.26	205,496.46
AUTOLIV INC	281	113.32	31,842.92
BORGWARNER INC	707	42.79	30,252.53
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	859	81.57	70,068.63
FORD MOTOR CO	10,422	15.36	160,081.92
GENERAL MOTORS CO	4,064	33.24	135,087.36
HARLEY-DAVIDSON INC	585	56.05	32,789.25
JOHNSON CONTROLS INC	1,840	44.03	81,015.20
LEAR CORPORATION	224	116.15	26,017.60
TESLA MOTORS INC	279	228.10	63,639.90
THE GOODYEAR TIRE & RUBBER COMPANY	787	32.30	25,420.10
COACH INC	856	30.17	25,825.52
DR HORTON INC	927	30.37	28,152.99
GARMIN LIMITED	374	34.03	12,727.22

HANESBRANDS INC	1,240	27.53	34,137.20
HARMAN INTERNATIONAL	200	105.00	21,000.00
HASBRO INC	315	72.18	22,736.70
JARDEN CORPORATION	568	49.60	28,172.80
LEGGETT & PLATT INC	409	43.75	17,893.75
LENNAR CORPORATION-CLASS A	508	50.47	25,638.76
LULULEMON ATHLETICA INC	334	53.26	17,788.84
MATTEL INC	977	23.14	22,607.78
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	558	39.77	22,191.66
MOHAWK INDUSTRIES INC	193	198.00	38,214.00
NEWELL RUBBERMAID INC	842	42.72	35,970.24
NIKE INC -CL B	1,917	133.21	255,363.57
POLARIS INDUSTRIES INC	196	124.26	24,354.96
PULTEGROUP INC	962	19.12	18,393.44
PVH CORPORATION	256	100.18	25,646.08
RALPH LAUREN CORPORATION	191	117.21	22,387.11
TOLL BROTHERS INC	479	36.40	17,435.60
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	504	100.45	50,626.80
VF CORP	955	72.57	69,304.35
WHIRLPOOL CORP	242	156.27	37,817.34
ARAMARK	583	31.21	18,195.43
CARNIVAL CORP(US)	1,167	51.86	60,520.62
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	87	718.64	62,521.68
DARDEN RESTAURANTS INC	329	65.70	21,615.30
H&R BLOCK INC	855	35.65	30,480.75
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	1,450	24.17	35,046.50
LAS VEGAS SANDS CORP	1,122	47.54	53,339.88
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	647	73.38	47,476.86
MCDONALD'S CORP	2,693	104.49	281,391.57
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,287	21.00	27,027.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	403	61.00	24,583.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	494	93.91	46,391.54
STARBUCKS CORP	4,213	60.97	256,866.61
STARWOOD HOTELS & RESORTS	501	67.62	33,877.62
WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	383	74.00	28,342.00
WYNN RESORTS LTD	254	68.25	17,335.50
YUM! BRANDS INC	1,265	71.71	90,713.15
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	700	32.97	23,079.00
CBS CORP-CLASS B	1,368	42.92	58,714.56
CHARTER COMMUNICATION INC-A	238	186.31	44,341.78
COMCAST CORP-CL A	5,965	61.56	367,205.40
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	1,174	62.14	72,952.36

DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	848	26.73	22,667.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	450	28.70	12,915.00
DISH NETWORK CORPORATION-A	691	61.30	42,358.30
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	1,160	21.40	24,824.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	770	45.78	35,250.60
LIBERTY GLOBAL PLC-C	1,811	43.89	79,484.79
LIBERTY MEDIA CORPORATION	276	38.61	10,656.36
LIBERTY MEDIA CORPORATION-C	573	37.64	21,567.72
NEWS CORPRATION-CLASS A	1,325	14.58	19,318.50
OMNICOM GROUP	717	72.23	51,788.91
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	240	55.96	13,430.40
SIRIUS XM HOLDINGS INC	7,183	3.94	28,301.02
TEGNA INC	632	25.00	15,800.00
THE WALT DISNEY CO.	4,529	109.47	495,789.63
TIME WARNER CABLE INC	813	187.33	152,299.29
TIME WARNER INC	2,317	71.16	164,877.72
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	3,537	29.48	104,270.76
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	1,365	29.67	40,499.55
VIACOM INC-CLASS B	974	48.90	47,628.60
ADVANCE AUTO PARTS INC	227	191.40	43,447.80
AMAZON.COM INC	1,112	573.15	637,342.80
AUTONATION INC	255	62.20	15,861.00
AUTOZONE INC	92	744.02	68,449.84
BED BATH & BEYOND INC	481	58.65	28,210.65
BEST BUY CO INC	1,000	35.07	35,070.00
CARMAX INC	588	56.85	33,427.80
DICK'S SPORTING GOODS INC	278	47.67	13,252.26
DOLLAR GENERAL CORPORATION	886	67.08	59,432.88
DOLLAR TREE INC	626	63.83	39,957.58
EXPEDIA INC	318	130.45	41,483.10
FOOT LOCKER INC	418	70.84	29,611.12
GAMESTOP CORP-CLASS A	301	44.72	13,460.72
GAP INC/THE	708	26.91	19,052.28
GENUINE PARTS CO	475	84.66	40,213.50
HOME DEPOT INC	3,650	123.10	449,315.00
KOHL'S CORP	591	45.67	26,990.97
L BRANDS INC	698	97.18	67,831.64
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	1,389	28.25	39,239.25
LKQ CORPORATION	969	27.96	27,093.24
LOWE'S COS INC	2,661	73.43	195,397.23
MACY'S INC	1,002	50.71	50,811.42
NETFLIX INC	1,133	101.69	115,214.77

NORDSTROM INC	443	68.44	30,318.92
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	296	252.22	74,657.12
PRICELINE GROUP INC/THE	146	1,376.13	200,914.98
ROSS STORES INC	1,224	50.39	61,677.36
SIGNET JEWELERS LTD	237	146.07	34,618.59
STAPLES INC	1,905	12.57	23,955.37
TARGET CORP	1,704	74.70	127,288.80
TIFFANY & CO	402	80.04	32,176.08
TJX COMPANIES INC	1,912	72.92	139,423.04
TRACTOR SUPPLY COMPANY	422	86.97	36,701.34
TRIPADVISOR INC	337	84.14	28,355.18
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	190	168.36	31,988.40
URBAN OUTFITTERS INC	398	28.23	11,235.54
COSTCO WHOLESALE CORP	1,236	153.22	189,379.92
CVS HEALTH CORPORATION	3,170	103.51	328,126.70
KROGER CO	2,708	37.83	102,443.64
RITE AID CORPORATION	2,901	6.50	18,856.50
SYSCO CORP	1,715	41.42	71,035.30
WAL-MART STORES INC	4,531	58.85	266,649.35
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,452	88.46	216,903.92
WHOLE FOODS MARKET INC	1,118	33.81	37,799.58
ALTRIA GROUP INC	5,525	59.66	329,621.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,743	45.97	80,125.71
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	337	107.45	36,210.65
BUNGE LIMITED	429	77.81	33,380.49
CAMPBELL SOUP COMPANY	526	49.40	25,984.40
COCA-COLA CO/THE	11,634	41.99	488,511.66
COCA-COLA ENTERPRISES INC	622	51.16	31,821.52
CONAGRA FOODS INC	1,200	41.59	49,908.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	481	135.18	65,021.58
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	539	84.90	45,761.10
GENERAL MILLS INC	1,675	56.68	94,939.00
HERSHEY CO/THE	423	95.25	40,290.75
HORMEL FOODS CORPORATION	408	66.33	27,062.64
KELLOGG COMPANY	773	69.61	53,808.53
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	378	53.10	20,071.80
KRAFT HEINZ CO/THE	1,715	76.80	131,712.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	325	82.62	26,851.50
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	585	75.04	43,898.40
MOLSON COORS BREWING CO-B	475	88.13	41,861.75
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	4,570	46.42	212,139.40
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	402	132.70	53,345.40

PEPSICO INC	4,147	100.18	415,446.46
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	4,352	88.42	384,803.84
REYNOLDS AMERICAN INC	2,412	47.49	114,545.88
THE JM SMUCKER COMPANY	316	118.77	37,531.32
TYSON FOODS INC-CL A	950	46.18	43,871.00
WHITEWAVE FOODS COMPANY	521	43.34	22,580.14
CHURCH & DWIGHT CO INC	416	88.21	36,695.36
CLOROX COMPANY	402	121.72	48,931.44
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,414	67.25	162,341.50
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	193	84.18	16,246.74
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	670	83.80	56,146.00
KIMBERLY-CLARK CORP	1,023	117.45	120,151.35
PROCTER & GAMBLE CO	7,622	75.16	572,869.52
ABBOTT LABORATORIES	4,183	42.15	176,313.45
AETNA INC	981	114.20	112,030.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	608	94.79	57,632.32
ANTHEM INC	743	148.81	110,565.83
BARD (C.R.) INC	209	195.76	40,913.84
BAXTER INTERNATIONAL INC.	1,579	34.02	53,717.58
BECTON DICKINSON & CO	614	139.95	85,929.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,767	17.08	64,340.36
CARDINAL HEALTH INC	967	80.20	77,553.40
CENTENE CORPORATION	335	60.65	20,317.75
CERNER CORPORATION	870	65.44	56,932.80
CIGNA CORP	723	141.90	102,593.70
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	534	76.33	40,760.22
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	417	56.87	23,714.79
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	302	151.40	45,722.80
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	537	36.00	19,332.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	2,048	87.38	178,954.24
HCA HOLDINGS INC	931	73.51	68,437.81
HENRY SCHEIN INC	262	145.60	38,147.20
HOLOGIC INC	671	38.54	25,860.34
HUMANA INC	437	186.67	81,574.79
INTUITIVE SURGICAL INC	104	478.44	49,757.76
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	300	117.39	35,217.00
MCKESSON CORP	651	194.85	126,847.35
MEDTRONIC PLC	3,979	74.24	295,400.96
PATTERSON COMPANIES INC	259	46.06	11,929.54
QUEST DIAGNOSTICS	464	65.66	30,466.24
RESMED INC	433	57.89	25,066.37
ST JUDE MEDICAL INC	824	68.22	56,213.28

STRYKER CORP	957	100.46	96,140.22
THE COOPER COS INC	150	143.71	21,556.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,674	120.73	322,832.02
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	285	129.40	36,879.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	311	78.47	24,404.17
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	526	98.19	51,647.94
ABBVIE INC	4,833	56.16	271,421.28
AGILENT TECHNOLOGIES INC	971	36.23	35,179.33
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	630	162.11	102,129.30
ALKERMES PLC	454	62.38	28,320.52
ALLERGAN PLC	1,103	273.31	301,460.93
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	221	84.42	18,656.82
AMGEN INC	2,136	154.47	329,947.92
BAXALTA INC	1,579	33.06	52,201.74
BIOGEN INC	661	273.02	180,466.22
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	450	107.28	48,276.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,684	65.08	304,834.72
CELGENE CORP	2,228	119.41	266,045.48
ELI LILLY & CO	2,809	80.25	225,422.25
ENDO INTERNATIONAL PLC	549	66.79	36,667.71
GILEAD SCIENCES INC	4,129	103.61	427,805.69
ILLUMINA INC	405	147.48	59,729.40
INCYTE CORP	454	110.69	50,253.26
ISIS PHARMACEUTICALS INC	367	44.11	16,188.37
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	177	136.46	24,153.42
JOHNSON & JOHNSON	7,791	97.94	763,050.54
MALLINCKRODT PLC	361	67.62	24,410.82
MEDIVATION INC	482	44.24	21,323.68
MERCK & CO. INC.	7,938	51.40	408,013.20
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	89	291.40	25,934.60
MYLAN NV	1,246	43.74	54,500.04
PERRIGO CO PLC	406	165.66	67,257.96
PFIZER INC	17,301	34.50	596,884.50
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	84	82.24	6,908.16
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	267	71.75	19,157.25
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	213	523.56	111,518.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,118	129.03	144,255.54
UNITED THERAPEUTICS CORPORATION	135	126.83	17,122.05
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	685	115.88	79,377.80
WATERS CORP	259	121.59	31,491.81
ZOETIS INC	1,419	43.78	62,123.82
BANK OF AMERICA CORPORATION	29,507	16.14	476,242.98

BB&T CORPORATION	2,115	36.25	76,668.75
CIT GROUP INC	569	40.81	23,220.89
CITIGROUP INC	8,525	52.86	450,631.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	1,207	23.23	28,038.61
COMERICA INC	526	41.97	22,076.22
FIFTH THIRD BANCORP	2,276	19.02	43,289.52
FIRST REPUBLIC BANK/CA	408	63.77	26,018.16
HUDSON CITY BANCORP INC	1,600	9.47	15,152.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,272	10.70	24,310.40
JPMORGAN CHASE & CO	10,427	62.22	648,767.94
KEYCORP	2,498	13.07	32,648.86
M & T BANK CORP	348	113.42	39,470.16
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	1,457	18.46	26,896.22
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	1,060	15.91	16,864.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,455	86.71	126,163.05
REGIONS FINANCIAL CORP	3,927	8.94	35,107.38
SUNTRUST BANKS INC	1,450	39.89	57,840.50
US BANCORP	4,982	40.73	202,916.86
WELLS FARGO & COMPANY	13,744	52.56	722,384.64
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	173	172.93	29,916.89
ALLY FINANCIAL INC	1,200	20.29	24,348.00
AMERICAN EXPRESS CO	2,569	77.00	197,813.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	532	111.25	59,185.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	3,151	40.17	126,575.67
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,276	133.62	437,739.12
BLACKROCK INC	347	327.88	113,774.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,535	74.64	114,572.40
CME GROUP INC	939	91.40	85,824.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,310	54.99	72,036.90
E*TRADE FINANCIAL CORP	846	26.51	22,427.46
EATON VANCE CORPORATION	429	35.05	15,036.45
FRANKLIN RESOURCES INC	1,131	38.15	43,147.65
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,092	185.74	202,828.08
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	330	240.27	79,289.10
INVESCO LIMITED	1,210	31.75	38,417.50
LEGG MASON INC	296	43.06	12,745.76
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,100	20.39	22,429.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	801	93.06	74,541.06
MOODY'S CORP	531	99.91	53,052.21
MORGAN STANLEY	4,151	32.32	134,160.32
NASDAQ INC	347	55.44	19,237.68
NAVIENT CORPORATION	1,179	12.27	14,466.33

NORTHERN TRUST CORP	623	68.34	42,575.82
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	396	51.89	20,548.44
SEI INVESTMENTS COMPANY	397	50.68	20,119.96
STATE STREET CORP	1,157	67.82	78,467.74
SYNCHRONY FINANCIAL	469	31.34	14,698.46
T ROWE PRICE GROUP INC	732	70.26	51,430.32
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	845	32.20	27,209.00
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	3,321	28.50	94,648.50
VOYA FINANCIAL INC	639	39.79	25,425.81
ACE LIMITED	918	109.51	100,530.18
AFLAC INC	1,219	61.03	74,395.57
ALLEGHANY CORPORATION	50	491.69	24,584.50
ALLSTATE CORP	1,220	61.59	75,139.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,746	60.00	224,760.00
AON PLC	792	90.63	71,778.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	401	77.48	31,069.48
ARTHUR J GALLAGHER & CO	477	42.71	20,372.67
ASSURANT INC	218	81.05	17,668.90
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	350	53.83	18,840.50
CHUBB CORP	679	127.32	86,450.28
CINCINNATI FINANCIAL CORP	483	57.37	27,709.71
EVEREST RE GROUP LTD	141	177.24	24,990.84
FNF GROUP	777	35.45	27,544.65
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,230	47.49	58,412.70
LINCOLN NATIONAL CORP	753	50.25	37,838.25
LOEWS CORPORATION	876	36.11	31,632.36
MARSH & MCLENNAN COS	1,576	53.68	84,599.68
METLIFE INC	2,665	48.93	130,398.45
PARTNERRE LTD	137	139.18	19,067.66
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	828	49.13	40,679.64
PROGRESSIVE CORP	1,735	32.68	56,699.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,273	79.21	100,834.33
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	120	109.27	13,112.40
TORCHMARK CORPORATION	400	57.96	23,184.00
TRAVELERS COS INC/THE	895	106.32	95,156.40
UNUM GROUP	701	32.78	22,978.78
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	495	42.09	20,834.55
WR BERKLEY CORP	295	55.71	16,434.45
XL GROUP PLC	802	37.32	29,930.64
CBRE GROUP INC	872	34.69	30,249.68
JONES LANG LASALLE INCORPORATED	130	152.68	19,848.40
REALOGY HOLDINGS CORPORATION	500	38.60	19,300.00



ACCENTURE PLC	1,760	103.10	181,456.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,492	33.75	50,355.00
ADOBE SYSTEMS INC	1,406	88.40	124,290.40
AKAMAI TECHNOLOGIES	519	70.42	36,547.98
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	184	280.07	51,532.88
ALPHABET INC-CL A	810	699.95	566,959.50
ALPHABET INC-CL C	866	666.10	576,842.60
ANSYS INC	286	93.29	26,680.94
AUTODESK INC	706	52.44	37,022.64
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,319	87.30	115,148.70
CA INC	1,037	28.48	29,533.76
CDK GLOBAL INC	398	49.44	19,677.12
CITRIX SYSTEMS INC	500	75.87	37,935.00
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	1,715	65.05	111,560.75
COMPUTER SCIENCES CORP	437	64.39	28,138.43
EBAY INC	3,072	24.55	75,432.96
ELECTRONIC ARTS INC	884	72.29	63,904.36
FACEBOOK INC-A	6,003	98.47	591,115.41
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	796	70.61	56,205.56
FIREEYE INC	296	31.12	9,211.52
FISERV INC	704	92.76	65,303.04
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	242	146.86	35,540.12
GARTNER INC	259	86.96	22,522.64
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	2,628	149.22	392,150.16
INTUIT INC	769	94.08	72,347.52
LINKEDIN CORPORATION-A	310	197.41	61,197.10
MASTERCARD INC.-CLASS A	2,822	97.74	275,822.28
MICROSOFT CORP	21,592	47.62	1,028,211.04
NETSUITE INC	107	90.76	9,711.32
NUANCE COMMUNICATIONS INC	898	16.91	15,185.18
ORACLE CORPORATION	9,816	36.87	361,915.92
PAYCHEX INC	918	50.46	46,322.28
PAYPAL HOLDINGS INC	3,060	34.84	106,610.40
RACKSPACE HOSTING INC	379	26.47	10,032.13
RED HAT INC	515	78.90	40,633.50
SALESFORCE COM INC	1,725	77.93	134,429.25
SERVICENOW INC	460	75.79	34,863.40
SPLUNK INC	379	58.79	22,281.41
SYMANTEC CORP	2,026	20.76	42,059.76
SYNOPSYS INC	484	48.40	23,425.60
TABLEAU SOFTWARE INC	140	85.52	11,972.80
TERADATA CORPORATION	426	28.86	12,294.36

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	520	49.81	25,901.20
TWITTER INC	1,428	30.91	44,139.48
VANTIV INC-CLASS A	461	46.74	21,547.14
VERISIGN INC	355	75.50	26,802.50
VISA INC-CLASS A SHARES	5,500	76.99	423,445.00
VMWARE INC-CLASS A	242	69.22	16,751.24
WESTERN UNION COMPANY	1,498	19.08	28,581.84
WORKDAY INC-CLASS A	260	78.53	20,417.80
XEROX CORPORATION	2,942	10.19	29,978.98
YAHOO! INC	2,603	33.50	87,200.50
ZILLOW GROUP INC-A	152	33.13	5,035.76
AMPHENOL CORPORATION-CL A	868	53.08	46,073.44
APPLE INC	16,186	111.73	1,808,461.78
ARROW ELECTRONICS INC	301	58.33	17,557.33
AVNET INC	404	44.86	18,123.44
CISCO SYSTEMS INC	14,289	28.25	403,664.25
CORNING INC	3,675	16.82	61,813.50
EMC CORP/MASSACHUSETTS	5,456	27.72	151,240.32
F5 NETWORKS INC	229	118.51	27,138.79
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	1,960	11.20	21,952.00
FLIR SYSTEMS INC	473	27.65	13,078.45
HARRIS CORPORATION	325	75.33	24,482.25
HEWLETT-PACKARD COMPANY	5,107	28.98	148,000.86
JUNIPER NETWORKS INC	998	29.94	29,880.12
MOTOROLA SOLUTIONS INC	605	69.03	41,763.15
NETAPP INC	969	33.68	32,635.92
PALO ALTO NETWORKS INC	213	167.96	35,775.48
QUALCOMM INC	4,580	59.10	270,678.00
SANDISK CORP	584	72.00	42,048.00
SEAGATE TECHNOLOGY	892	38.75	34,565.00
TE CONNECTIVITY LIMITED	1,193	63.38	75,612.34
TRIMBLE NAVIGATION LIMITED	886	17.99	15,939.14
WESTERN DIGITAL CORPORATION	686	80.48	55,209.28
AT&T INC	17,272	33.63	580,857.36
CENTURYLINK INC	1,584	26.92	42,641.28
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	3,419	5.25	17,949.75
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	868	47.44	41,177.92
SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	364	110.82	40,338.48
SPRINT CORPORATION	2,709	4.41	11,946.69
T-MOBILE US INC	750	41.21	30,907.50
VERIZON COMMUNICATIONS INC	11,459	44.70	512,217.30
AES CORP	2,257	10.74	24,240.18

ALLIANT ENERGY CORP	369	60.99	22,505.31
AMEREN CORPORATION	754	44.29	33,394.66
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,445	58.59	84,662.55
AMERICAN WATER WORKS CO INC	523	58.95	30,830.85
CALPINE CORPORATION	1,200	16.30	19,560.00
CENTERPOINT ENERGY INC	1,148	18.48	21,215.04
CMS ENERGY CORPORATION	858	36.59	31,394.22
CONSOLIDATED EDISON INC	823	66.93	55,083.39
DOMINION RESOURCES INC/VA	1,700	73.37	124,729.00
DTE ENERGY COMPANY	550	83.64	46,002.00
DUKE ENERGY CORPORATION	1,943	73.58	142,965.94
EDISON INTERNATIONAL	962	64.98	62,510.76
ENERGY CORP	504	69.38	34,967.52
EVERSOURCE ENERGY	892	51.98	46,366.16
EXELON CORP	2,509	30.18	75,721.62
FIRSTENERGY CORP	1,308	32.22	42,143.76
MDU RESOURCES GROUP INC	700	19.12	13,384.00
NEXTERA ENERGY INC	1,248	103.77	129,504.96
NRG ENERGY INC	989	14.80	14,637.20
OGE ENERGY CORPORATION	703	28.88	20,302.64
P G & E CORPORATION	1,349	54.29	73,237.21
PEPCO HOLDINGS INC	783	26.43	20,694.69
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	365	65.53	23,918.45
PPL CORPORATION	1,874	34.29	64,259.46
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	1,472	43.89	64,606.08
SCANA CORPORATION	421	57.95	24,396.95
SEMPRA ENERGY	661	101.84	67,316.24
SOUTHERN CO	2,552	45.96	117,289.92
WEC ENERGY GROUP INC	887	53.47	47,427.89
XCEL ENERGY INC	1,480	36.26	53,664.80
ALTERA CORPORATION	881	52.69	46,419.89
ANALOG DEVICES INC	881	60.22	53,053.82
APPLIED MATERIALS INC	3,460	15.80	54,685.30
AVAGO TECHNOLOGIES LIMITED	729	118.96	86,721.84
BROADCOM CORP-CL A	1,554	51.54	80,093.16
FREESCALE SEMICONDUCTOR HOLDINGS LTD	323	38.94	12,577.62
INTEL CORP	13,329	33.59	447,721.11
KLA-TENCOR CORPORATION	490	53.12	26,028.80
LAM RESEARCH CORP	494	67.64	33,414.16
LINEAR TECHNOLOGY CORP	741	43.80	32,455.80
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,274	9.45	12,039.30
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	842	39.63	33,368.46

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	600	47.23	28,338.00
	MICRON TECHNOLOGY INC	3,039	19.16	58,227.24
	NVIDIA CORP	1,512	27.81	42,048.72
	QORVO INC	457	46.85	21,410.45
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	537	77.83	41,794.71
	SUNEDISON INC	818	9.05	7,402.90
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,923	52.64	153,866.72
	XILINX INC	822	46.56	38,272.32
	米ドル 建小計	905,630		52,389,520.10 (6,262,643,232)
カナダドル	ALTAGAS LIMITED	479	34.36	16,458.44
	ARC RESOURCES LIMITED	1,119	20.05	22,435.95
	BAYTEX ENERGY CORPORATION	625	5.19	3,243.75
	CAMECO CORP (CA)	1,372	18.32	25,135.04
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,195	30.28	96,744.60
	CANADIAN OIL SANDS LIMITED	1,728	9.77	16,882.56
	CENOVUS ENERGY INC	2,296	20.89	47,963.44
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,193	18.21	21,724.53
	ENBRIDGE INC	2,485	56.15	139,532.75
	ENCANA CORP	2,496	10.75	26,832.00
	ENERPLUS CORP	653	6.96	4,544.88
	HUSKY ENERGY INC	1,200	21.77	26,124.00
	IMPERIAL OIL LTD	997	43.25	43,120.25
	INTER PIPELINE LIMITED	1,090	25.11	27,369.90
	KEYERA CORP	510	39.92	20,359.20
	MEG ENERGY CORPORATION	585	10.49	6,136.65
	PARAMOUNT RESOURCES LTD	200	14.06	2,812.00
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	1,067	34.52	36,832.84
	PEYTO EXPLORATION & DEVELOPMENT CORP	500	31.02	15,510.00
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	500	26.03	13,015.00
	SUNCOR ENERGY INC	4,527	36.36	164,601.72
	TOURMALINE OIL CORPORATION	600	29.80	17,880.00
	TRANSCANADA CORPORATION	2,062	44.29	91,325.98
	VERESEN INC	800	11.93	9,544.00
	VERMILION ENERGY INC	354	47.43	16,790.22
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	731	36.85	26,937.35
	AGRIUM INC	424	123.48	52,355.52
	BARRICK GOLD CORP	3,416	9.83	33,579.28
	ELDORADO GOLD CORPORATION	2,400	4.86	11,664.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	2,000	6.83	13,660.00
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	421	66.00	27,786.00
	GOLDCORP INC	2,534	19.28	48,855.52

KINROSS GOLD CORP	3,830	2.69	10,302.70
METHANEX CORPORATION	234	51.91	12,146.94
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	2,594	28.47	73,851.18
SILVER WHEATON CORPORATION	1,209	17.78	21,496.02
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	1,897	8.09	15,346.73
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	2,700	3.75	10,125.00
WEST FRASER TIMBER CO LIMITED	200	46.15	9,230.00
YAMANA GOLD INC	3,000	2.96	8,880.00
BOMBARDIER INC 'B'	4,812	1.57	7,554.84
CAE INC	904	14.49	13,098.96
FINNING INTERNATIONAL INC	637	20.18	12,854.66
SNC-LAVALIN GROUP INC	441	42.37	18,685.17
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,506	77.10	193,212.60
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	541	190.22	102,909.02
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,310	65.28	85,516.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	642	39.04	25,063.68
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	600	49.28	29,568.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,191	26.33	31,359.03
THOMSON REUTERS CORP(CA)	1,033	54.07	55,854.31
CANADIAN TIRE CORP -CL A	226	116.49	26,326.74
DOLLARAMA INC	400	89.65	35,860.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,315	60.56	79,636.40
EMPIRE COMPANY LIMITED A	750	27.94	20,955.00
GEORGE WESTON LIMITED	200	111.34	22,268.00
JEAN COUTU GROUP INC A	300	19.89	5,967.00
LOBLAW COMPANIES LTD	713	69.57	49,603.41
METRO INC	813	36.78	29,902.14
SAPUTO INC	700	31.19	21,833.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	984	213.05	209,641.20
BANK OF MONTREAL	2,007	75.35	151,227.45
BANK OF NOVA SCOTIA	3,693	60.38	222,983.34
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,192	98.93	117,924.56
NATIONAL BANK OF CANADA	1,100	40.96	45,056.00
ROYAL BANK OF CANADA	4,433	73.55	326,047.15
TORONTO-DOMINION BANK(CA)	5,662	52.85	299,236.70
CI FINANCIAL CORPORATION	783	31.95	25,016.85
IGM FINANCIAL INC	393	37.17	14,607.81
ONEX CORPORATION	300	75.91	22,773.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	88	635.65	55,937.20
GREAT-WEST LIFE CO INC	1,000	33.41	33,410.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	442	41.55	18,365.10
INTACT FINANCIAL CORPORATION	400	93.86	37,544.00

	MANULIFE FINANCIAL CORP	6,060	21.33	129,259.80
	POWER CORP OF CANADA	1,129	28.80	32,515.20
	POWER FINANCIAL CORP	873	31.76	27,726.48
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,850	43.84	81,104.00
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,602	44.48	115,736.96
	FIRST CAPITAL REALTY INC	400	19.57	7,828.00
	CGI GROUP INC -CL A	677	47.67	32,272.59
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	100	554.98	55,498.00
	OPEN TEXT CORPORATION	389	61.88	24,071.32
	BLACKBERRY LIMITED	1,700	9.36	15,912.00
	BCE INC	436	57.11	24,899.96
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,183	48.83	57,765.89
	TELUS CORPORATION	44	42.30	1,861.20
	ATCO LIMITED	294	39.67	11,662.98
	CANADIAN UTILITIES LTD A	328	36.41	11,942.48
	FORTIS INC	800	38.83	31,064.00
	TRANSALTA CORP	881	6.66	5,867.46
	カナダドル 建小計	122,480		4,403,923.38 (404,192,087)
ユーロ	ENI SPA	7,159	15.59	111,608.81
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,261	9.72	12,258.18
	KONINKLIJKE VOPAK NV	230	35.51	8,168.45
	NESTE OYJ	420	22.17	9,311.40
	OMV AG	482	24.74	11,924.68
	REPSOL SA	2,983	11.42	34,080.77
	SAIPEM	866	8.10	7,014.60
	TECHNIP S.A.	335	45.17	15,133.62
	TENARIS SA	1,544	12.01	18,543.44
	TOTAL SA	6,068	44.96	272,847.62
	AIR LIQUIDE SA	968	110.45	106,915.60
	AKZO NOBEL	734	60.42	44,348.28
	ARCELORMITTAL	2,882	5.46	15,753.01
	ARKEMA	214	63.42	13,571.88
	BASF SE	2,585	71.33	184,388.05
	CRH PLC(IE)	2,530	23.65	59,834.50
	EVONIK INDUSTRIES AG	393	31.50	12,381.46
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	228	41.90	9,553.20
	HEIDELBERGCEMENT AG	397	63.56	25,233.32
	IMERYS SA	113	60.14	6,795.82
	K+S AG	564	23.49	13,248.36
	KONINKLIJKE DSM NV	564	46.15	26,028.60
	LANXESS AG	300	45.46	13,639.50

LINDE AG	523	148.50	77,665.50
OCI NV	248	23.92	5,932.16
SOLVAY SA	194	94.90	18,410.60
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	1,799	8.45	15,201.55
SYMRISE AG	404	57.30	23,149.20
THYSSENKRUPP AG	1,079	17.54	18,931.05
UMICORE	353	37.12	13,105.12
UPM-KYMMENE OYJ	1,740	15.99	27,822.60
VOESTALPINE AG	367	32.94	12,090.81
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	573	29.29	16,783.17
AIRBUS GROUP SE	1,662	55.41	92,091.42
ALSTOM	708	28.14	19,926.66
ANDRITZ AG	238	42.84	10,195.92
BOSKALIS WESTMINSTER NV	282	41.82	11,793.24
BOUYGUES SA	549	33.97	18,652.27
BRENTAG AG	505	49.60	25,050.52
CNH INDUSTRIAL NV	3,097	5.84	18,086.48
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,396	38.35	53,543.58
FERROVIAL SA	1,362	22.46	30,597.33
FINMECCANICA SPA	1,323	11.87	15,704.01
GEA GROUP AG	598	34.71	20,759.57
KONE OYJ-B	914	36.66	33,507.24
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,741	22.55	61,823.25
LEGRAND SA	787	47.03	37,012.61
MAN SE	116	93.48	10,843.68
METSO OYJ	369	20.78	7,667.82
OSRAM LICHT AG	291	48.99	14,256.09
PRYSMIAN SPA	667	18.85	12,572.95
REXEL SA	912	11.73	10,702.32
SAFRAN SA	822	69.23	56,907.06
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,563	49.99	78,134.37
SIEMENS AG-REG	2,231	84.28	188,028.68
THALES SA	305	62.28	18,995.40
VINCI SA	1,386	57.69	79,958.34
WARTSILA OYJ-B SHARES	484	36.30	17,569.20
ZARDOYA OTIS SA	569	10.82	6,156.58
ZODIAC AEROSPACE	608	22.35	13,591.84
BUREAU VERITAS SA	723	19.95	14,423.85
EDENRED	674	16.10	10,851.40
RANDSTAD HOLDING NV	413	50.99	21,058.87
SOCIETE BIC SA	94	139.70	13,131.80
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	1,322	15.13	20,001.86

AENA SA	186	103.75	19,297.50
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	98	113.15	11,088.70
ATLANTIA SPA	1,162	25.08	29,142.96
BOLLORE	2,530	4.32	10,937.19
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	689	13.84	9,535.76
DEUTSCHE POST AG-REG	2,768	25.74	71,262.16
FRAPORT AG	121	58.95	7,132.95
GROUPE EUROTUNNEL SE	1,528	11.68	17,847.04
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	2,534	8.24	20,892.83
TNT EXPRESS NV	1,434	6.85	9,835.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	960	87.69	84,182.40
BMW-PFD	178	69.23	12,322.94
CONTINENTAL AG	322	202.50	65,205.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	2,710	72.82	197,342.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	2,531	14.52	36,750.12
MICHELIN (CGDE)-B	537	86.22	46,300.14
NOKIAN RENKAAT OYJ	371	29.85	11,074.35
PEUGEOT SA	1,280	15.13	19,372.80
PIRELLI & C SPA	778	14.98	11,654.44
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	442	38.81	17,156.23
RENAULT SA	551	78.10	43,033.10
VALEO SA	247	131.00	32,357.00
VOLKSWAGEN AG	97	118.60	11,504.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	475	99.19	47,115.25
ADIDAS AG	604	76.75	46,357.00
CHRISTIAN DIOR SE	153	170.00	26,010.00
HERMES INTERNATIONAL	82	334.35	27,416.70
HUGO BOSS AG-ORD	175	88.24	15,442.00
KERING	221	150.85	33,337.85
LUXOTTICA GROUP SPA	475	63.90	30,352.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	786	158.90	124,895.40
ACCOR SA	565	42.31	23,905.15
SODEXO	309	76.13	23,524.17
AXEL SPRINGER SE	130	49.16	6,390.80
EUTELSAT COMMUNICATIONS	504	30.76	15,505.56
JC DECAUX SA	220	35.70	7,855.10
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	73	118.00	8,614.00
LAGARDERE S.C.A.	386	25.85	9,980.03
NUMERICABLE GROUP	302	42.49	12,831.98
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	616	46.26	28,499.24
PUBLICIS GROUPE	545	63.75	34,743.75
RELX NV	2,982	15.12	45,087.84



RTL GROUP SA	127	76.06	9,659.62
SES	994	28.69	28,517.86
TELENET GROUP HOLDING NV	172	50.61	8,704.92
VIVENDI	3,376	21.47	72,499.60
WOLTERS KLUWER NV-CVA	850	29.80	25,330.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	3,070	31.38	96,351.95
CARREFOUR SA	1,613	28.67	46,252.77
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	185	54.00	9,990.00
COLRUYT SA	230	44.00	10,120.00
DELHAIZE GROUP	336	79.52	26,718.72
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	2,022	5.91	11,956.08
JERONIMO MARTINS SGPS SA	823	12.72	10,472.67
KONINKLIJKE AHOLD NV	2,663	17.56	46,775.59
METRO AG	530	27.54	14,596.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	2,263	102.45	231,844.35
DANONE	1,631	59.41	96,897.71
HEINEKEN HOLDING NV	330	69.34	22,882.20
HEINEKEN NV	675	78.57	53,034.75
KERRY GROUP PLC-A	491	68.80	33,780.80
PERNOD-RICARD SA	598	99.02	59,213.96
REMY COINTREAU SA	80	60.81	4,864.80
BEIERSDORF AG	330	83.07	27,413.10
HENKEL AG & CO KGAA	309	82.28	25,424.52
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	526	95.00	49,970.00
L'OREAL	709	168.40	119,395.60
UNILEVER NV-CVA	4,584	40.23	184,437.24
ESSILOR INTERNATIONAL SA	606	111.35	67,478.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	650	75.34	48,971.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,129	60.31	68,089.99
BAYER AG	2,327	110.80	257,831.60
GRIFOLS SA	488	40.05	19,546.84
MERCK KGAA	381	79.44	30,266.64
ORION OYJ-CLASS B	327	33.20	10,856.40
QIAGEN NV	761	22.68	17,259.48
SANOFI	3,312	89.11	295,132.32
UCB SA	356	69.55	24,759.80
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	7,128	1.67	11,903.76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	17,745	7.97	141,516.37
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-R	115,136	0.05	6,482.15
BANCO DE SABADELL SA	14,354	1.94	27,975.94
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.00	0.00
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	1,184	14.23	16,848.32

BANCO POPULAR ESPANOL SA	4,978	3.73	18,607.76
BANCO SANTANDER SA	40,291	5.15	207,498.65
BANK OF IRELAND	85,435	0.35	30,500.29
BANKIA SA	15,058	1.20	18,205.12
BANKINTER SA	2,204	6.89	15,205.39
BNP PARIBAS	2,981	55.09	164,223.29
CAIXABANK	7,399	3.76	27,879.43
COMMERZBANK AG	3,163	9.96	31,503.48
CREDIT AGRICOLE SA	3,005	11.16	33,535.80
ERSTE GROUP BANK AG	914	26.39	24,125.03
ING GROEP NV-CVA	10,884	12.99	141,437.58
INTESA SANPAOLO	35,677	3.28	117,020.56
INTESA SANPAOLO-RSP	3,048	2.96	9,034.27
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
KBC GROEP NV	742	55.70	41,329.40
NATIXIS SA	3,056	5.50	16,835.50
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	384	13.99	5,374.08
SOCIETE GENERALE	2,124	41.84	88,878.78
UNICREDIT SPA	13,465	5.81	78,231.65
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	2,800	6.98	19,558.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,003	26.92	107,780.77
DEUTSCHE BOERSE AG	576	79.64	45,872.64
EURAZEO	131	59.38	7,778.78
EXOR SPA	322	45.22	14,560.84
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	264	71.67	18,920.88
MEDIOBANCA SPA	1,972	9.20	18,142.40
WENDEL	104	107.65	11,195.60
AEGON NV	5,225	5.47	28,580.75
AGEAS	606	38.63	23,409.78
ALLIANZ SE-REG	1,306	149.00	194,594.00
ASSICURAZIONI GENERALI	3,447	16.50	56,875.50
AXA	5,643	22.89	129,168.27
CNP ASSURANCES	562	12.78	7,182.36
DELTA LLOYD NV	652	7.64	4,981.93
HANNOVER RUECK SE	198	94.42	18,695.16
MAPFRE SA	3,020	2.60	7,852.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	470	170.70	80,229.00
NN GROUP NV	560	27.90	15,624.00
SAMPO OYJ-A SHS	1,294	43.54	56,340.76
SCOR SE	502	32.02	16,076.55
UNIPOLSAI SPA	2,976	2.17	6,475.77
DEUTSCHE WOHNEN AG	936	24.40	22,838.40

VONOVIA SE	1,311	26.86	35,213.46
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	1,260	39.40	49,644.00
ATOS SE	264	70.43	18,593.52
CAP GEMINI SA	468	78.66	36,812.88
DASSAULT SYSTEMES SA	418	69.91	29,222.38
GEMALTO NV	259	62.22	16,114.98
SAP SE	2,766	66.15	182,970.90
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	403	45.98	18,531.95
ALCATEL-LUCENT	7,948	3.35	26,633.74
INGENICO GROUP	154	110.70	17,047.80
NOKIA OYJ	10,352	6.20	64,182.40
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	8,935	15.34	137,107.57
ELISA OYJ	465	32.59	15,154.35
ILIAD SA	86	176.55	15,183.30
KONINKLIJKE KPN NV	9,013	3.19	28,787.52
ORANGE	5,471	14.27	78,098.52
PROXIMUS	498	30.32	15,101.85
TELECOM ITALIA SPA	28,434	1.07	30,594.98
TELECOM ITALIA-RSP	19,696	0.89	17,687.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,945	5.40	10,520.50
TELEFONICA SA	12,508	11.33	141,778.18
E.ON SE	5,870	9.36	54,978.42
ELECTRICITE DE FRANCE	791	17.22	13,621.02
ENAGAS SA	664	26.76	17,768.64
ENDESA SA	986	19.88	19,601.68
ENEL GREEN POWER SPA	5,720	1.77	10,147.28
ENEL SPA	20,443	4.11	84,061.61
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	7,570	3.38	25,601.74
ENGIE	4,112	15.11	62,132.32
FORTUM OYJ	1,452	14.24	20,676.48
GAS NATURAL SDG SA	1,145	19.33	22,132.85
IBERDROLA SA	15,204	6.23	94,781.73
RED ELECTRICA CORPORACION SA	354	77.30	27,364.20
RWE AG	1,423	12.23	17,403.29
SNAM SPA	6,632	4.57	30,361.29
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	972	16.70	16,237.26
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	4,928	4.50	22,176.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,379	20.46	28,214.34
ASML HOLDING NV	975	78.34	76,381.50
INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,177	11.09	35,232.93
STMICROELECTRONICS NV	2,084	6.57	13,696.04
	787,413		9,700,099.57

	ユーロ 建小計			(1,314,266,490)
英ポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	1,278	7.69	9,827.82
	BG GROUP PLC	8,795	10.73	94,414.32
	BP PLC	47,023	3.77	177,394.26
	PETROFAC LIMITED	856	8.91	7,626.96
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	10,030	17.74	177,982.35
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	6,285	17.99	113,098.57
	TULLOW OIL PLC	3,003	2.28	6,867.86
	ANGLO AMERICAN PLC	3,610	6.25	22,580.55
	ANTOFAGASTA PLC	1,301	5.59	7,279.09
	BHP BILLITON PLC(UK)	5,439	10.96	59,611.44
	CRODA INTERNATIONAL PLC	350	27.86	9,751.00
	FRESNILLO PLC	729	7.34	5,354.50
	GLENCORE PLC	28,643	1.10	31,507.30
	JOHNSON MATTHEY PLC	528	24.44	12,904.32
	MONDI PLC	1,059	14.51	15,366.09
	RANDGOLD RESOURCES LIMITED	291	44.87	13,057.17
	REXAM PLC	2,322	5.30	12,306.60
	RIO TINTO PLC(UK)	3,257	24.40	79,470.80
	SOUTH32 LIMITED (GBP)	6,559	0.70	4,591.30
	ASHTED GROUP PLC	1,432	9.38	13,432.16
	BAE SYSTEMS PLC	8,149	4.50	36,743.84
	BUNZL PLC	863	18.38	15,861.94
	COBHAM PLC	3,755	2.90	10,904.52
	IMI PLC	896	9.52	8,534.40
	MEGGITT PLC	2,027	4.67	9,480.27
	MELROSE INDUSTRIES PLC	3,281	2.67	8,760.27
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,735	6.69	31,700.82
	SMITHS GROUP PLC	1,017	9.98	10,149.66
	THE WEIR GROUP PLC	704	11.42	8,039.68
	TRAVIS PERKINS PLC	641	19.28	12,358.48
	WOLSELEY PLC	670	37.39	25,051.30
	AGGREKO PLC	845	9.78	8,268.32
	BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	828	9.66	7,998.48
	CAPITA PLC	1,915	12.61	24,148.15
	EXPERIAN PLC	2,541	10.93	27,773.13
	G4S PLC	3,996	2.46	9,858.13
	INTERTEK GROUP PLC	416	25.93	10,786.88
	ROYAL MAIL PLC	2,144	4.37	9,388.57
	GKN PLC	4,244	2.71	11,501.24
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,887	6.32	18,245.84
	BURBERRY GROUP PLC	1,298	12.63	16,393.74

PERSIMMON PLC	789	19.70	15,543.30
TAYLOR WIMPEY PLC	9,436	1.90	17,994.45
CARNIVAL PLC(UK)	474	34.49	16,348.26
COMPASS GROUP PLC	4,273	10.72	45,806.56
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	608	23.11	14,050.88
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	1,672	3.71	6,208.13
TUI AG	1,406	12.04	16,928.24
WHITBREAD PLC	468	47.25	22,113.00
WILLIAM HILL PLC	2,886	3.44	9,942.27
ITV PLC	9,864	2.49	24,610.68
PEARSON PLC	2,113	11.88	25,102.44
RELX PLC	2,892	11.57	33,460.44
SKY PLC	2,659	10.71	28,477.89
WPP PLC	3,355	14.39	48,278.45
DIXONS CARPHONE PLC	2,521	4.29	10,837.77
KINGFISHER PLC	5,990	3.62	21,713.75
MARKS & SPENCER GROUP PLC	4,741	4.90	23,273.56
NEXT PLC	374	76.70	28,685.80
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	889	6.60	5,867.40
SAINSBURY (J) PLC	4,101	2.63	10,810.23
TESCO PLC	20,954	1.93	40,566.94
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	6,930	1.72	11,981.97
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	917	32.84	30,114.28
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	4,801	38.24	183,614.24
COCA-COLA HBC AG-CDI	661	15.18	10,033.98
DIAGEO PLC	6,476	18.47	119,611.72
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	2,465	34.88	85,979.20
SABMILLER PLC	2,498	39.93	99,757.63
TATE & LYLE PLC	1,542	5.68	8,766.27
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,654	61.49	101,704.46
UNILEVER PLC	3,305	29.21	96,539.05
SMITH & NEPHEW PLC	2,303	11.51	26,507.53
ASTRAZENECA PLC	3,254	41.56	135,252.51
GLAXOSMITHKLINE PLC	12,532	13.45	168,555.40
SHIRE PLC	1,524	46.26	70,500.24
BARCLAYS PLC	43,142	2.54	109,861.10
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	50,260	5.17	259,994.98
LLOYDS BANKING GROUP PLC	147,049	0.75	110,977.88
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	8,332	3.23	26,954.02
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	6,557	7.34	48,148.05
3I GROUP PLC	2,505	4.79	12,021.49
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	3,034	3.38	10,279.19

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	782	13.92	10,885.44
	ICAP PLC	1,818	4.38	7,968.29
	INVESTEC PLC	1,821	5.43	9,888.03
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	805	24.62	19,819.10
	SCHRODERS PLC	410	28.14	11,537.40
	ADMIRAL GROUP PLC	639	15.98	10,211.22
	AVIVA PLC	10,419	4.66	48,646.31
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	3,541	3.83	13,590.35
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	15,305	2.49	38,170.67
	OLD MUTUAL PLC	14,009	2.09	29,390.88
	PRUDENTIAL PLC	6,621	15.21	100,705.41
	RSA INSURANCE GROUP PLC	2,619	4.09	10,719.56
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,348	8.81	11,882.62
	STANDARD LIFE PLC	5,678	4.09	23,228.69
	SAGE GROUP PLC (THE)	2,776	5.25	14,587.88
	BT GROUP PLC	21,548	4.28	92,257.76
	INMARSAT PLC	1,405	9.23	12,968.15
	VODAFONE GROUP PLC	68,282	2.08	142,299.68
	CENTRICA PLC	12,812	2.36	30,300.38
	NATIONAL GRID PLC	9,635	9.25	89,191.19
	SEVERN TRENT PLC	612	22.47	13,751.64
	SSE PLC	2,558	15.54	39,751.32
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,756	9.80	17,208.80
	ARM HOLDINGS PLC	3,635	9.75	35,459.42
	英債券 建小計	765,682		4,224,567.94 (781,714,051)
スイスフラン	TRANSOCEAN LIMITED(CHF)	1,183	14.60	17,271.80
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	27	383.75	10,361.25
	GIVAUDAN-REG	30	1,745.00	52,350.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	1,423	54.40	77,411.20
	SIKA AG-BR	6	3,164.00	18,984.00
	SYNGENTA AG(CH)	307	306.20	94,003.40
	ABB LIMITED-REG	7,617	17.10	130,250.70
	GEBERIT AG-REG	126	314.30	39,601.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	67	145.90	9,775.30
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	146	144.00	21,024.00
	SULZER AG-REG	79	99.10	7,828.90
	ADECCO SA-REG	567	72.05	40,852.35
	SGS SA-REG	18	1,793.00	32,274.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	177	132.30	23,417.10
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	1,790	80.85	144,721.50
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	163	73.45	11,972.35

	THE SWATCH GROUP AG-B	100	375.30	37,530.00
	DUFREY AG	132	119.50	15,774.00
	ARYZTA AG	285	45.10	12,853.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	8	1,121.00	8,968.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	3	5,860.00	17,580.00
	NESTLE SA-REGISTERED	11,010	73.50	809,235.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	176	130.40	22,950.40
	ACTELION LTD-REG	340	125.20	42,568.00
	LONZA GROUP AG-REG	173	138.30	23,925.90
	NOVARTIS AG-REG SHS	7,768	90.40	702,227.20
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,399	260.50	624,939.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5,314	24.62	130,830.68
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	742	46.60	34,577.20
	PARGESA HOLDING SA-BR	101	60.80	6,140.80
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	57	337.25	19,223.25
	UBS GROUP AG	12,467	19.36	241,361.12
	BALOISE HOLDING AG-REG	156	112.90	17,612.40
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	105	228.50	23,992.50
	SWISS RE LIMITED	1,167	86.80	101,295.60
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	512	252.30	129,177.60
	SWISS PRIME SITE AG-REG	188	74.85	14,071.80
	SWISSCOM AG-REG	86	487.40	41,916.40
	スイスフラン 建小計	57,015		3,810,850.50 (476,546,855)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	714	125.40	89,535.60
	BOLIDEN AB	897	152.80	137,061.60
	ALFA LAVAL AB	1,032	139.40	143,860.80
	ASSA ABLOY AB-B	3,353	147.00	492,891.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,247	204.40	459,286.80
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,279	192.00	245,568.00
	SANDVIK AB	3,495	73.85	258,105.75
	SKANSKA AB-B SHS	1,246	151.40	188,644.40
	SKF AB-B SHARES	1,299	141.40	183,678.60
	VOLVO AB-B SHS	5,143	83.50	429,440.50
	SECURITAS AB-B SHS	1,027	101.20	103,932.40
	ELECTROLUX AB-SER B	789	257.10	202,851.90
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,338	54.85	73,389.30
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	3,176	317.00	1,006,792.00
	ICA GRUPPEN AB	254	282.60	71,780.40
	SWEDISH MATCH AB	658	258.30	169,961.40
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	1,969	227.80	448,538.20
	GETINGE AB-B SHS	656	209.60	137,497.60

	NORDEA BANK AB	10,162	98.95	1,005,529.90
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	5,082	92.90	472,117.80
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	5,010	123.60	619,236.00
	SWEDBANK AB-A SHARES	3,030	195.40	592,062.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	537	152.70	81,999.90
	INVESTOR AB-B SHS	1,524	304.80	464,515.20
	KINNEVIK INVESTMENT AB	772	254.30	196,319.60
	ERICSSON LM-B SHS	10,181	86.25	878,111.25
	HEXAGON AB-B SHS	837	263.60	220,633.20
	MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	217	513.50	111,429.50
	TELE2 AB-B SHS	1,047	76.55	80,147.85
	TELIASONERA AB	8,692	42.36	368,193.12
	スウェーデンクローナ 建小計	77,663		9,933,111.57 (142,838,144)
ノルウェークローネ	SEADRILL LIMITED	1,298	57.50	74,635.00
	STATOIL ASA	3,769	140.70	530,298.30
	SUBSEA 7 SA	927	67.00	62,109.00
	NORSK HYDRO ASA	4,426	32.02	141,720.52
	YARA INTERNATIONAL ASA	591	354.50	209,509.50
	ORKLA ASA	2,683	66.60	178,687.80
	DNB ASA	3,301	116.70	385,226.70
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	659	115.20	75,916.80
	TELENOR ASA	2,535	166.30	421,570.50
	ノルウェークローネ 建小計	20,189		2,079,674.12 (30,592,006)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	783	275.80	215,951.40
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	733	375.90	275,534.70
	ISS A/S	427	228.80	97,697.60
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	13	10,410.00	135,330.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	22	10,670.00	234,740.00
	DSV A/S	579	274.10	158,703.90
	PANDORA A/S	333	759.50	252,913.50
	CARLSBERG AS-B	350	527.00	184,450.00
	COLOPLAST A/S	364	476.50	173,446.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	75	610.00	45,750.00
	NOVO NORDISK A/S-B	6,382	370.00	2,361,340.00
	DANSKE BANK A/S	2,299	203.80	468,536.20
	TRYG A/S	345	119.80	41,331.00
	TDC A/S	2,655	34.00	90,270.00
	デンマーククローネ 建小計	15,360		4,735,994.30 (86,005,656)
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	770	32.67	25,155.90



オーストラリア  
ドル

ORIGIN ENERGY LIMITED	3,138	5.47	17,164.86
SANTOS LTD	3,221	5.46	17,586.66
WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,116	32.07	67,860.12
WORLEYPARSONS LIMITED	691	7.25	5,009.75
ALUMINA LIMITED	8,314	1.18	9,810.52
AMCOR LTD	3,509	13.01	45,652.09
BHP BILLITON LIMITED(AU)	9,032	24.71	223,180.72
BORAL LIMITED	2,577	5.41	13,941.57
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	5,125	2.30	11,787.50
ILUKA RESOURCES LIMITED	1,379	6.66	9,184.14
INCITEC PIVOT LIMITED	5,448	3.89	21,192.72
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,465	17.54	25,696.10
NEWCREST MINING LIMITED	2,080	14.86	30,908.80
ORICA LTD	1,227	16.68	20,466.36
RIO TINTO LIMITED(AU)	1,238	53.35	66,047.30
SOUTH32 LIMITED	9,929	1.50	14,943.14
CIMIC GROUP LIMITED	335	25.84	8,656.40
BRAMBLES LTD	4,475	10.09	45,152.75
SEEK LIMITED	1,065	12.92	13,759.80
ASCIANO LIMITED	3,211	7.66	24,596.26
AURIZON HOLDINGS LIMITED	6,031	5.20	31,361.20
QANTAS AIRWAYS LTD	1,808	3.88	7,015.04
SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	3,575	6.23	22,272.25
TRANSURBAN GROUP	5,310	10.10	53,631.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,459	9.07	13,233.13
CROWN RESORTS LIMITED	1,199	11.84	14,196.16
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	183	39.07	7,149.81
TABCORP HOLDINGS LIMITED	2,512	4.87	12,233.44
TATTS GROUP LTD	4,723	3.89	18,372.47
REA GROUP LIMITED	174	46.55	8,099.70
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,749	3.79	6,628.71
WESFARMERS LIMITED	3,192	40.28	128,573.76
WOOLWORTHS LIMITED	3,562	26.96	96,031.52
COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,886	9.15	17,256.90
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	2,144	7.40	15,865.60
TREASURY WINE ESTATES LIMITED-RIGHTS	285	1.70	484.50
COCHLEAR LIMITED	188	84.45	15,876.60
HEALTHSCOPE LTD	3,707	2.64	9,786.48
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	433	61.25	26,521.25
SONIC HEALTHCARE LTD	1,254	18.51	23,211.54
CSL LIMITED	1,348	88.70	119,567.60
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	7,951	28.86	229,465.86

	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	1,194	13.15	15,701.10
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	1,477	10.40	15,360.80
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	4,895	76.43	374,124.85
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	7,538	31.96	240,914.48
	WESTPAC BANKING CORPORATION	8,820	31.34	276,418.80
	WESTPAC BANKING CORPORATION-RIGHTS	383	4.85	1,857.55
	ASX LTD	638	40.02	25,532.76
	MACQUARIE GROUP LIMITED	842	82.51	69,473.42
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT LIMITED	720	6.99	5,032.80
	AMP LIMITED	8,393	5.84	49,015.12
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	6,690	5.40	36,126.00
	MEDIBANK PRIVATE LIMITED	8,514	2.52	21,455.28
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	3,969	13.13	52,112.97
	SUNCORP GROUP LIMITED	3,701	12.94	47,890.94
	LEND LEASE GROUP	1,806	12.85	23,207.10
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,557	10.63	16,550.91
	TELSTRA CORPORATION	12,016	5.30	63,684.80
	TPG TELECOM LIMITED	915	10.73	9,817.95
	AGL ENERGY LIMITED	2,081	15.97	33,233.57
	APA GROUP	3,445	8.95	30,832.75
	AUSNET SERVICES	5,638	1.42	8,005.96
	オーストラリアドル 建小計	210,250		3,010,937.89 (261,560,174)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	2,266	7.25	16,428.50
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	3,137	5.10	15,998.70
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	1,235	7.60	9,386.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	6,022	3.17	19,089.74
	CONTACT ENERGY LIMITED	1,208	5.05	6,100.40
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,656	2.17	7,933.52
	MIGHTY RIVER POWER LTD	2,306	2.58	5,961.01
	ニュージーランドドル 建小計	19,830		80,897.87 (6,576,996)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	9,534	107.50	1,024,905.00
	NWS HOLDINGS LIMITED	4,500	10.92	49,140.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	4,000	15.34	61,360.00
	MTR CORPORATION	4,903	34.70	170,134.10
	LI & FUNG LIMITED	20,000	6.01	120,200.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED	4,773	28.25	134,837.25
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	2,338	27.45	64,178.10
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	6,537	26.70	174,537.90
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	3,355	11.38	38,179.90
	SANDS CHINA LIMITED	8,574	28.60	245,216.40
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	3,813	7.16	27,301.08

	SJM HOLDINGS LIMITED	7,000	6.48	45,360.00	
	WYNN MACAU LIMITED	5,099	11.00	56,089.00	
	WH GROUP LTD	12,500	4.49	56,125.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,267	28.80	94,089.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	13,184	25.80	340,147.20	
	HANG SENG BANK LTD	2,700	141.90	383,130.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	8,000	5.17	41,360.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	3,866	205.40	794,076.40	
	AIA GROUP LIMITED	41,951	45.80	1,921,355.80	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	9,534	57.70	550,111.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	7,864	19.48	153,190.72	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,245	50.05	212,462.25	
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	2,000	33.95	67,900.00	
	KERRY PROPERTIES LIMITED	2,452	23.10	56,641.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	17,562	8.33	146,291.46	
	SINO LAND CO	10,576	12.72	134,526.72	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	6,000	105.50	633,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,000	88.85	177,700.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	4,032	23.25	93,744.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	5,000	46.60	233,000.00	
	WHELOCK AND COMPANY LTD	3,000	35.45	106,350.00	
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	9,080	9.25	83,990.00	
	PCCW LIMITED	13,884	4.18	58,035.12	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	2,000	71.15	142,300.00	
	CLP HOLDINGS LTD	6,735	68.40	460,674.00	
	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	23,556	15.48	364,646.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	5,067	75.95	384,838.65	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	800	54.20	43,360.00	
	香港ドル 建小計	305,281		9,944,485.53 (153,343,966)	
シンガポールドル	KEPPEL CORPORATION LIMITED	4,200	7.25	30,450.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	14,636	0.50	7,391.18	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	4,000	3.84	15,360.00	
	SEMBCORP MARINE LIMITED	2,987	2.60	7,766.20	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	4,400	3.22	14,168.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	7,069	1.25	8,871.59	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	7,000	3.00	21,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,500	10.94	16,410.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	21,000	0.78	16,380.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	4,600	4.01	18,446.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	300	32.14	9,642.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	24,000	0.37	9,000.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	7,000	2.91	20,370.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LIMITED	5,800	17.91	103,878.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	10,000	9.40	94,000.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	4,300	20.03	86,129.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	2,300	7.52	17,296.00	
	CAPITALAND LTD	7,200	3.12	22,464.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,300	8.25	10,725.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	9,000	2.30	20,700.00	
	UOL GROUP LIMITED	2,000	6.73	13,460.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	26,500	3.89	103,085.00	
	STARHUB LIMITED	2,000	3.63	7,260.00	
	シンガポールドル 建小計	173,092		674,251.97 (58,059,837)	
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LIMITED	16	879.60	14,073.60	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	1,458	21.22	30,938.76	
	THE ISRAEL CORPORATION LIMITED	9	1,003.00	9,027.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	2,955	233.50	689,992.50	
	BANK HAPOLIM BM	3,465	20.11	69,681.15	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,349	14.60	63,495.40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	454	45.58	20,693.32	
	AZRIELI GROUP	107	154.50	16,531.50	
	NICE SYSTEMS LIMITED	187	221.20	41,364.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	6,284	7.90	49,643.60	
	イスラエルシュケル 建小計	19,284		1,005,441.23 (31,198,841)	
	合 計	3,479,169		10,009,538,335 (10,009,538,335)	

(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	10,640.00	
		投資信託受益証券 小計	19,000	10,640.00 (1,271,905)	
	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORPORATION	1,025	19,577.50	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	1,232	119,245.28	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	2,787	28,204.44	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	371	68,731.46	
		BOSTON PROPERTIES INC	431	53,487.10	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	520	13,140.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	300	23,712.00	

		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	398	7,864.48
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	977	80,661.12
		DIGITAL REALTY TRUST INC	421	30,130.97
		DUKE REALTY CORP	1,175	24,733.75
		EQUINIX INC	171	49,711.41
		EQUITY RESIDENTIAL	1,070	85,739.10
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	199	47,272.45
		EXTRA SPACE STORAGE INC	322	25,611.88
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	212	30,797.24
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	1,768	49,132.72
		HCP INC	1,297	50,985.07
		HOST HOTELS & RESORTS	2,214	39,165.66
		IRON MOUNTAIN INC	512	16,220.16
		KIMCO REALTY CORP	1,216	31,834.88
		LIBERTY PROPERTY TRUST	500	17,215.00
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	600	24,678.00
		PROLOGIS INC	1,554	65,734.20
		PUBLIC STORAGE	432	97,597.44
		REALTY INCOME CORP	692	33,824.96
		REGENCY CENTERS CORPORATION	290	19,372.00
		SIMON PROPERTY GROUP	875	177,266.25
		SL GREEN REALTY CORPORATION	300	35,700.00
		THE MACERICH COMPANY	393	33,008.07
		UDR INC	765	27,853.65
		VENTAS INC	955	55,418.65
		VEREIT INC	2,950	24,898.00
		VORNADO REALTY TRUST	476	47,709.48
		WELLTOWER INC	985	69,087.90
		WEYERHAEUSER COMPANY	1,455	42,558.75
		投資証券 小計	31,840	1,667,881.42 (199,378,544)
		米ドル建小計	50,840	1,678,521.42 (200,650,449)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	500	10,600.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	497	13,046.25
		カナダドル建小計	997	23,646.25 (2,170,252)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	93	7,739.46
		GECINA SA	93	10,760.10
		ICADE	121	8,006.57
		KLEPIERRE	537	22,360.68
		UNIBAIL-RODAMCO SE	277	66,715.45

ユーロ建小計			1,121	115,582.26 (15,660,240)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	2,497	21,474.20
		HAMMERSON PLC	2,020	12,594.70
		INTU PROPERTIES PLC	3,027	10,455.25
		LAND SECURITIES GROUP PLC	2,036	26,691.96
		SEGRO PLC	2,448	10,587.60
英ポンド建小計			12,028	81,803.71 (15,136,958)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	2,981	22,208.45
		FEDERATION CENTRES	10,481	29,661.23
		GOODMAN GROUP	5,746	34,073.78
		GPT GROUP	5,549	25,636.38
		MIRVAC GROUP	12,171	21,299.25
		SCENTRE GROUP	15,100	60,098.00
		STOCKLAND	7,732	30,232.12
		WESTFIELD CORPORATION	5,646	56,742.30
オーストラリアドル建小計			65,406	279,951.51 (24,319,387)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	8,107	372,516.65
香港ドル建小計			8,107	372,516.65 (5,744,206)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,000	17,010.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	6,669	9,436.63
		CAPITALAND MALL TRUST	8,000	16,320.00
		SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,000	13,360.00
シンガポールドル建小計			29,669	56,126.63 (4,833,064)
合計				268,514,556 (268,514,556)

(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 599銘柄	52.4%			60.9%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 36銘柄			1.7%	1.9%

カナダドル	株式	91銘柄	3.4%			3.9%
	投資証券	2銘柄			0.0%	0.0%
ユーロ	株式	232銘柄	11.0%			12.8%
	投資証券	5銘柄			0.1%	0.2%
英ポンド	株式	107銘柄	6.5%			7.6%
	投資証券	5銘柄			0.1%	0.1%
スイスフラン	株式	38銘柄	4.0%			4.6%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	1.2%			1.4%
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	0.7%			0.8%
オーストラリアドル	株式	64銘柄	2.2%			2.5%
	投資証券	8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	1.3%			1.5%
	投資証券	1銘柄			0.0%	0.1%
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%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	0.3%			0.3%

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	16,951,174	31,916,601
国債証券	14,115,165,800	13,032,139,200
地方債証券	1,248,218,400	1,192,131,900
特殊債券	1,348,705,600	1,322,925,200
社債券	742,150,000	737,380,000
未収入金	10,687,000	-

	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
未収利息	40,334,636	36,581,848
前払費用	622,641	359,456
流動資産合計	17,522,835,251	16,353,434,205
資産合計	17,522,835,251	16,353,434,205
負債の部		
流動負債		
未払金	-	10,486,700
未払解約金	6,060,000	3,500,000
流動負債合計	6,060,000	13,986,700
負債合計	6,060,000	13,986,700
純資産の部		
元本等		
元本	14,429,316,960	13,424,076,433
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,087,458,291	2,915,371,072
元本等合計	17,516,775,251	16,339,447,505
純資産合計	17,516,775,251	16,339,447,505
負債純資産合計	17,522,835,251	16,353,434,205

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 14,429,316,960口	1. 計算日における受益権の総数 13,424,076,433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 1.2140円 (1万口当たり純資産額) (12,140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 1.2172円 (1万口当たり純資産額) (12,172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10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日



1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、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27年 4月20日現在	平成27年10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10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,916,956,426円	14,429,316,960円
期中追加設定元本額	525,868,840円	461,341,836円
期中一部解約元本額	1,013,508,306円	1,466,582,363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）	116,031,169円	108,901,500円
新光7資産バランスファンド	886,444,703円	786,651,829円
日本債券ファンド	701,634,431円	1,005,937,306円
新光日本債券インデックスVA	2,543,991,201円	1,971,571,962円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,418,972,286円	2,270,232,969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）	2,707,846,994円	2,451,269,840円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	166,136,729円	150,449,720円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	3,349,638,531円	3,192,950,288円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,506,277,990円	1,448,640,414円

世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）	- 円	6,046,926円
グローバル・ナビ	32,342,926円	31,423,679円
合計	14,429,316,960円	13,424,076,433円

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	162,592,400	113,079,200
地方債証券	1,077,800	4,348,200
特殊債券	3,275,800	412,900
社債券	150,000	4,620,000
合計	167,096,000	104,523,900

(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101回利付国債（5年）	280,000,000	281,299,200	
	第103回利付国債（5年）	260,000,000	261,097,200	
	第105回利付国債（5年）	230,000,000	230,742,900	
	第106回利付国債（5年）	140,000,000	140,520,800	
	第107回利付国債（5年）	80,000,000	80,319,200	
	第109回利付国債（5年）	130,000,000	130,265,200	
	第112回利付国債（5年）	50,000,000	50,505,000	

第113回利付国債(5年)	50,000,000	50,372,000	
第114回利付国債(5年)	130,000,000	131,058,200	
第116回利付国債(5年)	140,000,000	140,772,800	
第117回利付国債(5年)	140,000,000	140,833,000	
第118回利付国債(5年)	160,000,000	160,993,600	
第120回利付国債(5年)	110,000,000	110,708,400	
第122回利付国債(5年)	160,000,000	160,398,400	
第123回利付国債(5年)	190,000,000	190,457,900	
第124回利付国債(5年)	180,000,000	180,417,600	
第125回利付国債(5年)	40,000,000	40,088,000	
第1回利付国債(40年)	10,000,000	12,637,800	
第2回利付国債(40年)	20,000,000	24,249,000	
第3回利付国債(40年)	20,000,000	24,250,400	
第4回利付国債(40年)	30,000,000	36,370,200	
第5回利付国債(40年)	30,000,000	34,675,200	
第6回利付国債(40年)	40,000,000	45,020,400	
第7回利付国債(40年)	40,000,000	42,624,400	
第8回利付国債(40年)	40,000,000	38,960,800	
第284回利付国債(10年)	110,000,000	112,171,400	
第285回利付国債(10年)	170,000,000	174,068,100	
第286回利付国債(10年)	100,000,000	102,979,000	
第288回利付国債(10年)	30,000,000	30,972,300	
第289回利付国債(10年)	90,000,000	92,898,000	
第290回利付国債(10年)	140,000,000	144,684,400	
第291回利付国債(10年)	40,000,000	41,242,000	
第293回利付国債(10年)	130,000,000	136,169,800	
第296回利付国債(10年)	110,000,000	114,737,700	
第297回利付国債(10年)	110,000,000	114,796,000	
第299回利付国債(10年)	80,000,000	83,472,800	
第300回利付国債(10年)	60,000,000	63,013,200	
第301回利付国債(10年)	110,000,000	115,911,400	
第302回利付国債(10年)	10,000,000	10,500,900	
第303回利付国債(10年)	180,000,000	189,599,400	
第305回利付国債(10年)	50,000,000	52,606,500	
第306回利付国債(10年)	200,000,000	211,876,000	
第308回利付国債(10年)	220,000,000	232,731,400	
第309回利付国債(10年)	20,000,000	20,971,400	
第310回利付国債(10年)	150,000,000	156,943,500	
第311回利付国債(10年)	20,000,000	20,729,800	
第312回利付国債(10年)	150,000,000	158,799,000	
第313回利付国債(10年)	190,000,000	202,644,500	
第315回利付国債(10年)	170,000,000	180,829,000	

第3 1 7 回利付国債(10年)	70,000,000	74,244,800	
第3 1 8 回利付国債(10年)	110,000,000	116,022,500	
第3 1 9 回利付国債(10年)	60,000,000	63,771,600	
第3 2 0 回利付国債(10年)	70,000,000	73,971,100	
第3 2 1 回利付国債(10年)	40,000,000	42,359,600	
第3 2 2 回利付国債(10年)	40,000,000	42,104,400	
第3 2 3 回利付国債(10年)	200,000,000	210,864,000	
第3 2 5 回利付国債(10年)	110,000,000	115,364,700	
第3 2 6 回利付国債(10年)	40,000,000	41,691,600	
第3 2 7 回利付国債(10年)	70,000,000	73,458,000	
第3 2 8 回利付国債(10年)	10,000,000	10,348,600	
第3 2 9 回利付国債(10年)	100,000,000	104,962,000	
第3 3 0 回利付国債(10年)	100,000,000	105,000,000	
第3 3 2 回利付国債(10年)	120,000,000	124,102,800	
第3 3 3 回利付国債(10年)	100,000,000	103,350,000	
第3 3 4 回利付国債(10年)	200,000,000	206,546,000	
第3 3 5 回利付国債(10年)	180,000,000	184,163,400	
第3 3 6 回利付国債(10年)	110,000,000	112,462,900	
第3 3 8 回利付国債(10年)	170,000,000	172,026,400	
第3 3 9 回利付国債(10年)	90,000,000	90,929,700	
第3 4 0 回利付国債(10年)	40,000,000	40,346,000	
第5 回利付国債(30年)	20,000,000	24,298,400	
第7 回利付国債(30年)	20,000,000	24,570,200	
第1 0 回利付国債(30年)	20,000,000	20,679,800	
第1 1 回利付国債(30年)	20,000,000	22,593,000	
第1 2 回利付国債(30年)	20,000,000	23,867,800	
第1 3 回利付国債(30年)	30,000,000	35,261,400	
第1 5 回利付国債(30年)	40,000,000	50,305,600	
第1 7 回利付国債(30年)	40,000,000	49,522,400	
第1 9 回利付国債(30年)	20,000,000	24,371,800	
第2 0 回利付国債(30年)	20,000,000	25,064,800	
第2 1 回利付国債(30年)	10,000,000	12,150,600	
第2 2 回利付国債(30年)	20,000,000	25,021,000	
第2 3 回利付国債(30年)	20,000,000	25,029,600	
第2 4 回利付国債(30年)	20,000,000	25,037,000	
第2 6 回利付国債(30年)	40,000,000	49,309,200	
第2 7 回利付国債(30年)	50,000,000	62,691,500	
第2 8 回利付国債(30年)	40,000,000	50,247,600	
第2 9 回利付国債(30年)	40,000,000	49,516,000	
第3 0 回利付国債(30年)	40,000,000	48,753,600	
第3 1 回利付国債(30年)	50,000,000	59,958,500	
第3 2 回利付国債(30年)	50,000,000	61,016,500	

第33回利付国債(30年)	60,000,000	69,472,200	
第34回利付国債(30年)	60,000,000	72,103,800	
第35回利付国債(30年)	60,000,000	69,556,200	
第36回利付国債(30年)	60,000,000	69,555,600	
第37回利付国債(30年)	60,000,000	68,196,600	
第38回利付国債(30年)	50,000,000	55,670,500	
第39回利付国債(30年)	30,000,000	34,077,900	
第40回利付国債(30年)	40,000,000	44,506,000	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	43,567,600	
第42回利付国債(30年)	40,000,000	43,545,200	
第43回利付国債(30年)	40,000,000	43,476,800	
第44回利付国債(30年)	40,000,000	43,453,200	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	62,274,000	
第46回利付国債(30年)	50,000,000	51,851,500	
第47回利付国債(30年)	30,000,000	31,824,300	
第48回利付国債(30年)	20,000,000	20,213,000	
第45回利付国債(20年)	30,000,000	33,108,000	
第47回利付国債(20年)	60,000,000	66,308,400	
第48回利付国債(20年)	60,000,000	67,537,200	
第50回利付国債(20年)	30,000,000	32,978,400	
第51回利付国債(20年)	10,000,000	11,091,700	
第52回利付国債(20年)	20,000,000	22,385,000	
第53回利付国債(20年)	30,000,000	33,725,700	
第55回利付国債(20年)	30,000,000	33,695,100	
第57回利付国債(20年)	30,000,000	33,628,200	
第58回利付国債(20年)	30,000,000	33,741,600	
第59回利付国債(20年)	30,000,000	33,413,100	
第61回利付国債(20年)	10,000,000	10,646,100	
第63回利付国債(20年)	30,000,000	33,774,300	
第64回利付国債(20年)	20,000,000	22,727,800	
第65回利付国債(20年)	80,000,000	91,140,800	
第69回利付国債(20年)	40,000,000	46,361,200	
第70回利付国債(20年)	30,000,000	35,618,400	
第72回利付国債(20年)	30,000,000	34,929,600	
第76回利付国債(20年)	60,000,000	69,099,600	
第78回利付国債(20年)	40,000,000	46,138,000	
第81回利付国債(20年)	50,000,000	58,238,000	
第84回利付国債(20年)	60,000,000	70,023,600	
第85回利付国債(20年)	50,000,000	58,935,000	
第88回利付国債(20年)	50,000,000	60,081,500	
第90回利付国債(20年)	60,000,000	71,629,200	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	71,088,000	

第94回利付国債(20年)	60,000,000	71,167,200	
第95回利付国債(20年)	50,000,000	60,549,500	
第97回利付国債(20年)	60,000,000	72,075,000	
第99回利付国債(20年)	60,000,000	71,456,400	
第100回利付国債(20年)	80,000,000	96,339,200	
第103回利付国債(20年)	50,000,000	60,933,500	
第105回利付国債(20年)	60,000,000	71,730,600	
第108回利付国債(20年)	60,000,000	70,242,600	
第111回利付国債(20年)	60,000,000	72,670,800	
第113回利付国債(20年)	70,000,000	83,913,200	
第114回利付国債(20年)	10,000,000	11,989,100	
第116回利付国債(20年)	80,000,000	97,103,200	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	83,037,500	
第121回利付国債(20年)	70,000,000	82,062,400	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	96,076,000	
第125回利付国債(20年)	60,000,000	72,871,800	
第128回利付国債(20年)	60,000,000	70,210,800	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	92,400,800	
第132回利付国債(20年)	80,000,000	91,085,600	
第134回利付国債(20年)	70,000,000	80,738,000	
第137回利付国債(20年)	70,000,000	79,553,600	
第140回利付国債(20年)	90,000,000	102,141,900	
第141回利付国債(20年)	90,000,000	101,991,600	
第143回利付国債(20年)	70,000,000	78,079,400	
第145回利付国債(20年)	70,000,000	79,014,600	
第146回利付国債(20年)	80,000,000	90,220,000	
第147回利付国債(20年)	70,000,000	77,648,900	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	98,062,200	
第149回利付国債(20年)	60,000,000	65,230,200	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	96,030,900	
第151回利付国債(20年)	90,000,000	92,670,300	
第152回利付国債(20年)	100,000,000	102,666,000	
第153回利付国債(20年)	50,000,000	52,037,000	
第154回利付国債(20年)	20,000,000	20,410,000	
国債証券 小計	12,080,000,000	13,032,139,200	
地方債証券			
第18回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,640,000	
第654回東京都公募公債	100,000,000	103,210,000	
第678回東京都公募公債	80,000,000	84,224,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	30,828,000	
第164回神奈川県公募公債	100,000,000	105,190,000	
第87回大阪府公募公債(5年)	50,000,000	50,100,000	
第110回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,120,000	

	第302回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	41,072,000	
	平成20年度第1回愛知県公募公債（10年）	48,000,000	50,145,600	
	平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	68,785,200	
	平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	103,050,000	
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,230,000	
	第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	52,770,000	
	第485回名古屋市公募公債（10年）	30,000,000	30,888,000	
	平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	31,071,000	
	平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,438,100	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	103,370,000	
地方債証券 小計		1,137,000,000	1,192,131,900	
特殊債券	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,050,000	
	第33回日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,290,000	
	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	104,110,000	
	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	119,010,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,050,000	
	第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,280,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,820,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,080,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,220,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	104,050,200	
	い第759号農林債	20,000,000	20,110,000	
	い第766号農林債	50,000,000	50,155,000	
	第274回信金中金債（5年）	100,000,000	100,280,000	
	第13回中日本高速道路社債（財投機関債）	100,000,000	105,420,000	
特殊債券 小計		1,271,000,000	1,322,925,200	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	103,760,000	
	第30回新日鐵住金社債	100,000,000	105,710,000	
	第1回日本電産社債	100,000,000	100,460,000	
	第8回トヨタ自動車社債	100,000,000	105,940,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,300,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	104,840,000	
	第524回東京電力社債	100,000,000	101,370,000	
社債券 小計		700,000,000	737,380,000	
合計		15,188,000,000	16,284,576,300	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表



該当事項はありません。

## 新光J-REITマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	22,587,687	38,795,489
投資証券	1,470,215,500	2,024,765,760
未収入金	-	958,140
未収配当金	8,164,744	12,064,054
未収利息	23	57
流動資産合計	1,500,967,954	2,076,583,500
<b>資産合計</b>	<b>1,500,967,954</b>	<b>2,076,583,500</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払金	-	12,340,228
未払解約金	100,000	-
流動負債合計	100,000	12,340,228
<b>負債合計</b>	<b>100,000</b>	<b>12,340,228</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	922,067,792	1,381,345,829
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	578,800,162	682,897,443
元本等合計	1,500,867,954	2,064,243,272
純資産合計	1,500,867,954	2,064,243,272
<b>負債純資産合計</b>	<b>1,500,967,954</b>	<b>2,076,583,500</b>

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

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 922,067,792口	1. 計算日における受益権の総数 1,381,345,829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 1.6277円 (1万口当たり純資産額) (16,277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 1.4944円 (1万口当たり純資産額) (14,944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10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。 また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	773,206,973円	922,067,792円
期中追加設定元本額	245,282,664円	473,837,012円
期中一部解約元本額	96,421,845円	14,558,975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	669,236,233円	659,199,851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）	3,433,388円	1,914,134円
グローバル・ナビ	6,044,546円	6,396,586円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	243,353,625円	713,835,258円
合計	922,067,792円	1,381,345,829円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
		当期間の損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	140,365,880	24,224,114
合計	140,365,880	24,224,114

(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	97	40,303,500	
	MCUBS MidCity投資法人	53	17,119,000	
	森ヒルズリート投資法人	313	45,635,400	
	産業ファンド投資法人	70	37,380,000	
	大和ハウスリート投資法人	70	32,970,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	259	66,226,300	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	70	21,035,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	111	56,610,000	
	GLP投資法人	517	61,109,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	94	21,103,000	
	日本プロロジスリート投資法人	345	74,416,500	
	星野リゾート・リート投資法人	10	12,100,000	
	SIA不動産投資法人	15	6,067,500	
	イオンリート投資法人	217	30,032,800	
	ヒューリックリート投資法人	156	22,916,400	

日本リート投資法人	78	21,130,200	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	108	10,324,800	
日本ヘルスケア投資法人	12	2,406,000	
積水ハウス・リート投資法人	158	20,050,200	
ト・セイ・リート投資法人	19	2,232,500	
ケネディクス商業リート投資法人	70	16,205,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	24	2,486,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	33	2,699,400	
ジャパン・シニアリビング投資法人	17	2,597,600	
野村不動産マスタ・ファンド投資法人	731.15	107,040,360	
日本ビルファンド投資法人	282	161,022,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	261	145,638,000	
日本リートファンド投資法人	509	116,917,300	
オリックス不動産投資法人	463	72,505,800	
日本プライムリアルティ投資法人	174	68,295,000	
プレミア投資法人	53	31,853,000	
東急リアル・エステート投資法人	195	28,353,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	39	14,274,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	549	91,737,900	
森トラスト総合リート投資法人	263	54,020,200	
インヴィンシブル投資法人	637	44,781,100	
フロンティア不動産投資法人	99	46,975,500	
平和不動産リート投資法人	190	16,834,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	175	38,552,500	
福岡リート投資法人	149	28,190,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	81	45,279,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	203	22,167,600	
いちごオフィスリート投資法人	282	21,911,400	
大和証券オフィス投資法人	97	59,946,000	
阪急リート投資法人	119	15,065,400	
スターツプロシード投資法人	35	5,957,000	
トップリート投資法人	35	16,135,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	149	36,207,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	627	50,598,900	
日本賃貸住宅投資法人	327	26,061,900	
ジャパンエクセレント投資法人	252	33,289,200	

合計	9,892.15	2,024,765,760	
----	----------	---------------	--

(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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	2,430,810	10,424,549
コール・ローン	11,216,943	8,643,985
投資証券	1,035,470,706	977,458,987
未収配当金	861,210	1,192,105
未収利息	11	12
流動資産合計	1,049,979,680	997,719,638
資産合計	1,049,979,680	997,719,638
<b>負債の部</b>		
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	-
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	707,635,787	664,707,158
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	341,393,893	333,012,480
元本等合計	1,049,029,680	997,719,638
純資産合計	1,049,029,680	997,719,638
負債純資産合計	1,049,979,680	997,719,638

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

## （貸借対照表に関する注記）

平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 707,635,787口	1. 計算日における受益権の総数 664,707,158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 1.4824円 (1万口当たり純資産額) (14,824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 1.5010円 (1万口当たり純資産額) (15,010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10月21日 至 平成27年 4月20日	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左

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27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額



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

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	905,073,922円	707,635,787円
期中追加設定元本額	3,001,420円	4,734,455円
期中一部解約元本額	200,439,555円	47,663,084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	695,618,948円	661,059,740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）	5,621,812円	3,647,418円
グローバル・ナビ	6,395,027円	- 円
合計	707,635,787円	664,707,158円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成27年 4月20日現在	平成27年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	73,709,274	59,267,840
合計	73,709,274	59,267,840

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

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

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	22,869.00	
		AGREE REALTY CORPORATION	200	6,262.00	
		ALEXANDER'S INC	20	7,509.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	700	66,087.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	400	17,412.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,100	43,032.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	1,500	25,335.00	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	200	3,452.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	4,100	396,839.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	1,500	60,480.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,600	31,008.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	300	3,177.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	200	3,126.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	900	6,489.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,300	240,838.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	2,000	46,780.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,500	186,150.00	
		BRANDYWINE REALTY	1,700	22,236.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,700	42,959.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	800	63,232.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	600	3,870.00	
		CARE CAPITAL PROPERTIES	800	26,832.00	
		CARETRUST REIT INC	400	4,724.00	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	400	4,332.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,600	23,776.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	800	5,416.00	
		CHAMBERS STREET PROPERTIES	2,300	16,146.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	400	9,652.00	

CHESAPEAKE LODGING TRUST	600	17,544.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1,200	30,300.00	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	1,200	23,712.00	
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	600	3,066.00	
CORESITE REALTY CORPORATION	200	11,496.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	900	20,322.00	
CORRECTIONS CORPORATION OF AMERICA	1,100	32,879.00	
COUSINS PROPERTIES INC	2,100	20,769.00	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3,200	264,192.00	
CUBESMART	1,600	44,768.00	
CYRUSONE INC	600	20,688.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	900	32,760.00	
DDR CORPORATION	3,000	50,250.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,900	23,807.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,300	93,041.00	
DOUGLAS EMMETT INC	1,300	40,703.00	
DUKE REALTY CORP	3,300	69,465.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	600	17,646.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	100	1,768.00	
EASTGROUP PROPERTIES	300	17,160.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	500	17,545.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	900	16,209.00	
EPR PROPERTIES	600	33,528.00	
EQUINIX INC	600	174,426.00	
EQUITY COMMONWEALTH	1,200	35,604.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	700	43,827.00	
EQUITY ONE INC	600	15,798.00	
EQUITY RESIDENTIAL	3,500	280,455.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	630	149,656.50	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,100	87,494.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT	700	101,689.00	
FELCOR LODGING TRUST	1,400	11,424.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY	1,100	24,464.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	600	7,050.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES	900	10,503.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	800	24,048.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	4,900	136,171.00	
GETTY REALTY CORP	200	3,392.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	200	3,078.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	700	12,467.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	500	11,055.00	
HCP INC	4,400	172,964.00	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,000	26,680.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,200	31,212.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	400	10,144.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	900	38,133.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1,500	42,870.00	
HOST HOTELS & RESORTS	7,300	129,137.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	700	21,553.00	
INFREIT INC	200	4,936.00	
INLAND REAL ESTATE CORP	800	6,976.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,200	9,636.00	
IRON MOUNTAIN INC	1,800	57,024.00	
KILROY REALTY CORP	900	62,928.00	
KIMCO REALTY CORP	4,000	104,720.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	800	20,872.00	
LAMAR ADVERTISING COMPANY	800	44,792.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,100	34,606.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	2,300	20,217.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,400	48,202.00	
LTC PROPERTIES INC	300	13,320.00	
MACK-CALI REALTY CORP	900	19,359.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,300	27,370.00	
MID-AMERICA APARTMENT	700	59,990.00	
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	600	6,282.00	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	1,600	15,824.00	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	300	18,405.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,300	49,751.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	100	1,494.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	800	8,888.00	
NEW YORK REIT INC	1,600	18,432.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	200	2,756.00	
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORPORATION	3,400	41,650.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	1,600	58,496.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	100	2,354.00	
OUTFRONT MEDIA INC	1,300	30,173.00	
PARAMOUNT GROUP INC	1,400	25,046.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	800	13,616.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	700	26,110.00	
PENN REAL ESTATE INVESTMENT	600	13,086.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	700	11,319.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	1,500	29,070.00	
PLUM CREEK TIMBER COMPANY	1,700	69,921.00	
POST PROPERTIES INC	500	30,965.00	

POTLATCH CORPORATION	400	11,840.00	
PROLOGIS INC	5,100	215,730.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	200	17,068.00	
PUBLIC STORAGE	1,400	316,288.00	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	300	13,356.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	800	12,856.00	
RAYONIER INC	1,200	27,432.00	
REALTY INCOME CORP	2,300	112,424.00	
REGENCY CENTERS CORPORATION	900	60,120.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	1,000	17,880.00	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	2,300	33,902.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	500	7,450.00	
RLJ LODGING TRUST	1,300	34,632.00	
ROUSE PROPERTIES INC	400	7,136.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	500	26,765.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	600	14,160.00	
SAUL CENTERS INC	100	5,596.00	
SELECT INCOME REIT	700	14,378.00	
SENIOR HOUSING PROPERTIES	2,300	38,617.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORPORATION	300	5,001.00	
SIMON PROPERTY GROUP	3,000	607,770.00	
SL GREEN REALTY CORPORATION	1,000	119,000.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	300	29,460.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4,100	40,918.00	
STAG INDUSTRIAL INC	700	13,958.00	
STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL	400	9,996.00	
STORE CAPITAL CORPORATION	500	11,120.00	
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	2,700	37,692.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	800	10,600.00	
SUN COMMUNITIES INC	500	35,025.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	2,000	29,860.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	900	32,436.00	
TAUBMAN CENTERS INC	600	46,290.00	
TERRENO REALTY CORP	400	8,820.00	
THE GEO GROUP INC	700	22,232.00	
THE MACERICH COMPANY	1,500	125,985.00	
TIER REIT INC	500	7,260.00	
UDR INC	2,500	91,025.00	
UMH PROPERTIES INC	200	2,050.00	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	100	5,073.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	900	21,411.00	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES INC	300	5,937.00	

	VENTAS INC	3,200	185,696.00
	VEREIT INC	8,700	73,428.00
	VORNADO REALTY TRUST	1,600	160,368.00
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	700	19,089.00
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1,100	38,434.00
	WELLTOWER INC	3,400	238,476.00
	WEYERHAEUSER COMPANY	5,000	146,250.00
	WHITESTONE REIT	300	3,783.00
	WINTHROP REALTY TRUST INC	300	4,350.00
	WP CAREY INC	800	49,872.00
	WP GLIMCHER INC	1,800	22,320.00
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	1,100	20,702.00
米ドル建小計		210,950	8,176,836.10 (977,458,987)
	合計		977,458,987 (977,458,987)

(注)券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 166銘柄	98.0%	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10月30日現在)

資産総額	6,989,326,090円
負債総額	2,877,786円
純資産総額( - )	6,986,448,304円
発行済口数	7,657,807,631口
1口当たり純資産額( / )	0.9123円
(1万口当たり純資産額)	(9,123円)

## (参考) 海外国債マザーファンド

(平成27年10月30日現在)

資産総額	40,912,976,648円
負債総額	円
純資産総額( - )	40,912,976,648円
発行済口数	17,522,602,760口
1口当たり純資産額( / )	2.3349円
(1万口当たり純資産額)	(23,349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10月30日現在)

資産総額	13,490,669,176円
負債総額	187,309,062円
純資産総額( - )	13,303,360,114円
発行済口数	6,920,772,323口
1口当たり純資産額( / )	1.9222円
(1万口当たり純資産額)	(19,222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10月30日現在)

資産総額	12,123,507,334円
負債総額	49,693,000円

純資産総額（ - ）	12,073,814,334円
発行済口数	6,141,250,020口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9660円
（1万口当たり純資産額）	（19,660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10月30日現在）

資産総額	16,350,216,882円
負債総額	10,031,600円
純資産総額（ - ）	16,340,185,282円
発行済口数	13,409,629,115口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2185円
（1万口当たり純資産額）	（12,185円）

（参考）新光J-REITマザーファンド

（平成27年10月30日現在）

資産総額	2,232,238,803円
負債総額	45,964,637円
純資産総額（ - ）	2,186,274,166円
発行済口数	1,432,992,969口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5257円
（1万口当たり純資産額）	（15,257円）

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成27年10月30日現在）

資産総額	1,017,867,678円
負債総額	9,610,232円
純資産総額（ - ）	1,008,257,446円
発行済口数	664,707,158口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5168円
（1万口当たり純資産額）	（15,168円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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



益証券を発行しません。

(1) 投資信託受益証券の名義書換等

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 償還金

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

(8) 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### a．資本金の額（平成27年10月末現在）

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

直近5ヵ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

###### b．委託会社の機構

（イ）株主総会において、15名以内の取締役が選任されます。

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

取締役の任期は、就任後1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ます。

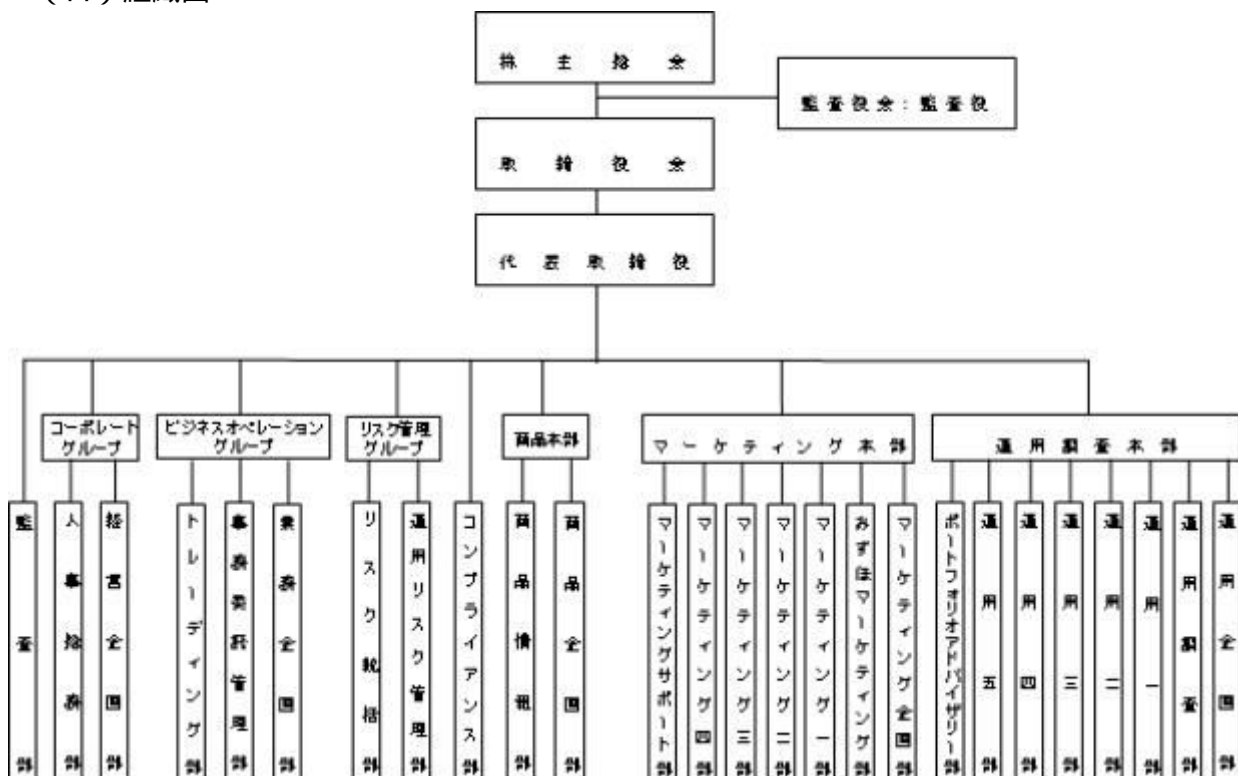
取締役会の決議により、取締役の中から取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

取締役会の決議をもって代表取締役3名以内を決定します。

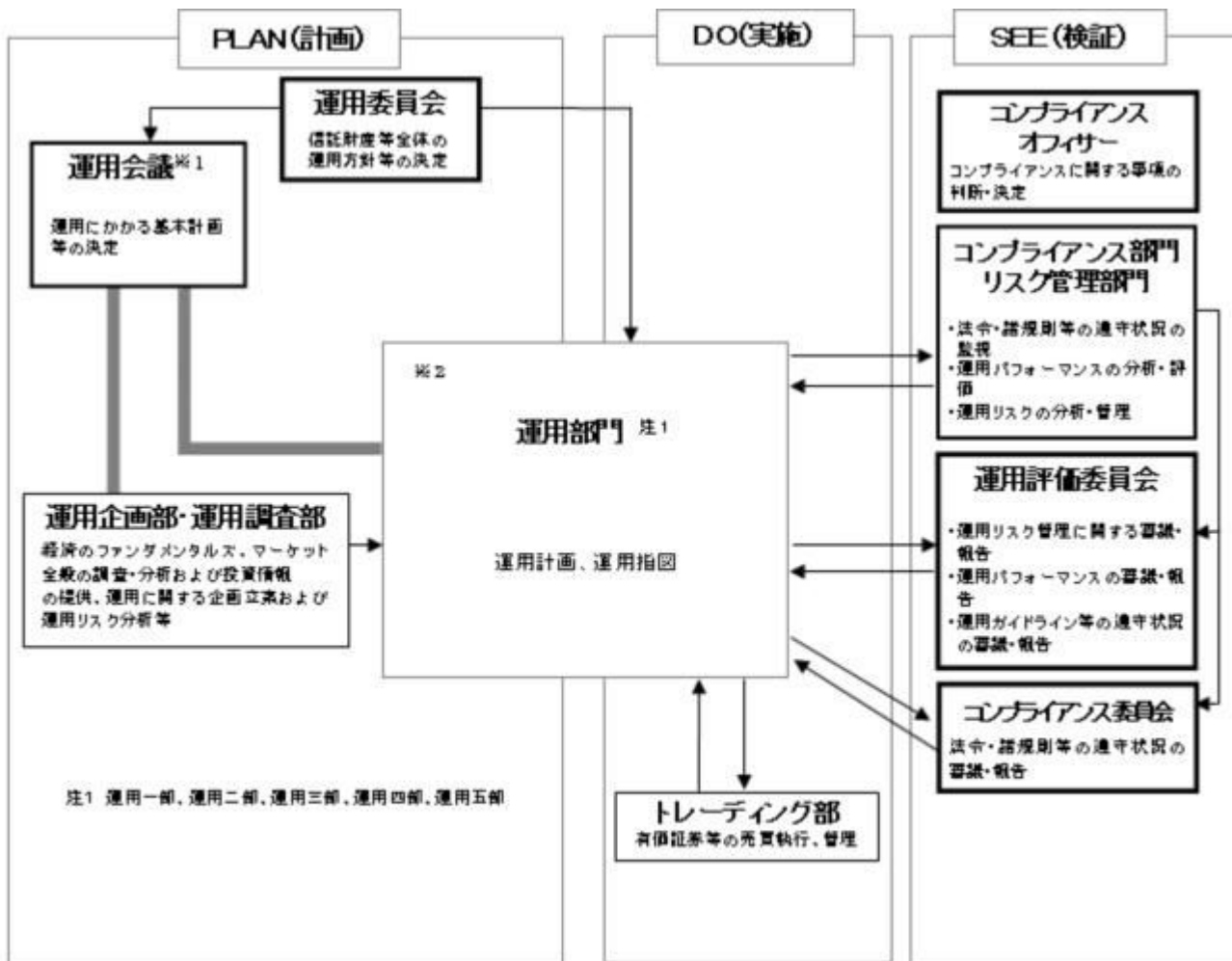
代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

###### （ロ）組織図



###### （ハ）投資運用の意思決定機構



実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】

「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10月30日現在）

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	319	4,232,727
株式投資信託（合計）	291	3,460,878
単位型	53	186,820
追加型	238	3,274,058
公社債投資信託（合計）	28	771,848
単位型	1	2,530
追加型	27	769,317

## 3【委託会社等の経理状況】

### 1．財務諸表の作成方法について

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

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

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

## 2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第55期事業年度(平成26年4月1日から平成27年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第56期事業年度(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

### 1. 財務諸表

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

	株主資本			株 主	評価・換算差額等
	利益剰余金				



	利益 剰余金 合計	自己 株式	資本 合計	その他有価証 券評価差額金	純資産合計
当期首残高	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		株主	評価・換算差額等
	利益剰余金			

	利益 剰余金 合計	自己 株式	資本 合計	その他有価証 券評価差額金	純資産合計
当期首残高	12,149,658	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まいります。

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 その他有価証券	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 その他有価証券」には含めておりません。

## (注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

## 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 その他有価証券	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、記載しておりません。

## 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

## (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 (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)
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 (平成26年3月31日)	当事業年度 (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。

## 2．中間財務諸表

## （1）中間貸借対照表

（単位：千円）

当中間会計期間 （平成27年9月30日）	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	15,954,811
有価証券	3,640,120
貯蔵品	6,357
未収委託者報酬	3,690,798
未収運用受託報酬	99,281
繰延税金資産	348,837
その他	242,660
流動資産合計	23,982,867
固定資産	
有形固定資産	
建物（純額）	11,617
構築物（純額）	1,354
器具・備品（純額）	76,976
有形固定資産合計	1 89,948



無形固定資産	
ソフトウェア	76,808
ソフトウェア仮勘定	12,744
その他	91
無形固定資産合計	89,644
投資その他の資産	
投資有価証券	2,763,859
長期繰延税金資産	989
前払年金費用	387,565
その他	129,929
投資その他の資産合計	3,282,343
固定資産合計	3,461,936
資産合計	27,444,803

(単位：千円)

当中間会計期間

(平成27年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

## 未払金

未払収益分配金	155
未払償還金	4,607
未払手数料	1,754,278
その他未払金	308,151
未払金合計	2,067,192

未払法人税等 946,118

未払消費税等 2 221,381

賞与引当金 449,925

役員賞与引当金 22,000

外国税支払損失引当金 139,578

訴訟損失引当金 30,000

その他 758,645

流動負債合計 4,634,840

## 固定負債

退職給付引当金 153,718

役員退職慰労引当金 37,333

執行役員退職慰労引当金 69,916

固定負債合計 260,968

## 負債合計

4,895,808

## 純資産の部

## 株主資本

資本金 4,524,300

資本剰余金

資本準備金	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700
利益剰余金	
利益準備金	360,493
その他利益剰余金	
別途積立金	8,900,000
繰越利益剰余金	6,076,707
利益剰余金合計	15,337,200
自己株式	72,415
株主資本合計	22,550,784
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,790
評価・換算差額等合計	1,790
純資産合計	22,548,994
負債純資産合計	27,444,803

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 平成27年4月 1日 至 平成27年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	19,786,569
運用受託報酬	127,876
営業収益合計	19,914,445
営業費用及び一般管理費	1 17,105,543
営業利益	2,808,902
営業外収益	
受取配当金	41,711
有価証券利息	1,754
受取利息	5,320
時効成立分配金・償還金	502
その他	157
営業外収益合計	49,446
営業外費用	
支払利息	3
その他	244
営業外費用合計	247
経常利益	2,858,102
特別利益	
投資有価証券売却益	222,173
外国税支払損失引当金戻入益	44,533
特別利益合計	266,706
特別損失	

固定資産除却損	69
投資有価証券売却損	5,811
特別損失合計	5,880
税引前中間純利益	3,118,928
法人税、住民税及び事業税	954,698
法人税等調整額	68,767
法人税等合計	1,023,466
中間純利益	2,095,462

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月 1日 至 平成27年9月30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	3,981,245
当中間期変動額					
中間純利益					2,095,462
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	-	2,095,462
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	6,076,707

	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	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当中間期変動額					
中間純利益	2,095,462		2,095,462		2,095,462
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）				284,475	284,475
当中間期変動額合計	2,095,462	-	2,095,462	284,475	1,810,986
当中間期末残高	15,337,200	72,415	22,550,784	1,790	22,548,994

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

    その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物            8～18年

構築物          20年

器具備品        2～20年

### (2) 無形固定資産

定額法。

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

## 3．引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 役員賞与引当金

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

### (3) 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、当中間会計期間末日において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

### (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、規程に基づく当中間会計期間末日要支給額を計上しております。

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、規程に基づく当中間会計期間末日要支給額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

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

(追加情報)

当社は、平成27年9月30日開催の取締役会において、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及びDIAMアセットマネジメント株式会社との間で、統合に向けた具体的な準備を開始するべく、グループ資産運用機能の統合に係る「統合基本合意書」の締結を決議いたしました。

(中間貸借対照表関係)

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

	当中間会計期間 (平成27年9月30日)
有形固定資産の減価償却累計額	501,932千円

2. 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
有形固定資産	24,732千円
無形固定資産	13,716千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	9,386	-	-	9,386

## 3．配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	15,954,811	15,954,811	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	6,127,827	6,127,827	-
(3) 未収委託者報酬	3,690,798	3,690,798	-
(4) 未払手数料	1,754,278	1,754,278	-

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

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 有価証券及び投資有価証券

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

## (3) 未収委託者報酬

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

## (4) 未払手数料

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

## (注) 2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

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

## （有価証券関係）

当中間会計期間（平成27年9月30日）

## 1．関連会社株式

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

## 2．その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,639,419	1,392,104	247,314
	小計	1,639,419	1,392,104	247,314
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	4,488,408	4,739,020	250,612
	小計	4,488,408	4,739,020	250,612
合計		6,127,827	6,131,125	3,297

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

## （デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## （1）営業収益

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

## （2）有形固定資産

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

### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

#### （1株当たり情報）

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

項目	当中間会計期間 (平成27年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	12,431円46銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	22,548,994
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	22,548,994
普通株式の発行済株式数(株)	1,823,250
普通株式の自己株式数(株)	9,386
1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	1,813,864

項目	当中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	1,155円24銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	2,095,462
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	2,095,462
普通株式の期中平均株式数(株)	1,813,864

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

#### (重要な後発事象)

当社は、将来の事業展開や市況変動に備えるために適正な内部留保を維持しつつ、利益配分については株主の皆様へ安定的かつ可能な範囲で高水準の配当を実施していくことを基本的な考え方としており、平成27年11月17日開催の取締役会において、次のとおり剰余金の処分を決議しました。



#### 株主配当に関する決議事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	3,446,341千円
1株当たり配当額	1,900円
基準日	平成27年12月 8日
効力発生日	平成27年12月 17日

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### a．定款の変更

委託者の定款につき、下記の変更を行いました。

- ・ 剰余金の配当等の決定機関を法令に別段の定めがある場合を除き、株主総会の定めによらず、取締役会の決議によって定めることとしました。（平成27年6月19日実施）

##### b．訴訟事件その他の重要事項

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

なお、「委託会社等の経理状況 中間財務諸表」の注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、平成27年11月17日開催の取締役会において期中配当を行うことを決議しました。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

## a. 資本金の額

平成27年3月末現在、342,037百万円

## b. 事業の内容

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

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

## a. 資本金の額

平成27年3月末現在、300万ポンド

## b. 事業の内容

英国籍の法人であり、内外の有価証券等にかかる投資顧問業務を営んでいます。

## (3) 販売会社

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

販売会社一覧表

（資本金の額は平成27年3月末現在）

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
大山日ノ丸証券株式会社	215	同上
岡安証券株式会社	650	同上
岡三にいがた証券株式会社	852	同上
三豊証券株式会社	300	同上
永和証券株式会社	500	同上
六和証券株式会社	204	同上
西村証券株式会社	500	同上
いちよし証券株式会社	14,577	同上
あかつき証券株式会社	2,834	同上
楽天証券株式会社	7,495	同上
株式会社SBI証券	47,937	同上
SMB C日興証券株式会社	10,000	同上
立花証券株式会社	6,695	同上
高木証券株式会社	11,069	同上

## 2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

「販売会社」は以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

- (1) みずほ証券株式会社は、委託者の株式の76.5%を所有しています。
  - (2) 委託者は、三豊証券株式会社の株式の4.5%を所有しています。
- (注) 関係法人が所有する委託者の株式または委託者が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が1.0%以上のものを記載しています。

#### <再信託受託会社の概要>

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

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙などに委託会社の名称、ロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、ファンドの形態などを記載することがあります。また、以下の内容を記載することがあります。
  - ・ 交付目論見書または請求目論見書である旨
  - ・ 金融商品取引法上の目論見書である旨
  - ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号
  - ・ 詳細情報の入手方法
    - 委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
    - 請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
  - ・ 目論見書の使用開始日
  - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
    - 届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
    - 届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
  - ・ ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭

和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2) 目論見書は別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(3) 目論見書は電子媒体などとして使用される他、インターネットなどに掲載されることがあります。

(4) 本書の記載内容について、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

(5) 目論見書に記載された運用実績のデータは、随時更新される場合があります。

(6) 請求目論見書にファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

平成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。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年12月1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27年4月21日から平成27年10月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの平成27年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月1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27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、新光投信株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日開催の取締役会において、「統合基本合意書」の締結について決議している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

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