

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年7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。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出しましたので、平成28年 1月20日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するため提出するものです。

## 2【訂正の内容】

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (3)【ファンドの仕組み】

## b. 委託会社の概況

&lt;更新後&gt;

## (イ) 資本金の額（平成28年4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	1,813,864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28年4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	76.98%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町1-5-5	275,055	15.16
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	7.56

## 2【投資方針】

## (2)【投資対象】

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

&lt;訂正前&gt;

(略)

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

(略)

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>
（略）	

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（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

（略）

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

<訂正後>

（略）

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

（略）	
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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>・単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、政府保証債は除きます。</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>
（略）	

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

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（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83.5兆円）の一員です。F T I M L社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2016年3月末現在、1米ドル = 112.395円で換算

（略）

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成28年7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。

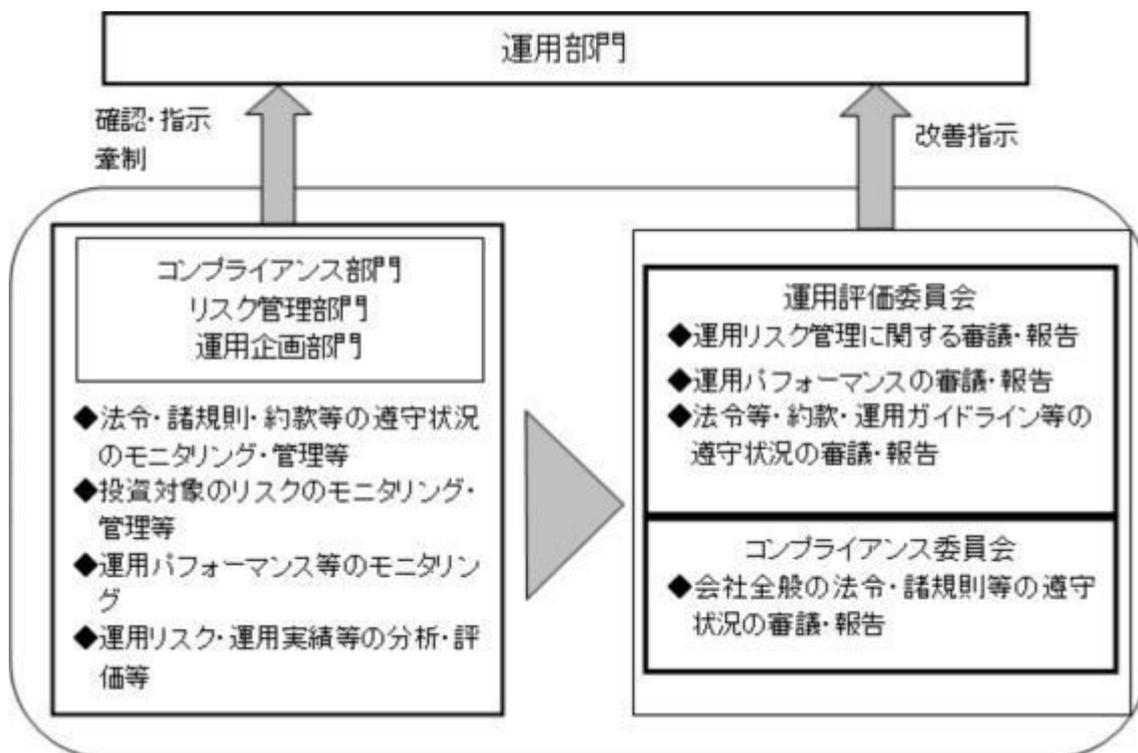
### 3【投資リスク】

#### (2) リスク管理体制

<更新後>

パフォーマンスの分析・管理 : 運用成果を分析し、その結果を審議・検討してその評価を行います。

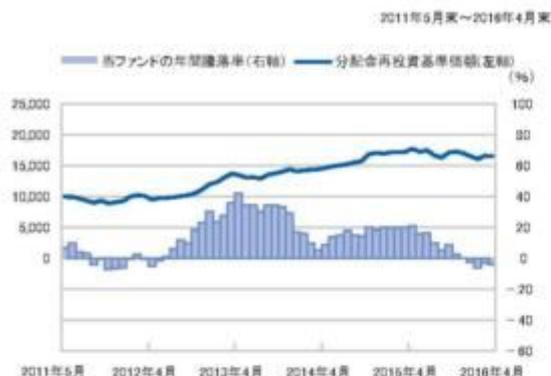
運用リスクの管理 : 投資信託財産の運用リスクの管理およびその管理の現状・適正性を把握し、管理方針を協議、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。



上記リスク管理体制は、今後変更になることがあります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

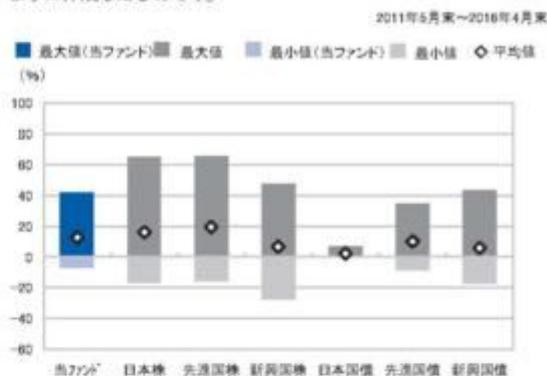


- \* 分配金再投資基準価額は、2011年5月末の基準価額を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2011年5月から2016年4月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	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	6.7	34.9	43.7
最小値	-17.2	-17.0	-15.6	-27.4	0.4	-8.6	-17.4
平均値	12.8	16.1	19.5	6.8	2.5	10.3	6.0

- \* 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。
- \* 2011年5月から2016年4月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

#### 各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)  
 先進国株・・・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)  
 新興国株・・・MSCIエマーゼンダ・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・エマーゼンダ・マーケット・グローバル・ディバースファイド(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。

#### 各資産クラスの騰落率について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、その内容について、信頼性、正確性、完全性、最新性、信頼性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

#### 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式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エマーゼンダ・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマーゼンダ・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・エマーゼンダ・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼンダ・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)は、JP 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とした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼンダ・マーケット・グローバル・ディ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、JP 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、JP Morganは其の完全性・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。JP 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, JP Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4【手数料等及び税金】

### (5)【課税上の取扱い】

## &lt;訂正前&gt;

## a．個人の受益者の場合

(略)

&lt;少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合&gt;

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式や公募株式投資信託などについての非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(略)

上記は平成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。

## &lt;訂正後&gt;

## a．個人の受益者の場合

(略)

<少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合>

「NISA（ニーサ）」および「ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」は、上場株式や公募株式投資信託などについての非課税制度です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(略)

上記は平成28年4月末現在のものです。税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## 新光7資産バランスファンド

(平成28年 4月28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	804,375,000	12.74
親投資信託受益証券	日本	5,320,707,761	84.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		188,038,497	2.97

純資産総額	6,313,121,258	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28年 4月28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	13,965,217,650	41.31
	カナダ	351,189,113	1.03
	ドイツ	3,340,301,925	9.88
	イタリア	6,743,691,567	19.94
	フランス	6,189,308,339	18.30
	イギリス	2,661,736,031	7.87
	小計	33,251,444,625	98.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		552,043,658	1.63
純資産総額		33,803,488,283	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28年 4月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	11,197,398,030	97.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		305,348,933	2.65
純資産総額		11,502,746,963	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28年 4月28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	5,136,692,909	51.52
	カナダ	330,870,930	3.31
	モーリシャス	791,986	0.00
	パナマ	6,338,593	0.06
	ドイツ	324,756,045	3.25
	イタリア	71,567,118	0.71
	フランス	326,496,616	3.27
	オランダ	149,411,498	1.49

	スペイン	117,978,997	1.18
	ベルギー	52,172,500	0.52
	オーストリア	7,444,295	0.07
	ルクセンブルグ	9,439,809	0.09
	フィンランド	36,392,399	0.36
	アイルランド	144,814,700	1.45
	ポルトガル	6,311,150	0.06
	イギリス	674,719,010	6.76
	スイス	407,891,724	4.09
	スウェーデン	121,685,744	1.22
	ノルウェー	25,909,425	0.25
	デンマーク	81,932,764	0.82
	ケイマン諸島	24,812,075	0.24
	リベリア	4,227,803	0.04
	オーストラリア	230,004,342	2.30
	バミューダ諸島	35,113,883	0.35
	ニュージーランド	7,034,414	0.07
	パプアニューギニア	2,048,725	0.02
	香港	97,308,889	0.97
	シンガポール	67,915,988	0.68
	イスラエル	27,850,755	0.27
	キュラソー	32,756,183	0.32
	ジャージー	38,401,753	0.38
	英ヴァージン諸島	3,375,576	0.03
	マン島	1,454,418	0.01
	小計	8,605,923,016	86.33
投資信託受益証券	シンガポール	938,362	0.00
投資証券	アメリカ	178,696,587	1.79
	カナダ	2,127,275	0.02
	フランス	13,660,407	0.13
	イギリス	11,621,975	0.11
	オーストラリア	24,552,358	0.24
	香港	4,827,074	0.04
	シンガポール	4,603,618	0.04
	小計	240,089,294	2.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,121,528,887	11.25
純資産総額		9,968,479,559	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28年 4月28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	11,963,990,800	79.30
地方債証券	日本	1,198,429,400	7.94
特殊債券	日本	1,233,770,600	8.17
社債券	日本	635,150,000	4.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		54,022,890	0.35
純資産総額		15,085,363,690	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28年 4月28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	3,286,926,000	98.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		60,941,840	1.82
純資産総額		3,347,867,840	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28年 4月28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	886,307,852	97.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		25,949,883	2.84
純資産総額		912,257,735	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28年 4月28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	新光日本債券インデックスマザー ファンド	714,653,519	1.2884	920,759,593	1.2828	916,757,534	14.52

2	日本	親投資信託 受益証券	新光J-R E I Tマザーファンド	531,532,406	1.6823	894,196,967	1.7167	912,481,681	14.45
3	日本	親投資信託 受益証券	新光米国R E I Tマザーファンド	624,156,895	1.4585	910,332,831	1.4490	904,403,340	14.32
4	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	2.2073	900,925,160	2.2009	898,312,954	14.22
5	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式インデックスマザー ファンド	486,152,665	1.7816	866,129,587	1.7850	867,782,507	13.74
6	日本	親投資信託 受益証券	ニュー トピックス インデック ス マザーファンド	491,333,859	1.7026	836,545,028	1.6709	820,969,745	13.00
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	4.759	785,235,000	4.875	804,375,000	12.74

(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28年 4月28日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	12.74
親投資信託受益証券	84.28
合計	97.02

(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28年 4月28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	12,800,000	11,155.04	1,427,845,716	11,492.8828	1,471,089,000	2.3750	2024.08.15	4.35
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,800,000	11,023.63	1,411,024,852	11,379.7031	1,456,602,000	2.2500	2024.11.15	4.30
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,800,000	11,082.01	1,418,497,743	11,356.5527	1,453,638,756	2.2500	2025.11.15	4.30
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,800,000	10,884.47	1,393,212,460	11,250.2324	1,440,029,756	2.1250	2025.05.15	4.26
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,400,000	11,276.81	1,398,324,750	11,607.7773	1,439,364,391	2.5000	2024.05.15	4.25
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,800,000	10,781.18	1,379,991,218	11,148.1992	1,426,969,499	2.0000	2025.02.15	4.22
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,800,000	10,763.20	1,377,690,346	11,127.6210	1,424,335,498	2.0000	2025.08.15	4.21
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,100,000	11,520.08	1,278,729,627	11,813.5585	1,311,305,002	2.7500	2023.11.15	3.87
9	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,500,000	16,013.96	1,201,047,180	16,179.0420	1,213,428,150	4.2500	2023.10.25	3.58
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,100,000	11,507.43	932,101,951	11,814.4160	956,967,700	2.7500	2024.02.15	2.83
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	10,786.46	895,276,623	10,742.6387	891,639,014	1.6250	2026.02.15	2.63
12	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,500,000	18,549.73	834,738,030	18,814.1096	846,634,932	6.0000	2025.10.25	2.50
13	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,000,000	13,555.14	813,308,711	13,817.0383	829,022,303	1.7500	2023.05.25	2.45

14	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,600,000	14,047.50	786,660,148	14,342.0660	803,155,696	2.2500	2024.05.25	2.37
15	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000	17,272.53	777,264,264	17,355.6996	781,006,482	5.2500	2029.11.01	2.31
16	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,600,000	13,486.87	755,265,234	13,824.4855	774,171,193	1.7500	2024.11.25	2.29
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,900,000	15,585.74	763,701,673	15,650.2908	766,864,250	4.7500	2023.08.01	2.26
18	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000	16,113.25	757,323,145	16,118.2231	757,556,490	5.0000	2025.03.01	2.24
19	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,800,000	12,034.67	698,011,161	12,438.0651	721,407,781	0.5000	2025.05.25	2.13
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000	15,411.98	708,951,099	15,455.4224	710,949,431	4.5000	2024.03.01	2.10
21	イギリス	国債証券	TSY	4,100,000	16,515.74	677,145,701	16,908.0696	693,230,854	2.2500	2023.09.07	2.05
22	イギリス	国債証券	TSY	4,200,000	16,043.84	673,841,593	16,479.8657	692,154,363	2.0000	2025.09.07	2.04
23	イギリス	国債証券	TSY	3,900,000	17,092.25	666,598,012	17,466.2495	681,183,734	2.7500	2024.09.07	2.01
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000	16,170.97	663,009,942	15,780.6168	647,005,289	4.5000	2026.03.01	1.91
25	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,700,000	12,730.72	598,343,918	12,924.6155	607,456,932	1.0000	2025.11.25	1.79
26	イギリス	国債証券	TSY	2,900,000	20,252.51	587,323,057	20,523.0027	595,167,080	5.0000	2025.03.07	1.76
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,900,000	14,716.90	573,959,428	14,783.9332	576,573,395	3.7500	2024.09.01	1.70
28	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,600,000	15,296.54	550,675,757	15,378.4680	553,624,848	4.5000	2023.05.01	1.63
29	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000	13,431.02	537,241,008	13,556.3864	542,255,457	2.5000	2024.12.01	1.60
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,900,000	12,357.38	481,938,100	12,505.0900	487,698,510	1.5000	2025.06.01	1.44

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成28年4月28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28年4月28日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.36
合計	98.36

(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28年4月28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	70,600	6,761.47	477,359,782	5,654.00	399,172,400	3.47
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	449,300	672.84	302,307,012	520.10	233,680,930	2.03
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	43,300	4,723.81	204,540,973	4,864.00	210,611,200	1.83
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	31,700	5,488.82	173,995,594	5,988.00	189,819,600	1.65
5	日本	株式	KDDI	情報・通信業	56,900	2,869.02	163,247,238	3,169.00	180,316,100	1.56
6	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	37,600	4,118.43	154,852,968	4,530.00	170,328,000	1.48
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	51,100	3,464.97	177,059,967	2,992.50	152,916,750	1.32
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	44,800	4,151.47	185,985,856	3,413.00	152,902,400	1.32
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	793,800	221.66	175,958,485	167.80	133,199,640	1.15
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	23,700	5,553.64	131,621,268	5,262.00	124,709,400	1.08
11	日本	株式	ソニー	電気機器	40,000	2,603.22	104,128,800	2,778.00	111,120,000	0.96
12	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	41,800	2,445.60	102,226,080	2,597.00	108,554,600	0.94
13	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	23,400	5,040.52	117,948,168	4,543.00	106,306,200	0.92
14	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	10,400	10,404.62	108,208,048	9,824.00	102,169,600	0.88
15	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	66,500	1,608.71	106,979,215	1,497.00	99,550,500	0.86
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	5,100	20,314.40	103,603,440	19,435.00	99,118,500	0.86
17	日本	株式	花王	化学	16,000	5,684.34	90,949,440	6,116.00	97,856,000	0.85
18	日本	株式	ファナック	電気機器	5,800	18,585.31	107,794,798	16,505.00	95,729,000	0.83
19	日本	株式	キヤノン	電気機器	30,500	3,299.39	100,631,395	3,112.00	94,916,000	0.82
20	日本	株式	三菱地所	不動産業	42,000	2,307.44	96,912,480	2,121.00	89,082,000	0.77
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	6,000	14,406.18	86,437,080	14,795.00	88,770,000	0.77
22	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	57,316.92	74,512,000	67,160.00	87,308,000	0.75
23	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	22,700	4,138.28	93,938,956	3,689.00	83,740,300	0.72
24	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	20,100	3,972.48	79,846,848	4,116.00	82,731,600	0.71
25	日本	株式	三井不動産	不動産業	30,000	2,809.60	84,288,000	2,725.00	81,750,000	0.71
26	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	79,200	1,119.64	88,675,488	1,000.00	79,200,000	0.68
27	日本	株式	三菱商事	卸売業	42,000	1,852.68	77,812,560	1,863.00	78,246,000	0.68
28	日本	株式	日立製作所	電気機器	145,000	608.40	88,218,000	515.60	74,762,000	0.64
29	日本	株式	ダイキン工業	機械	8,300	7,754.40	64,361,520	8,884.00	73,737,200	0.64
30	日本	株式	三菱電機	電気機器	61,000	1,115.93	68,071,730	1,198.00	73,078,000	0.63

(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28年 4月28日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.30
		建設業	3.05
		食料品	4.91
		繊維製品	0.71

パルプ・紙	0.25
化学	6.04
医薬品	5.65
石油・石炭製品	0.53
ゴム製品	0.95
ガラス・土石製品	0.91
鉄鋼	1.23
非鉄金属	0.83
金属製品	0.63
機械	4.60
電気機器	11.43
輸送用機器	9.13
精密機器	1.58
その他製品	1.51
電気・ガス業	1.98
陸運業	4.53
海運業	0.22
空運業	0.65
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	8.15
卸売業	4.07
小売業	4.69
銀行業	7.30
証券、商品先物取引業	1.02
保険業	2.21
その他金融業	1.34
不動産業	2.74
サービス業	3.73
合計	97.34

（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28年 4月28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	14,587	13,232.55	193,023,316	10,735.7449	156,602,312	1.57
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	19,854	5,944.05	118,013,367	5,590.6650	110,997,063	1.11
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	10,891	8,994.01	97,953,790	9,708.4849	105,735,110	1.06

4	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,239	11,067.19	80,115,389	12,376.5075	89,593,538	0.89
5	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO (US)	資本財	24,692	3,265.06	80,620,924	3,394.5675	83,818,661	0.84
6	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	9,737	8,444.91	82,228,186	8,190.8950	79,754,745	0.80
7	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	5,940	11,687.27	69,422,428	11,950.6774	70,987,024	0.71
8	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	12,695	6,087.83	77,285,033	5,589.5674	70,959,559	0.71
9	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,042	71,940.02	74,961,509	66,571.0575	69,367,042	0.69
10	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	16,095	3,604.18	58,009,438	4,249.5199	68,396,024	0.68
11	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	9,631	7,396.05	71,231,381	7,036.0724	67,764,414	0.67
12	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	814	79,556.67	64,759,135	77,465.9398	63,057,275	0.63
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	7,118	8,275.15	58,902,518	8,767.9275	62,410,108	0.62
14	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	10,645	4,971.67	52,923,480	5,672.9774	60,388,845	0.60
15	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	762	82,836.00	63,121,038	79,180.2349	60,335,339	0.60
16	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	2,146	30,110.43	64,616,983	28,055.6500	60,207,425	0.60
17	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,949	10,014.23	69,588,885	8,427.9850	58,566,068	0.58
18	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	16,152	3,693.08	59,650,749	3,621.7500	58,498,506	0.58
19	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	4,924	10,132.12	49,890,559	11,397.5375	56,121,475	0.56
20	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	10,809	4,559.01	49,278,393	4,903.6300	53,003,337	0.53
21	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	3,103	14,706.49	45,634,269	16,199.0999	50,265,807	0.50
22	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	3,317	13,663.87	45,323,074	14,898.5625	49,418,532	0.49
23	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	4,109	12,777.09	52,501,083	11,554.4799	47,477,358	0.47
24	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	7,309	5,952.83	43,509,307	6,180.0224	45,169,784	0.45
25	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	27,242	1,940.38	52,859,832	1,648.4450	44,906,939	0.45
26	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	5,092	8,564.89	43,612,420	8,643.9100	44,014,790	0.44
27	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	6,496	6,735.35	43,752,883	6,727.6750	43,702,977	0.43
28	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	食品・飲料・タバコ	4,053	9,356.18	37,920,628	10,675.3824	43,267,325	0.43
29	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	12,346	3,660.16	45,188,367	3,484.5625	43,020,409	0.43
30	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	3,812	10,852.08	41,368,129	11,263.6424	42,937,005	0.43

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成28年4月28日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成28年4月28日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.44
		素材	4.28
		資本財	6.59
		商業・専門サービス	0.87
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.43
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.65
		メディア	2.51
		小売	3.45
		食品・生活必需品小売り	1.88
		食品・飲料・タバコ	5.81
		家庭用品・パーソナル用品	1.97
		ヘルスケア機器・サービス	3.33
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.61
		銀行	7.64
		各種金融	3.58
		保険	3.80
		不動産	0.65
		ソフトウェア・サービス	7.31
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.14		
電気通信サービス	2.94		
公益事業	3.12		
半導体・半導体製造装置	1.78		
投資信託受益証券			0.00
投資証券			2.40
合計			88.74

(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28年4月28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313回利付 国債(10年)	170,000,000	106.69	181,379,400	107.37	182,542,600	1.3000	2021.03.20	1.21
2	日本	国債証券	第315回利付 国債(10年)	170,000,000	106.48	181,031,800	107.27	182,365,800	1.2000	2021.06.20	1.20
3	日本	国債証券	第323回利付 国債(10年)	170,000,000	105.42	179,214,000	106.81	181,592,300	0.9000	2022.06.20	1.20
4	日本	国債証券	第308回利付 国債(10年)	170,000,000	105.83	179,914,500	106.28	180,676,000	1.3000	2020.06.20	1.19
5	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	170,000,000	103.25	175,537,500	106.21	180,558,700	0.6000	2024.06.20	1.19
6	日本	国債証券	第124回利付 国債(5年)	170,000,000	100.34	170,584,400	101.28	172,191,300	0.1000	2020.06.20	1.14
7	日本	国債証券	第123回利付 国債(5年)	170,000,000	100.34	170,589,900	101.22	172,089,300	0.1000	2020.03.20	1.14
8	日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	160,000,000	105.97	169,556,000	106.30	170,086,400	1.4000	2020.03.20	1.12
9	日本	国債証券	第335回利付 国債(10年)	150,000,000	102.76	154,154,700	105.46	158,202,000	0.5000	2024.09.20	1.04
10	日本	国債証券	第341回利付 国債(10年)	150,000,000	102.52	153,794,400	103.83	155,754,000	0.3000	2025.12.20	1.03
11	日本	国債証券	第107回利付 国債(5年)	150,000,000	100.42	150,637,800	100.74	151,113,000	0.2000	2017.12.20	1.00
12	日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	140,000,000	105.93	148,306,500	106.53	149,147,600	1.2000	2020.12.20	0.98
13	日本	国債証券	第340回利付 国債(10年)	140,000,000	100.93	141,315,600	104.78	146,693,400	0.4000	2025.09.20	0.97
14	日本	国債証券	第338回利付 国債(10年)	140,000,000	101.18	141,657,500	104.75	146,658,400	0.4000	2025.03.20	0.97
15	日本	国債証券	第105回利付 国債(5年)	140,000,000	100.32	140,459,200	100.50	140,708,400	0.2000	2017.06.20	0.93
16	日本	国債証券	第303回利付 国債(10年)	130,000,000	105.33	136,932,000	105.52	137,183,800	1.4000	2019.09.20	0.90
17	日本	国債証券	第310回利付 国債(10年)	130,000,000	104.70	136,110,600	105.32	136,916,000	1.0000	2020.09.20	0.90
18	日本	国債証券	第290回利付 国債(10年)	130,000,000	103.29	134,277,000	103.09	134,019,600	1.4000	2018.03.20	0.88
19	日本	国債証券	第126回利付 国債(5年)	130,000,000	101.19	131,547,600	101.42	131,851,200	0.1000	2020.12.20	0.87
20	日本	国債証券	第125回利付 国債(5年)	130,000,000	100.30	130,395,800	101.34	131,749,800	0.1000	2020.09.20	0.87
21	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	118.56	118,560,000	126.10	126,100,000	2.1000	2029.12.28	0.83
22	日本	地方債証券	第18回東京都 公募公債(20 年)	100,000,000	119.26	119,260,000	125.96	125,960,000	2.2200	2029.03.19	0.83
23	日本	国債証券	第106回利付 国債(5年)	120,000,000	100.47	120,567,400	100.62	120,752,400	0.2000	2017.09.20	0.80
24	日本	社債券	第36回東日本 旅客鉄道社債	100,000,000	114.96	114,960,000	116.84	116,840,000	2.1100	2024.12.20	0.77
25	日本	国債証券	第332回利付 国債(10年)	110,000,000	103.89	114,288,400	105.94	116,542,800	0.6000	2023.12.20	0.77
26	日本	国債証券	第123回利付 国債(20年)	90,000,000	120.04	108,038,000	129.38	116,448,300	2.1000	2030.12.20	0.77
27	日本	国債証券	第301回利付 国債(10年)	110,000,000	105.38	115,923,500	105.44	115,986,200	1.5000	2019.06.20	0.76
28	日本	国債証券	第120回利付 国債(5年)	110,000,000	100.73	110,805,200	101.46	111,608,200	0.2000	2019.09.20	0.73
29	日本	国債証券	第117回利付 国債(5年)	110,000,000	100.65	110,715,300	101.27	111,399,200	0.2000	2019.03.20	0.73
30	日本	国債証券	第116回利付 国債(5年)	110,000,000	100.60	110,665,500	101.17	111,292,500	0.2000	2018.12.20	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。

## ロ.種類別投資比率

(平成28年 4月28日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.30
地方債証券	7.94
特殊債券	8.17
社債券	4.21
合計	99.64

(参考) 新光J-REITマザーファンド

## イ.評価額上位銘柄明細

(平成28年 4月28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	387	597,876.2	231,378,089	686,000	265,482,000	7.92
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	359	589,957.29	211,794,667	674,000	241,966,000	7.22
3	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	700	238,479.28	166,935,496	266,100	186,270,000	5.56
4	日本	投資証券	野村不動産マスタ-ファンド投資法人	1,021	150,794.23	153,960,908	169,900	173,467,900	5.18
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	755	170,597.95	128,801,452	187,100	141,260,500	4.21
6	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	505	225,735.21	113,996,281	260,600	131,603,000	3.93
7	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	664	161,329.48	107,122,774	180,400	119,785,600	3.57
8	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	240	411,606.22	98,785,492	478,500	114,840,000	3.43
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	357	261,847.86	93,479,686	291,800	104,172,600	3.11
10	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	165	527,975.25	87,115,916	578,000	95,370,000	2.84
11	日本	投資証券	GLP投資法人	712	120,812.06	86,018,186	131,400	93,556,800	2.79
12	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	133	639,569.3	85,062,716	694,000	92,302,000	2.75
13	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	911	86,198.84	78,527,143	98,000	89,278,000	2.66
14	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	1,007	74,171.52	74,690,720	82,200	82,775,400	2.47
15	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	480	153,533.28	73,695,974	161,600	77,568,000	2.31
16	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	362	204,454.46	74,012,514	211,400	76,526,800	2.28
17	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	136	482,710.02	65,648,562	544,000	73,984,000	2.20
18	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	111	581,091.94	64,501,205	635,000	70,485,000	2.10
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	133	420,206.6	55,887,477	459,000	61,047,000	1.82
20	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	241	225,276.84	54,291,718	239,100	57,623,100	1.72
21	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	96	476,102.65	45,705,854	577,000	55,392,000	1.65
22	日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	205	241,550.41	49,517,834	264,200	54,161,000	1.61
23	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	347	136,442.13	47,345,419	153,200	53,160,400	1.58
24	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	97	532,703.9	51,672,278	545,000	52,865,000	1.57
25	日本	投資証券	プレミアム投資法人	361	124,270.88	44,861,787	138,000	49,818,000	1.48
26	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	263	160,828.86	42,297,990	186,100	48,944,300	1.46
27	日本	投資証券	イオンリート投資法人	359	137,992.64	49,539,357	134,700	48,357,300	1.44

28	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	268	149,020.56	39,937,510	155,800	41,754,400	1.24
29	日本	投資証券	福岡リート投資法人	205	192,670.25	39,497,401	197,200	40,426,000	1.20
30	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	450	81,141.75	36,513,787	84,700	38,115,000	1.13

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

#### ロ.種類別投資比率

(平成28年 4月28日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.17
合計	98.17

#### (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28年 4月28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	2,870	22,223.04	63,780,150	22,451.5574	64,435,970	7.06
2	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	3,900	10,622.70	41,428,539	11,467.7774	44,724,332	4.90
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	1,300	24,794.72	32,233,136	27,241.0476	35,413,362	3.88
4	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3,100	9,070.83	28,119,596	9,629.4648	29,851,341	3.27
5	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	7,300	3,070.76	22,416,592	3,547.1200	25,893,976	2.83
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,300	20,274.27	26,356,552	19,702.3200	25,613,016	2.80
7	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3,300	7,688.11	25,370,766	7,660.5500	25,279,815	2.77
8	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	3,300	8,794.26	29,021,083	7,545.3124	24,899,531	2.72
9	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	4,800	4,642.42	22,283,640	5,048.5000	24,232,800	2.65
10	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	600	31,912.36	19,147,417	36,417.2450	21,850,347	2.39
11	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	3,100	6,358.54	19,711,485	6,860.4725	21,267,465	2.33
12	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1,400	13,619.97	19,067,965	14,333.3500	20,066,690	2.19
13	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1,600	10,947.92	17,516,672	10,567.8275	16,908,524	1.85
14	アメリカ	投資証券	HCP INC	4,300	4,310.98	18,537,214	3,756.7425	16,153,993	1.77
15	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	610	26,004.29	15,862,619	24,655.3377	15,039,756	1.64
16	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2,300	5,375.32	12,363,240	6,524.6373	15,006,666	1.64
17	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	4,700	3,049.01	14,330,359	3,176.1651	14,927,976	1.63
18	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,400	8,120.69	11,368,968	9,616.2950	13,462,813	1.47
19	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	1,500	9,177.28	13,765,925	8,469.4073	12,704,111	1.39
20	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	7,000	1,937.00	13,559,014	1,749.4150	12,245,905	1.34
21	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	3,800	2,873.25	10,918,369	3,152.0200	11,977,676	1.31
22	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	700	16,107.62	11,275,337	16,962.9600	11,874,072	1.30
23	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	900	13,060.25	11,754,225	11,660.9377	10,494,844	1.15
24	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,100	8,729.51	9,602,467	9,441.7927	10,385,972	1.13
25	アメリカ	投資証券	UDR INC	2,400	3,990.51	9,577,224	3,876.3700	9,303,288	1.01
26	アメリカ	投資証券	VEREIT INC	8,400	924.64	7,766,986	983.3600	8,260,224	0.90
27	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	3,200	2,309.14	7,389,248	2,443.0350	7,817,712	0.85

28	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT	700	9,405.57	6,583,902	10,607.3371	7,425,136	0.81
29	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORPORATION	900	7,331.30	6,598,170	8,206.0077	7,385,407	0.80
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	800	8,674.64	6,939,712	9,003.8900	7,203,112	0.78

(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28年4月28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28年4月28日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	97.15
合計	97.15

#### 【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28年 4月28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	22	日本円	291,666,760	291,830,000	2.53

（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28年 4月28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	70	米ドル	7,038,375	772,461,656	7,317,450	803,090,137	8.05
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60IX	買建	4	カナダド ル	629,416	54,878,781	647,680	56,471,219	0.56
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EURO ST50	買建	36	ユーロ	1,075,338	133,470,953	1,103,400	136,954,008	1.37
	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	386,136	32,203,742	386,550	32,238,270	0.32
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 100 IDX	買建	8	英ポンド	484,088	77,202,354	501,440	79,969,651	0.80

（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28年 4月28日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新光J - R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新光米国R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

## （ 3 ） 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 新光7資産バランスファンド

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（平成19年 4月20日）	46,505,640,498	46,672,485,568	1.0946	1.0985
第2特定期間末（平成19年10月22日）	73,335,259,420	73,622,000,840	1.0050	1.0090
第3特定期間末（平成20年 4月21日）	60,571,391,084	60,839,591,183	0.9027	0.9067
第4特定期間末（平成20年10月20日）	31,463,032,178	31,656,566,896	0.6503	0.6543
第5特定期間末（平成21年 4月20日）	21,963,360,031	22,110,320,662	0.5978	0.6018
第6特定期間末（平成21年10月20日）	19,553,950,956	19,673,764,141	0.6526	0.6566
第7特定期間末（平成22年 4月20日）	16,678,962,105	16,777,904,047	0.6743	0.6783
第8特定期間末（平成22年10月20日）	13,023,510,796	13,108,669,225	0.6117	0.6157
第9特定期間末（平成23年 4月20日）	12,014,371,674	12,090,851,540	0.6284	0.6324
第10特定期間末（平成23年10月20日）	9,331,021,288	9,365,284,964	0.5447	0.5467
第11特定期間末（平成24年 4月20日）	8,395,549,774	8,423,613,455	0.5983	0.6003
第12特定期間末（平成24年10月22日）	7,563,587,311	7,588,930,007	0.5969	0.5989
第13特定期間末（平成25年 4月22日）	9,376,624,758	9,400,502,707	0.7854	0.7874
第14特定期間末（平成25年10月21日）	8,609,105,823	8,631,386,804	0.7728	0.7748
第15特定期間末（平成26年 4月21日）	8,104,673,028	8,125,011,741	0.7970	0.7990
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
第19特定期間末（平成28年 4月20日）	6,329,734,429	6,344,342,644	0.8666	0.8686
平成27年 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	
11月末日	6,976,015,360		0.9195	
12月末日	6,757,962,728		0.9045	
平成28年 1月末日	6,490,132,766		0.8742	
2月末日	6,269,829,258		0.8487	
3月末日	6,410,814,596		0.8755	
4月末日	6,313,121,258		0.8683	

(注)表中の(分配付)の数値は支払外国税を控除している場合があります。

## 【分配の推移】

## 新光7資産バランスファンド

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	平成18年10月31日～平成19年 4月20日	0.0100
第2特定期間	平成19年 4月21日～平成19年10月22日	0.0240
第3特定期間	平成19年10月23日～平成20年 4月21日	0.0240
第4特定期間	平成20年 4月22日～平成20年10月20日	0.0240
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年 4月20日	0.0240
第6特定期間	平成21年 4月21日～平成21年10月20日	0.0240
第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年 4月20日	0.0240
第8特定期間	平成22年 4月21日～平成22年10月20日	0.0240
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年 4月20日	0.0240
第10特定期間	平成23年 4月21日～平成23年10月20日	0.0220
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年 4月20日	0.0120
第12特定期間	平成24年 4月21日～平成24年10月22日	0.0120
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年 4月22日	0.0120
第14特定期間	平成25年 4月23日～平成25年10月21日	0.0120
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年 4月21日	0.0120
第16特定期間	平成26年 4月22日～平成26年10月20日	0.0120
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4月20日	0.0120
第18特定期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	0.0120
第19特定期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	0.0120

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

## 【収益率の推移】

## 新光7資産バランスファンド

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

第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年 4月20日	12.0
第12特定期間	平成24年 4月21日～平成24年10月22日	1.8
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年 4月22日	33.6
第14特定期間	平成25年 4月23日～平成25年10月21日	0.1
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年 4月21日	4.7
第16特定期間	平成26年 4月22日～平成26年10月20日	5.1
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4月20日	13.9
第18特定期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	1.8
第19特定期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	2.3

(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
第19特定期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	7,316,627	417,039,060

(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

2016年4月28日現在

## &lt;基準価額・純資産の推移&gt; (2006年10月31日～2016年4月28日)



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

## &lt;分配の推移&gt;

2016年4月	20円
2016年3月	20円
2016年2月	20円
2016年1月	20円
2015年12月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	3,320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。

## &lt;主要な資産の状況&gt;

## 組入状況

ファンド名	純資産比率
新光日本債券インデックスマザーファンド	14.52%
新光J-REITマザーファンド	14.45%
新光米国REITマザーファンド	14.32%
海外国債マザーファンド	14.22%
新光外国株式インデックスマザーファンド	13.74%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	13.00%
フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	12.74%
合計	97.02%

## 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	3.47%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.03%
日本電信電話	情報・通信業	1.83%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.65%
KDDI	情報・通信業	1.56%

※業種33業種分類にしたがって記載しています。  
 ※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 国内債券の組入上位5銘柄 (新光日本債券インデックスマザーファンド)

銘柄名	償還日	利率	純資産比率
第313回利付国債(10年)	2021/03/20	1.300%	1.21%
第315回利付国債(10年)	2021/06/20	1.200%	1.20%
第323回利付国債(10年)	2022/06/20	0.900%	1.20%
第308回利付国債(10年)	2020/06/20	1.300%	1.19%
第334回利付国債(10年)	2024/06/20	0.600%	1.19%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 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	7.92%
ジャパンリアルエステイト投資法人	7.22%
日本リテールファンド投資法人	5.56%
野村不動産マスターファンド投資法人	5.18%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.21%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

-当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を承継・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。

2016年4月28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	1.57%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.11%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.06%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.89%
GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	資本財	0.84%

※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	4.35%
US TREASURY N/B	2024/11/15	2.250%	米ドル	4.30%
US TREASURY N/B	2025/11/15	2.250%	米ドル	4.30%
US TREASURY N/B	2025/05/15	2.125%	米ドル	4.26%
US TREASURY N/B	2024/05/15	2.500%	米ドル	4.25%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの状況（現地2016年4月14日現在）

## ①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	60.6%
ユーロ	6.4%
ガーナセディ	4.0%
南アフリカランド	3.9%
トルコリラ	3.6%

## ②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
ロシア	6.4%
ナイジェリア	5.3%
ウクライナ	4.6%
アンゴラ	4.0%
ガーナ	4.0%

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

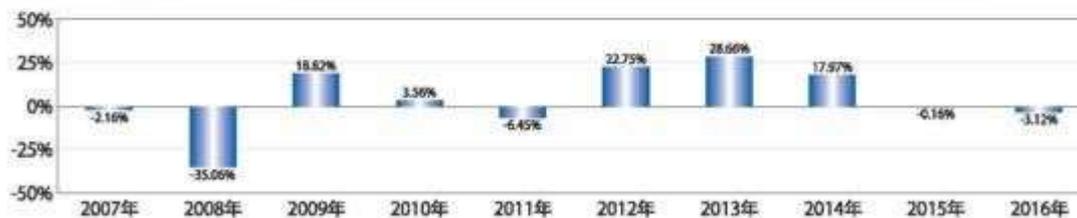
## 米国REITの組入上位5銘柄（新光米国REITマザーファンド）

銘柄名	純資産比率
SIMON PROPERTY GROUP	7.06%
AMERICAN TOWER CORPORATION	4.90%
PUBLIC STORAGE	3.88%
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3.27%
WEYERHAEUSER COMPANY	2.83%

※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



※取引前の分配金を前年に含めて計算しています。  
 ※当ファンドにはベンチマークがありません。  
 ※2016年については、年初から4月末までの収益率を記載しています。

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

## 第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19期特定期間（平成27年10月21日から平成28年4月20日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【新光7資産バランスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期特定期間末 平成27年10月20日現在	第19期特定期間末 平成28年4月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	23,357,211
コール・ローン	173,670,989	155,524,634
投資信託受益証券	930,765,000	785,235,000
親投資信託受益証券	5,862,446,488	5,391,196,574
未収利息	255	-
流動資産合計	6,966,882,732	6,355,313,419
資産合計	6,966,882,732	6,355,313,419
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	15,427,660	14,608,215
未払解約金	9,310,720	5,762,292
未払受託者報酬	421,903	435,032
未払委託者報酬	4,588,176	4,730,946
未払利息	-	340
その他未払費用	36,908	42,165
流動負債合計	29,785,367	25,578,990
負債合計	29,785,367	25,578,990
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,713,830,253	7,304,107,820
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	776,732,888	974,373,391
（分配準備積立金）	231,284,580	251,774,015
元本等合計	6,937,097,365	6,329,734,429
純資産合計	6,937,097,365	6,329,734,429
負債純資産合計	6,966,882,732	6,355,313,419

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第18期特定期間		第19期特定期間	
	自	平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自	平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
営業収益				
受取配当金		75,337,500		74,250,000
受取利息		51,373		31,148
有価証券売買等損益		170,887,694		195,779,914
その他収益		-		2,714
営業収益合計		95,498,821		121,496,052
営業費用				
支払利息		-		592
受託者報酬		3,166,569		2,842,111
委託者報酬		34,436,381		30,907,811
その他費用		277,014		269,726
営業費用合計		37,879,964		34,020,240
営業利益		133,378,785		155,516,292
経常利益		133,378,785		155,516,292
当期純利益		133,378,785		155,516,292
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		2,966,448		858,600
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		593,758,124		776,732,888
剰余金増加額又は欠損金減少額		43,294,851		48,803,407
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		43,294,851		48,803,407
剰余金減少額又は欠損金増加額		880,165		880,198
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		880,165		880,198
分配金		94,977,113		89,188,820
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		776,732,888		974,373,391

## ( 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19期特定期間	
	自	平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。	

( 貸借対照表に関する注記 )

第18期特定期間末 平成27年10月20日現在	第19期特定期間末 平成28年 4月20日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 7,713,830,253口	1. 特定期間末日における受益権の総数 7,304,107,820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 776,732,888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 974,373,391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)	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 0.8666円 (1万口当たり純資産額) (8,666円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

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	第19期特定期間 自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
分配金の計算過程	<p>第101期（自 平成27年 4月21日 至 平成27年 5月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（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102期（自 平成27年 5月21日 至 平成27年 6月22日） 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103期（自 平成27年 6月23日 至 平成27年 7月21日） 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107期（自 平成27年10月21日 至 平成27年11月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（21,708,826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（3,442,445円）及び分配準備積立金（227,941,290円）より分配対象収益は253,092,561円（1万口当たり333.21円）であり、うち15,190,690円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第108期（自 平成27年11月21日 至 平成27年12月21日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（15,650,624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（3,445,008円）及び分配準備積立金（231,470,354円）より分配対象収益は250,565,986円（1万口当たり334.45円）であり、うち14,982,769円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第109期（自 平成27年12月22日 至 平成28年 1月20日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,849,193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（3,464,778円）及び分配準備積立金（231,089,660円）より分配対象収益は253,403,631円（1万口当たり339.86円）であり、うち14,911,609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> <p>第106期（自 平成27年 9月25日 至 平成27年10月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。</p>	<p>第110期（自 平成28年 1月21日 至 平成28年 2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（15,639,552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（3,481,033円）及び分配準備積立金（233,462,452円）より分配対象収益は252,583,037円（1万口当たり341.12円）であり、うち14,808,022円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第111期（自 平成28年 2月23日 至 平成28年 3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（26,036,640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（3,489,806円）及び分配準備積立金（232,455,224円）より分配対象収益は261,981,670円（1万口当たり356.73円）であり、うち14,687,515円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第112期（自 平成28年 3月23日 至 平成28年 4月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,830,459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（3,509,215円）及び分配準備積立金（242,551,771円）より分配対象収益は269,891,445円（1万口当たり369.48円）であり、うち14,608,215円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>
--	--

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第18期特定期間 自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日	第19期特定期間 自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、投資信託受益証券、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	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

第18期特定期間末 平成27年10月20日現在	第19期特定期間末 平成28年 4月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

	第18期特定期間 自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日	第19期特定期間 自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	第18期特定期間末 平成27年10月20日現在	第19期特定期間末 平成28年 4月20日現在
期首元本額	8,286,364,635円	7,713,830,253円
期中追加設定元本額	10,689,548円	7,316,627円
期中一部解約元本額	583,223,930円	417,039,060円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第18期特定期間末 平成27年10月20日現在	第19期特定期間末 平成28年 4月20日現在
	当特定期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当特定期間の損益に含まれた評価差額 （円）
投資信託受益証券	9,075,000	14,355,000
親投資信託受益証券	209,074,419	7,216,420
合計	199,999,419	21,571,420

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	165,000	785,235,000	
投資信託受益証券 小計		165,000	785,235,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	408,157,097	900,925,160	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	491,333,859	836,545,028	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	486,152,665	866,129,587	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	714,653,519	920,759,593	
	新光J-REITマザーファンド	568,569,444	956,504,375	
	新光米国REITマザーファンド	624,156,895	910,332,831	
親投資信託受益証券 小計		3,293,023,479	5,391,196,574	
合計		3,293,188,479	6,176,431,574	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

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

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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

「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」は、ケイマン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの平成27年11月30日現在の財務書類は、国際財務報告基準に従い作成されておりますが、独立監査人の監査を受けておりません。

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

## （1）財政状態計算書（無監査）

2015年11月30日現在

	注記	2015年11月30日 現在 (日本円)	2015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)	34,384,703,988	38,340,660,126
ブローカーに対する債権		409,896,603	-
発行に係る未収入金		199,526,250	-
現金および現金同等物	5	660,115,449	4,796,975,748
その他の債権	6(d)	1,959,042	8,387,306
資産合計		35,656,201,332	43,146,023,180
<b>負債</b>			
<b>流動負債</b>			
償還に係る未払金		60,842,800	989,922,180
ブローカーに対する債務		-	54,095,601
未払費用	7	35,427,591	43,262,820
負債合計		96,270,391	1,087,280,601
受益証券保有者に帰属する純資産	8	35,559,930,941	42,058,742,579

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部です。

## （2）包括利益計算書（無監査）

2015年11月30日に終了した半年間

	注記	2015年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2014年11月30日に 終了した半年間 (日本円)
<b>収益</b>			

受取利息		48,061	121,731
その他の収益		4,618,037	-
為替差益純額		5,475,960	181,324,587
受取配当金		479,828,830	444,549,611
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)	(1,442,502,569)	4,292,043,140
純(損失)/収益合計		(952,531,681)	4,918,039,069
費用			
運用報酬	6(a)	75,041,745	82,767,198
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	6(b)	18,915,481	21,086,882
保管受託銀行報酬	6(c)	8,108,696	8,996,944
費用の払戻し	6(d)	(1,959,042)	(3,777,074)
監査報酬		3,075,518	3,745,999
当座借越利息		38,867	-
その他の営業費用		69,756	1,736,775
営業費用合計		103,291,021	114,556,724
税引前(損失)/利益		(1,055,822,702)	4,803,482,345
源泉税		(10,897,109)	(6,154,784)
営業による受益証券保有者に帰属する純資産の(減少)/増加額		(1,066,719,811)	4,797,327,561

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部です。

### (3) 受益証券保有者に帰属する純資産変動計算書(無監査)

2015年11月30日に終了した半年間

注記	2015年11月30日に 終了した半年間		2014年11月30日に 終了した半年間	
	受益証券口数	(日本円)	受益証券口数	(日本円)
受益証券保有者に帰属する純資産期首残高	6,590,677	42,058,742,579	7,021,982	44,377,557,484
営業による受益証券保有者に帰属する純資産の(減少)/増加額	-	(1,066,719,811)	-	4,797,327,561
半年間の分配金	10	(2,880,248,025)	-	(3,002,521,200)
受益証券の発行	692,567	4,116,796,889	368,600	2,362,321,125
受益証券の償還	(1,125,655)	(6,668,640,691)	(1,240,116)	(7,813,836,115)
受益証券保有者に帰属する純資産期末残高	6,157,589	35,559,930,941	6,150,466	40,720,848,855

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部です。

### (4) キャッシュ・フロー計算書(無監査)

2015年11月30日に終了した半年間

注記	2015年11月30日に 終了した半年間 (日本円)	2014年11月30日に 終了した半年間 (日本円)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
投資の購入	(8,609,250,864)	(2,291,076,968)
投資の処分	9,425,678,518	9,072,475,627
受取配当金	479,828,830	444,549,611
受取利息	48,061	121,731
その他の収益の受取	4,618,037	-
投資収益の受取	1,233,033,711	1,108,953,524
運用報酬支払	(78,607,038)	(87,043,057)
受託会社報酬および管理事務代行会社報酬支払	(19,610,007)	(21,234,605)

保管受託銀行報酬支払	(8,518,860)	(9,689,355)
監査報酬支払	(6,240,764)	(6,483,856)
その他の営業費用支払	(69,756)	(1,736,775)
払戻費用の受取	8,387,306	6,720,638
源泉税支払	(10,897,109)	(6,154,784)
営業活動による正味キャッシュ収入	2,418,400,065	8,209,401,731
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	(2,880,248,025)	(3,002,521,200)
受益証券の発行による収入	3,917,270,639	2,420,510,193
受益証券の償還による支払	(7,597,720,071)	(7,783,881,557)
当座借越利息	(38,867)	-
財務活動による正味キャッシュ支出	(6,560,736,324)	(8,365,892,564)
現金および現金同等物の純減少額	(4,142,336,259)	(156,490,833)
現金および現金同等物期首残高	4,796,975,748	1,492,885,496
外国為替レート変動の影響額	5,475,960	181,324,587
現金および現金同等物期末残高	5 660,115,449	1,517,719,250

添付の注記は、本財務書類の不可分の一部です。

#### (5) 財務書類に対する注記(無監査)

2015年11月30日に終了した半年間

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

#### 1 一般的情報

フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド(以下「当ファンド」といいます。)は、ケイマン諸島で設立され、同地に籍を置いています。当ファンドの登記上の事務所の住所は、ケイマン諸島、Camana Bay, 72 Market Street, Cassia Court, 2nd Floor Suite 2204, PO Box 31371, Grand Cayman KY1-1206です。当ファンドは、2006年3月8日に設立され、2006年4月3日に運用を開始しました。

当ファンドは、償還可能受益証券の保有者のために、新興国が発行する上場および非上場のソブリン債および準ソブリン債に投資することで、高利回りおよび長期的な資本の増価を達成することを目標としています。

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 サービス 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。

#### 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) 2015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

当ファンドの2015年11月30日に終了する報告期間に発行された新基準および修正基準はありませんでした。

##### (b) 2015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、期末現在の取引市場価格に基づいています。当ファンドが保有する金融資産に使用される市場相場価格は、経過利息を考慮した期末の仲値です。

活発な市場で取引されない金融商品の公正価値は、評価技法を使用して決定されます。当ファンドは、様々な方法を使用し、各年度末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管理会社にありますが、管理会社は、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、管理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11月30日現在		2015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				
アルバニア	280,993,481	0.79	-	-
アルゼンチン	359,116,526	1.01	-	-
アンゴラ	1,301,345,016	3.66	851,832,527	2.03
アルメニア	786,378,007	2.21	437,794,547	1.04
アゼルバイジャン	931,222,304	2.62	1,132,567,953	2.69
ボスニア・ヘルツェゴビナ	1,117,769,546	3.14	1,173,070,634	2.79
ブラジル	584,293,205	1.64	425,602,334	1.01
カメルーン	546,667,282	1.54	-	-
中国	355,776,831	1.00	746,416,859	1.77
コロンビア	1,066,347,694	3.00	1,237,365,510	2.94
コスタリカ	-	-	680,676,600	1.62
ドミニカ共和国	256,638,902	0.72	-	-
エチオピア	499,556,355	1.40	647,750,231	1.54
エルサルバドル	865,745,015	2.43	1,339,239,171	3.18
ガボン	419,503,426	1.18	-	-
ジョージア	1,061,674,024	2.99	1,407,568,331	3.35
ガーナ	1,145,599,792	3.22	980,419,191	2.33
ホンジュラス	492,972,776	1.39	510,125,771	1.21
イラク	1,078,257,563	3.03	846,996,263	2.01
ヨルダン	467,051,594	1.31	534,407,813	1.27
カザフスタン	878,255,008	2.47	927,240,746	2.20
ケニア	825,763,285	2.32	710,483,386	1.69
マケドニア	341,283,032	0.96	703,431,473	1.67
メキシコ	1,286,092,140	3.62	1,426,287,842	3.39
モンゴル	826,993,161	2.33	925,958,103	2.20
モンテネグロ	-	-	402,654,539	0.96
モザンビーク	713,438,830	2.01	881,096,011	2.09
パラグアイ	432,410,912	1.22	454,468,940	1.08
ペルー	609,545,106	1.71	-	-
ロシア	1,777,299,995	5.00	2,152,747,673	5.12
ルワンダ	120,212,557	0.34	190,927,791	0.45

投資	2015年11月30日現在		2015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 (%)
セルビア	-	-	665,593,319	1.58
南アフリカ	1,060,517,149	2.98	1,237,988,909	2.94
スリランカ	571,902,397	1.61	589,466,932	1.40
国際機関	1,242,472,215	3.49	3,382,733,857	8.04
トリニダード・トバゴ	1,073,152,080	3.02	1,351,037,918	3.21
チュニジア	481,499,768	1.35	111,427,647	0.26
トルコ	1,998,053,950	5.62	2,120,556,534	5.04
ウガンダ	596,629,246	1.68	615,702,711	1.46

ウクライナ	1,399,259,394	3.93	1,440,208,241	3.42
ウルグアイ	1,262,759,252	3.55	1,509,020,787	3.59
ザンビア	435,076,996	1.22	629,013,585	1.50
債券合計	31,549,525,812	88.71	35,379,880,679	84.07
原油ワラント				
ナイジェリア	2,004,800,591	5.64	2,154,027,554	5.12
ベネズエラ	830,377,585	2.34	806,751,893	1.92
原油ワラント合計	2,835,178,176	7.98	2,960,779,447	7.04
投資合計	34,384,703,988	96.69	38,340,660,126	91.11

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。

管理会社は、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11月30日および2015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11月30日現在	2015年5月31日現在
VaR(%)	8.180%	6.910%
VaR(金額)	2,908,802,351円	2,906,259,112円

デリバティブ金融商品は、当ファンドの為替エクスポージャーをヘッジする目的で適宜利用される場合があります。一方、クレジット・リンク債は、基礎となる商品に対するエクスポージャーを創出するために許容制限内で利用される場合があります。目論見書に規定されているとおり、管理会社はクレジット・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11月30日および2015年5月31日現在、当ファンドが保有するクレジット・リンク債はありません。

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

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

	資本金および剰余金の変動			
	2015年11月30日現在		2015年5月31日現在	
	(%)	(日本円)	(%)	(日本円)
<b>ナイジェリア原油ワラント</b>				
月次総利回り中央値	(0.18)	(3,618,774)	0.32	6,816,543
月次総利回り最小値	(2.17)	(43,504,173)	(4.55)	(97,910,343)
月次総利回り最大値	3.01	60,344,498	6.23	134,133,584
<b>ベネズエラ原油ワラント</b>				
月次総利回り中央値	(0.18)	(1,494,680)	(1.02)	(8,208,597)
月次総利回り最小値	(14.32)	(118,910,070)	(30.77)	(248,231,352)
月次総利回り最大値	11.11	92,254,950	11.11	89,639,099

## 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。管理会社は、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。管理会社は、当ファンドの平均修正デュレーションが、目論見書に規定されているとおり8年未満になるようにしています。以下の表は、金利リスクに対する当ファンドのエクスポージャーを要約したものです。表には、当ファンドの資産およびトレーディング負債が公正価値で含まれており、契約上の価格改定日または満期日のいずれか早い方により分類されています。

	1ヶ月未満 (日本円)	1ヶ月以上 1年未満 (日本円)	1年以上 5年未満 (日本円)	5年以上 (日本円)	無利息 (日本円)	合計 (日本円)
2015年11月30日現在						
資産						
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	3,817,905,772	2,438,059,779	10,987,190,925	14,306,369,336	2,835,178,176	34,384,703,988
ブローカーに対する債権	-	-	-	-	409,896,603	409,896,603
発行に係る未収入金	-	-	-	-	199,526,250	199,526,250
現金および現金同等物	660,115,449	-	-	-	-	660,115,449
その他の債権	-	-	-	-	1,959,042	1,959,042
資産合計	4,478,021,221	2,438,059,779	10,987,190,925	14,306,369,336	3,446,560,071	35,656,201,332

負債						
償還に係る未払金	-	-	-	-	60,842,800	60,842,800
ブローカーに対する債務	-	-	-	-	-	-
未払費用	-	-	-	-	35,427,591	35,427,591
負債合計	-	-	-	-	96,270,391	96,270,391

金利感応度ギャップ合計	4,478,021,221	2,438,059,779	10,987,190,925	14,306,369,336		
-------------	---------------	---------------	----------------	----------------	--	--

	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)
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

### 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11月30日および2015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11月30日現在 (日本円)	2015年5月31日現在 (日本円)
<b>資産</b>		
ブラジル・レアル	-	1,946,128,503
コロンビア・ペソ	687,065,437	812,850,919
コスタリカ・コロン	-	680,676,600
ドイツ・マルク	1,117,769,546	1,173,070,634
ユーロ	1,103,776,281	1,217,513,659
ガーナ・セディ	1,145,599,792	980,419,191
インド・ルピー	1,242,472,215	1,308,389,139
日本円	456,737,892	1,520,445,851
ケニア・シリング	651,052,679	710,483,386
メキシコ・ヌエボ・ペソ	1,286,092,140	1,427,617,477
新トルコ・リラ	1,133,190,754	842,303,565
ナイジェリア・ナイラ	-	128,216,215
セルビア・ディナール	99,201,064	665,593,319
南アフリカ・ランド	1,060,531,136	1,237,994,281
ウガンダ・シリング	596,922,703	687,792,229
ウルグアイ・ペソ	1,262,759,252	1,509,020,787
米ドル	23,376,517,560	25,666,031,524
ザンビア・クワチャ	436,512,881	631,475,901
<b>資産合計</b>	<b>35,656,201,332</b>	<b>43,146,023,180</b>
<b>負債</b>		
日本円	84,279,765	1,016,924,438
シンガポール・ドル	2,761,968	5,523,845
ウガンダ・シリング	-	54,095,601
米ドル	9,228,658	10,736,717
<b>負債合計</b>	<b>96,270,391</b>	<b>1,087,280,601</b>

### 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11月30日および2015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。

管理会社は、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。

管理会社は、各投資の信用格付を取引ベースで監視し、当ファンドが目論見書に規定されている投資方針を厳守することを確保しています。これには、当ファンドが、当ファンドの純資産の10%を超えて、無格付の発行体、またはムーディーズもしくはスタンダード・アンド・プアーズのソブリン債信用格付が、それぞれCaa1またはCCC+と同等かそれより低い発行体の有価証券には投資しないこと、および当ファンドの有価証券の平均

信用格付けが、最低でも、ムーディーズによる評価ではB1またはスタンダード・アンド・プアーズによる評価ではB+であることの確保が含まれています。2015年11月30日現在、当ファンドの有価証券の平均信用格付けは、BB- (2015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11月30日現在 純資産比率 (%)	2015年5月31日現在 純資産比率 (%)
Aaa / AAA	3.49	8.04
Baa1 / BBB+	6.60	6.33
Baa2 / BBB	6.33	1.01
Baa3 / BBB-	7.26	14.25
Ba1 / BB+	7.32	6.11
Ba2 / BB	4.24	2.70
Ba3 / BB-	9.47	7.90
B1 / B+	19.88	18.81
B2 / B	14.05	12.32
B3 / B-	10.78	8.35
Caa3 / CCC-	5.93	1.92
Ca / CC	-	3.42
D	1.35	-
その他の純資産*	3.30	8.84
	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11月30日現在 (日本円)	2015年5月31日現在 (日本円)
債券	31,549,525,812	35,379,880,679
デリバティブ資産	2,835,178,176	2,960,779,447
ブローカーに対する債権	409,896,603	-
発行に係る未収入金	199,526,250	-
現金および現金同等物	660,115,449	4,796,975,748
その他の債権	1,959,042	8,387,306
合計	35,656,201,332	43,146,023,180

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11月30日現在 (日本円)	2015年5月31日現在 (日本円)
Astana Finance JSC ADR* (ISIN: US46630H3012)	-	-
Astana Finance JSC 0.000001% due 22/12/2024 REGS*	-	-
	-	-

2015年11月30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日のエクステンジオファー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11月30日および2015年5月31日現在の公正価値の考慮に入れていません。

以下の表は、2015年11月30日および2015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11月30日現在		
銀行		
バンク オブ ニューヨーク メロン	1.86	A1

保管受託銀行		
バンク オブ ニューヨーク メロン	96.70	A1
	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

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、管理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、管理会社は、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11月30日現在			
資産			
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	34,365,228,087	19,475,901	34,384,703,988
ブローカーに対する債権	409,896,603	-	409,896,603
発行に係る未収入金	199,526,250	-	199,526,250
現金および現金同等物	660,115,449	-	660,115,449
その他の債権	-	1,959,042	1,959,042
合計	35,634,766,389	21,434,943	35,656,201,332
負債			
償還に係る未払金	60,842,800	-	60,842,800
ブローカーに対する債務	-	-	-
未払費用	-	35,427,591	35,427,591
合計	60,842,800	35,427,591	96,270,391
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	38,340,660,126	-	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
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

## 3.7 自己資本リスク管理

当ファンドの自己資本は、当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金です。当ファンドの償還可能受益証券の保有者に帰属する資本金および剰余金の金額は、当ファンドが受益証券保有者の判断による追加申込および償還請求を日々受けるため、日次ベースで著しく変動する可能性があります。当ファンドの自己資本管理の目的は、受益証券保有者にリターンを、その他のステークホルダーに便益を提供するために、継続企業として存続する当ファンドの能力を保全すること、ならびに、当ファンドの投資活動の発展を支えるために、強固な自己資本基盤を維持することです。

自己資本構成を維持または調整するために、当ファンドは以下を実施する方針です。

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

報告期間末現在、受益証券保有者は1名（2015年5月31日：1名）であり、当ファンドの69%（2015年5月31日：71%）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。当会計年度末現在、実効金利による価格付けの手法を用いて評価されたソブリン短期証券はありません。

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

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11月30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	-	31,549,525,812	-	31,549,525,812
- デリバティブ資産	-	2,835,178,176	-	2,835,178,176
資産合計	-	34,384,703,988	-	34,384,703,988

	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

2015年11月30日および2015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11月30日現在 (日本円)	2015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	31,549,525,812	35,379,880,679
原油ワラント	2,835,178,176	2,960,779,447
合計	34,384,703,988	38,340,660,126

##### (b) 投資ポートフォリオ - 半年間の損益

	2015年11月30日現在 (日本円)	2014年11月30日現在 (日本円)
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る公正価値の純変動額		
- 実現	1,712,710,884	1,581,132,503
- 未実現の変動額	(3,155,213,453)	2,710,910,637
(損失) / 利益合計	(1,442,502,569)	4,292,043,140

#### 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11月30日現在 (日本円)	2015年5月31日現在 (日本円)
現金および現金同等物	660,115,449	4,796,975,748

現金および現金同等物は、保管受託銀行に保管されている金銭です。

#### 6 関連当事者との取引

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

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

##### (a) 運用報酬

管理会社は、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

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、管理会社から払い戻される予定です。

以下の表は、報告期間における関連当事者との取引の詳細です。

	費用		債務	
	2015年11月30日 現在 (日本円)	2014年11月30日 現在 (日本円)	2015年11月30日 現在 (日本円)	2015年5月31日 現在 (日本円)
(a) 運用報酬	75,041,745	82,767,198	23,436,965	27,002,258
(b) 受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	18,915,481	21,086,882	5,968,279	6,662,805
(c) 保管受託銀行報酬	8,108,696	8,996,944	2,856,996	3,267,160
費用合計	102,065,922	112,851,024	32,262,240	36,932,223
	費用		債権	
(d) 費用の払戻し	(1,959,042)	(3,777,074)	1,959,042	8,387,306

## 7 未払費用

	2015年11月30日現在 (日本円)	2015年5月31日現在 (日本円)
未払運用報酬	23,436,965	27,002,258
未払受託会社報酬および管理事務代行会社報酬	5,968,279	6,662,805
未払保管受託銀行報酬	2,856,996	3,267,160
未払監査報酬	3,165,351	6,330,597
	35,427,591	43,262,820

未払費用の帳簿価額は、報告期間末現在の公正価値に近似していました。

## 8 受益証券

すべての受益証券は、分配金を受け取る権利があり、償還日に当ファンドの受益証券1口当たり純資産額に基づく比例持分の支払を受ける権利があります。関連する変動は、受益証券保有者に帰属する純資産変動計算書に示されています。注記1に概説された目的および注記3のリスク管理方針に従い、当ファンドは受け取った申込金額を適切な投資対象に投資するよう努める一方で、償還に見合う十分な流動性を維持します。このような流動性は、短期借入金または必要な場合には上場有価証券の処分によって高められます。

当ファンドは上場金融資産および金融負債の評価インプットとして仲値を使用しています。これは、受益証券1口当たりの取引価額の計算に関して当ファンドの募集文書に規定されているインプットと一致します。財政状態計算書日現在、当ファンドの純資産額は35,559,930,941円（2015年5月31日：42,058,742,579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、管理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、管理会社の同意を得て受託会社の裁量で行われています。

当半年間に支払われた分配金は、以下で構成されています。

	権利付最終日	分配金額 (日本円)
2015年11月30日		
受益証券1口当たり分配金75円	2015年6月3日	494,067,750
受益証券1口当たり分配金75円	2015年7月7日	479,695,650
受益証券1口当たり分配金75円	2015年8月3日	493,667,175
受益証券1口当たり分配金75円	2015年9月3日	477,850,950
受益証券1口当たり分配金75円	2015年10月5日	464,040,825
受益証券1口当たり分配金75円	2015年11月4日	470,925,675
		2,880,248,025
2014年11月30日		
受益証券1口当たり分配金75円	2014年6月3日	526,894,125
受益証券1口当たり分配金75円	2014年7月3日	517,537,125
受益証券1口当たり分配金75円	2014年8月4日	508,270,200
受益証券1口当たり分配金75円	2014年9月3日	494,506,950
受益証券1口当たり分配金75円	2014年10月3日	482,681,700
受益証券1口当たり分配金75円	2014年11月4日	472,631,100
		3,002,521,200

2015年11月30日および2015年5月31日現在の投資ポートフォリオ

以下の表は、保有する金融資産の要約です。

	公正価値 2015年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)
債券		
アルバニア		
Albania Government International Bond 5.75% due 12/11/2020 REGS	280,993,481	-
アルバニア合計	280,993,481	-
アルゼンチン		
Province Del Neuquen 7.875% due 26/04/2021 REGS	359,116,526	-
アルゼンチン合計	359,116,526	-
アンゴラ		
Republic of Angola (Northern Lights Iii Bv) 7.00% due 16/08/2019 REGS	935,041,044	851,832,527
Republic Of Angola 9.50% due 12/11/2025 REGS	366,303,972	-
アンゴラ合計	1,301,345,016	851,832,527
アルメニア		
Republic of Armenia 7.15% due 26/03/2025 REGS	786,378,007	437,794,547
アルメニア合計	786,378,007	437,794,547

アゼルバイジャン Rubrika Finance Co Ltd (International Bank Of AZ) 7.20% due 31/10/2016 REGS	931,222,304	1,132,567,953
アゼルバイジャン合計	931,222,304	1,132,567,953
ボスニア・ヘルツェゴビナ Bosnia and Herzegovina 0.8125% due 11/12/2021	1,117,769,546	1,173,070,634
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	1,117,769,546	1,173,070,634
ブラジル Caixa Economica Federal 4.25% due 13/05/2019 REGS	584,293,205	425,602,334
ブラジル合計	584,293,205	425,602,334
	公正価値 2015年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き) カメルーン Republic Of Cameroon International Bond 9.50% due 19/11/2025 REGS	546,667,282	-
カメルーン合計	546,667,282	-
中国 Franshion Development Ltd 6.75% due 15/04/2021 REGS	355,776,831	746,416,859
中国合計	355,776,831	746,416,859
コロンビア Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS	226,230,167	267,111,292
Ecopetrol SA 4.125% due 16/01/2025	379,282,257	424,514,591
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	460,835,270	545,739,627
コロンビア合計	1,066,347,694	1,237,365,510
コスタリカ Costa Rica Government International Bond 10.58% due 23/09/2015 REGS	-	680,676,600
コスタリカ合計	-	680,676,600
ドミニカ共和国 Mestenio Ltd 8.50% due 02/01/2020 REGS	256,638,902	-
ドミニカ共和国合計	256,638,902	-
エチオピア Federal Democratic Republic Of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	499,556,355	647,750,231
エチオピア合計	499,556,355	647,750,231
エルサルバドル Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	865,745,015	1,339,239,171
エルサルバドル合計	865,745,015	1,339,239,171
ガボン Republic Of Gabon 6.95% due 16/06/2025 REGS	419,503,426	-
ガボン合計	419,503,426	-

	公正価値 2015年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き)		
ジョージア		
Georgian Oil & Gas Corp 6.875% due 16/05/2017 REGS	490,849,591	471,265,213
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022	159,473,987	168,932,192
Republic of Georgia 6.875% due 12/04/2021 REGS	411,350,446	767,370,926
ジョージア合計	1,061,674,024	1,407,568,331
ガーナ		
Ghana Govt 23.00% due 21/08/2017	1,145,599,792	980,419,191
ガーナ合計	1,145,599,792	980,419,191
ホンジュラス		
Honduras Government 7.50% due 15/03/2024 REGS	492,972,776	510,125,771
ホンジュラス合計	492,972,776	510,125,771
イラク		
Republic of Iraq 5.8% due 15/01/2028 REGS	1,078,257,563	846,996,263
イラク合計	1,078,257,563	846,996,263
ヨルダン		
Dev Inv Jordan Arm Force 6.14% due 16/12/2019	467,051,594	534,407,813
ヨルダン合計	467,051,594	534,407,813
カザフスタン		
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	876,576,032	927,240,746
Kazmunaygas National Co Jsc 4.40% due 30/04/2023 REGS	1,678,976	-
カザフスタン合計	878,255,008	927,240,746

# 2015年11月30日および2015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11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き)		
ケニア		
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	651,052,679	710,483,386
Kenya Government International Bond 6.875% due 24/06/2024 REGS	174,710,606	-
ケニア合計	825,763,285	710,483,386
マケドニア		
Former Yugoslav Republic of Macedonia 4.625% due 08/12/2015	341,283,032	703,431,473
マケドニア合計	341,283,032	703,431,473
メキシコ		
Mexican Udibonos 4.00% 15/11/2040 Index Linked	1,286,092,140	1,426,287,842
メキシコ合計	1,286,092,140	1,426,287,842
モンゴル		
Mongolia Government International Bond 5.125% due 05/12/2022 REGS	826,993,161	925,958,103

モンゴル合計	826,993,161	925,958,103
モンテネグロ		
Republic of Montenegro 7.875% due 14/09/2015	-	402,654,539
モンテネグロ合計	-	402,654,539
モザンビーク		
Ematum Via Mozambique Ematum Finance 2020 BV 6.305% due 11/09/2020 REGS	713,438,830	881,096,011
モザンビーク合計	713,438,830	881,096,011
パラグアイ		
Republic of Paraguay 4.625% due 25/01/2023 REGS	432,410,912	454,468,940
パラグアイ合計	432,410,912	454,468,940
	公正価値 2015年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き)		
ペルー		
Lima Metro Line 2 Finance Ltd 5.875% due 05/07/2034 REGS	609,545,106	-
ペルー合計	609,545,106	-
ロシア		
RSHB Capital (RUSS AGRIC BK) 6.00% due 03/06/2021 REGS	1,097,095,642	1,481,113,731
RZD Capital Ltd 5.70% due 05/04/2022 REGS	680,204,353	671,633,942
ロシア合計	1,777,299,995	2,152,747,673
ルワンダ		
Republic of Rwanda 6.625% due 02/05/2023 REGS	120,212,557	190,927,791
ルワンダ合計	120,212,557	190,927,791
セルビア		
Serbia Treasury Bonds 10.00% due 27/02/2017	-	665,593,319
セルビア合計	-	665,593,319
南アフリカ		
South Africa Republic of 8.00% due 21/12/2018	1,060,517,149	1,237,988,909
南アフリカ合計	1,060,517,149	1,237,988,909
スリランカ		
National Savings Bank 8.875% due 18/09/2018 REGS	571,902,397	589,466,932
スリランカ合計	571,902,397	589,466,932
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
International Finance Corp 7.75% due 03/12/2016	1,242,472,215	1,308,389,139
国際機関合計	1,242,472,215	3,382,733,857
	公正価値 2015年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2015年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き)		
トリニダード・トバゴ		
Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 REGS	1,073,152,080	1,351,037,918
トリニダード・トバゴ合計	1,073,152,080	1,351,037,918

チュニジア		
Banque Cent de Tunisie 4.50% due 22/06/2020 REGS	481,499,768	111,427,647
チュニジア合計	481,499,768	111,427,647
トルコ		
Turkey Government Bond 8.20% due 16/11/2016	698,426,363	367,766,376
Turkey Government Bond FRN due 04/01/2017	434,764,391	474,537,189
Turkiye Halk Bankasi As 3.875% due 05/02/2020 REGS	864,863,196	1,278,252,969
トルコ合計	1,998,053,950	2,120,556,534
ウガンダ		
Republic of Uganda Government Bonds 10.25% due 21/04/2016	116,854,422	127,883,881
Republic Of Uganda Government Bonds 16.75% due 23/02/2017	121,669,380	110,595,565
Republic of Uganda Government Bonds 10.75% due 22/02/2018	95,740,233	110,534,705
Uganda Treasury Bills due 26/05/2016	256,479,694	266,688,560
Republic Of Uganda Government Bonds 14.625% due 01/11/2018	5,885,517	-
ウガンダ合計	596,629,246	615,702,711
ウクライナ		
City of KYIV (CSFB) 8.00% due 06/11/2015**デフォルト**	479,532,523	235,874,946
State Savings Bank of Ukraine 8.25% due 10/03/2016	-	746,654,586
State Savings Bank Of Ukraine 8.875% due 20/03/2018 REGS	-	457,678,709
Ssb #1 Plc (Ojsc State Savings Bank Of Ukraine) 9.625% due 20/03/2025 Step REGS	919,726,871	-
ウクライナ合計	1,399,259,394	1,440,208,241
ウルグアイ		
Uruguay Republic Of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked	1,262,759,252	1,509,020,787
ウルグアイ合計	1,262,759,252	1,509,020,787
	公正価値 2015年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2015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 11/01/2016	61,422,967	-
Zambia Treasury Bill 0% due 25/01/2016	69,803,512	-
Zambia Treasury Bill 0% due 21/03/2016	49,866,283	-
Zambia Treasury Bill 0% due 11/04/2016	44,764,374	-
Zambia Treasury Bill 0% due 18/04/2016	49,571,212	-
Zambia Treasury Bill 0% due 02/05/2016	146,408,954	186,207,090
Zambia Treasury Bill 0% due 02/05/2016	13,239,694	-
ザンビア合計	435,076,996	629,013,585
債券合計	31,549,525,812	35,379,880,679
原油ワラント		
ナイジェリア		
Nigeria Central Bank of Wrd Exp 15/11/2020	2,004,800,591	2,154,027,554
ナイジェリア合計	2,004,800,591	2,154,027,554

## ベネズエラ

Venezuela Rep Of Exp 15/04/2020 Par/Disc/Flirb Ser A&amp;B

Oil Index Wts

ベネズエラ合計

830,377,585

806,751,893

830,377,585

806,751,893

原油ワラント合計

2,835,178,176

2,960,779,447

投資ポートフォリオ

34,384,703,988

38,340,660,126

(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10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	32,307,862
コール・ローン	417,583,171	215,122,794
国債証券	40,825,610,798	33,547,658,659
未収利息	326,961,381	276,833,575
前払費用	28,497,454	18,247,325
流動資産合計	41,598,652,804	34,090,170,215
資産合計	41,598,652,804	34,090,170,215
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	60,650,000	40,000,000
未払利息	-	471
その他未払費用	-	1,123
流動負債合計	60,650,000	40,001,594
負債合計	60,650,000	40,001,594
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,681,628,940	15,426,229,045
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	23,856,373,864	18,623,939,576
元本等合計	41,538,002,804	34,050,168,621
純資産合計	41,538,002,804	34,050,168,621
負債純資産合計	41,598,652,804	34,090,170,215

## 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10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

区分	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4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10月20日現在	平成28年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数  17,681,628,940口	1. 計算日における受益権の総数  15,426,229,045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 2.3492円 (1万口当たり純資産額) (23,492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 2.2073円 (1万口当たり純資産額) (22,073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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4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10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</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10月20日現在	平成28年 4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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

### 1 元本の移動

区分	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	20,725,705,706円	17,681,628,940円
期中追加設定元本額	14,688,809円	59,731,675円
期中一部解約元本額	3,058,765,575円	2,315,131,570円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	11,816,367,337円	10,531,304,957円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	1,562,725,993円	1,443,023,007円
新光7資産バランスファンド	439,647,799円	408,157,097円
海外国債ファンド（1年決算型）	39,221,620円	41,390,859円
海外国債ファンド（変額年金）	3,804,619,847円	2,979,547,249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）	2,749,327円	6,041,115円
グローバル・ナビ	16,297,017円	16,764,761円
合計	17,681,628,940円	15,426,229,045円

### 2 有価証券関係

#### 売買目的有価証券

種類	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	533,673,602	843,379,827
合計	533,673,602	843,379,827

（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-2.75%-23/11/15	11,100,000.00	12,013,148.49	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	9,600,000.00	10,391,250.04	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	12,400,000.00	13,186,625.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	12,800,000.00	13,477,999.99	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	12,800,000.00	13,345,000.05	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	12,800,000.00	13,076,000.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	12,800,000.00	13,205,000.05	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	12,800,000.00	13,053,999.99	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	12,800,000.00	13,329,000.06	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	8,300,000.00	8,180,039.10	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,500,000.00	2,075,859.37	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	4,000,000.00	4,340,000.00	
米ドル建小計			123,700,000.00	129,673,922.14 (14,160,392,297)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,300,000.00	1,334,489.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,300,000.00	1,426,438.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,200,000.00	1,295,400.00	
カナダドル建小計			3,800,000.00	4,056,327.00 (348,844,122)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	2,400,000.00	2,687,880.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	2,400,000.00	2,781,000.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	1,300,000.00	1,942,460.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	2,400,000.00	2,746,920.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	2,400,000.00	2,703,480.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	2,400,000.00	2,604,840.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	3,100,000.00	3,222,605.00	

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	3,000,000.00	3,245,550.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,900,000.00	1,958,520.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,900,000.00	3,249,722.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	3,600,000.00	4,481,640.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	4,900,000.00	6,207,320.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	2,400,000.00	3,777,360.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01	4,600,000.00	5,761,500.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01	3,900,000.00	4,678,050.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01	4,000,000.00	4,401,200.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	4,700,000.00	6,151,360.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	3,900,000.00	3,959,670.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	3,500,000.00	3,688,300.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	4,100,000.00	5,254,970.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	4,500,000.00	6,354,000.00	
	FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	2,000,000.00	3,188,800.00	
	FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	6,000,000.00	6,718,800.00	
	FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	7,500,000.00	9,840,750.00	
	FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	5,600,000.00	6,527,360.00	
	FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	5,600,000.00	6,298,320.00	
	FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	5,800,000.00	5,869,600.00	
	FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	4,500,000.00	6,884,100.00	
	FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	4,700,000.00	4,946,280.00	
ユーロ建小計		109,000,000.00	132,132,357.00 (16,392,340,209)	
英ポンド	国債証券	TSY-2.25%-23/09/07	4,100,000.00	4,380,112.00
		TSY-2.75%-24/09/07	3,900,000.00	4,311,099.00
		TSY-5.0%-25/03/07	2,900,000.00	3,769,362.00
		TSY-2.0%-25/09/07	4,200,000.00	4,378,437.00
英ポンド建小計		15,100,000.00	16,839,010.00 (2,646,082,031)	
合計			33,547,658,659 (33,547,658,659)	

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 12銘柄	41.6%	42.2%
カナダドル	債券 3銘柄	1.0%	1.0%
ユーロ	債券 29銘柄	48.1%	48.9%
英ポンド	債券 4銘柄	7.8%	7.9%

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## ニュー トピックス インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	40,439,700
コール・ローン	659,795,751	269,268,861
株式	12,387,766,180	11,587,959,540
派生商品評価勘定	25,755,080	8,385,160
未収入金	-	102,152,708
未収配当金	93,655,756	115,116,508
未収利息	970	-
流動資産合計	13,166,973,737	12,123,322,477
資産合計	13,166,973,737	12,123,322,477
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,080	-
前受金	23,603,000	8,295,000
未払解約金	350,000	200,000,000
未払利息	-	590
その他未払費用	-	1,209
流動負債合計	23,994,080	208,296,799
負債合計	23,994,080	208,296,799
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,107,026,833	6,998,098,410

平成27年10月20日現在

平成28年 4月20日現在

剰余金		
剰余金又は欠損金( )	6,035,952,824	4,916,927,268
元本等合計	13,142,979,657	11,915,025,678
純資産合計	13,142,979,657	11,915,025,678
負債純資産合計	13,166,973,737	12,123,322,477

## 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10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
1. 担保資産 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 株式 151,908,900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 125,509,950円
2. 計算日における受益権の総数 7,107,026,833口	2. 計算日における受益権の総数 6,998,098,410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 1.8493円 (1万口当たり純資産額) (18,493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 1.7026円 (1万口当たり純資産額) (17,026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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左

区分	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。  また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 2.時価の算定方法 株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して おります。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法 同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	7,378,969,384円	7,107,026,833円
期中追加設定元本額	598,638,681円	767,077,526円
期中一部解約元本額	870,581,232円	876,005,949円

区分	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
同期末における元本の内訳		
ニュー トピックス インデックス	384,993,689円	355,477,325円
新光7資産バランスファンド	510,414,876円	491,333,859円
ニュー トピックス インデックス（変額年金）	334,449,197円	247,916,349円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	1,924,591,535円	1,887,454,417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）	1,652,193,247円	1,654,954,896円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	50,797,273円	52,280,515円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,604,036,323円	1,651,797,360円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	586,762,298円	598,542,820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）	2,088,264円	2,329,214円
グローバル・ナビ	26,476,445円	23,351,058円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,924,337円	6,511,372円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	19,734,333円	21,172,983円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	4,565,016円	4,976,242円
合計	7,107,026,833円	6,998,098,410円

## 2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,070,836,454	303,139,894
合計	1,070,836,454	303,139,894

(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10月20日現在				平成28年 4月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	723,286,000	-	749,000,000	25,714,000	304,874,840	-	313,260,000	8,385,160
東証株価指数先物	723,286,000	-	749,000,000	25,714,000	304,874,840	-	313,260,000	8,385,160
合計	723,286,000	-	749,000,000	25,714,000	304,874,840	-	313,260,000	8,385,160

## 時価の算定方法

## 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,000	264.00	792,000	
日本水産	7,400	593.00	4,388,200	
マルハニチロ	1,300	2,448.00	3,182,400	
サカタのタネ	1,000	2,673.00	2,673,000	
ホクト	700	2,073.00	1,451,100	
日鉄鉱業	2,000	414.00	828,000	
三井松島産業	4,000	114.00	456,000	
国際石油開発帝石	34,000	869.00	29,546,000	
日本海洋掘削	200	2,438.00	487,600	
石油資源開発	1,000	2,517.00	2,517,000	
K&Oエナジーグループ	400	1,311.00	524,400	
ショーボンドホールディングス	700	4,945.00	3,461,500	
ミライト・ホールディングス	2,000	980.00	1,960,000	
タマホーム	500	432.00	216,000	
ダイセキ環境ソリューション	200	1,199.00	239,800	
安藤・間	4,300	572.00	2,459,600	
東急建設	2,100	917.00	1,925,700	
コムシスホールディングス	2,800	1,707.00	4,779,600	
ミサワホーム	800	745.00	596,000	
高松コンストラクショングループ	500	2,436.00	1,218,000	
東建コーポレーション	300	8,770.00	2,631,000	
大成建設	34,000	765.00	26,010,000	
大林組	19,400	1,114.00	21,611,600	
清水建設	20,000	1,006.00	20,120,000	
飛島建設	5,200	187.00	972,400	
長谷工コーポレーション	7,500	1,040.00	7,800,000	
松井建設	700	828.00	579,600	
銭高組	1,000	468.00	468,000	
鹿島建設	30,000	714.00	21,420,000	
不動テトラ	4,600	146.00	671,600	

大末建設	200	741.00	148,200
鉄建建設	4,000	286.00	1,144,000
西松建設	7,000	497.00	3,479,000
三井住友建設	24,800	100.00	2,480,000
大豊建設	2,000	492.00	984,000
前田建設工業	4,000	879.00	3,516,000
佐田建設	400	418.00	167,200
ナカノフドー建設	500	530.00	265,000
奥村組	6,000	588.00	3,528,000
東鉄工業	800	3,290.00	2,632,000
イチケン	1,000	296.00	296,000
戸田建設	8,000	546.00	4,368,000
熊谷組	9,000	308.00	2,772,000
青木あすなろ建設	400	703.00	281,200
北野建設	1,000	269.00	269,000
植木組	1,000	223.00	223,000
三井ホーム	1,000	524.00	524,000
矢作建設工業	900	813.00	731,700
ピーエス三菱	800	422.00	337,600
日本ハウスホールディングス	1,300	385.00	500,500
大東建託	2,400	15,875.00	38,100,000
新日本建設	800	522.00	417,600
N I P P O	1,000	1,903.00	1,903,000
東亜道路工業	1,000	375.00	375,000
前田道路	2,000	2,017.00	4,034,000
日本道路	2,000	553.00	1,106,000
東亜建設工業	6,000	264.00	1,584,000
若築建設	4,000	159.00	636,000
東洋建設	2,000	502.00	1,004,000
五洋建設	7,200	521.00	3,751,200
大林道路	800	792.00	633,600
世紀東急工業	1,000	492.00	492,000
福田組	1,000	1,201.00	1,201,000
住友林業	4,400	1,311.00	5,768,400
日本基礎技術	700	446.00	312,200
日成ビルド工業	2,000	408.00	816,000
巴コーポレーション	800	355.00	284,000
パナホーム	2,000	817.00	1,634,000
大和ハウス工業	19,100	3,026.00	57,796,600
ライト工業	1,200	1,256.00	1,507,200
積水ハウス	21,600	1,972.50	42,606,000
日特建設	700	477.00	333,900
北陸電気工事	200	808.00	161,600

ユアテック	1,000	894.00	894,000
西部電気工業	1,000	456.00	456,000
中電工	900	2,203.00	1,982,700
関電工	3,000	804.00	2,412,000
きんでん	3,900	1,356.00	5,288,400
東京エネシス	1,000	839.00	839,000
トーエネック	1,000	702.00	702,000
住友電設	500	1,423.00	711,500
日本電設工業	1,100	2,239.00	2,462,900
協和エクシオ	2,500	1,268.00	3,170,000
新日本空調	500	1,009.00	504,500
N D S	1,000	293.00	293,000
九電工	1,200	2,830.00	3,396,000
三機工業	1,400	887.00	1,241,800
日揮	6,000	1,869.00	11,214,000
中外炉工業	2,000	188.00	376,000
ヤマト	600	483.00	289,800
太平電業	1,000	879.00	879,000
高砂熱学工業	1,900	1,420.00	2,698,000
朝日工業社	1,000	447.00	447,000
明星工業	1,200	460.00	552,000
大気社	800	2,669.00	2,135,200
ダイダン	1,000	732.00	732,000
日比谷総合設備	800	1,520.00	1,216,000
東芝プラントシステム	1,000	1,408.00	1,408,000
O S J Bホールディングス	1,300	268.00	348,400
東洋エンジニアリング	3,000	307.00	921,000
千代田化工建設	5,000	860.00	4,300,000
新興プランテック	1,300	834.00	1,084,200
日本製粉	4,000	851.00	3,404,000
日清製粉グループ本社	7,100	1,811.00	12,858,100
昭和産業	3,000	491.00	1,473,000
鳥越製粉	500	637.00	318,500
中部飼料	600	860.00	516,000
日本甜菜製糖	3,000	188.00	564,000
三井製糖	3,000	503.00	1,509,000
森永製菓	6,000	528.00	3,168,000
中村屋	1,000	452.00	452,000
江崎グリコ	1,500	5,220.00	7,830,000
名糖産業	300	1,305.00	391,500
不二家	4,000	191.00	764,000
山崎製パン	5,000	2,515.00	12,575,000
モロゾフ	1,000	431.00	431,000

亀田製菓	400	4,380.00	1,752,000
寿スピリッツ	500	2,208.00	1,104,000
カルビー	2,400	4,240.00	10,176,000
森永乳業	6,000	568.00	3,408,000
六甲バター	300	1,823.00	546,900
ヤクルト本社	3,500	5,420.00	18,970,000
明治ホールディングス	3,800	8,680.00	32,984,000
雪印メグミルク	1,500	2,560.00	3,840,000
プリマハム	4,000	288.00	1,152,000
日本ハム	5,000	2,445.00	12,225,000
丸大食品	3,000	451.00	1,353,000
S Foods	400	2,718.00	1,087,200
伊藤ハム米久ホールディングス	3,900	816.00	3,182,400
サッポロホールディングス	10,000	593.00	5,930,000
アサヒグループホールディングス	12,100	3,573.00	43,233,300
キリンホールディングス	26,200	1,635.00	42,837,000
宝ホールディングス	4,700	926.00	4,352,200
オエノンホールディングス	2,000	215.00	430,000
養命酒製造	200	1,929.00	385,800
コカ・コーラウエスト	2,200	2,784.00	6,124,800
コカ・コーライーストジャパン	2,300	1,820.00	4,186,000
サントリー食品インターナショナル	4,400	4,935.00	21,714,000
ダйдードリンク	300	5,370.00	1,611,000
伊藤園	1,900	3,515.00	6,678,500
キーコーヒー	600	1,822.00	1,093,200
日清オイリオグループ	3,000	453.00	1,359,000
不二製油グループ本社	1,700	2,029.00	3,449,300
J-オイルミルズ	3,000	341.00	1,023,000
キッコーマン	5,000	3,695.00	18,475,000
味の素	13,600	2,571.00	34,965,600
キュービー	3,300	2,848.00	9,398,400
ハウス食品グループ本社	2,200	2,097.00	4,613,400
カゴメ	2,300	2,319.00	5,333,700
焼津水産化学工業	300	992.00	297,600
アリアケジャパン	500	6,350.00	3,175,000
エバラ食品工業	200	1,949.00	389,800
ニチレイ	7,000	968.00	6,776,000
東洋水産	3,200	3,915.00	12,528,000
日清食品ホールディングス	2,700	5,290.00	14,283,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,121.00	1,121,000
一正蒲鉾	200	1,005.00	201,000
フジッコ	600	2,352.00	1,411,200
ロック・フィールド	300	3,490.00	1,047,000

日本たばこ産業	38,200	4,709.00	179,883,800
ケンコーマヨネーズ	200	2,434.00	486,800
わらべや日洋	300	2,093.00	627,900
なとり	300	1,679.00	503,700
ユーグレナ	2,200	1,587.00	3,491,400
理研ビタミン	200	4,095.00	819,000
片倉工業	800	1,201.00	960,800
ゲンゼ	5,000	321.00	1,605,000
東洋紡	24,000	195.00	4,680,000
ユニチカ	18,000	57.00	1,026,000
富士紡ホールディングス	3,000	211.00	633,000
倉敷紡績	6,000	205.00	1,230,000
日本毛織	1,900	780.00	1,482,000
ダイドーリミテッド	700	482.00	337,400
帝国繊維	600	1,531.00	918,600
帝人	25,000	407.00	10,175,000
東レ	44,000	954.30	41,989,200
サカイオーベックス	2,000	170.00	340,000
住江織物	2,000	278.00	556,000
芦森工業	1,000	157.00	157,000
アツギ	5,000	111.00	555,000
ダイニック	1,000	148.00	148,000
セーレン	1,500	1,168.00	1,752,000
小松精練	900	625.00	562,500
ワコールホールディングス	4,000	1,336.00	5,344,000
ホギメディカル	400	5,800.00	2,320,000
T S Iホールディングス	2,700	721.00	1,946,700
三陽商会	3,000	265.00	795,000
オンワードホールディングス	4,000	761.00	3,044,000
ルック	1,000	153.00	153,000
ゴールドウイン	300	4,325.00	1,297,500
デサント	1,400	1,584.00	2,217,600
特種東海製紙	4,000	361.00	1,444,000
王子ホールディングス	25,000	472.00	11,800,000
日本製紙	3,100	2,133.00	6,612,300
三菱製紙	9,000	81.00	729,000
北越紀州製紙	3,700	695.00	2,571,500
中越パルプ工業	2,000	210.00	420,000
巴川製紙所	1,000	184.00	184,000
大王製紙	2,700	1,007.00	2,718,900
レンゴー	5,000	596.00	2,980,000
トーモク	2,000	279.00	558,000
ザ・パック	400	2,648.00	1,059,200

クラレ	9,500	1,427.00	13,556,500
旭化成	38,000	777.50	29,545,000
共和レザー	400	855.00	342,000
昭和電工	40,000	115.00	4,600,000
住友化学	44,000	504.00	22,176,000
住友精化	1,000	557.00	557,000
日産化学工業	3,600	3,020.00	10,872,000
クレハ	5,000	371.00	1,855,000
テイカ	1,000	501.00	501,000
石原産業	11,000	77.00	847,000
片倉コープアグリ	1,000	220.00	220,000
日東エフシー	400	914.00	365,600
日本曹達	4,000	574.00	2,296,000
東ソー	16,000	502.00	8,032,000
トクヤマ	10,000	176.00	1,760,000
セントラル硝子	7,000	614.00	4,298,000
東亜合成	3,800	971.00	3,689,800
大阪ソーダ	3,000	420.00	1,260,000
関東電化工業	1,000	819.00	819,000
デンカ	13,000	485.00	6,305,000
信越化学工業	10,800	6,158.00	66,506,400
日本カーバイド工業	2,000	160.00	320,000
堺化学工業	2,000	316.00	632,000
エア・ウォーター	5,000	1,713.00	8,565,000
大陽日酸	4,700	1,073.00	5,043,100
日本化学工業	2,000	212.00	424,000
日本パーカライズン	3,100	1,001.00	3,103,100
高压ガス工業	1,000	634.00	634,000
四国化成工業	1,000	937.00	937,000
戸田工業	1,000	316.00	316,000
ステラ ケミファ	300	2,330.00	699,000
保土谷化学工業	2,000	217.00	434,000
日本触媒	900	5,920.00	5,328,000
大日精化工業	2,000	452.00	904,000
カネカ	8,000	966.00	7,728,000
三菱瓦斯化学	10,000	611.00	6,110,000
三井化学	26,000	373.00	9,698,000
J S R	5,700	1,612.00	9,188,400
東京応化工業	1,200	3,110.00	3,732,000
大阪有機化学工業	400	655.00	262,000
三菱ケミカルホールディングス	40,500	571.10	23,129,550
日本合成化学工業	1,000	650.00	650,000
ダイセル	8,500	1,422.00	12,087,000

住友ベークライト	6,000	458.00	2,748,000
積水化学工業	13,700	1,411.00	19,330,700
日本ゼオン	5,000	751.00	3,755,000
アイカ工業	1,800	2,407.00	4,332,600
宇部興産	32,000	213.00	6,816,000
積水樹脂	900	1,506.00	1,355,400
タキロン	1,000	535.00	535,000
旭有機材	2,000	206.00	412,000
日立化成	3,000	1,936.00	5,808,000
ニチバン	1,000	630.00	630,000
リケンテクノス	1,000	399.00	399,000
大倉工業	1,000	286.00	286,000
積水化成成品工業	2,000	316.00	632,000
群栄化学工業	2,000	302.00	604,000
タイガースポリマー	300	603.00	180,900
ミライアル	200	766.00	153,200
ダイキョーニシカワ	800	1,610.00	1,288,000
日本化薬	4,000	1,208.00	4,832,000
カーリットホールディングス	600	490.00	294,000
日本精化	500	769.00	384,500
A D E K A	3,000	1,614.00	4,842,000
日油	5,000	839.00	4,195,000
新日本理化	1,000	178.00	178,000
ハリマ化成グループ	500	516.00	258,000
花王	16,200	5,884.00	95,320,800
第一工業製薬	1,000	343.00	343,000
三洋化成工業	2,000	832.00	1,664,000
大日本塗料	3,000	196.00	588,000
日本ペイントホールディングス	4,700	2,864.00	13,460,800
関西ペイント	6,800	1,980.00	13,464,000
中国塗料	2,000	776.00	1,552,000
日本特殊塗料	400	869.00	347,600
藤倉化成	800	506.00	404,800
太陽ホールディングス	400	3,670.00	1,468,000
D I C	24,000	268.00	6,432,000
サカタインクス	1,200	1,293.00	1,551,600
東洋インキ S C ホールディングス	6,000	444.00	2,664,000
T & K T O K A	400	919.00	367,600
富士フイルムホールディングス	13,800	4,289.00	59,188,200
資生堂	11,500	2,546.50	29,284,750
ライオン	7,000	1,392.00	9,744,000
高砂香料工業	400	2,533.00	1,013,200
マンダム	600	5,030.00	3,018,000

ミルボン	400	4,770.00	1,908,000	
ファンケル	1,400	1,544.00	2,161,600	
コーセー	1,000	10,760.00	10,760,000	
コタ	200	1,125.00	225,000	
シーズ・ホールディングス	800	2,259.00	1,807,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	600	9,320.00	5,592,000	
ノエビアホールディングス	400	3,110.00	1,244,000	
エステー	400	1,086.00	434,400	
アグロ カネショウ	200	1,044.00	208,800	
コニシ	900	1,397.00	1,257,300	
長谷川香料	800	1,789.00	1,431,200	
星光PMC	300	1,261.00	378,300	
小林製薬	900	9,290.00	8,361,000	
荒川化学工業	500	957.00	478,500	
メック	500	818.00	409,000	
日本高純度化学	200	2,053.00	410,600	
JCU	200	3,595.00	719,000	
新田ゼラチン	400	753.00	301,200	
デクセリアルズ	1,400	1,067.00	1,493,800	
アース製薬	400	4,610.00	1,844,000	
イハラケミカル工業	900	1,398.00	1,258,200	
北興化学工業	1,000	323.00	323,000	
大成ラミック	200	2,846.00	569,200	
クミアイ化学工業	1,200	954.00	1,144,800	
日本農薬	1,400	586.00	820,400	
アキレス	5,000	142.00	710,000	
有沢製作所	900	576.00	518,400	
日東電工	4,700	6,225.00	29,257,500	
レック	200	1,339.00	267,800	
きもと	1,000	161.00	161,000	
藤森工業	500	2,620.00	1,310,000	
前澤化成工業	400	1,007.00	402,800	
JSP	400	1,925.00	770,000	
エフピコ	500	4,850.00	2,425,000	
天馬	500	1,775.00	887,500	
信越ポリマー	1,200	606.00	727,200	
東リ	2,000	297.00	594,000	
ニフコ	1,200	5,120.00	6,144,000	
日本バルカー工業	2,000	287.00	574,000	
ユニ・チャーム	12,200	2,507.00	30,585,400	
協和発酵キリン	7,200	1,930.00	13,896,000	
武田薬品工業	24,100	5,369.00	129,392,900	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	67,600	1,518.00	102,616,800	

大日本住友製薬	4,300	1,454.00	6,252,200
塩野義製薬	8,800	5,645.00	49,676,000
田辺三菱製薬	7,000	1,927.00	13,489,000
わかもと製薬	1,000	266.00	266,000
あすか製薬	800	1,446.00	1,156,800
日本新薬	1,400	4,860.00	6,804,000
ピオフェルミン製薬	100	3,650.00	365,000
中外製薬	6,000	3,735.00	22,410,000
科研製薬	1,000	6,820.00	6,820,000
エーザイ	7,400	7,057.00	52,221,800
ロート製薬	3,000	1,967.00	5,901,000
小野薬品工業	13,700	5,200.00	71,240,000
久光製薬	1,900	5,490.00	10,431,000
持田製薬	400	8,390.00	3,356,000
参天製薬	11,100	1,696.00	18,825,600
扶桑薬品工業	2,000	258.00	516,000
日本ケミファ	1,000	478.00	478,000
ツムラ	1,900	2,916.00	5,540,400
日医工	1,400	2,712.00	3,796,800
キッセイ薬品工業	1,100	2,672.00	2,939,200
生化学工業	1,200	1,752.00	2,102,400
栄研化学	500	2,239.00	1,119,500
日水製薬	200	1,284.00	256,800
鳥居薬品	400	2,637.00	1,054,800
JCRファーマ	500	2,826.00	1,413,000
東和薬品	300	5,100.00	1,530,000
富士製薬工業	200	1,959.00	391,800
沢井製薬	1,000	7,170.00	7,170,000
ゼリア新薬工業	1,200	1,408.00	1,689,600
第一三共	20,300	2,634.50	53,480,350
キョーリン製薬ホールディングス	1,600	2,297.00	3,675,200
大幸薬品	300	1,470.00	441,000
ダイト	300	3,150.00	945,000
大塚ホールディングス	13,000	4,343.00	56,459,000
大正製薬ホールディングス	1,500	9,160.00	13,740,000
日本コークス工業	4,900	77.00	377,300
昭和シェル石油	6,100	1,124.00	6,856,400
ニチレキ	700	827.00	578,900
東燃ゼネラル石油	9,000	1,032.00	9,288,000
ユシロ化学工業	300	1,230.00	369,000
ビーピー・カストロール	200	1,265.00	253,000
富士石油	1,400	339.00	474,600
MORESCO	200	1,151.00	230,200

出光興産	3,200	2,241.00	7,171,200
JXホールディングス	71,500	472.10	33,755,150
コスモエネルギーホールディングス	1,800	1,369.00	2,464,200
横浜ゴム	3,600	1,808.00	6,508,800
東洋ゴム工業	2,700	1,571.00	4,241,700
ブリヂストン	20,400	4,080.00	83,232,000
住友ゴム工業	5,700	1,694.00	9,655,800
藤倉ゴム工業	500	440.00	220,000
オカモト	2,000	885.00	1,770,000
フコク	200	876.00	175,200
ニッタ	700	2,737.00	1,915,900
住友理工	1,300	968.00	1,258,400
三ツ星ベルト	1,000	885.00	885,000
バンドー化学	2,000	539.00	1,078,000
日東紡績	4,000	358.00	1,432,000
旭硝子	32,000	654.00	20,928,000
日本板硝子	29,000	89.00	2,581,000
石塚硝子	1,000	197.00	197,000
日本山村硝子	2,000	165.00	330,000
日本電気硝子	12,000	602.00	7,224,000
住友大阪セメント	12,000	491.00	5,892,000
太平洋セメント	38,000	300.00	11,400,000
デイ・シイ	600	329.00	197,400
日本ヒューム	600	586.00	351,600
日本コンクリート工業	1,200	288.00	345,600
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	700	431.00	301,700
東海カーボン	5,000	290.00	1,450,000
日本カーボン	3,000	232.00	696,000
東洋炭素	300	1,433.00	429,900
ノリタケカンパニーリミテド	3,000	245.00	735,000
TOTO	4,400	3,805.00	16,742,000
日本碍子	8,000	2,143.00	17,144,000
日本特殊陶業	5,200	2,240.00	11,648,000
MARUWA	200	2,940.00	588,000
品川リフラクトリーズ	2,000	202.00	404,000
黒崎播磨	1,000	256.00	256,000
フジインコーポレーテッド	500	1,496.00	748,000
ニチアス	3,000	721.00	2,163,000
ニチハ	800	1,705.00	1,364,000
新日鐵住金	27,200	2,426.50	66,000,800
神戸製鋼所	111,000	116.00	12,876,000
合同製鐵	3,000	208.00	624,000

ジェイ エフ イー ホールディングス	16,500	1,742.00	28,743,000
日新製鋼	2,800	1,405.00	3,934,000
東京製鐵	3,300	689.00	2,273,700
共英製鋼	600	1,700.00	1,020,000
大和工業	1,300	2,567.00	3,337,100
東京鐵鋼	1,000	363.00	363,000
大阪製鐵	400	1,744.00	697,600
淀川製鋼所	900	2,508.00	2,257,200
東洋鋼鈹	1,400	357.00	499,800
丸一鋼管	2,000	3,290.00	6,580,000
モリ工業	1,000	294.00	294,000
大同特殊鋼	10,000	402.00	4,020,000
日本冶金工業	4,400	140.00	616,000
山陽特殊製鋼	4,000	499.00	1,996,000
愛知製鋼	4,000	435.00	1,740,000
日立金属	6,900	1,245.00	8,590,500
大太平洋金属	4,000	337.00	1,348,000
新日本電工	3,400	172.00	584,800
栗本鐵工所	3,000	168.00	504,000
三菱製鋼	4,000	188.00	752,000
日亜鋼業	800	236.00	188,800
シンニッタン	500	630.00	315,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	273.00	273,000
日本軽金属ホールディングス	13,700	193.00	2,644,100
三井金属鉱業	15,000	197.00	2,955,000
東邦亜鉛	3,000	299.00	897,000
三菱マテリアル	38,000	353.00	13,414,000
住友金属鉱山	17,000	1,240.00	21,080,000
DOWAホールディングス	8,000	718.00	5,744,000
古河機械金属	9,000	160.00	1,440,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	1,530.00	918,000
東邦チタニウム	1,000	833.00	833,000
UACJ	8,000	224.00	1,792,000
古河電気工業	19,000	263.00	4,997,000
住友電気工業	24,200	1,321.50	31,980,300
フジクラ	8,000	561.00	4,488,000
昭和電線ホールディングス	7,000	67.00	469,000
タツタ電線	1,300	355.00	461,500
カナレ電気	100	1,911.00	191,100
リョービ	4,000	435.00	1,740,000
アーレスティ	700	674.00	471,800
アサヒホールディングス	900	1,494.00	1,344,600
稲葉製作所	300	1,338.00	401,400

宮地エンジニアリンググループ	2,000	156.00	312,000	
トーカロ	400	2,039.00	815,600	
アルファC o	200	1,023.00	204,600	
SUMCO	4,700	684.00	3,214,800	
川田テクノロジーズ	100	3,515.00	351,500	
東洋製罐グループホールディングス	4,300	2,179.00	9,369,700	
ホッカンホールディングス	2,000	323.00	646,000	
コロナ	300	1,070.00	321,000	
横河ブリッジホールディングス	1,100	1,288.00	1,416,800	
駒井ハルテック	1,000	241.00	241,000	
三和ホールディングス	6,000	866.00	5,196,000	
文化シャッター	1,700	939.00	1,596,300	
三協立山	800	1,549.00	1,239,200	
アルインコ	300	1,059.00	317,700	
LIXILグループ	8,400	2,349.00	19,731,600	
日本フィルコン	400	424.00	169,600	
ノーリツ	1,200	1,852.00	2,222,400	
長府製作所	600	2,540.00	1,524,000	
リンナイ	1,100	9,950.00	10,945,000	
ダイニチ工業	300	603.00	180,900	
日東精工	1,000	288.00	288,000	
岡部	1,300	827.00	1,075,100	
ジーテクト	600	1,178.00	706,800	
東プレ	1,200	2,262.00	2,714,400	
高周波熱錬	1,100	761.00	837,100	
東京製網	4,000	156.00	624,000	
サンコール	300	468.00	140,400	
パイオラックス	300	5,730.00	1,719,000	
日本発條	5,700	988.00	5,631,600	
中央発條	1,000	270.00	270,000	
アドバネクス	100	1,249.00	124,900	
立川ブラインド工業	300	709.00	212,700	
三益半導体工業	400	1,035.00	414,000	
日本製鋼所	10,000	378.00	3,780,000	
三浦工業	2,700	2,151.00	5,807,700	
タクマ	2,000	994.00	1,988,000	
ツガミ	2,000	460.00	920,000	
オークマ	4,000	886.00	3,544,000	
東芝機械	3,000	352.00	1,056,000	
アマダホールディングス	8,800	1,134.00	9,979,200	
アイダエンジニアリング	1,600	1,030.00	1,648,000	
滝澤鉄工所	2,000	123.00	246,000	
富士機械製造	2,000	1,176.00	2,352,000	

牧野フライス製作所	3,000	708.00	2,124,000
オーエスジー	2,700	2,045.00	5,521,500
旭ダイヤモンド工業	1,600	1,102.00	1,763,200
D M G 森精機	3,300	1,297.00	4,280,100
ソディック	1,100	873.00	960,300
ディスコ	800	9,850.00	7,880,000
日東工器	400	2,167.00	866,800
パンチ工業	200	747.00	149,400
豊和工業	300	555.00	166,500
東洋機械金属	400	328.00	131,200
島精機製作所	900	1,874.00	1,686,600
N C ホールディングス	200	1,351.00	270,200
日阪製作所	800	832.00	665,600
やまびこ	1,100	808.00	888,800
ペガサスミシン製造	600	500.00	300,000
ナブテスコ	3,100	2,570.00	7,967,000
三井海洋開発	700	1,647.00	1,152,900
レオン自動機	500	648.00	324,000
S M C	1,800	27,760.00	49,968,000
新川	500	432.00	216,000
ホソカワミクロン	1,000	570.00	570,000
ユニオンツール	300	3,035.00	910,500
オイレス工業	800	1,780.00	1,424,000
日精エー・エス・ピー機械	200	2,183.00	436,600
サトーホールディングス	800	2,293.00	1,834,400
日精樹脂工業	400	671.00	268,400
ワイエイシイ	200	1,000.00	200,000
小松製作所	29,600	1,945.00	57,572,000
住友重機械工業	18,000	471.00	8,478,000
日立建機	2,700	1,879.00	5,073,300
日工	1,000	331.00	331,000
巴工業	200	1,514.00	302,800
井関農機	6,000	236.00	1,416,000
T O W A	600	720.00	432,000
丸山製作所	1,000	176.00	176,000
北川鉄工所	3,000	208.00	624,000
クボタ	29,000	1,671.50	48,473,500
荏原実業	200	1,241.00	248,200
三菱化工機	2,000	218.00	436,000
月島機械	1,100	933.00	1,026,300
帝国電機製作所	400	830.00	332,000
新東工業	1,400	964.00	1,349,600
澁谷工業	500	1,349.00	674,500

アイチ コーポレーション	900	868.00	781,200
小森コーポレーション	1,500	1,293.00	1,939,500
鶴見製作所	400	1,515.00	606,000
住友精密工業	1,000	333.00	333,000
酒井重工業	1,000	189.00	189,000
荏原製作所	13,000	523.00	6,799,000
西島製作所	600	1,045.00	627,000
北越工業	600	668.00	400,800
ダイキン工業	8,400	8,839.00	74,247,600
オルガノ	1,000	427.00	427,000
トーヨーカネツ	3,000	239.00	717,000
栗田工業	3,600	2,665.00	9,594,000
椿本チエイン	3,000	750.00	2,250,000
大同工業	1,000	187.00	187,000
木村化工機	500	373.00	186,500
アネスト岩田	1,000	1,152.00	1,152,000
ダイフク	3,100	1,989.00	6,165,900
加藤製作所	1,000	440.00	440,000
油研工業	1,000	178.00	178,000
タダノ	2,800	1,088.00	3,046,400
フジテック	1,700	1,126.00	1,914,200
C K D	1,600	907.00	1,451,200
キトー	700	763.00	534,100
平和	1,800	2,380.00	4,284,000
理想科学工業	600	1,738.00	1,042,800
S A N K Y O	1,600	4,300.00	6,880,000
日本金銭機械	500	913.00	456,500
マースエンジニアリング	300	1,964.00	589,200
福島工業	400	2,594.00	1,037,600
ダイコク電機	200	1,292.00	258,400
竹内製作所	900	1,590.00	1,431,000
アマノ	1,800	1,803.00	3,245,400
J U K I	900	966.00	869,400
サンデンホールディングス	4,000	312.00	1,248,000
蛇の目マシン工業	600	607.00	364,200
マックス	1,000	1,140.00	1,140,000
グローリー	2,000	3,755.00	7,510,000
新晃工業	400	1,626.00	650,400
大和冷機工業	900	947.00	852,300
セガサミーホールディングス	6,200	1,242.00	7,700,400
日本ピストンリング	200	1,447.00	289,400
リケン	3,000	366.00	1,098,000
T P R	700	2,819.00	1,973,300

ホシザキ電機	1,300	9,640.00	12,532,000
大豊工業	500	1,095.00	547,500
日本精工	11,800	1,006.00	11,870,800
NTN	14,000	353.00	4,942,000
ジェイテクト	6,100	1,509.00	9,204,900
不二越	5,000	363.00	1,815,000
日本トムソン	2,000	389.00	778,000
THK	3,800	2,277.00	8,652,600
ユーシン精機	200	1,897.00	379,400
前澤給装工業	200	1,420.00	284,000
イーグル工業	700	1,481.00	1,036,700
日本ピラー工業	600	948.00	568,800
キッツ	2,600	467.00	1,214,200
日立工機	1,500	762.00	1,143,000
マキタ	3,800	7,050.00	26,790,000
日立造船	4,600	566.00	2,603,600
三菱重工業	103,000	418.10	43,064,300
IHI	44,000	243.00	10,692,000
日清紡ホールディングス	3,200	1,219.00	3,900,800
イビデン	3,500	1,476.00	5,166,000
コニカミノルタ	14,400	981.00	14,126,400
ブラザー工業	7,500	1,339.00	10,042,500
ミネベア	9,000	932.00	8,388,000
日立製作所	147,000	527.20	77,498,400
東芝	121,000	234.00	28,314,000
三菱電機	62,000	1,230.50	76,291,000
富士電機	17,000	406.00	6,902,000
東洋電機製造	1,000	317.00	317,000
安川電機	7,200	1,336.00	9,619,200
シンフォニアテクノロジー	4,000	147.00	588,000
明電舎	5,000	544.00	2,720,000
オリジン電気	1,000	270.00	270,000
山洋電気	2,000	535.00	1,070,000
デンヨー	500	1,233.00	616,500
東芝テック	4,000	431.00	1,724,000
芝浦メカトロニクス	1,000	225.00	225,000
マブチモーター	1,700	5,280.00	8,976,000
日本電産	6,900	7,762.00	53,557,800
東光高岳	300	1,574.00	472,200
ダイヘン	3,000	531.00	1,593,000
田淵電機	700	501.00	350,700
JVCケンウッド	4,200	282.00	1,184,400
ミマキエンジニアリング	400	557.00	222,800

第一精工	200	1,241.00	248,200	
日新電機	1,400	1,355.00	1,897,000	
大崎電気工業	1,000	767.00	767,000	
オムロン	6,500	3,535.00	22,977,500	
日東工業	900	1,773.00	1,595,700	
I D E C	800	1,022.00	817,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11,000	476.00	5,236,000	
サクサホールディングス	1,000	203.00	203,000	
メルコホールディングス	300	2,425.00	727,500	
テクノメディカ	100	2,304.00	230,400	
日本電気	79,000	279.00	22,041,000	
富士通	56,000	409.00	22,904,000	
沖電気工業	25,000	156.00	3,900,000	
電気興業	2,000	506.00	1,012,000	
サンケン電気	3,000	372.00	1,116,000	
アイホン	300	1,854.00	556,200	
ルネサスエレクトロニクス	3,000	659.00	1,977,000	
セイコーエプソン	8,600	1,889.00	16,245,400	
ワコム	4,500	475.00	2,137,500	
アルバック	1,100	3,510.00	3,861,000	
アクセル	300	848.00	254,400	
E I Z O	600	2,792.00	1,675,200	
ジャパンディスプレイ	10,800	206.00	2,224,800	
日本信号	1,600	904.00	1,446,400	
京三製作所	1,000	346.00	346,000	
能美防災	700	1,644.00	1,150,800	
ホーチキ	400	1,294.00	517,600	
エレコム	500	2,125.00	1,062,500	
日本無線	2,000	281.00	562,000	
パナソニック	65,900	1,004.50	66,196,550	代用有価証券 7,500株
シャープ	49,000	136.00	6,664,000	
アンリツ	3,500	624.00	2,184,000	
富士通ゼネラル	2,000	1,819.00	3,638,000	
日立国際電気	1,300	1,283.00	1,667,900	
ソニー	40,700	3,027.00	123,198,900	代用有価証券 3,700株
T D K	3,500	6,630.00	23,205,000	
帝国通信工業	1,000	161.00	161,000	
ミツミ電機	2,200	556.00	1,223,200	
タムラ製作所	2,000	297.00	594,000	
アルプス電気	4,900	1,889.00	9,256,100	
池上通信機	2,000	135.00	270,000	
パイオニア	9,300	312.00	2,901,600	

日本電波工業	500	731.00	365,500
日本トリム	200	5,900.00	1,180,000
ローランド ディー . ジー .	300	2,198.00	659,400
フォスター電機	700	2,367.00	1,656,900
クラリオン	3,000	337.00	1,011,000
S M K	2,000	556.00	1,112,000
ヨコオ	400	510.00	204,000
東光	1,000	392.00	392,000
ホシデン	1,700	716.00	1,217,200
ヒロセ電機	900	13,720.00	12,348,000
日本航空電子工業	2,000	1,286.00	2,572,000
T O A	700	1,101.00	770,700
日立マクセル	1,000	1,766.00	1,766,000
古野電気	700	646.00	452,200
ユニデンホールディングス	2,000	126.00	252,000
アルパイン	1,400	1,252.00	1,752,800
スミダコーポレーション	500	689.00	344,500
アイコム	300	2,155.00	646,500
リオン	200	1,641.00	328,200
船井電機	600	1,028.00	616,800
横河電機	5,800	1,232.00	7,145,600
新電元工業	2,000	401.00	802,000
アズビル	1,900	2,929.00	5,565,100
日本光電工業	2,400	2,829.00	6,789,600
チノー	200	1,002.00	200,400
共和電業	700	406.00	284,200
堀場製作所	1,100	4,185.00	4,603,500
アドバンテスト	3,900	1,048.00	4,087,200
小野測器	300	706.00	211,800
エスペック	600	1,506.00	903,600
パナソニック デバイス S U N X	500	582.00	291,000
キーエンス	1,300	65,320.00	84,916,000
日置電機	300	2,285.00	685,500
シスメックス	4,500	7,070.00	31,815,000
メガチップス	600	1,219.00	731,400
O B A R A G R O U P	400	4,155.00	1,662,000
コーセル	800	1,108.00	886,400
新日本無線	400	399.00	159,600
オブテックス	400	3,830.00	1,532,000
千代田インテグレ	300	2,250.00	675,000
レーザーテック	700	1,533.00	1,073,100
スタンレー電気	4,100	2,363.00	9,688,300
岩崎電気	2,000	191.00	382,000

ウシオ電機	3,500	1,590.00	5,565,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	500	382.00	191,000	
日本セラミック	300	2,058.00	617,400	
遠藤照明	300	978.00	293,400	
日本デジタル研究所	500	1,564.00	782,000	
山一電機	500	568.00	284,000	
図研	400	1,213.00	485,200	
日本電子	2,000	510.00	1,020,000	
カシオ計算機	5,800	2,156.00	12,504,800	
ファナック	5,900	18,505.00	109,179,500	
日本シイエムケイ	1,200	431.00	517,200	
エンプラス	300	3,670.00	1,101,000	
大真空	1,000	242.00	242,000	
ローム	2,800	4,900.00	13,720,000	
浜松ホトニクス	4,500	3,145.00	14,152,500	
三井ハイテック	800	689.00	551,200	
新光電気工業	2,200	632.00	1,390,400	
京セラ	9,500	5,360.00	50,920,000	
太陽誘電	2,800	1,113.00	3,116,400	
村田製作所	6,100	14,605.00	89,090,500	
ユーシン	800	698.00	558,400	
双葉電子工業	900	1,686.00	1,517,400	
北陸電気工業	2,000	135.00	270,000	
ニチコン	1,800	776.00	1,396,800	
日本ケミコン	5,000	146.00	730,000	
K O A	800	820.00	656,000	
市光工業	1,000	239.00	239,000	
小糸製作所	3,500	4,785.00	16,747,500	
ミツバ	1,000	1,632.00	1,632,000	
スター精密	1,100	1,376.00	1,513,600	
S C R E E Nホールディングス	6,000	917.00	5,502,000	
キャノン電子	500	1,655.00	827,500	
キャノン	31,100	3,333.00	103,656,300	代用有価証券 4,100株
リコー	18,700	1,140.00	21,318,000	
M U T O Hホールディングス	1,000	227.00	227,000	
東京エレクトロン	4,700	7,435.00	34,944,500	
トヨタ紡織	2,000	1,946.00	3,892,000	
ユニプレス	1,200	1,881.00	2,257,200	
豊田自動織機	5,300	4,900.00	25,970,000	
モリタホールディングス	1,000	1,329.00	1,329,000	
三櫻工業	700	600.00	420,000	
デンソー	14,200	4,328.00	61,457,600	
東海理化電機製作所	1,700	2,018.00	3,430,600	

三井造船	22,000	169.00	3,718,000	
川崎重工業	45,000	322.00	14,490,000	
名村造船所	1,700	815.00	1,385,500	
日本車輛製造	2,000	263.00	526,000	
ニチユ三菱フォークリフト	700	503.00	352,100	
近畿車輛	1,000	309.00	309,000	
日産自動車	81,000	1,016.00	82,296,000	
いすゞ自動車	16,700	1,193.00	19,923,100	
トヨタ自動車	71,700	5,643.00	404,603,100	代用有価証券 9,000株
日野自動車	8,200	1,221.00	10,012,200	
三菱自動車工業	22,900	733.00	16,785,700	
エフテック	300	1,058.00	317,400	
武蔵精密工業	600	2,101.00	1,260,600	
日産車体	2,800	1,088.00	3,046,400	
新明和工業	3,000	765.00	2,295,000	
極東開発工業	1,100	1,130.00	1,243,000	
日信工業	1,300	1,546.00	2,009,800	
トビー工業	5,000	214.00	1,070,000	
ティラド	2,000	168.00	336,000	
曙ブレーキ工業	2,900	289.00	838,100	
タチエス	900	1,542.00	1,387,800	
N O K	2,800	1,867.00	5,227,600	
フタバ産業	1,800	449.00	808,200	
K Y B	6,000	337.00	2,022,000	
大同メタル工業	800	826.00	660,800	
プレス工業	3,100	377.00	1,168,700	
ミクニ	500	345.00	172,500	
カルソニックカンセイ	4,000	773.00	3,092,000	
太平洋工業	1,300	1,027.00	1,335,100	
ケーヒン	1,300	1,638.00	2,129,400	
河西工業	700	1,109.00	776,300	
アイシン精機	5,900	4,185.00	24,691,500	
富士機工	700	435.00	304,500	
マツダ	18,300	1,694.00	31,000,200	
ダイハツ工業	6,900	1,489.00	10,274,100	
今仙電機製作所	500	979.00	489,500	
本田技研工業	51,900	3,050.00	158,295,000	代用有価証券 6,000株
スズキ	12,100	3,019.00	36,529,900	
富士重工業	18,200	3,669.00	66,775,800	
ヤマハ発動機	8,100	1,852.00	15,001,200	
ショーワ	1,500	960.00	1,440,000	
T B K	700	380.00	266,000	

エクセディ	800	2,375.00	1,900,000
豊田合成	2,100	2,054.00	4,313,400
愛三工業	1,000	896.00	896,000
ヨロズ	500	2,260.00	1,130,000
エフ・シー・シー	900	1,790.00	1,611,000
シマノ	2,300	17,570.00	40,411,000
タカタ	1,000	392.00	392,000
テイ・エス テック	1,300	2,508.00	3,260,400
ジャムコ	300	2,762.00	828,600
テルモ	8,800	4,240.00	37,312,000
日機装	2,100	840.00	1,764,000
島津製作所	7,000	1,720.00	12,040,000
JMS	1,000	288.00	288,000
長野計器	300	632.00	189,600
ブイ・テクノロジー	100	4,790.00	479,000
東京計器	2,000	160.00	320,000
愛知時計電機	1,000	303.00	303,000
東京精密	1,100	2,331.00	2,564,100
マニー	500	1,884.00	942,000
ニコン	10,800	1,702.00	18,381,600
トプコン	1,900	1,449.00	2,753,100
オリンパス	8,600	4,365.00	37,539,000
理研計器	500	1,071.00	535,500
タムロン	500	1,832.00	916,000
HOYA	13,000	4,303.00	55,939,000
ノーリツ銅機	500	669.00	334,500
エー・アンド・デイ	500	388.00	194,000
シチズンホールディングス	7,100	662.00	4,700,200
リズム時計工業	3,000	147.00	441,000
大研医器	500	887.00	443,500
メニコン	300	3,800.00	1,140,000
松風	300	1,366.00	409,800
セイコーホールディングス	4,000	430.00	1,720,000
ニプロ	4,300	1,095.00	4,708,500
パラマウントベッドホールディングス	600	4,095.00	2,457,000
ニホンフラッシュ	200	1,039.00	207,800
前田工織	600	1,205.00	723,000
永大産業	1,000	406.00	406,000
アートネイチャー	500	916.00	458,000
ダンロップスポーツ	400	988.00	395,200
バンダイナムコホールディングス	6,000	2,491.00	14,946,000
共立印刷	1,000	282.00	282,000
フランスベッドホールディングス	800	1,024.00	819,200

パイロットコーポレーション	1,000	4,465.00	4,465,000
萩原工業	100	2,776.00	277,600
トッパン・フォームズ	1,000	1,230.00	1,230,000
フジシールインターナショナル	700	3,860.00	2,702,000
タカラトミー	1,900	783.00	1,487,700
廣済堂	500	333.00	166,500
プロネクサス	500	1,124.00	562,000
ウッドワン	1,000	252.00	252,000
大建工業	2,000	325.00	650,000
凸版印刷	16,000	969.00	15,504,000
大日本印刷	17,000	1,061.00	18,037,000
図書印刷	1,000	546.00	546,000
共同印刷	2,000	326.00	652,000
日本写真印刷	1,000	1,732.00	1,732,000
宝印刷	300	1,374.00	412,200
アシックス	5,400	2,270.00	12,258,000
ツツミ	300	2,318.00	695,400
小松ウオール工業	200	1,747.00	349,400
ヤマハ	4,200	3,295.00	13,839,000
河合楽器製作所	200	1,986.00	397,200
クリナップ	700	770.00	539,000
ビジョン	3,300	2,970.00	9,801,000
キングジム	500	848.00	424,000
リンテック	1,400	2,152.00	3,012,800
T A S A K I	100	1,644.00	164,400
イトーキ	1,200	767.00	920,400
任天堂	3,600	17,220.00	61,992,000
三菱鉛筆	400	5,200.00	2,080,000
タカラスタンダード	2,000	973.00	1,946,000
コクヨ	3,000	1,349.00	4,047,000
ナカバヤシ	1,000	283.00	283,000
グロープライド	300	1,349.00	404,700
岡村製作所	2,000	1,030.00	2,060,000
美津濃	3,000	534.00	1,602,000
アデランス	1,000	578.00	578,000
東京電力ホールディングス	48,900	608.00	29,731,200
中部電力	17,600	1,487.00	26,171,200
関西電力	23,500	993.10	23,337,850
中国電力	8,000	1,434.00	11,472,000
北陸電力	5,700	1,542.00	8,789,400
東北電力	14,400	1,380.00	19,872,000
四国電力	5,200	1,449.00	7,534,800
九州電力	12,700	1,133.00	14,389,100

北海道電力	5,400	936.00	5,054,400
沖縄電力	600	2,865.00	1,719,000
電源開発	4,900	3,410.00	16,709,000
東京瓦斯	64,000	516.40	33,049,600
大阪瓦斯	60,000	418.20	25,092,000
東邦瓦斯	15,000	779.00	11,685,000
北海道瓦斯	1,000	273.00	273,000
広島ガス	1,000	366.00	366,000
西部瓦斯	6,000	257.00	1,542,000
静岡ガス	1,600	773.00	1,236,800
メタウォーター	400	2,902.00	1,160,800
SBSホールディングス	600	714.00	428,400
東武鉄道	31,000	578.00	17,918,000
相鉄ホールディングス	10,000	718.00	7,180,000
東京急行電鉄	34,000	973.00	33,082,000
京浜急行電鉄	16,000	1,006.00	16,096,000
小田急電鉄	18,000	1,254.00	22,572,000
京王電鉄	16,000	1,030.00	16,480,000
京成電鉄	9,000	1,625.00	14,625,000
富士急行	2,000	1,500.00	3,000,000
新京成電鉄	1,000	442.00	442,000
東日本旅客鉄道	10,500	10,250.00	107,625,000
西日本旅客鉄道	5,600	6,863.00	38,432,800
東海旅客鉄道	5,200	20,285.00	105,482,000
西武ホールディングス	4,600	2,361.00	10,860,600
鴻池運輸	800	1,299.00	1,039,200
西日本鉄道	7,000	691.00	4,837,000
ハマキョウレックス	400	1,894.00	757,600
サカイ引越センター	200	2,722.00	544,400
近鉄グループホールディングス	58,000	463.00	26,854,000
阪急阪神ホールディングス	39,000	711.00	27,729,000
南海電気鉄道	13,000	610.00	7,930,000
京阪ホールディングス	13,000	830.00	10,790,000
神戸電鉄	1,000	363.00	363,000
名古屋鉄道	21,000	568.00	11,928,000
山陽電気鉄道	2,000	501.00	1,002,000
日本通運	22,000	502.00	11,044,000
ヤマトホールディングス	10,700	2,274.00	24,331,800
山九	8,000	515.00	4,120,000
丸全昭和運輸	2,000	405.00	810,000
センコー	2,600	706.00	1,835,600
トナミホールディングス	1,000	281.00	281,000
ニッコンホールディングス	1,900	2,050.00	3,895,000

福山通運	3,000	562.00	1,686,000
セイノーホールディングス	4,100	1,171.00	4,801,100
神奈川中央交通	1,000	648.00	648,000
日立物流	1,200	1,869.00	2,242,800
丸和運輸機関	100	2,641.00	264,100
C & F ロジホールディングス	600	812.00	487,200
日本郵船	52,000	228.00	11,856,000
商船三井	28,000	262.00	7,336,000
川崎汽船	25,000	241.00	6,025,000
N S ユナイテッド海運	3,000	158.00	474,000
飯野海運	3,000	446.00	1,338,000
乾汽船	500	847.00	423,500
日本航空	11,000	4,102.00	45,122,000
A N A ホールディングス	107,000	314.60	33,662,200
トランコム	200	6,000.00	1,200,000
日新	2,000	319.00	638,000
三菱倉庫	4,000	1,487.00	5,948,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	294.00	882,000
住友倉庫	4,000	549.00	2,196,000
澁澤倉庫	1,000	280.00	280,000
東陽倉庫	1,000	225.00	225,000
日本トランスシティ	1,000	362.00	362,000
ケイヒン	1,000	136.00	136,000
中央倉庫	300	910.00	273,000
安田倉庫	400	712.00	284,800
東洋埠頭	2,000	146.00	292,000
宇徳	500	325.00	162,500
上組	7,000	1,033.00	7,231,000
キューソー流通システム	200	2,819.00	563,800
郵船ロジスティクス	500	1,354.00	677,000
近鉄エクスプレス	1,000	1,436.00	1,436,000
エーアイティー	300	920.00	276,000
N E C ネットズエスアイ	700	1,739.00	1,217,300
システナ	600	1,819.00	1,091,400
デジタルアーツ	300	2,335.00	700,500
新日鉄住金ソリューションズ	900	2,063.00	1,856,700
コア	200	1,298.00	259,600
ソフトクリエイイトホールディングス	200	855.00	171,000
I T ホールディングス	1,900	2,527.00	4,801,300
電算システム	200	1,584.00	316,800
グリー	3,500	660.00	2,310,000
コーエーテクモホールディングス	1,400	1,727.00	2,417,800
三菱総合研究所	200	3,460.00	692,000

ファインデックス	400	1,449.00	579,600
K L a b	900	638.00	574,200
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	400	934.00	373,600
ネクソン	5,400	1,730.00	9,342,000
アイスタイル	900	1,077.00	969,300
エイチーム	200	1,630.00	326,000
コロブラ	1,600	2,510.00	4,016,000
ブロードリーフ	600	1,170.00	702,000
ハーツユナイテッドグループ	200	2,394.00	478,800
ブイキューブ	300	1,234.00	370,200
VOYAGE GROUP	100	1,409.00	140,900
ティーガイア	600	1,391.00	834,600
豆蔵ホールディングス	400	645.00	258,000
テクマトリックス	200	2,056.00	411,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,900	302.00	2,989,800
GMOペイメントゲートウェイ	500	7,670.00	3,835,000
インターネットイニシアティブ	900	2,257.00	2,031,300
SRAホールディングス	300	2,592.00	777,600
朝日ネット	500	481.00	240,500
コムチュア	100	2,615.00	261,500
gumi	600	834.00	500,400
フェイス	100	1,285.00	128,500
野村総合研究所	4,000	3,975.00	15,900,000
インテージホールディングス	300	1,412.00	423,600
クレスコ	100	1,683.00	168,300
フジ・メディア・ホールディングス	5,900	1,276.00	7,528,400
オービック	2,000	6,100.00	12,200,000
ジャストシステム	1,000	921.00	921,000
ヤフー	40,800	506.00	20,644,800
トレンドマイクロ	2,800	4,295.00	12,026,000
日本オラクル	900	6,220.00	5,598,000
アルファシステムズ	200	1,664.00	332,800
フューチャー	700	834.00	583,800
CAC Holdings	400	855.00	342,000
オービックビジネスコンサルタント	300	4,715.00	1,414,500
伊藤忠テクノソリューションズ	1,300	2,161.00	2,809,300
アイティフォー	700	509.00	356,300
東計電算	100	2,043.00	204,300
大塚商会	1,500	5,570.00	8,355,000
サイボウズ	800	339.00	271,200
電通国際情報サービス	400	2,198.00	879,200
EMシステムズ	200	1,270.00	254,000
ウェザーニューズ	200	3,685.00	737,000

C I J	500	458.00	229,000
WOWOW	300	2,444.00	733,200
イマジカ・ロボット ホールディングス	500	399.00	199,500
ネットワンシステムズ	2,500	585.00	1,462,500
アルゴグラフィックス	300	1,725.00	517,500
マーベラス	1,000	945.00	945,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,000	1,443.00	1,443,000
日本ユニシス	1,600	1,396.00	2,233,600
兼松エレクトロニクス	400	1,952.00	780,800
東京放送ホールディングス	3,400	1,638.00	5,569,200
日本テレビホールディングス	5,200	1,887.00	9,812,400
朝日放送	600	676.00	405,600
テレビ朝日ホールディングス	1,600	1,917.00	3,067,200
スカパーJ S A Tホールディングス	4,300	623.00	2,678,900
テレビ東京ホールディングス	500	1,987.00	993,500
コネクシオ	500	1,263.00	631,500
日本通信	3,000	205.00	615,000
日本電信電話	44,000	4,960.00	218,240,000
K D D I	57,800	3,197.00	184,786,600
光通信	700	8,430.00	5,901,000
N T T ドコモ	43,900	2,705.00	118,749,500
エムティーアイ	700	805.00	563,500
G M O インターネット	2,100	1,348.00	2,830,800
カドカワ	1,800	1,602.00	2,883,600
学研ホールディングス	2,000	249.00	498,000
ゼンリン	800	2,350.00	1,880,000
昭文社	300	602.00	180,600
アイネット	300	1,149.00	344,700
松竹	4,000	1,096.00	4,384,000
東宝	4,100	2,883.00	11,820,300
東映	2,000	877.00	1,754,000
A O I P r o .	300	888.00	266,400
エヌ・ティ・ティ・データ	3,500	5,690.00	19,915,000
D T S	600	2,155.00	1,293,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,400	3,015.00	7,236,000
シーイーシー	400	1,600.00	640,000
カプコン	1,500	2,717.00	4,075,500
ジャステック	400	905.00	362,000
S C S K	1,400	4,170.00	5,838,000
日本システムウエア	200	1,001.00	200,200
アイネス	800	1,172.00	937,600
T K C	500	2,982.00	1,491,000
富士ソフト	800	2,574.00	2,059,200

N S D	1,200	1,722.00	2,066,400
コナミホールディングス	2,600	3,520.00	9,152,000
J B C Cホールディングス	500	677.00	338,500
ミロク情報サービス	400	1,213.00	485,200
ソフトバンクグループ	32,300	6,002.00	193,864,600
高千穂交易	200	876.00	175,200
伊藤忠食品	100	4,120.00	412,000
エレマテック	300	1,966.00	589,800
J A L U X	200	2,075.00	415,000
あらた	300	2,510.00	753,000
東京エレクトロン デバイス	200	1,487.00	297,400
フィールズ	400	1,895.00	758,000
双日	35,900	227.00	8,149,300
アルフレッサ ホールディングス	7,200	2,155.00	15,516,000
横浜冷凍	1,400	1,058.00	1,481,200
アルコニックス	300	1,627.00	488,100
神戸物産	400	2,415.00	966,000
あい ホールディングス	1,000	3,235.00	3,235,000
ダイワボウホールディングス	5,000	219.00	1,095,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,000	1,294.00	1,294,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,000	903.00	903,000
八洲電機	400	564.00	225,600
U K Cホールディングス	400	2,123.00	849,200
T O K A Iホールディングス	2,500	606.00	1,515,000
三洋貿易	300	1,455.00	436,500
ウイン・パートナーズ	200	1,467.00	293,400
シップヘルスケアホールディングス	1,200	2,848.00	3,417,600
明治電機工業	200	1,109.00	221,800
小野建	500	1,154.00	577,000
佐島電機	400	733.00	293,200
伯東	400	901.00	360,400
コンドーテック	500	925.00	462,500
中山福	400	744.00	297,600
ナガイレーベン	800	2,284.00	1,827,200
三菱食品	600	2,871.00	1,722,600
松田産業	400	1,193.00	477,200
メディバルホールディングス	5,700	1,811.00	10,322,700
アドヴァン	600	1,051.00	630,600
S P K	100	2,004.00	200,400
萩原電気	100	1,977.00	197,700
アズワン	400	4,075.00	1,630,000
シモジマ	400	1,107.00	442,800
ドウシシャ	700	2,042.00	1,429,400

小津産業	100	2,214.00	221,400	
高速	300	859.00	257,700	
たけびし	200	977.00	195,400	
黒田電気	1,100	1,708.00	1,878,800	
丸文	500	775.00	387,500	
ハビネット	500	950.00	475,000	
エクセル	300	1,428.00	428,400	
マルカキカイ	200	1,305.00	261,000	
ガリバーインターナショナル	1,500	1,149.00	1,723,500	
日本エム・ディ・エム	500	614.00	307,000	
進和	300	1,428.00	428,400	
ダイトエレクトロン	300	686.00	205,800	
シークス	400	3,360.00	1,344,000	
オーハシテクニカ	300	1,229.00	368,700	
白銅	200	1,043.00	208,600	
伊藤忠商事	44,700	1,413.00	63,161,100	
丸紅	56,000	582.90	32,642,400	
高島	1,000	174.00	174,000	
長瀬産業	3,400	1,257.00	4,273,800	
蝶理	400	1,492.00	596,800	
豊田通商	6,300	2,634.00	16,594,200	
三共生興	900	380.00	342,000	
兼松	12,000	165.00	1,980,000	
三井物産	51,500	1,338.50	68,932,750	
日本紙パルプ商事	3,000	325.00	975,000	
日立ハイテクノロジーズ	2,000	3,270.00	6,540,000	
カメイ	700	1,037.00	725,900	
OUGホールディングス	1,000	230.00	230,000	
スターゼン	200	3,200.00	640,000	
山善	2,200	878.00	1,931,600	
椿本興業	1,000	293.00	293,000	
住友商事	35,800	1,186.00	42,458,800	
内田洋行	1,000	456.00	456,000	
三菱商事	42,700	1,935.50	82,645,850	代用有価証券 5,200株
第一実業	1,000	494.00	494,000	
キヤノンマーケティングジャパン	1,600	1,904.00	3,046,400	
西華産業	2,000	224.00	448,000	
佐藤商事	500	636.00	318,000	
菱洋エレクトロ	700	1,336.00	935,200	
東京産業	600	382.00	229,200	
ユアサ商事	500	2,521.00	1,260,500	
神鋼商事	1,000	200.00	200,000	
阪和興業	6,000	499.00	2,994,000	

カナデン	500	850.00	425,000
菱電商事	1,000	646.00	646,000
フルサト工業	300	1,687.00	506,100
岩谷産業	7,000	644.00	4,508,000
すてきナイスグループ	2,000	137.00	274,000
ニチモウ	1,000	179.00	179,000
極東貿易	1,000	222.00	222,000
三愛石油	1,400	786.00	1,100,400
稲畑産業	1,400	1,098.00	1,537,200
明和産業	500	376.00	188,000
ワキタ	1,200	791.00	949,200
東邦ホールディングス	1,800	2,603.00	4,685,400
サンゲツ	2,000	2,020.00	4,040,000
ミツウロコグループホールディングス	900	540.00	486,000
シナネンホールディングス	1,000	426.00	426,000
伊藤忠エネクス	1,500	897.00	1,345,500
サンリオ	1,800	2,168.00	3,902,400
サンワテクノス	400	712.00	284,800
リョーサン	900	2,704.00	2,433,600
新光商事	700	1,092.00	764,400
トーホー	300	2,455.00	736,500
三信電気	800	921.00	736,800
東陽テクニカ	800	1,154.00	923,200
モスフードサービス	700	2,907.00	2,034,900
加賀電子	500	1,343.00	671,500
ソーダニッカ	600	460.00	276,000
立花エレテック	400	1,175.00	470,000
PALTA C	900	1,928.00	1,735,200
三谷産業	600	345.00	207,000
ヤマタネ	3,000	150.00	450,000
日鉄住金物産	4,000	384.00	1,536,000
トラスコ中山	700	4,610.00	3,227,000
オートバックスセブン	2,200	1,890.00	4,158,000
加藤産業	900	2,721.00	2,448,900
イノテック	500	439.00	219,500
イエローハット	500	2,288.00	1,144,000
J Kホールディングス	600	471.00	282,600
日伝	200	2,977.00	595,400
杉本商事	300	1,179.00	353,700
因幡電機産業	800	3,605.00	2,884,000
バイテックホールディングス	200	932.00	186,400
ミスミグループ本社	6,400	1,636.00	10,470,400
タキヒヨー	1,000	424.00	424,000

スズケン	2,600	3,880.00	10,088,000
ジェコス	400	1,031.00	412,400
ローソン	2,200	8,670.00	19,074,000
サンエー	400	5,270.00	2,108,000
カワチ薬品	400	2,110.00	844,000
エービーシー・マート	700	7,360.00	5,152,000
ハードオフコーポレーション	300	1,509.00	452,700
アスクル	700	4,610.00	3,227,000
ゲオホールディングス	1,000	1,854.00	1,854,000
アダストリア	1,000	3,705.00	3,705,000
くらコーポレーション	300	4,925.00	1,477,500
キャンドウ	300	1,617.00	485,100
パル	300	2,654.00	796,200
エディオン	2,400	887.00	2,128,800
サーラコーポレーション	500	554.00	277,000
ワッツ	200	894.00	178,800
あみやき亭	100	4,270.00	427,000
ひらまつ	800	695.00	556,000
ゲンキー	100	3,565.00	356,500
大黒天物産	100	4,905.00	490,500
ハニーズ	500	1,075.00	537,500
アルペン	500	1,866.00	933,000
クオール	600	1,633.00	979,800
ジェイアイエヌ	400	3,850.00	1,540,000
ビックカメラ	2,900	1,160.00	3,364,000
D C Mホールディングス	2,800	816.00	2,284,800
Monotaro	2,000	3,420.00	6,840,000
アーランドサービス	200	3,010.00	602,000
J.フロント リテイリング	7,200	1,464.00	10,540,800
ドトール・日レスホールディングス	1,000	1,969.00	1,969,000
マツモトキヨシホールディングス	1,200	5,800.00	6,960,000
ブロンコビリー	200	3,100.00	620,000
スタートトゥデイ	1,700	4,800.00	8,160,000
トレジャー・ファクトリー	200	1,101.00	220,200
物語コーポレーション	200	5,280.00	1,056,000
ココカラファイン	600	4,890.00	2,934,000
三越伊勢丹ホールディングス	11,300	1,236.00	13,966,800
ウエルシアホールディングス	500	6,460.00	3,230,000
クリエイトSDホールディングス	800	2,752.00	2,201,600
丸善CHIホールディングス	700	364.00	254,800
チムニー	100	2,932.00	293,200
ジョイフル本田	900	2,487.00	2,238,300
キリン堂ホールディングス	200	1,105.00	221,000

ホットランド	100	1,042.00	104,200
すかいらーく	1,700	1,449.00	2,463,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,900	990.00	1,881,000
ブックオフコーポレーション	300	893.00	267,900
あさひ	400	1,611.00	644,400
日本調剤	100	3,665.00	366,500
コスモス薬品	300	20,030.00	6,009,000
トーエル	300	824.00	247,200
セブン&アイ・ホールディングス	23,800	4,684.00	111,479,200
薬王堂	100	3,495.00	349,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,500	1,102.00	1,653,000
ツルハホールディングス	1,300	11,020.00	14,326,000
サンマルクホールディングス	400	2,972.00	1,188,800
トリドール	700	1,995.00	1,396,500
クスリのアオキ	500	6,130.00	3,065,000
メディカルシステムネットワーク	600	680.00	408,000
総合メディカル	300	3,455.00	1,036,500
カップ・クリエイト	800	1,193.00	954,400
ライトオン	400	1,578.00	631,200
良品計画	700	25,760.00	18,032,000
三城ホールディングス	700	452.00	316,400
アルビス	100	1,975.00	197,500
コナカ	700	532.00	372,400
G-7ホールディングス	200	1,237.00	247,400
イオン北海道	400	521.00	208,400
コジマ	800	252.00	201,600
ヒマラヤ	200	1,005.00	201,000
コーナン商事	800	1,866.00	1,492,800
エコス	200	1,476.00	295,200
ワタミ	700	1,050.00	735,000
ドンキホーテホールディングス	3,700	3,925.00	14,522,500
西松屋チェーン	1,100	1,200.00	1,320,000
ゼンショーホールディングス	2,900	1,408.00	4,083,200
幸楽苑ホールディングス	400	1,475.00	590,000
ハークスレイ	200	1,056.00	211,200
サイゼリヤ	900	1,950.00	1,755,000
V Tホールディングス	1,900	580.00	1,102,000
魚力	200	1,238.00	247,600
ユナイテッドアローズ	800	4,265.00	3,412,000
ハイデイ日高	500	2,627.00	1,313,500
京都きもの友禅	400	836.00	334,400
コロナ	1,900	1,754.00	3,332,600

壱番屋	300	6,620.00	1,986,000
スギホールディングス	1,000	5,650.00	5,650,000
スクロール	900	472.00	424,800
ヨンドシーホールディングス	400	2,767.00	1,106,800
ファミリーマート	1,700	6,010.00	10,217,000
木曽路	700	2,234.00	1,563,800
サトレストランシステムズ	700	802.00	561,400
千趣会	1,100	733.00	806,300
ケーヨー	1,000	519.00	519,000
上新電機	1,000	866.00	866,000
日本瓦斯	700	2,675.00	1,872,500
ロイヤルホールディングス	900	2,140.00	1,926,000
いなげや	600	1,389.00	833,400
島忠	1,500	2,463.00	3,694,500
チヨダ	700	2,899.00	2,029,300
ライフコーポレーション	400	2,821.00	1,128,400
リンガーハット	500	2,266.00	1,133,000
テンアライド	500	364.00	182,000
AOKIホールディングス	1,300	1,286.00	1,671,800
オークワ	1,000	1,148.00	1,148,000
コメリ	900	2,545.00	2,290,500
青山商事	1,100	4,045.00	4,449,500
しまむら	700	14,120.00	9,884,000
高島屋	8,000	833.00	6,664,000
松屋	1,100	893.00	982,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,900	1,871.00	5,425,900
近鉄百貨店	2,000	296.00	592,000
パルコ	500	957.00	478,500
丸井グループ	7,000	1,655.00	11,585,000
アクシアル リテイリング	400	3,525.00	1,410,000
イオン	23,400	1,646.00	38,516,400
ユニーグループ・ホールディングス	5,500	829.00	4,559,500
イズミ	1,100	4,510.00	4,961,000
東武ストア	1,000	307.00	307,000
平和堂	1,200	2,326.00	2,791,200
フジ	600	2,405.00	1,443,000
ヤオコー	600	4,785.00	2,871,000
ゼビオホールディングス	800	1,771.00	1,416,800
ケーズホールディングス	1,200	3,775.00	4,530,000
Olympicグループ	300	574.00	172,200
日産東京販売ホールディングス	1,000	264.00	264,000
アインホールディングス	700	5,690.00	3,983,000
元気寿司	200	2,121.00	424,200

ヤマダ電機	17,300	582.00	10,068,600
アークランドサカモト	1,000	1,151.00	1,151,000
ニトリホールディングス	2,500	10,460.00	26,150,000
ケヨーホールディングス	300	710.00	213,000
吉野家ホールディングス	2,100	1,392.00	2,923,200
松屋フーズ	300	2,836.00	850,800
サガミチェーン	800	1,227.00	981,600
関西スーパーマーケット	500	773.00	386,500
王将フードサービス	400	3,430.00	1,372,000
プレナス	600	1,987.00	1,192,200
ミニストップ	400	1,764.00	705,600
アークス	1,100	2,721.00	2,993,100
パローホールディングス	1,200	2,771.00	3,325,200
ベルク	300	4,385.00	1,315,500
大庄	300	1,441.00	432,300
ファーストリテイリング	1,100	29,425.00	32,367,500
サンドラッグ	1,200	8,280.00	9,936,000
サックスパー ホールディングス	500	1,442.00	721,000
ヤマザワ	100	1,660.00	166,000
やまや	100	2,083.00	208,300
ベルーナ	1,400	556.00	778,400
じもとホールディングス	4,100	145.00	594,500
足利ホールディングス	4,200	329.00	1,381,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	800	2,742.00	2,193,600
九州フィナンシャルグループ	8,700	604.00	5,254,800
ゆうちょ銀行	10,900	1,396.00	15,216,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	39,700	521.70	20,711,490
新生銀行	49,000	157.00	7,693,000
あおぞら銀行	36,000	386.00	13,896,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	456,700	538.80	246,069,960
りそなホールディングス	66,600	411.00	27,372,600
三井住友トラスト・ホールディングス	119,000	351.70	41,852,300
三井住友フィナンシャルグループ	45,600	3,598.00	164,068,800
第四銀行	7,000	387.00	2,709,000
北越銀行	6,000	188.00	1,128,000
西日本シティ銀行	19,000	199.00	3,781,000
千葉銀行	22,000	578.00	12,716,000
常陽銀行	21,000	394.00	8,274,000
群馬銀行	13,000	465.00	6,045,000
武蔵野銀行	900	2,921.00	2,628,900
千葉興業銀行	1,600	500.00	800,000
筑波銀行	2,400	303.00	727,200
七十七銀行	9,000	398.00	3,582,000

青森銀行	4,000	330.00	1,320,000
秋田銀行	4,000	300.00	1,200,000
山形銀行	3,000	426.00	1,278,000
岩手銀行	400	4,105.00	1,642,000
東邦銀行	5,000	363.00	1,815,000
東北銀行	3,000	143.00	429,000
みちのく銀行	3,000	176.00	528,000
ふくおかフィナンシャルグループ	25,000	384.00	9,600,000
静岡銀行	17,000	841.00	14,297,000
十六銀行	7,000	334.00	2,338,000
スルガ銀行	5,400	2,065.00	11,151,000
八十二銀行	10,300	500.00	5,150,000
山梨中央銀行	4,000	421.00	1,684,000
大垣共立銀行	8,000	344.00	2,752,000
福井銀行	5,000	211.00	1,055,000
北國銀行	6,000	314.00	1,884,000
清水銀行	200	2,350.00	470,000
滋賀銀行	5,000	483.00	2,415,000
南都銀行	5,000	314.00	1,570,000
百五銀行	5,000	414.00	2,070,000
京都銀行	11,000	781.00	8,591,000
紀陽銀行	2,200	1,305.00	2,871,000
三重銀行	3,000	202.00	606,000
ほくほくフィナンシャルグループ	39,000	147.00	5,733,000
広島銀行	17,000	416.00	7,072,000
山陰合同銀行	3,400	727.00	2,471,800
中国銀行	4,000	1,177.00	4,708,000
鳥取銀行	2,000	166.00	332,000
伊予銀行	6,100	735.00	4,483,500
百十四銀行	6,000	324.00	1,944,000
四国銀行	4,000	213.00	852,000
阿波銀行	5,000	549.00	2,745,000
大分銀行	3,000	338.00	1,014,000
宮崎銀行	4,000	283.00	1,132,000
佐賀銀行	3,000	214.00	642,000
十八銀行	3,000	256.00	768,000
沖縄銀行	500	3,640.00	1,820,000
琉球銀行	1,200	1,252.00	1,502,400
セブン銀行	21,300	479.00	10,202,700
みずほフィナンシャルグループ	803,900	171.10	137,547,290
山口フィナンシャルグループ	5,000	1,035.00	5,175,000
長野銀行	2,000	189.00	378,000
名古屋銀行	5,000	375.00	1,875,000

北洋銀行	8,600	291.00	2,502,600
愛知銀行	200	4,755.00	951,000
第三銀行	3,000	151.00	453,000
中京銀行	2,000	211.00	422,000
大光銀行	2,000	202.00	404,000
愛媛銀行	3,000	227.00	681,000
トマト銀行	2,000	144.00	288,000
みなと銀行	5,000	158.00	790,000
京葉銀行	5,000	414.00	2,070,000
関西アーバン銀行	800	1,058.00	846,400
栃木銀行	3,000	423.00	1,269,000
北日本銀行	200	2,779.00	555,800
東和銀行	8,000	87.00	696,000
福島銀行	7,000	84.00	588,000
大東銀行	3,000	178.00	534,000
トモニホールディングス	4,400	314.00	1,381,600
フィデアホールディングス	3,500	173.00	605,500
池田泉州ホールディングス	6,000	415.00	2,490,000
F P G	1,700	1,363.00	2,317,100
S B Iホールディングス	6,800	1,156.00	7,860,800
ジャフコ	1,000	3,480.00	3,480,000
大和証券グループ本社	53,000	675.30	35,790,900
野村ホールディングス	109,500	508.00	55,626,000
岡三証券グループ	5,000	597.00	2,985,000
丸三証券	1,700	1,012.00	1,720,400
東洋証券	2,000	257.00	514,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,500	589.00	3,828,500
光世証券	1,000	136.00	136,000
水戸証券	1,800	304.00	547,200
いちよし証券	1,300	936.00	1,216,800
松井証券	2,800	946.00	2,648,800
だいこう証券ビジネス	300	734.00	220,200
マネックスグループ	6,700	284.00	1,902,800
カブドットコム証券	5,000	359.00	1,795,000
極東証券	800	1,298.00	1,038,400
岩井コスモホールディングス	500	1,064.00	532,000
藍澤證券	800	582.00	465,600
マネースクウェアHD	200	987.00	197,400
マネーパートナーズグループ	500	738.00	369,000
かんぽ生命保険	1,700	2,616.00	4,447,200
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	12,600	3,035.00	38,241,000
アニコムホールディングス	400	2,898.00	1,159,200
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	17,000	2,945.00	50,065,000

ソニーフィナンシャルホールディングス	5,500	1,465.00	8,057,500
第一生命保険	36,500	1,373.50	50,132,750
東京海上ホールディングス	23,100	3,692.00	85,285,200
T & Dホールディングス	20,700	1,115.00	23,080,500
全国保証	1,500	4,045.00	6,067,500
クレディセゾン	4,300	2,052.00	8,823,600
アクリーティブ	500	502.00	251,000
芙蓉総合リース	700	4,725.00	3,307,500
興銀リース	1,100	1,901.00	2,091,100
東京センチュリーリース	1,300	3,920.00	5,096,000
日本証券金融	2,500	443.00	1,107,500
アイフル	9,500	391.00	3,714,500
ポケットカード	600	544.00	326,400
リコーリース	400	3,205.00	1,282,000
イオンフィナンシャルサービス	3,700	2,395.00	8,861,500
アコム	11,400	584.00	6,657,600
ジャックス	3,000	425.00	1,275,000
オリエントコーポレーション	24,600	226.00	5,559,600
日立キャピタル	1,300	2,428.00	3,156,400
オリックス	40,300	1,632.50	65,789,750
三菱UFJリース	14,400	497.00	7,156,800
日本取引所グループ	16,700	1,733.00	28,941,100
イー・ギャランティ	200	2,535.00	507,000
N E Cキャピタルソリューション	200	1,586.00	317,200
日本駐車場開発	6,200	121.00	750,200
ヒューリック	11,900	1,085.00	12,911,500
三栄建築設計	200	1,207.00	241,400
野村不動産ホールディングス	3,800	2,031.00	7,717,800
三重交通グループホールディングス	1,000	560.00	560,000
日本商業開発	200	2,173.00	434,600
プレサンスコーポレーション	200	3,960.00	792,000
ユニゾホールディングス	400	4,655.00	1,862,000
日本管理センター	400	1,652.00	660,800
フージャースホールディングス	800	513.00	410,400
オープンハウス	800	2,380.00	1,904,000
東急不動産ホールディングス	13,800	776.00	10,708,800
飯田グループホールディングス	5,300	2,128.00	11,278,400
パーク24	2,900	3,240.00	9,396,000
パラカ	200	1,451.00	290,200
三井不動産	30,000	2,741.00	82,230,000
三菱地所	42,000	2,142.50	89,985,000
平和不動産	1,100	1,326.00	1,458,600
東京建物	6,200	1,520.00	9,424,000

ダイビル	1,500	932.00	1,398,000
京阪神ビルディング	900	584.00	525,600
住友不動産	14,000	3,241.00	45,374,000
大京	11,000	172.00	1,892,000
テーオーシー	2,200	884.00	1,944,800
東京楽天地	1,000	484.00	484,000
レオパレス21	6,700	675.00	4,522,500
スターツコーポレーション	700	2,360.00	1,652,000
フジ住宅	700	677.00	473,900
空港施設	700	488.00	341,600
住友不動産販売	400	2,121.00	848,400
ゴールドクレスト	400	1,552.00	620,800
日本エスリード	200	1,002.00	200,400
日神不動産	800	369.00	295,200
タカラレーベン	2,500	663.00	1,657,500
サンヨーハウジング名古屋	300	975.00	292,500
イオンモール	3,700	1,621.00	5,997,700
ファースト住建	200	1,311.00	262,200
トーセイ	900	798.00	718,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,500	1,023.00	3,580,500
サンフロンティア不動産	700	1,068.00	747,600
エフ・ジェー・ネクスト	500	490.00	245,000
グランディハウス	500	340.00	170,000
日本空港ビルディング	1,800	3,870.00	6,966,000
日本工営	2,000	354.00	708,000
ネクスト	1,700	1,258.00	2,138,600
ジェイエイシーリクルートメント	300	1,433.00	429,900
日本M&Aセンター	900	6,520.00	5,868,000
アコーディア・ゴルフ	1,700	1,070.00	1,819,000
タケエイ	500	1,005.00	502,500
トラスト・テック	200	1,421.00	284,200
パソナグループ	500	649.00	324,500
GCAサヴィアン	500	1,107.00	553,500
エス・エム・エス	800	2,048.00	1,638,400
テンプホールディングス	4,200	1,596.00	6,703,200
リニカル	400	2,114.00	845,600
クックパッド	1,300	1,679.00	2,182,700
エスクリ	300	624.00	187,200
学情	200	1,235.00	247,000
スタジオアリス	300	2,718.00	815,400
シミックホールディングス	300	1,332.00	399,600
総合警備保障	2,000	6,260.00	12,520,000
カカコム	4,300	2,137.00	9,189,100

アイロムグループ	200	1,178.00	235,600
ルネサンス	300	1,220.00	366,000
ディップ	700	2,849.00	1,994,300
オプトホールディング	400	650.00	260,000
新日本科学	600	456.00	273,600
ツクイ	700	1,366.00	956,200
エムスリー	5,200	2,860.00	14,872,000
ツカダ・グローバルホールディング	400	744.00	297,600
アウトソーシング	300	3,625.00	1,087,500
ウェルネット	200	4,080.00	816,000
ディー・エヌ・エー	2,700	2,011.00	5,429,700
博報堂DYホールディングス	8,400	1,255.00	10,542,000
ぐるなび	700	2,834.00	1,983,800
エスアールジータカミヤ	500	437.00	218,500
ファンコミュニケーションズ	1,400	857.00	1,199,800
WDBホールディングス	200	937.00	187,400
バリューコマース	600	383.00	229,800
J Pホールディングス	1,500	399.00	598,500
E P Sホールディングス	700	1,345.00	941,500
プレステージ・インターナショナル	500	1,309.00	654,500
アミューズ	300	2,442.00	732,600
ドリームインキュベータ	200	2,303.00	460,600
クイック	300	867.00	260,100
ケネディクス	8,100	476.00	3,855,600
電通	6,700	5,680.00	38,056,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	442.00	132,600
ぴあ	200	2,030.00	406,000
イオンファンタジー	200	2,348.00	469,600
みらかホールディングス	1,500	4,770.00	7,155,000
アルプス技研	200	2,258.00	451,600
日本空調サービス	500	541.00	270,500
オリエンタルランド	6,500	7,686.00	49,959,000
ダスキン	1,700	2,085.00	3,544,500
明光ネットワークジャパン	700	1,211.00	847,700
ファルコホールディングス	300	1,372.00	411,600
ラウンドワン	1,900	664.00	1,261,600
リゾートトラスト	2,500	2,338.00	5,845,000
ビー・エム・エル	400	4,600.00	1,840,000
りらいあコミュニケーションズ	1,000	1,107.00	1,107,000
ユー・エス・エス	7,300	1,787.00	13,045,100
サイバーエージェント	1,500	5,390.00	8,085,000
楽天	28,200	1,284.00	36,208,800
テー・オー・ダブリュー	400	680.00	272,000

セントラルスポーツ	200	2,261.00	452,200
フルキャストホールディングス	600	757.00	454,200
テクノプロ・ホールディングス	1,000	3,130.00	3,130,000
ジャパンマテリアル	300	2,811.00	843,300
ベクトル	200	2,684.00	536,800
アサンテ	200	1,500.00	300,000
N・フィールド	200	1,930.00	386,000
リクルートホールディングス	12,100	3,440.00	41,624,000
日本郵政	13,300	1,537.00	20,442,100
リロ・ホールディング	200	14,920.00	2,984,000
東祥	200	4,115.00	823,000
エイチ・アイ・エス	1,000	2,943.00	2,943,000
共立メンテナンス	500	8,920.00	4,460,000
イチネンホールディングス	600	984.00	590,400
建設技術研究所	400	1,015.00	406,000
スペース	300	1,328.00	398,400
よみうりランド	1,000	530.00	530,000
東京都競馬	4,000	217.00	868,000
常磐興産	2,000	151.00	302,000
カナモト	800	2,952.00	2,361,600
東京ドーム	5,000	480.00	2,400,000
西尾レントオール	500	3,005.00	1,502,500
トランス・コスモス	700	2,923.00	2,046,100
乃村工藝社	1,300	1,877.00	2,440,100
藤田観光	2,000	519.00	1,038,000
KNT-CTホールディングス	3,000	173.00	519,000
日本管財	500	1,690.00	845,000
トーカイ	300	3,245.00	973,500
セコム	6,300	8,371.00	52,737,300
セントラル警備保障	300	2,353.00	705,900
丹青社	1,100	908.00	998,800
メイテック	700	3,860.00	2,702,000
アサツー ディ・ケイ	1,100	2,762.00	3,038,200
応用地質	600	1,248.00	748,800
船井総研ホールディングス	800	1,655.00	1,324,000
進学会	300	563.00	168,900
ベネッセホールディングス	2,000	3,175.00	6,350,000
イオンディライト	600	3,105.00	1,863,000
ナック	400	869.00	347,600
ニチイ学館	1,000	794.00	794,000
ダイセキ	1,100	2,092.00	2,301,200
ステップ	200	1,051.00	210,200
合 計	9,369,400		11,587,959,540

## (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10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,209,638,506	773,476,976
金銭信託	-	2,145,680
コール・ローン	9,897,264	14,287,073
株式	10,009,538,335	8,594,261,771
投資信託受益証券	1,271,905	964,782
投資証券	267,242,651	242,204,908
派生商品評価勘定	57,857,363	45,864,079
未収入金	73,525	88,236
未収配当金	9,422,845	13,488,470
未収利息	14	-
差入委託証拠金	399,774,047	445,265,257
流動資産合計	11,964,716,455	10,132,047,232
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	600	5,600
未払解約金	4,550,000	13,400,000
未払利息	-	31
その他未払費用	-	72
流動負債合計	4,550,600	13,405,703
<b>負債合計</b>		
	4,550,600	13,405,703
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,253,707,132	5,679,647,156
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,706,458,723	4,438,994,373
元本等合計	11,960,165,855	10,118,641,529
<b>純資産合計</b>		
	11,960,165,855	10,118,641,529
<b>負債純資産合計</b>		
	11,964,716,455	10,132,047,232

## 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10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 (1) 株式及び投資証券 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 投資信託受益証券 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 6,253,707,132口	1. 計算日における受益権の総数 5,679,647,156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 1.9125円 (1万口当たり純資産額) (19,125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 1.7816円 (1万口当たり純資産額) (17,816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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスク、為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在

本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,571,028,589円	6,253,707,132円
期中追加設定元本額	376,272,755円	260,834,162円
期中一部解約元本額	693,594,212円	834,894,138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	497,173,395円	486,152,665円
新光外国株式インデックスVA	2,716,228,820円	2,158,285,244円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	728,410,380円	720,815,744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）	541,089,965円	535,430,363円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	127,860,117円	126,671,142円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,051,128,371円	1,054,901,285円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	574,299,806円	578,960,190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）	1,859,736円	2,387,450円
グローバル・ナビ	15,656,542円	16,043,073円
合計	6,253,707,132円	5,679,647,156円

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	17,719,167	77,397,437
投資信託受益証券	272,551	176,358
投資証券	13,693,364	17,821,109
合計	31,139,980	59,752,686

(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10月20日現在			平成28年 4月20日現在				
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超				うち1年超			
市場取引								

株価指数先物取引									
買建	1,598,710,625	-	1,656,392,081	57,681,456	1,221,998,143	-	1,267,731,977	45,733,834	
S&P500 EMINI	1,108,948,373	-	1,151,188,131	42,239,758	867,328,043	-	903,096,558	35,768,515	
S&P/TSE 601X	28,911,433	-	29,604,556	693,123	54,129,776	-	55,624,800	1,495,024	
DJ EURO ST50	201,525,928	-	207,979,859	6,453,931	163,069,674	-	166,051,828	2,982,154	
FTSE 100 IDX	-	-	-	-	104,602,754	-	109,883,287	5,280,533	
LIFFE FTSE	215,412,280	-	222,125,716	6,713,436	-	-	-	-	
SPI 200	43,912,611	-	45,493,819	1,581,208	32,867,896	-	33,075,504	207,608	
合計	1,598,710,625	-	1,656,392,081	57,681,456	1,221,998,143	-	1,267,731,977	45,733,834	

## 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はありません。

### (通貨関連)

種類	平成27年10月20日現在				平成28年 4月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超				うち1年超			
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	19,206,500	-	19,200,450	6,050	7,637,700	-	7,643,300	5,600
米ドル	10,757,700	-	10,757,700	0	7,637,700	-	7,643,300	5,600
ユーロ	4,748,800	-	4,742,150	6,650	-	-	-	-
英ポンド	3,700,000	-	3,700,600	600	-	-	-	-
合計	19,206,500	-	19,200,450	6,050	7,637,700	-	7,643,300	5,600

## 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	1,329	50.53	67,154.37	
	ANTERO RESOURCES CORPORATION	240	27.91	6,698.40	
	APACHE CORP	1,069	55.02	58,816.38	
	BAKER HUGHES INC	1,141	46.50	53,056.50	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,174	23.48	27,565.52	
	CHENIERE ENERGY INC	699	37.12	25,946.88	
	CHEVRON CORP	4,924	100.50	494,862.00	
	CIMAREX ENERGY CO	264	108.00	28,512.00	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	927	25.37	23,517.99	
	CONCHO RESOURCES INC	351	110.03	38,620.53	
	CONOCOPHILLIPS	3,230	47.06	152,003.80	
	CONTINENTAL RESOURCES INC	289	36.68	10,600.52	
	CORE LABORATORIES NV	136	116.87	15,894.32	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,116	33.62	37,519.92	
	EOG RESOURCES INC	1,438	79.13	113,788.94	
	EQT CORPORATION	436	68.80	29,996.80	
	EXXON MOBIL CORP	10,891	86.21	938,913.11	
	FMC TECHNOLOGIES INC	641	29.52	18,922.32	
	HALLIBURTON CO	2,239	40.04	89,649.56	
	HELMERICH & PAYNE INC	336	63.06	21,188.16	
	HESS CORPORATION	749	61.17	45,816.33	
	HOLLYFRONTIER CORPORATION	578	34.83	20,131.74	
	KINDER MORGAN INC	4,963	19.16	95,091.08	
	MARATHON OIL CORP	1,933	13.95	26,965.35	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	1,394	38.33	53,432.02	
	MURPHY OIL CORPORATION	496	30.47	15,113.12	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,072	29.22	31,323.84		
NOBLE ENERGY INC	1,154	34.34	39,628.36		

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,998	74.86	149,570.28
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	285	34.07	9,709.95
ONEOK INC	672	34.39	23,110.08
PHILLIPS 66	1,396	86.42	120,642.32
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	421	152.17	64,063.57
PLAINS GP HOLDINGS LP	627	9.16	5,743.32
RANGE RESOURCES CORP	524	38.28	20,058.72
SCHLUMBERGER LIMITED	3,703	79.64	294,906.92
SOUTHWESTERN ENERGY CO	1,224	10.63	13,011.12
SPECTRA ENERGY CORPORATION	1,757	30.79	54,098.03
TESORO CORPORATION	344	83.44	28,703.36
VALERO ENERGY CORP	1,260	60.11	75,738.60
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	2,157	8.02	17,299.14
WILLIAMS COS INC	2,030	18.01	36,560.30
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	535	149.20	79,822.00
AIRGAS INC	170	141.75	24,097.50
ALBEMARLE CORPORATION	350	65.34	22,869.00
ALCOA INC	3,537	10.53	37,244.61
ASHLAND INC	205	114.56	23,484.80
AVERY DENNISON CORPORATION	283	73.39	20,769.37
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	333	30.33	10,099.89
BALL CORPORATION	381	74.99	28,571.19
CELANESE CORP-SERIES A	384	69.74	26,780.16
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	705	33.70	23,758.50
CROWN HOLDINGS INC	408	52.03	21,228.24
DOW CHEMICAL	2,942	53.05	156,073.10
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	2,293	65.68	150,604.24
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	434	76.70	33,287.80
ECOLAB INC	695	116.04	80,647.80
FMC CORPORATION	414	41.81	17,309.34
FREEPORT-MCMORAN INC	3,229	12.01	38,780.29
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	252	122.28	30,814.56
INTERNATIONAL PAPER CO	1,030	42.92	44,207.60
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	999	91.10	91,008.90
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	166	167.60	27,821.60
MONSANTO CO	1,151	93.27	107,353.77
NEWMONT MINING CORP	1,504	30.91	46,488.64
NUCOR CORP	893	50.46	45,060.78
PACKAGING CORPORATION OF AMERICA	288	63.09	18,169.92
PPG INDUSTRIES INC	704	116.55	82,051.20
PRAXAIR INC	745	118.82	88,520.90
SEALED AIR CORPORATION	517	50.80	26,263.60

THE MOSAIC COMPANY	995	28.22	28,078.90
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	221	298.30	65,924.30
VULCAN MATERIALS CO	349	107.81	37,625.69
WESTLAKE CHEMICAL CORPORATION	145	49.33	7,152.85
WESTROCK COMPANY	734	39.79	29,205.86
WR GRACE & CO	185	77.22	14,285.70
3M CO	1,611	169.65	273,306.15
ACUITY BRANDS INC	125	259.54	32,442.50
AERCAP HOLDINGS NV	248	40.50	10,044.00
AGCO CORPORATION	232	52.26	12,124.32
AMETEK INC	679	50.99	34,622.21
B/E AEROSPACE INC	366	48.79	17,857.14
BOEING CO	1,665	132.68	220,912.20
CATERPILLAR INC	1,523	80.39	122,433.97
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	303	36.41	11,032.23
CUMMINS INC	441	117.75	51,927.75
DANAHER CORP	1,614	94.83	153,055.62
DEERE & CO	871	82.36	71,735.56
DOVER CORP	437	67.97	29,702.89
EATON CORPORATION PLC	1,211	62.77	76,014.47
EMERSON ELECTRIC CO	1,713	55.65	95,328.45
FASTENAL CO	770	45.74	35,219.80
FLOWERVE CORP	424	46.02	19,512.48
FLUOR CORP	370	53.60	19,832.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	465	58.37	27,142.05
GENERAL DYNAMICS CORP	703	136.69	96,093.07
GENERAL ELECTRIC CO(US)	24,692	31.15	769,155.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,916	115.80	221,872.80
ILLINOIS TOOL WORKS	856	105.67	90,453.52
INGERSOLL-RAND PLC	683	63.88	43,630.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	376	42.96	16,152.96
JARDINE MATHESON HLDGS LIMITED	600	58.49	35,094.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	224	123.21	27,599.04
LOCKHEED MARTIN CORP	724	226.51	163,993.24
MASCO CORP	1,033	32.40	33,469.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	453	201.59	91,320.27
PACCAR INC	925	56.12	51,911.00
PARKER HANNIFIN CORP	356	114.05	40,601.80
PENTAIR PLC	503	56.26	28,298.78
QUANTA SERVICES INC	605	22.89	13,848.45
RAYTHEON COMPANY	788	126.26	99,492.88
ROCKWELL AUTOMATION INC	378	116.19	43,919.82

ROCKWELL COLLINS INC.	372	93.69	34,852.68
ROPER TECHNOLOGIES INC	282	179.75	50,689.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	498	38.72	19,282.56
SNAP-ON INC	170	161.60	27,472.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	392	109.06	42,751.52
TEXTRON INC	716	38.05	27,243.80
TRANSDIGM GROUP INC	155	227.05	35,192.75
UNITED RENTALS INC	256	61.15	15,654.40
UNITED TECHNOLOGIES CORP	2,205	105.00	231,525.00
WABCO HOLDINGS INC	159	111.65	17,752.35
WABTEC CORPORATION	299	81.54	24,380.46
WW GRAINGER INC	148	230.26	34,078.48
XYLEM INC	565	42.71	24,131.15
CINTAS CORPORATION	262	90.47	23,703.14
DUN & BRADSTREET CORP	112	108.65	12,168.80
EQUIFAX INC	330	116.41	38,415.30
IHS INC-CLASS A	212	123.73	26,230.76
MANPOWER GROUP	229	84.10	19,258.90
NIELSEN HOLDINGS PLC	977	53.96	52,718.92
REPUBLIC SERVICES INC	725	46.45	33,676.25
ROBERT HALF INTL INC	423	45.12	19,085.76
STERICYCLE INC	222	125.37	27,832.14
THE ADT CORPORATION	432	41.78	18,048.96
TYCO INTERNATIONAL PLC	1,178	36.73	43,267.94
VERISK ANALYTICS INC	421	78.60	33,090.60
WASTE CONNECTIONS INC	320	64.61	20,675.20
WASTE MANAGEMENT INC	1,168	57.13	66,727.84
AMERCO	22	353.48	7,776.56
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	512	41.34	21,166.08
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	410	75.23	30,844.30
CSX CORP	2,551	26.41	67,371.91
DELTA AIR LINES INC	573	46.87	26,856.51
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	488	49.82	24,312.16
FEDEX CORP	702	168.27	118,125.54
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,115	8.92	9,945.80
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	291	88.46	25,741.86
KANSAS CITY SOUTHERN	286	96.02	27,461.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	781	82.77	64,643.37
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	469	47.13	22,103.97
UNION PACIFIC CORP	2,235	82.24	183,806.40
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	287	58.05	16,660.35
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,821	106.84	194,555.64

AUTOLIV INC	246	115.69	28,459.74
BORGWARNER INC	707	38.51	27,226.57
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	794	76.77	60,955.38
FORD MOTOR CO	9,688	13.44	130,206.72
GENERAL MOTORS CO	3,701	31.97	118,320.97
HARLEY-DAVIDSON INC	585	45.78	26,781.30
JOHNSON CONTROLS INC	1,695	39.20	66,444.00
LEAR CORPORATION	224	112.11	25,112.64
TESLA MOTORS INC	279	247.37	69,016.23
THE GOODYEAR TIRE & RUBBER COMPANY	787	32.15	25,302.05
COACH INC	726	40.07	29,090.82
DR HORTON INC	927	31.28	28,996.56
GARMIN LIMITED	374	42.60	15,932.40
HANESBRANDS INC	1,025	28.28	28,987.00
HARMAN INTERNATIONAL	200	84.62	16,924.00
HASBRO INC	315	87.02	27,411.30
LEGGETT & PLATT INC	409	47.50	19,427.50
LENNAR CORPORATION-CLASS A	508	47.32	24,038.56
LULULEMON ATHLETICA INC	334	66.48	22,204.32
MATTEL INC	977	33.91	33,130.07
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	558	51.98	29,004.84
MOHAWK INDUSTRIES INC	164	197.89	32,453.96
NEWELL BRANDS INC	1,237	44.87	55,504.19
NIKE INC -CL B	3,548	59.56	211,318.88
POLARIS INDUSTRIES INC	196	94.38	18,498.48
PULTEGROUP INC	962	18.66	17,950.92
PVH CORPORATION	256	95.25	24,384.00
RALPH LAUREN CORPORATION	191	94.81	18,108.71
TOLL BROTHERS INC	479	29.38	14,073.02
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	504	43.95	22,150.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	504	43.00	21,672.00
VF CORP	955	64.40	61,502.00
WHIRLPOOL CORP	205	190.15	38,980.75
ARAMARK	583	34.06	19,856.98
CARNIVAL CORP(US)	1,167	50.60	59,050.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	87	455.18	39,600.66
DARDEN RESTAURANTS INC	329	63.19	20,789.51
H&R BLOCK INC	659	24.00	15,816.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	1,450	22.31	32,349.50
LAS VEGAS SANDS CORP	1,122	52.50	58,905.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	538	67.81	36,481.78
MCDONALD'S CORP	2,402	128.86	309,521.72

MELCO CROWN ENTERTAINMENT LTD-ADR	266	16.69	4,439.54
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,287	23.03	29,639.61
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	403	51.50	20,754.50
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	494	79.19	39,119.86
STARBUCKS CORP	3,885	60.90	236,596.50
STARWOOD HOTELS & RESORTS	501	80.25	40,205.25
WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	304	77.29	23,496.16
WYNN RESORTS LTD	254	99.99	25,397.46
YUM! BRANDS INC	1,128	82.13	92,642.64
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	559	33.56	18,760.04
CBS CORP-CLASS B	1,135	54.96	62,379.60
CHARTER COMMUNICATION INC-A	238	204.63	48,701.94
COMCAST CORP-CL A	6,496	62.28	404,570.88
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	848	27.68	23,472.64
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	450	28.34	12,753.00
DISH NETWORK CORPORATION-A	588	47.32	27,824.16
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	1,160	23.41	27,155.60
LIBERTY BRAVES GROUP-A	27	18.05	487.35
LIBERTY BRAVES GROUP-C	57	17.50	997.50
LIBERTY GLOBAL PLC-A	770	38.75	29,837.50
LIBERTY GLOBAL PLC-C	1,562	37.95	59,277.90
LIBERTY MEDIA GROUP-A	69	19.03	1,313.07
LIBERTY MEDIA GROUP-C	143	18.02	2,576.86
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	276	32.53	8,978.28
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	573	32.07	18,376.11
NEWS CORPRATION-CLASS A	1,325	12.54	16,615.50
OMNICOM GROUP	634	84.74	53,725.16
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE INC	240	63.75	15,300.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	5,455	3.92	21,410.87
TEGNA INC	632	24.30	15,357.60
THE WALT DISNEY CO.	4,109	102.64	421,747.76
TIME WARNER INC	2,092	74.84	156,565.28
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	3,063	30.30	92,808.90
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	1,227	30.04	36,859.08
VIACOM INC-CLASS B	974	35.64	34,713.36
ADVANCE AUTO PARTS INC	192	160.79	30,871.68
AMAZON.COM INC	1,042	627.90	654,271.80
AUTONATION INC	255	48.23	12,298.65
AUTOZONE INC	80	777.43	62,194.40
BED BATH & BEYOND INC	481	48.02	23,097.62
BEST BUY CO INC	811	32.90	26,681.90
CARMAX INC	588	54.33	31,946.04

DICK'S SPORTING GOODS INC	278	47.03	13,074.34
DOLLAR GENERAL CORPORATION	823	83.49	68,712.27
DOLLAR TREE INC	626	82.72	51,782.72
EXPEDIA INC	318	107.56	34,204.08
FOOT LOCKER INC	418	61.76	25,815.68
GAMESTOP CORP-CLASS A	301	32.45	9,767.45
GAP INC/THE	708	23.96	16,963.68
GENUINE PARTS CO	424	96.88	41,077.12
HOME DEPOT INC	3,317	135.44	449,254.48
KOHL'S CORP	591	44.85	26,506.35
L BRANDS INC	646	79.33	51,247.18
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	1,162	26.32	30,583.84
LKQ CORPORATION	799	33.35	26,646.65
LOWE'S COS INC	2,399	76.41	183,307.59
MACY'S INC	822	41.15	33,825.30
NETFLIX INC	1,062	94.34	100,189.08
NORDSTROM INC	443	52.51	23,261.93
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	258	274.31	70,771.98
PRICELINE GROUP INC/THE	130	1,345.78	174,951.40
ROSS STORES INC	1,068	57.53	61,442.04
SIGNET JEWELERS LTD	237	111.89	26,517.93
STAPLES INC	1,905	11.03	21,012.15
TARGET CORP	1,531	83.98	128,573.38
TIFFANY & CO	402	71.76	28,847.52
TJX COMPANIES INC	1,752	77.72	136,165.44
TRACTOR SUPPLY COMPANY	351	89.63	31,460.13
TRIPADVISOR INC	337	64.54	21,749.98
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	159	204.04	32,442.36
COSTCO WHOLESALE CORP	1,144	153.68	175,809.92
CVS HEALTH CORPORATION	2,897	103.46	299,723.62
KROGER CO	2,419	36.23	87,640.37
RITE AID CORPORATION	2,901	8.04	23,324.04
SYSCO CORP	1,477	46.98	69,389.46
WAL-MART STORES INC	4,194	69.77	292,615.38
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,279	81.84	186,513.36
WHOLE FOODS MARKET INC	893	30.23	26,995.39
ALTRIA GROUP INC	5,130	61.71	316,572.30
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,561	38.23	59,677.03
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	337	96.61	32,557.57
BUNGE LIMITED	429	59.19	25,392.51
CAMPBELL SOUP COMPANY	526	61.82	32,517.32
COCA-COLA CO/THE	10,809	46.60	503,699.40

COCA-COLA ENTERPRISES INC	622	53.78	33,451.16
CONAGRA FOODS INC	1,200	45.29	54,348.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	481	157.30	75,661.30
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	539	89.59	48,289.01
GENERAL MILLS INC	1,564	62.38	97,562.32
HERSHEY CO/THE	423	94.56	39,998.88
HORMEL FOODS CORPORATION	816	39.47	32,207.52
KELLOGG COMPANY	695	77.60	53,932.00
KRAFT HEINZ CO/THE	1,587	78.30	124,262.10
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	325	94.99	30,871.75
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	516	84.24	43,467.84
MOLSON COORS BREWING CO-B	486	97.75	47,506.50
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	4,158	43.26	179,875.08
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	402	129.31	51,982.62
PEPSICO INC	3,812	104.32	397,667.84
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	4,053	99.28	402,381.84
REYNOLDS AMERICAN INC	2,245	48.71	109,353.95
THE JM SMUCKER COMPANY	316	129.53	40,931.48
TYSON FOODS INC-CL A	773	65.32	50,492.36
WHITEWAVE FOODS COMPANY	521	39.99	20,834.79
CHURCH & DWIGHT CO INC	366	94.26	34,499.16
CLOROX COMPANY	359	126.56	45,435.04
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,229	71.66	159,730.14
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	193	85.04	16,412.72
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	582	96.95	56,424.90
KIMBERLY-CLARK CORP	950	137.11	130,254.50
PROCTER & GAMBLE CO	7,118	83.28	592,787.04
ABBOTT LABORATORIES	3,903	43.85	171,146.55
AETNA INC	912	111.47	101,660.64
AMERISOURCEBERGEN CORP	511	89.49	45,729.39
ANTHEM INC	683	144.40	98,625.20
BARD (C.R.) INC	209	208.79	43,637.11
BAXTER INTERNATIONAL INC.	1,431	43.37	62,062.47
BECTON DICKINSON & CO	551	157.99	87,052.49
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,767	19.67	74,096.89
CARDINAL HEALTH INC	861	85.59	73,692.99
CENTENE CORPORATION	335	59.15	19,815.25
CERNER CORPORATION	870	58.04	50,494.80
CIGNA CORP	674	139.87	94,272.38
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	442	74.94	33,123.48
DENTSPLY SIRONA INC	632	61.03	38,570.96
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	604	106.08	64,072.32

ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	537	21.98	11,803.26
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	1,769	72.35	127,987.15
HCA HOLDINGS INC	853	79.78	68,052.34
HENRY SCHEIN INC	233	171.70	40,006.10
HOLOGIC INC	671	36.62	24,572.02
HUMANA INC	388	174.77	67,810.76
IMS HEALTH HOLDINGS INC	459	26.74	12,273.66
INTUITIVE SURGICAL INC	104	623.71	64,865.84
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	300	118.99	35,697.00
MCKESSON CORP	602	175.84	105,855.68
MEDNAX INC	262	68.64	17,983.68
MEDTRONIC PLC	3,698	78.11	288,850.78
PATTERSON COMPANIES INC	259	45.22	11,711.98
QUEST DIAGNOSTICS	401	74.37	29,822.37
RESMED INC	433	59.67	25,837.11
ST JUDE MEDICAL INC	740	58.60	43,364.00
STRYKER CORP	885	109.73	97,111.05
THE COOPER COS INC	150	157.45	23,617.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,494	130.50	325,467.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	239	125.75	30,054.25
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	253	85.12	21,535.36
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	483	113.84	54,984.72
ABBVIE INC	4,277	60.17	257,347.09
AGILENT TECHNOLOGIES INC	971	41.40	40,199.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	590	155.44	91,709.60
ALKERMES PLC	454	40.45	18,364.30
ALLERGAN PLC	1,031	225.67	232,665.77
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	221	66.81	14,765.01
AMGEN INC	1,974	162.10	319,985.40
BAXALTA INC	1,579	41.26	65,149.54
BIOGEN INC	583	271.00	157,993.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	450	86.37	38,866.50
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,365	68.91	300,792.15
CELGENE CORP	2,056	106.53	219,025.68
ELI LILLY & CO	2,609	77.25	201,545.25
ENDO INTERNATIONAL PLC	549	28.75	15,783.75
GILEAD SCIENCES INC	3,771	99.44	374,988.24
ILLUMINA INC	405	136.88	55,436.40
INCYTE CORP	454	76.77	34,853.58
IONIS PHARMACEUTICALS INC	367	42.51	15,601.17
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	177	149.52	26,465.04
JOHNSON & JOHNSON	7,239	112.68	815,690.52

MALLINCKRODT PLC	361	61.86	22,331.46
MEDIVATION INC	482	52.15	25,136.30
MERCK & CO. INC.	7,309	56.86	415,589.74
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	77	362.18	27,887.86
MYLAN NV	1,167	47.77	55,747.59
PERRIGO CO PLC	406	130.62	53,031.72
PFIZER INC	16,152	32.89	531,239.28
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	267	69.74	18,620.58
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	200	413.78	82,756.00
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	20	147.40	2,948.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,044	145.59	151,995.96
UNITED THERAPEUTICS CORPORATION	135	114.89	15,510.15
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	685	83.21	56,998.85
WATERS CORP	214	136.62	29,236.68
ZOETIS INC	1,324	48.56	64,293.44
BANK OF AMERICA CORPORATION	27,242	14.45	393,646.90
BB&T CORPORATION	2,115	34.71	73,411.65
CIT GROUP INC	569	33.54	19,084.26
CITIGROUP INC	7,794	45.63	355,640.22
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	1,474	23.10	34,049.40
COMERICA INC	526	41.64	21,902.64
FIFTH THIRD BANCORP	2,276	18.11	41,218.36
FIRST REPUBLIC BANK/CA	408	71.32	29,098.56
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,272	10.11	22,969.92
JPMORGAN CHASE & CO	9,631	63.32	609,834.92
KEYCORP	2,498	11.98	29,926.04
M & T BANK CORP	402	117.85	47,375.70
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	1,457	15.95	23,239.15
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	1,060	16.35	17,331.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,329	86.27	114,652.83
REGIONS FINANCIAL CORP	3,927	8.98	35,264.46
SIGNATURE BANK	142	146.89	20,858.38
SUNTRUST BANKS INC	1,450	39.24	56,898.00
US BANCORP	4,576	41.91	191,780.16
WELLS FARGO & COMPANY	12,695	49.88	633,226.60
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	173	172.68	29,873.64
ALLY FINANCIAL INC	1,200	17.99	21,588.00
AMERICAN EXPRESS CO	2,189	63.57	139,154.73
AMERIPRISE FINANCIAL INC	456	96.84	44,159.04
BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	2,859	38.84	111,043.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,103	145.95	452,882.85
BLACKROCK INC	322	364.66	117,420.52

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,392	72.80	101,337.60
CME GROUP INC	841	92.62	77,893.42
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,118	52.55	58,750.90
E*TRADE FINANCIAL CORP	846	24.49	20,718.54
EATON VANCE CORPORATION	429	35.50	15,229.50
FRANKLIN RESOURCES INC	1,131	40.40	45,692.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,004	162.65	163,300.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	309	242.10	74,808.90
INVESCO LIMITED	1,210	31.79	38,465.90
LEGG MASON INC	296	34.53	10,220.88
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,100	16.98	18,678.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	707	103.14	72,919.98
MOODY'S CORP	466	99.59	46,408.94
MORGAN STANLEY	3,799	26.46	100,521.54
MSCI INC	255	75.93	19,362.15
NASDAQ INC	347	64.17	22,266.99
NAVIENT CORPORATION	1,179	12.95	15,268.05
NORTHERN TRUST CORP	623	71.84	44,756.32
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	396	48.31	19,130.76
SEI INVESTMENTS COMPANY	397	46.23	18,353.31
STATE STREET CORP	1,056	60.26	63,634.56
SYNCHRONY FINANCIAL	2,330	29.82	69,480.60
T ROWE PRICE GROUP INC	657	77.72	51,062.04
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	845	30.98	26,178.10
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	3,100	28.77	89,187.00
VOYA FINANCIAL INC	639	31.84	20,345.76
AFLAC INC	1,116	67.56	75,396.96
ALLEGHANY CORPORATION	50	512.93	25,646.50
ALLSTATE CORP	1,013	67.53	68,407.89
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,236	55.72	180,309.92
AON PLC	717	105.19	75,421.23
ARCH CAPITAL GROUP LTD	342	71.15	24,333.30
ARTHUR J GALLAGHER & CO	477	45.33	21,622.41
ASSURANT INC	218	81.52	17,771.36
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	252	55.50	13,986.00
CHUBB LIMITED	1,206	122.02	147,156.12
CINCINNATI FINANCIAL CORP	407	66.02	26,870.14
EVEREST RE GROUP LTD	113	197.89	22,361.57
FNF GROUP	777	32.80	25,485.60
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,072	46.08	49,397.76
LINCOLN NATIONAL CORP	753	41.78	31,460.34
LOEWS CORPORATION	742	39.74	29,487.08

MARKEL CORPORATION	39	914.17	35,652.63
MARSH & MCLENNAN COS	1,365	63.32	86,431.80
METLIFE INC	2,472	45.62	112,772.64
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	828	42.22	34,958.16
PROGRESSIVE CORP	1,529	33.75	51,603.75
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,175	77.50	91,062.50
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	120	117.21	14,065.20
TORCHMARK CORPORATION	400	56.32	22,528.00
TRAVELERS COS INC/THE	796	116.27	92,550.92
UNUM GROUP	701	33.12	23,217.12
WILLIS TOWERS WATSON PLC	342	121.68	41,614.56
WR BERKLEY CORP	295	56.76	16,744.20
XL GROUP PLC	802	36.68	29,417.36
CBRE GROUP INC	872	30.62	26,700.64
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,643	6.45	10,597.35
JONES LANG LASALLE INCORPORATED	130	120.85	15,710.50
REALOGY HOLDINGS CORPORATION	500	36.04	18,020.00
ACCENTURE PLC	1,635	115.10	188,188.50
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,339	35.21	47,146.19
ADOBE SYSTEMS INC	1,305	96.52	125,958.60
AKAMAI TECHNOLOGIES	519	51.35	26,650.65
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	160	211.62	33,859.20
ALPHABET INC-CL A	762	776.25	591,502.50
ALPHABET INC-CL C	814	753.93	613,699.02
ANSYS INC	233	90.94	21,189.02
AUTODESK INC	632	59.13	37,370.16
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,207	90.74	109,523.18
CA INC	861	30.30	26,088.30
CDK GLOBAL INC	398	47.66	18,968.68
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	189	88.88	16,798.32
CITRIX SYSTEMS INC	402	80.14	32,216.28
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	1,591	59.85	95,221.35
EBAY INC	2,827	24.30	68,696.10
ELECTRONIC ARTS INC	813	66.19	53,812.47
FACEBOOK INC-A	5,940	112.29	667,002.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	796	65.49	52,130.04
FISERV INC	598	100.74	60,242.52
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	205	152.07	31,174.35
FORTINET INC	406	30.02	12,188.12
GARTNER INC	259	89.03	23,058.77
GLOBAL PAYMENTS INC	360	76.60	27,576.00
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	2,411	144.00	347,184.00

INTUIT INC	656	103.92	68,171.52
LINKEDIN CORPORATION-A	310	115.42	35,780.20
MASTERCARD INC.-CLASS A	2,591	97.24	251,948.84
MICROSOFT CORP	19,854	56.39	1,119,567.06
MOBILEYE NV	227	40.01	9,082.27
NETSUITE INC	107	71.57	7,657.99
NUANCE COMMUNICATIONS INC	692	19.21	13,293.32
ORACLE CORPORATION	8,368	41.06	343,590.08
PAYCHEX INC	918	53.56	49,168.08
PAYPAL HOLDINGS INC	2,877	39.24	112,893.48
RED HAT INC	515	75.04	38,645.60
SABRE CORPORATION	498	28.51	14,197.98
SALESFORCE COM INC	1,650	76.19	125,713.50
SERVICENOW INC	460	63.67	29,288.20
SPLUNK INC	379	48.73	18,468.67
SYMANTEC CORP	1,767	18.13	32,035.71
SYNOPSYS INC	484	49.24	23,832.16
TABLEAU SOFTWARE INC	140	47.00	6,580.00
TERADATA CORPORATION	426	25.12	10,701.12
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	520	50.81	26,421.20
TWITTER INC	1,606	16.92	27,173.52
VANTIV INC-CLASS A	461	55.31	25,497.91
VERISIGN INC	285	88.79	25,305.15
VISA INC-CLASS A SHARES	5,092	80.75	411,179.00
VMWARE INC-CLASS A	242	51.46	12,453.32
WESTERN UNION COMPANY	1,498	20.12	30,139.76
WORKDAY INC-CLASS A	310	75.38	23,367.80
XEROX CORPORATION	2,384	11.23	26,772.32
YAHOO! INC	2,347	36.33	85,266.51
ZILLOW GROUP INC-C	280	22.28	6,238.40
AMPHENOL CORPORATION-CL A	868	58.31	50,613.08
APPLE INC	14,587	106.91	1,559,496.17
ARROW ELECTRONICS INC	301	64.71	19,477.71
AVNET INC	404	44.21	17,860.84
CDW CORPORATION	403	42.86	17,272.58
CISCO SYSTEMS INC	13,281	28.33	376,250.73
CORNING INC	3,095	20.93	64,778.35
EMC CORP/MASSACHUSETTS	5,073	25.55	129,615.15
F5 NETWORKS INC	229	95.76	21,929.04
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	1,583	12.26	19,407.58
FLIR SYSTEMS INC	473	32.97	15,594.81
HARRIS CORPORATION	325	78.79	25,606.75

HEWLETT PACKARD ENTERPRISE COMPANY	4,722	17.24	81,407.28
HEWLETT-PACKARD COMPANY	5,107	12.78	65,267.46
JUNIPER NETWORKS INC	998	23.47	23,423.06
MOTOROLA SOLUTIONS INC	444	75.97	33,730.68
NETAPP INC	765	24.44	18,696.60
PALO ALTO NETWORKS INC	213	140.28	29,879.64
SANDISK CORP	584	75.81	44,273.04
SEAGATE TECHNOLOGY	892	25.33	22,594.36
TE CONNECTIVITY LIMITED	1,011	63.69	64,390.59
TRIMBLE NAVIGATION LIMITED	655	25.27	16,551.85
WESTERN DIGITAL CORPORATION	686	41.32	28,345.52
AT&T INC	16,095	38.92	626,417.40
CENTURYLINK INC	1,436	32.71	46,971.56
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	3,419	5.68	19,419.92
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	868	53.98	46,854.64
SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	364	101.86	37,077.04
SPRINT CORPORATION	2,709	3.68	9,969.12
T-MOBILE US INC	750	39.84	29,883.75
VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,645	52.08	554,391.60
AES CORP	1,760	11.50	20,240.00
AGL RESOURCES INC	335	65.83	22,053.05
ALLIANT ENERGY CORP	297	73.21	21,743.37
AMEREN CORPORATION	635	49.12	31,191.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,284	65.84	84,538.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	523	72.20	37,760.60
ATMOS ENERGY CORPORATION	267	74.04	19,768.68
CALPINE CORPORATION	1,200	15.73	18,876.00
CENTERPOINT ENERGY INC	1,148	21.00	24,108.00
CMS ENERGY CORPORATION	727	41.79	30,381.33
CONSOLIDATED EDISON INC	823	76.01	62,556.23
DOMINION RESOURCES INC/VA	1,558	72.82	113,453.56
DTE ENERGY COMPANY	470	89.55	42,088.50
DUKE ENERGY CORPORATION	1,801	79.79	143,701.79
EDISON INTERNATIONAL	852	71.42	60,849.84
ENERGY CORP	504	76.43	38,520.72
EVERSOURCE ENERGY	892	57.04	50,879.68
EXELON CORP	2,509	34.80	87,313.20
FIRSTENERGY CORP	1,107	35.50	39,298.50
NEXTERA ENERGY INC	1,205	118.10	142,310.50
NRG ENERGY INC	989	14.31	14,152.59
OGE ENERGY CORPORATION	522	28.69	14,976.18
P G & E CORPORATION	1,349	59.58	80,373.42

	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	290	74.85	21,706.50
	PPL CORPORATION	1,874	37.80	70,837.20
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	1,324	47.12	62,386.88
	SCANA CORPORATION	421	69.88	29,419.48
	SEMPRA ENERGY	661	104.21	68,882.81
	SOUTHERN CO	2,378	51.00	121,278.00
	TECO ENERGY INC	615	27.78	17,084.70
	WEC ENERGY GROUP INC	887	59.14	52,457.18
	XCEL ENERGY INC	1,328	41.16	54,660.48
	ANALOG DEVICES INC	881	58.23	51,300.63
	APPLIED MATERIALS INC	3,141	21.20	66,589.20
	BROADCOM LTD	1,016	151.07	153,487.12
	INTEL CORP	12,346	31.60	390,133.60
	KLA-TENCOR CORPORATION	408	73.12	29,832.96
	LAM RESEARCH CORP	414	82.77	34,266.78
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	626	44.35	27,763.10
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,274	9.80	12,485.20
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	842	35.88	30,210.96
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	600	48.52	29,112.00
	MICRON TECHNOLOGY INC	3,039	10.72	32,578.08
	NVIDIA CORP	1,512	36.31	54,900.72
	NXP SEMICONDUCTORS NV	355	82.89	29,425.95
	QORVO INC	457	45.24	20,674.68
	QUALCOMM INC	3,933	51.83	203,847.39
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	537	72.23	38,787.51
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,654	58.42	155,046.68
	XILINX INC	723	45.90	33,185.70
	米ドル 建小計	843,865		49,630,138.85 (5,419,611,162)
カナダドル	ALTAGAS LIMITED	479	32.42	15,529.18
	ARC RESOURCES LIMITED	1,119	19.13	21,406.47
	CAMECO CORP (CA)	972	16.30	15,843.60
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	2,795	38.08	106,433.60
	CENOVUS ENERGY INC	2,296	17.97	41,259.12
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,193	21.08	25,148.44
	ENBRIDGE INC	2,285	53.56	122,384.60
	ENCANA CORP	2,496	8.97	22,389.12
	HUSKY ENERGY INC	1,225	17.42	21,339.50
	IMPERIAL OIL LTD	797	41.03	32,700.91
	INTER PIPELINE LIMITED	1,090	26.62	29,015.80
	KEYERA CORP	510	40.43	20,619.30
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	867	36.49	31,636.83

PEYTO EXPLORATION & DEVELOPMENT CORP	500	31.24	15,620.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	500	25.03	12,515.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	500	21.86	10,930.00
SUNCOR ENERGY INC	4,027	37.14	149,562.78
TOURMALINE OIL CORPORATION	600	28.14	16,884.00
TRANSCANADA CORPORATION	1,762	51.54	90,813.48
VERESEN INC	800	8.51	6,808.00
VERMILION ENERGY INC	354	38.19	13,519.26
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	731	52.56	38,421.36
AGRIUM INC	324	110.27	35,727.48
BARRICK GOLD CORP	3,016	20.70	62,431.20
CCL INDUSTRIES INC - CL B	100	233.77	23,377.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	2,400	4.90	11,760.00
FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	2,000	8.83	17,660.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	421	88.03	37,060.63
GOLDCORP INC	2,134	22.00	46,948.00
KINROSS GOLD CORP	3,830	5.82	22,290.60
METHANEX CORPORATION	234	42.73	9,998.82
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	2,094	22.72	47,575.68
SILVER WHEATON CORPORATION	1,209	23.41	28,302.69
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	1,897	13.34	25,305.98
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	2,700	3.75	10,125.00
WEST FRASER TIMBER CO LIMITED	200	44.40	8,880.00
YAMANA GOLD INC	3,000	5.58	16,740.00
BOMBARDIER INC 'B'	4,812	1.65	7,939.80
CAE INC	904	14.71	13,297.84
FINNING INTERNATIONAL INC	637	21.78	13,873.86
SNC-LAVALIN GROUP INC	441	47.22	20,824.02
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	300	39.05	11,715.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,006	81.42	163,328.52
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	441	189.95	83,767.95
LINAMAR CORPORATION	100	58.49	5,849.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,010	53.67	54,206.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	642	38.79	24,903.18
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	600	52.21	31,326.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,191	23.42	27,893.22
THOMSON REUTERS CORP(CA)	1,033	52.29	54,015.57
CANADIAN TIRE CORP -CL A	226	134.40	30,374.40
DOLLARAMA INC	300	90.65	27,195.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,115	57.99	64,658.85
EMPIRE COMPANY LIMITED A	450	20.98	9,441.00
GEORGE WESTON LIMITED	100	111.88	11,188.00

	JEAN COUTU GROUP INC A	300	20.72	6,216.00
	LOBLAW COMPANIES LTD	613	70.51	43,222.63
	METRO INC	613	42.00	25,746.00
	SAPUTO INC	700	39.33	27,531.00
	BANK OF MONTREAL	1,607	81.65	131,211.55
	BANK OF NOVA SCOTIA	3,093	64.33	198,972.69
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	992	99.77	98,971.84
	NATIONAL BANK OF CANADA	900	45.14	40,626.00
	ROYAL BANK OF CANADA	3,833	78.34	300,277.22
	TORONTO-DOMINION BANK(CA)	4,662	55.91	260,652.42
	CI FINANCIAL CORPORATION	783	27.69	21,681.27
	ELEMENT FINANCIAL CORPORATION	1,100	14.89	16,379.00
	IGM FINANCIAL INC	393	39.25	15,425.25
	ONEX CORPORATION	200	77.14	15,428.00
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	88	696.73	61,312.24
	GREAT-WEST LIFECO INC	800	35.88	28,704.00
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	442	40.15	17,746.30
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	300	92.49	27,747.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	4,960	18.61	92,305.60
	POWER CORP OF CANADA	1,129	30.34	34,253.86
	POWER FINANCIAL CORP	673	32.36	21,778.28
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,550	42.89	66,479.50
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,302	43.11	99,239.22
	FIRST CAPITAL REALTY INC	400	20.17	8,068.00
	CGI GROUP INC -CL A	577	61.63	35,560.51
	OPEN TEXT CORPORATION	289	70.19	20,284.91
	BLACKBERRY LIMITED	1,700	8.93	15,181.00
	BCE INC	436	59.65	26,007.40
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	983	49.27	48,432.41
	TELUS CORPORATION	44	40.25	1,771.00
	ATCO LIMITED	294	39.74	11,683.56
	CANADIAN UTILITIES LTD A	328	35.75	11,726.00
	FORTIS INC	800	40.17	32,136.00
	カナダドル 建小計	107,649		3,783,519.00 (325,382,634)
ユーロ	ENI SPA	6,538	13.67	89,374.46
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,261	11.89	14,993.29
	KONINKLIJKE VOPAK NV	230	44.71	10,284.45
	NESTE OYJ	420	29.90	12,558.00
	OMV AG	482	25.50	12,291.00
	REPSOL SA	2,983	10.91	32,559.44
	SAIPEM	15,652	0.37	5,831.93

TECHNIP S.A.	335	52.60	17,621.00
TENARIS SA	1,544	11.93	18,419.92
TOTAL SA	5,641	42.88	241,914.28
AIR LIQUIDE SA	884	105.00	92,820.00
AKZO NOBEL	670	63.75	42,712.50
ARCELORMITTAL	2,882	5.19	14,966.22
ARKEMA	214	71.01	15,196.14
BASF SE	2,361	69.99	165,246.39
CRH PLC(IE)	2,115	25.66	54,281.47
EVONIK INDUSTRIES AG	393	27.96	10,990.24
FUCHS PETROLUB SE-PREF	228	39.99	9,118.86
HEIDELBERGCEMENT AG	397	79.26	31,466.22
IMERYS SA	113	64.11	7,244.43
K+S AG	564	20.75	11,703.00
KONINKLIJKE DSM NV	466	52.72	24,567.52
LANXESS AG	300	45.77	13,732.50
LINDE AG	477	135.40	64,585.80
OCI NV	248	17.93	4,447.88
SOLVAY SA	194	90.64	17,584.16
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	1,799	7.65	13,771.34
SYMRISE AG	334	61.33	20,484.22
THYSSENKRUPP AG	1,079	21.42	23,112.18
UMICORE	245	45.93	11,254.07
UPM-KYMMENE OYJ	1,445	15.45	22,325.25
VOESTALPINE AG	367	31.25	11,468.75
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	573	28.19	16,155.73
AIRBUS GROUP SE	1,519	57.38	87,160.22
ALSTOM	394	23.21	9,144.74
ANDRITZ AG	238	49.55	11,792.90
BOSKALIS WESTMINSTER NV	282	36.36	10,253.52
BOUYGUES SA	549	30.98	17,008.02
BRENTAG AG	418	51.50	21,527.00
CNH INDUSTRIAL NV	3,097	6.36	19,712.40
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,225	40.37	49,453.25
FERROVIAL SA	1,362	19.04	25,939.29
FINMECCANICA SPA	1,323	11.06	14,632.38
GEA GROUP AG	495	42.67	21,121.65
KONE OYJ-B	914	43.13	39,420.82
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,579	25.14	64,836.06
LEGRAND SA	686	50.05	34,334.30
MAN SE	116	95.64	11,094.24
METSO OYJ	369	22.79	8,409.51

OSRAM LICHT AG	291	45.68	13,292.88
PRYSMIAN SPA	667	20.46	13,646.82
REXEL SA	912	12.25	11,172.00
SAFRAN SA	822	61.33	50,413.26
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,435	55.80	80,073.00
SIEMENS AG-REG	2,038	95.39	194,404.82
THALES SA	305	76.87	23,445.35
VINCI SA	1,295	66.18	85,703.10
WARTSILA OYJ-B SHARES	484	41.14	19,911.76
ZARDOYA OTIS SA	569	9.69	5,513.61
ZODIAC AEROSPACE	608	17.50	10,640.00
BUREAU VERITAS SA	723	20.95	15,146.85
EDENRED	674	18.87	12,721.75
RANDSTAD HOLDING NV	347	49.41	17,145.27
SOCIETE BIC SA	94	136.80	12,859.20
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,322	14.26	18,851.72
AENA SA	186	121.05	22,515.30
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	98	109.70	10,750.60
ATLANTIA SPA	1,162	24.45	28,410.90
BOLLORE	2,530	3.50	8,867.65
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	689	14.07	9,694.23
DEUTSCHE POST AG-REG	2,623	25.88	67,883.24
FRAPORT AG	121	53.86	6,517.06
GROUPE EUROTUNNEL SE	1,528	10.05	15,364.04
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	2,534	6.73	17,071.55
TNT EXPRESS NV	1,434	7.93	11,371.62
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	896	83.07	74,430.72
BMW-PFD	178	71.38	12,705.64
CONTINENTAL AG	298	199.65	59,495.70
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	2,475	65.64	162,459.00
FERRARI NV	253	39.30	9,942.90
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	2,531	7.10	17,970.10
MICHELIN (CGDE)-B	480	94.34	45,283.20
NOKIAN RENKAAT OYJ	371	32.16	11,931.36
PEUGEOT SA	1,280	14.30	18,304.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	442	45.37	20,055.75
RENAULT SA	494	90.00	44,460.00
VALEO SA	215	134.90	29,003.50
VOLKSWAGEN AG	97	129.05	12,517.85
VOLKSWAGEN AG-PFD	475	113.40	53,865.00
ADIDAS AG	538	108.60	58,426.80
CHRISTIAN DIOR SE	153	159.55	24,411.15

HERMES INTERNATIONAL	68	315.15	21,430.20
HUGO BOSS AG-ORD	175	61.04	10,682.00
KERING	195	161.90	31,570.50
LUXOTTICA GROUP SPA	475	48.36	22,971.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	718	153.45	110,177.10
ACCOR SA	565	38.92	21,989.80
PADDY POWER BETFAIR PLC	208	118.35	24,616.80
SODEXO	255	93.18	23,760.90
ALTICE NV - B	296	14.34	4,244.64
ALTICE SA-A	998	14.25	14,226.49
AXEL SPRINGER SE	130	50.68	6,588.40
EUTELSAT COMMUNICATIONS	504	27.54	13,880.16
JC DECAUX SA	220	39.37	8,662.50
LAGARDERE S.C.A.	386	24.25	9,360.50
NUMERICABLE GROUP	302	29.20	8,818.40
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	616	45.82	28,228.20
PUBLICIS GROUPE	545	66.38	36,177.10
RELX NV	2,694	15.83	42,659.49
RTL GROUP SA	127	73.93	9,389.11
SES	994	25.92	25,769.45
TELENET GROUP HOLDING NV	172	45.42	7,813.10
VIVENDI	3,148	18.51	58,285.22
WOLTERS KLUWER NV-CVA	850	36.02	30,621.25
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	2,804	29.52	82,788.10
ZALANDO SE	234	29.31	6,858.54
CARREFOUR SA	1,423	26.25	37,360.86
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	185	53.05	9,814.25
COLRUYT SA	230	52.11	11,985.30
DELHAIZE GROUP	281	93.79	26,354.99
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	2,022	5.02	10,150.44
JERONIMO MARTINS SGPS SA	823	14.94	12,295.62
KONINKLIJKE AHOLD NV	2,259	20.10	45,405.90
METRO AG	530	29.72	15,754.25
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	2,067	115.45	238,635.15
DANONE	1,515	64.52	97,747.80
HEINEKEN HOLDING NV	273	72.83	19,882.59
HEINEKEN NV	624	83.16	51,891.84
KERRY GROUP PLC-A	407	84.05	34,208.35
PERNOD-RICARD SA	546	102.30	55,855.80
REMY COINTREAU SA	80	75.11	6,008.80
BEIERSDORF AG	273	82.24	22,451.52
HENKEL AG & CO KGAA	309	90.79	28,054.11

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	482	104.05	50,152.10
L'OREAL	647	168.50	109,019.50
UNILEVER NV-CVA	4,187	41.50	173,760.50
ESSILOR INTERNATIONAL SA	556	111.15	61,799.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	592	80.00	47,360.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,033	66.42	68,611.86
BAYER AG	2,125	109.65	233,006.25
GRIFOLS SA	767	19.57	15,014.02
MERCK KGAA	381	79.29	30,209.49
ORION OYJ-CLASS B	327	30.34	9,921.18
QIAGEN NV	599	20.76	12,435.24
SANOFI	3,020	77.71	234,684.20
UCB SA	356	70.21	24,994.76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	16,363	6.01	98,456.17
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-R	115,136	0.03	3,914.62
BANCO DE SABADELL SA	14,526	1.61	23,474.01
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.00	0.00
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	1,184	6.04	7,151.36
BANCO POPULAR ESPANOL SA	4,978	2.35	11,743.10
BANCO SANTANDER SA	37,099	4.16	154,665.73
BANK OF IRELAND	85,435	0.24	20,931.57
BANKIA SA	15,058	0.83	12,588.48
BANKINTER SA	2,204	6.43	14,178.33
BNP PARIBAS	2,722	45.63	124,204.86
CAIXABANK	7,399	2.61	19,326.18
COMMERZBANK AG	3,163	8.45	26,746.32
CREDIT AGRICOLE SA	3,005	9.74	29,295.74
ERSTE GROUP BANK AG	756	25.59	19,346.04
ING GROEP NV-CVA	9,945	11.17	111,135.37
INTESA SANPAOLO	34,344	2.42	83,112.48
INTESA SANPAOLO-RSP	3,048	2.27	6,943.34
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
KBC GROEP NV	644	47.39	30,519.16
NATIXIS SA	3,056	4.72	14,436.54
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	384	13.88	5,329.92
SOCIETE GENERALE	1,964	34.23	67,227.72
UNICREDIT SPA	12,269	3.30	40,487.70
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	2,800	3.60	10,091.20
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	3,734	15.64	58,399.76
DEUTSCHE BOERSE AG	523	73.51	38,445.73
EURAZEO	131	63.01	8,254.31
EXOR SPA	322	32.12	10,342.64

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	264	78.14	20,628.96
MEDIOBANCA SPA	1,526	6.58	10,041.08
WENDEL	104	100.45	10,446.80
AEGON NV	5,225	5.14	26,882.62
AGEAS	606	35.38	21,443.31
ALLIANZ SE-REG	1,175	151.35	177,836.25
ASSICURAZIONI GENERALI	3,161	13.27	41,946.47
AXA	5,067	22.40	113,500.80
CNP ASSURANCES	562	14.93	8,390.66
HANNOVER RUECK SE	163	105.60	17,212.80
MAPFRE SA	3,020	2.20	6,668.16
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	429	183.30	78,635.70
NN GROUP NV	560	30.30	16,968.00
SAMPO OYJ-A SHS	1,210	43.13	52,187.30
SCOR SE	502	32.81	16,473.13
UNIPOLSAI SPA	2,976	2.03	6,065.08
DEUTSCHE WOHNEN AG	936	27.43	25,674.48
VONOVIA SE	1,311	30.97	40,608.22
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	1,128	39.70	44,787.24
ATOS SE	264	75.97	20,056.08
CAP GEMINI SA	468	81.55	38,165.40
DASSAULT SYSTEMES SA	346	71.95	24,894.70
GEMALTO NV	259	59.00	15,281.00
SAP SE	2,526	71.03	179,421.78
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	403	44.75	18,036.26
INGENICO GROUP	154	100.95	15,546.30
NOKIA OYJ	10,352	5.54	57,350.08
NOKIA OYJ	4,371	5.55	24,289.64
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	8,288	16.12	133,644.00
ELISA OYJ	465	34.80	16,182.00
ILIAD SA	68	190.60	12,960.80
KONINKLIJKE KPN NV	9,013	3.56	32,113.31
ORANGE	5,106	15.23	77,764.38
PROXIMUS	498	30.96	15,420.57
TELECOM ITALIA SPA	28,434	0.90	25,619.03
TELECOM ITALIA-RSP	19,696	0.72	14,190.96
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,945	4.71	9,172.62
TELEFONICA SA	11,583	9.75	113,026.91
E.ON SE	5,418	9.13	49,488.01
ELECTRICITE DE FRANCE	791	11.61	9,183.51
ENAGAS SA	664	27.28	18,117.24
ENDESA SA	986	17.59	17,348.67

	ENEL SPA	21,874	3.92	85,877.32
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	6,270	3.00	18,822.54
	ENGIE	3,755	14.25	53,508.75
	FORTUM OYJ	1,452	12.53	18,193.56
	GAS NATURAL SDG SA	948	18.00	17,064.00
	IBERDROLA SA	14,584	5.99	87,474.83
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	293	78.25	22,927.25
	RWE AG	1,423	12.53	17,830.19
	SNAM SPA	5,687	5.43	30,908.84
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	972	16.59	16,125.48
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	4,082	5.01	20,450.82
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,156	21.49	24,842.44
	ASML HOLDING NV	891	88.25	78,630.75
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,177	12.81	40,713.25
	STMICROELECTRONICS NV	2,084	5.22	10,884.73
	ユーロ 建小計	761,760		8,764,641.65 (1,087,341,443)
英ボンド	BP PLC	49,530	3.62	179,769.13
	PETROFAC LIMITED	856	9.20	7,875.20
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	10,659	18.00	191,915.29
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	10,716	18.08	193,798.86
	ANGLO AMERICAN PLC	3,610	7.52	27,165.25
	ANTOFAGASTA PLC	1,301	4.92	6,411.32
	BHP BILLITON PLC(UK)	5,439	9.64	52,459.15
	CRODA INTERNATIONAL PLC	350	30.76	10,766.00
	FRESNILLO PLC	729	10.63	7,749.27
	GLENCORE PLC	33,086	1.69	56,213.11
	JOHNSON MATTHEY PLC	498	29.06	14,471.88
	MONDI PLC	1,059	13.56	14,360.04
	RANDGOLD RESOURCES LIMITED	291	67.15	19,540.65
	REXAM PLC	1,768	6.33	11,191.44
	RIO TINTO PLC(UK)	3,257	23.33	75,985.81
	SOUTH32 LIMITED (GBP)	6,559	0.85	5,607.94
	ASHTREAD GROUP PLC	1,432	8.46	12,121.88
	BAE SYSTEMS PLC	8,149	5.17	42,171.07
	BUNZL PLC	863	20.94	18,071.22
	COBHAM PLC	3,755	2.10	7,919.29
	IMI PLC	896	9.75	8,740.48
	MEGGITT PLC	2,027	4.13	8,375.56
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,735	6.96	32,979.27
	SMITHS GROUP PLC	1,017	11.17	11,359.89
	THE WEIR GROUP PLC	704	11.96	8,419.84

TRAVIS PERKINS PLC	641	18.24	11,691.84
WOLSELEY PLC	670	38.86	26,036.20
AGGREKO PLC	845	11.07	9,354.15
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	828	9.89	8,188.92
CAPITA PLC	1,666	10.44	17,393.04
EXPERIAN PLC	2,541	12.90	32,778.90
G4S PLC	3,996	1.97	7,892.10
INTERTEK GROUP PLC	416	32.30	13,436.80
ROYAL MAIL PLC	2,144	4.90	10,516.32
GKN PLC	4,244	2.95	12,549.50
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,887	4.99	14,423.45
BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	351	28.82	10,115.82
BURBERRY GROUP PLC	1,298	12.92	16,770.16
PERSIMMON PLC	789	18.59	14,667.51
TAYLOR WIMPEY PLC	9,436	1.71	16,173.30
CARNIVAL PLC(UK)	474	36.69	17,391.06
COMPASS GROUP PLC	4,273	12.74	54,438.02
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	608	28.98	17,619.84
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	1,672	4.60	7,706.24
TUI AG	1,406	10.46	14,706.76
WHITBREAD PLC	468	37.95	17,760.60
WILLIAM HILL PLC	2,886	3.36	9,705.61
ITV PLC	9,864	2.38	23,515.77
PEARSON PLC	2,113	8.46	17,886.54
RELX PLC	2,892	13.19	38,145.48
SKY PLC	2,659	10.20	27,121.80
WPP PLC	3,355	16.78	56,296.90
DIXONS CARPHONE PLC	2,521	4.14	10,436.94
KINGFISHER PLC	5,990	3.63	21,767.66
MARKS & SPENCER GROUP PLC	4,122	4.34	17,922.45
NEXT PLC	374	54.40	20,345.60
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	889	3.98	3,541.77
SAINSBURY (J) PLC	4,101	2.92	11,995.42
TESCO PLC	20,954	1.81	38,094.37
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	6,930	1.93	13,430.34
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	917	34.13	31,297.21
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	5,041	42.81	215,805.21
COCA-COLA HBC AG-CDI	661	14.50	9,584.50
DIAGEO PLC	6,802	19.46	132,400.93
IMPERIAL BRANDS PLC	2,592	37.70	97,718.40
SABMILLER PLC	2,627	42.75	112,304.25
TATE & LYLE PLC	1,542	6.06	9,344.52

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,723	69.74	120,162.02
UNILEVER PLC	3,471	33.31	115,619.01
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	997	9.00	8,977.98
SMITH & NEPHEW PLC	2,303	11.93	27,474.79
ASTRAZENECA PLC	3,418	41.60	142,188.80
GLAXOSMITHKLINE PLC	13,161	15.01	197,546.61
SHIRE PLC	1,524	42.75	65,151.00
BARCLAYS PLC	45,422	1.67	76,218.11
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	52,961	4.54	240,469.42
LLOYDS BANKING GROUP PLC	154,403	0.67	104,762.43
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	8,332	2.43	20,246.76
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	8,208	5.41	44,479.15
3I GROUP PLC	2,505	4.82	12,079.11
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	3,034	3.15	9,578.33
HARGREAVES LANSDOWN PLC	782	13.75	10,752.50
ICAP PLC	1,818	4.71	8,566.41
INVESTEC PLC	1,821	5.29	9,642.19
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	805	27.60	22,218.00
PROVIDENT FINANCIAL PLC(UK)	368	30.19	11,109.92
SCHRODERS PLC	312	26.24	8,186.88
ADMIRAL GROUP PLC	639	19.50	12,460.50
AVIVA PLC	10,419	4.40	45,906.11
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	3,541	3.59	12,726.35
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	15,305	2.43	37,298.28
OLD MUTUAL PLC	12,354	1.96	24,238.54
PRUDENTIAL PLC	6,954	14.25	99,129.27
RSA INSURANCE GROUP PLC	2,619	4.70	12,314.53
ST JAMES'S PLACE PLC	1,348	9.19	12,388.12
STANDARD LIFE PLC	4,937	3.39	16,766.05
AUTO TRADER GROUP PLC	1,882	3.83	7,217.47
SAGE GROUP PLC (THE)	2,776	6.36	17,669.24
WORLDPAY GROUP PLC	2,975	2.71	8,062.25
BT GROUP PLC	22,898	4.51	103,292.87
INMARSAT PLC	1,127	10.05	11,326.35
VODAFONE GROUP PLC	71,806	2.32	166,841.24
CENTRICA PLC	12,812	2.37	30,402.87
NATIONAL GRID PLC	10,124	10.07	101,948.68
SEVERN TRENT PLC	612	22.36	13,684.32
SSE PLC	2,558	15.31	39,162.98
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,756	9.55	16,778.58
ARM HOLDINGS PLC	3,635	9.64	35,041.40
	785,216		4,375,796.46

英ボンド 建小計				(687,612,655)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	27	489.25	13,209.75
	GIVAUDAN-REG	30	1,941.00	58,230.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	1,423	49.72	70,751.56
	SIKA AG-BR	6	3,841.00	23,046.00
	SYNGENTA AG(CH)	282	405.00	114,210.00
	ABB LIMITED-REG	6,715	19.53	131,143.95
	GEBERIT AG-REG	126	360.10	45,372.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	67	180.40	12,086.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	146	182.20	26,601.20
	SULZER AG-REG	79	81.95	6,474.05
	ADECCO SA-REG	567	65.70	37,251.90
	SGS SA-REG	18	2,145.00	38,610.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	177	136.60	24,178.20
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	1,594	65.30	104,088.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	163	67.80	11,051.40
	THE SWATCH GROUP AG-B	100	341.00	34,100.00
	DUFREY AG	132	128.10	16,909.20
	ARYZTA AG	285	38.31	10,918.35
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	8	1,166.00	9,328.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT&SPRUNGLI AG	1	74,000.00	74,000.00
	LINDT&SPRUNGLI AG-PC	3	6,130.00	18,390.00
	NESTLE SA-REGISTERED	9,737	73.95	720,051.15
	SONOVA HOLDING AG-REG	176	130.40	22,950.40
	ACTELION LTD-REG	340	155.00	52,700.00
	GALENICA AG-REG	12	1,493.00	17,916.00
	LONZA GROUP AG-REG	173	166.30	28,769.90
	NOVARTIS AG-REG SHS	6,949	74.15	515,268.35
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,146	254.40	545,942.40
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5,484	14.75	80,889.00
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	742	40.36	29,947.12
	PARGESA HOLDING SA-BR	101	67.10	6,777.10
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	57	400.75	22,842.75
	UBS GROUP AG	11,166	15.87	177,204.42
BALOISE HOLDING AG-REG	156	122.20	19,063.20	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	105	259.10	27,205.50	
SWISS RE LIMITED	1,116	93.90	104,792.40	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	457	216.20	98,803.40	
SWISS PRIME SITE AG-REG	188	84.85	15,951.80	
SWISSCOM AG-REG	86	504.50	43,387.00	
スイスフラン 建小計	51,140		3,410,413.05 (387,252,401)	

スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	714	140.00	99,960.00	
	BOLIDEN AB	897	138.10	123,875.70	
	ALFA LAVAL AB	1,032	136.40	140,764.80	
	ASSA ABLOY AB-B	3,081	167.40	515,759.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,065	218.20	450,583.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,279	204.20	261,171.80	
	SANDVIK AB	3,495	87.15	304,589.25	
	SKANSKA AB-B SHS	1,246	177.10	220,666.60	
	SKF AB-B SHARES	1,299	143.50	186,406.50	
	VOLVO AB-B SHS	5,143	93.25	479,584.75	
	SECURITAS AB-B SHS	1,027	135.70	139,363.90	
	ELECTROLUX AB-SER B	789	220.10	173,658.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,338	63.85	85,431.30	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,919	303.00	884,457.00	
	ICA GRUPPEN AB	254	280.50	71,247.00	
	SWEDISH MATCH AB	658	284.10	186,937.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	1,811	258.80	468,686.80	
	GETINGE AB-B SHS	656	197.20	129,363.20	
	NORDEA BANK AB	9,338	79.20	739,569.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	4,670	81.15	378,970.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,604	104.20	479,736.80	
	SWEDBANK AB-A SHARES	2,784	171.50	477,456.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	537	146.90	78,885.30	
	INVESTOR AB-B SHS	1,400	309.40	433,160.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB	772	250.50	193,386.00		
ERICSSON LM-B SHS	9,356	79.00	739,124.00		
HEXAGON AB-B SHS	837	334.80	280,227.60		
MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	217	478.50	103,834.50		
TELE2 AB-B SHS	1,047	75.95	79,519.65		
TELIA CO AB	8,692	39.65	344,637.80		
スウェーデンクローナ 建小計		73,957		9,251,015.45 (124,888,708)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	3,444	133.70	460,462.80	
	NORSK HYDRO ASA	4,426	33.84	149,775.84	
	YARA INTERNATIONAL ASA	591	321.60	190,065.60	
	SCHIBSTED ASA-A	241	236.60	57,020.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	284	231.00	65,604.00	
	ORKLA ASA	2,683	70.75	189,822.25	
	DNB ASA	3,301	104.20	343,964.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	659	135.60	89,360.40	
	TELENOR ASA	2,535	140.40	355,914.00	
		18,164		1,901,989.69	

ノルウェークローネ 建小計				(25,543,721)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	312	420.80	131,289.60
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	783	303.70	237,797.10
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	733	450.90	330,509.70
	ISS A/S	427	257.50	109,952.50
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	13	8,960.00	116,480.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	22	9,230.00	203,060.00
	DSV A/S	579	273.70	158,472.30
	PANDORA A/S	333	866.00	288,378.00
	CARLSBERG AS-B	350	646.00	226,100.00
	COLOPLAST A/S	364	501.00	182,364.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	75	698.50	52,387.50
	GENMAB A/S	164	967.00	158,588.00
	NOVO NORDISK A/S-B	6,014	377.80	2,272,089.20
	DANSKE BANK A/S	2,299	179.60	412,900.40
	TRYG A/S	345	129.90	44,815.50
TDC A/S	2,655	33.49	88,915.95	
デンマーククローネ 建小計		15,468		5,014,099.75 (83,585,042)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	770	32.48	25,009.60
	OIL SEARCH LIMITED	3,555	6.53	23,214.15
	ORIGIN ENERGY LIMITED	4,524	4.98	22,529.52
	SANTOS LTD	3,221	4.08	13,141.68
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,924	26.82	51,601.68
	ALUMINA LIMITED	8,314	1.42	11,805.88
	AMCOR LTD	3,061	15.40	47,139.40
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	8,333	19.67	163,910.11
	BORAL LIMITED	2,577	6.54	16,853.58
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	5,125	3.32	17,015.00
	ILUKA RESOURCES LIMITED	1,379	6.05	8,342.95
	INCITEC PIVOT LIMITED	5,448	3.05	16,616.40
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,465	19.53	28,611.45
	NEWCREST MINING LIMITED	2,080	18.01	37,460.80
	ORICA LTD	1,227	15.30	18,773.10
	RIO TINTO LIMITED(AU)	1,101	49.29	54,268.29
	SOUTH32 LIMITED	9,929	1.55	15,389.95
	CIMIC GROUP LIMITED	335	35.90	12,026.50
	BRAMBLES LTD	4,475	12.41	55,534.75
	SEEK LIMITED	1,065	15.83	16,858.95
ASCIANO LIMITED	1,645	8.81	14,492.45	
AURIZON HOLDINGS LIMITED	6,031	4.20	25,330.20	
QANTAS AIRWAYS LTD	1,697	3.47	5,888.59	

SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	3,575	6.58	23,523.50
TRANSURBAN GROUP	5,310	11.30	60,003.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,459	10.29	15,013.11
CROWN RESORTS LIMITED	1,199	11.82	14,172.18
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	183	40.41	7,395.03
TABCORP HOLDINGS LIMITED	2,512	4.59	11,530.08
TATTS GROUP LTD	4,723	3.85	18,183.55
REA GROUP LIMITED	174	50.81	8,840.94
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,749	4.35	7,608.15
WESFARMERS LIMITED	2,916	40.82	119,031.12
WOOLWORTHS LIMITED	3,286	22.14	72,752.04
COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,886	8.82	16,634.52
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	2,144	9.40	20,153.60
COCHLEAR LIMITED	188	104.70	19,683.60
HEALTHSCOPE LTD	3,707	2.71	10,045.97
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	433	62.78	27,183.74
SONIC HEALTHCARE LTD	1,254	19.33	24,239.82
CSL LIMITED	1,206	103.50	124,821.00
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	7,460	24.06	179,487.60
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	1,194	11.54	13,778.76
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	1,477	9.04	13,352.08
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	4,406	74.70	329,128.20
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	6,812	27.20	185,286.40
WESTPAC BANKING CORPORATION	8,620	30.55	263,341.00
ASX LTD	502	43.31	21,741.62
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	1,478	8.67	12,814.26
MACQUARIE GROUP LIMITED	842	65.90	55,487.80
PLATINUM ASSET MANAGEMENT LIMITED	720	6.05	4,356.00
AMP LIMITED	8,393	5.81	48,763.33
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	6,690	5.62	37,597.80
MEDIBANK PRIVATE LIMITED	8,514	3.03	25,797.42
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	3,969	11.25	44,651.25
SUNCORP GROUP LIMITED	3,701	12.41	45,929.41
LENLEASE GROUP	1,806	12.96	23,405.76
COMPUTERSHARE LIMITED	1,557	9.67	15,056.19
TELSTRA CORPORATION	12,016	5.39	64,766.24
TPG TELECOM LIMITED	915	10.96	10,028.40
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	1,181	8.94	10,558.14
AGL ENERGY LIMITED	2,081	18.44	38,373.64
APA GROUP	3,445	8.77	30,212.65
AUSNET SERVICES	5,638	1.53	8,654.33
DUET GROUP	6,022	2.26	13,609.72

	オーストラリアドル 建小計	216,624		2,798,807.93 (238,234,531)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	2,266	8.18	18,535.88
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	3,137	6.50	20,390.50
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	1,235	8.70	10,744.50
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	6,022	3.74	22,552.39
	CONTACT ENERGY LIMITED	1,208	4.98	6,015.84
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,656	2.69	9,834.64
	MIGHTY RIVER POWER LTD	2,306	2.96	6,825.76
	ニュージーランドドル 建小計	19,830		94,899.51 (7,267,404)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	8,534	97.40	831,211.60
	NWS HOLDINGS LIMITED	4,500	12.00	54,000.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	4,000	13.34	53,360.00
	MTR CORPORATION	4,903	38.75	189,991.25
	LI & FUNG LIMITED	20,000	4.85	97,000.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED	4,773	30.35	144,860.55
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	2,338	27.35	63,944.30
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	6,537	29.45	192,514.65
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	3,355	12.26	41,132.30
	SANDS CHINA LIMITED	8,574	30.75	263,650.50
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	3,813	9.58	36,528.54
	SJM HOLDINGS LIMITED	7,000	5.50	38,500.00
	WYNN MACAU LIMITED	5,099	12.34	62,921.66
	WH GROUP LTD	12,500	5.96	74,500.00
	BANK OF EAST ASIA	3,267	29.25	95,559.75
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	11,684	24.30	283,921.20
	HANG SENG BANK LTD	2,400	140.30	336,720.00
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	8,000	5.06	40,480.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	3,566	196.00	698,936.00
	AIA GROUP LIMITED	37,751	45.10	1,702,570.10
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	8,534	51.65	440,781.10
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	7,864	15.96	125,509.44
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,245	49.90	211,825.50
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	2,000	33.40	66,800.00
	KERRY PROPERTIES LIMITED	2,452	21.85	53,576.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	17,562	7.85	137,861.70
	SINO LAND CO	10,576	12.50	132,200.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	5,000	98.00	490,000.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,000	83.60	167,200.00	
SWIRE PROPERTIES LIMITED	4,032	20.85	84,067.20	
WHARF HOLDINGS LTD	4,000	42.95	171,800.00	

	WHELOCK AND COMPANY LTD	3,000	36.15	108,450.00	
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	9,080	10.78	97,882.40	
	PCCW LIMITED	13,884	5.32	73,862.88	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	2,000	74.45	148,900.00	
	CLP HOLDINGS LTD	6,235	72.95	454,843.25	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	8,500	6.96	59,160.00	
	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	23,556	15.06	354,753.36	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	4,567	81.00	369,927.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	800	61.75	49,400.00	
	香港ドル 建小計	302,481		9,101,102.43 (128,143,522)	
シンガポールドル	KEPPEL CORPORATION LIMITED	4,200	6.07	25,494.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	14,636	0.45	6,659.38	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	4,000	3.10	12,400.00	
	SEMBCORP MARINE LIMITED	2,987	1.81	5,421.40	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	4,400	3.41	15,004.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	7,069	1.01	7,139.69	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	7,000	2.93	20,510.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,500	11.50	17,250.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	21,000	0.86	18,060.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	4,600	4.10	18,860.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	300	43.78	13,134.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	24,000	0.41	9,960.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	7,000	3.52	24,640.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LIMITED	5,800	15.87	92,046.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	10,000	9.39	93,900.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	4,300	19.86	85,398.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	2,300	8.02	18,446.00	
	CAPITALAND LTD	7,200	3.22	23,184.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,300	8.85	11,505.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	9,000	1.97	17,730.00	
UOL GROUP LIMITED	2,000	6.25	12,500.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	24,700	3.96	97,812.00		
STARHUB LIMITED	2,000	3.36	6,720.00		
	シンガポールドル 建小計	171,292		653,773.47 (53,328,301)	
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LIMITED	16	661.70	10,587.20	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	1,458	17.60	25,660.80	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	2,798	212.60	594,854.80	
	BANK HAPUALIM BM	3,465	19.90	68,953.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,349	14.43	62,756.07	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	454	44.24	20,084.96	

	AZRIELI GROUP	107	148.00	15,836.00	
	NICE SYSTEMS LIMITED	187	245.20	45,852.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	6,284	8.45	53,150.07	
	イスラエルシュケル 建小計	19,118		897,735.80 (26,070,247)	
	合 計	3,386,564		8,594,261,771 (8,594,261,771)	

(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	8,835.00	
	投資信託受益証券 小計		19,000	8,835.00 (964,782)	
	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORPORATION	1,025	19,403.25	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	1,108	116,894.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	2,787	29,124.15	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	371	68,123.02	
		BOSTON PROPERTIES INC	431	56,521.34	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	520	13,353.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	243	19,977.03	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	873	76,902.57	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	421	37,346.91	
		DUKE REALTY CORP	965	21,606.35	
		EQUINIX INC	175	56,850.50	
		EQUITY RESIDENTIAL	953	68,377.75	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	173	39,663.71	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	322	28,352.10	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	182	28,280.98	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	1,608	47,275.20	
		HCP INC	1,297	45,706.28	
		HOST HOTELS & RESORTS	2,214	35,114.04	
		IRON MOUNTAIN INC	512	17,925.12	
		KIMCO REALTY CORP	1,216	34,850.56	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	500	17,380.00	
		MID-AMERICA APARTMENT	197	19,512.85	
		PROLOGIS INC	1,372	62,810.16	
		PUBLIC STORAGE	385	101,439.80	
		REALTY INCOME CORP	692	43,796.68	
REGENCY CENTERS CORPORATION	290	21,773.20			
SIMON PROPERTY GROUP	810	168,690.60			

		SL GREEN REALTY CORPORATION	300	30,708.00	
		THE MACERICH COMPANY	393	30,901.59	
		UDR INC	765	28,144.35	
		VENTAS INC	871	55,683.03	
		VEREIT INC	2,368	21,761.92	
		VORNADO REALTY TRUST	476	45,724.56	
		WELLTOWER INC	985	70,260.05	
		WEYERHAEUSER COMPANY	2,235	71,475.30	
	投資証券	小計	30,035	1,651,710.55	(180,366,792)
米ドル建小計			49,035	1,660,545.55	(181,331,574)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	500	10,935.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	497	13,717.20	
カナダドル建小計			997	24,652.20	(2,120,089)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	93	7,871.52	
		GECINA SA	93	11,666.85	
		ICADE	121	8,115.47	
		KLEPIERRE	537	23,069.52	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	254	61,429.90	
ユーロ建小計			1,098	112,153.26	(13,913,733)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	2,497	17,616.33	
		HAMMERSON PLC	2,020	11,776.60	
		INTU PROPERTIES PLC	3,027	9,029.54	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	2,036	22,477.44	
		SEGRO PLC	2,448	10,318.32	
英ポンド建小計			12,028	71,218.23	(11,191,232)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	2,981	23,997.05	
		GOODMAN GROUP	4,592	31,225.60	
		GPT GROUP	5,549	27,523.04	
		MIRVAC GROUP	12,171	23,794.30	
		SCENTRE GROUP	15,100	69,460.00	
		STOCKLAND	6,168	26,954.16	
		VICINITY CENTRES	10,481	34,482.49	
		WESTFIELD CORPORATION	5,646	57,532.74	
オーストラリアドル建小計			62,688	294,969.38	(25,107,793)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	7,107	339,714.60	
香港ドル建小計			7,107	339,714.60	(4,783,181)

シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,000	17,640.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	6,669	9,570.01	
		CAPITALAND MALL TRUST	8,000	17,040.00	
		SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,000	13,640.00	
シンガポールドル建小計			29,669	57,890.01 (4,722,088)	
合計				243,169,690 (243,169,690)	

(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 601銘柄	53.6%			61.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			1.8%	2.0%
カナダドル	株式 88銘柄	3.2%			3.7%
	投資証券 2銘柄			0.0%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	10.7%			12.3%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.2%
英ポンド	株式 108銘柄	6.8%			7.8%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.8%			4.4%
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 16銘柄	0.8%			0.9%
オーストラリアドル	株式 65銘柄	2.4%			2.7%
	投資証券 8銘柄			0.2%	0.3%
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 40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%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	0.3%			0.3%

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光日本債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	8,825,504
コール・ローン	31,916,601	58,764,862
国債証券	13,032,139,200	12,116,192,300
地方債証券	1,192,131,900	1,201,505,000
特殊債券	1,322,925,200	1,237,085,400
社債券	737,380,000	636,350,000
未収利息	36,581,848	32,007,051
前払費用	359,456	474,997
流動資産合計	16,353,434,205	15,291,205,114
資産合計		
	16,353,434,205	15,291,205,114
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	10,486,700	-
未払解約金	3,500,000	49,000,000
未払利息	-	128
その他未払費用	-	146
流動負債合計	13,986,700	49,000,274
負債合計		
	13,986,700	49,000,274
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	13,424,076,433	11,830,445,129
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,915,371,072	3,411,759,711
元本等合計	16,339,447,505	15,242,204,840
純資産合計		
	16,339,447,505	15,242,204,840
負債純資産合計		
	16,353,434,205	15,291,205,114

## 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10月21日 至 平成28年 4月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。  
 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配は使用いたしません。）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 13,424,076,433口	1. 計算日における受益権の総数 11,830,445,129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 1.2172円 (1万口当たり純資産額) (12,172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 1.2884円 (1万口当たり純資産額) (12,884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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券であり、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,429,316,960円	13,424,076,433円
期中追加設定元本額	461,341,836円	334,848,716円
期中一部解約元本額	1,466,582,363円	1,928,480,020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）	108,901,500円	106,246,517円
新光7資産バランスファンド	786,651,829円	714,653,519円
日本債券ファンド	1,005,937,306円	1,185,952,638円
新光日本債券インデックスVA	1,971,571,962円	1,263,887,174円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,270,232,969円	1,989,298,939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）	2,451,269,840円	2,185,350,495円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	150,449,720円	137,520,511円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	3,192,950,288円	2,894,013,235円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,448,640,414円	1,323,900,981円

世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）	6,046,926円	- 円
グローバル・ナビ	31,423,679円	29,621,120円
合計	13,424,076,433円	11,830,445,129円

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	113,079,200	733,769,500
地方債証券	4,348,200	10,387,900
特殊債券	412,900	17,676,200
社債券	4,620,000	1,190,000
合計	104,523,900	763,023,600

(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105回利付国債（5年）	140,000,000	140,749,000	
	第106回利付国債（5年）	130,000,000	130,856,700	
	第107回利付国債（5年）	150,000,000	151,177,500	
	第109回利付国債（5年）	100,000,000	100,710,000	
	第111回利付国債（5年）	80,000,000	81,028,800	
	第112回利付国債（5年）	40,000,000	40,582,400	
	第113回利付国債（5年）	50,000,000	50,619,500	

第 1 1 4 回利付国債（ 5 年）	100,000,000	101,397,000	
第 1 1 6 回利付国債（ 5 年）	110,000,000	111,401,400	
第 1 1 7 回利付国債（ 5 年）	110,000,000	111,515,800	
第 1 1 8 回利付国債（ 5 年）	110,000,000	111,630,200	
第 1 2 0 回利付国債（ 5 年）	110,000,000	111,742,400	
第 1 2 2 回利付国債（ 5 年）	80,000,000	81,064,800	
第 1 2 3 回利付国債（ 5 年）	170,000,000	172,381,700	
第 1 2 4 回利付国債（ 5 年）	170,000,000	172,538,100	
第 1 2 5 回利付国債（ 5 年）	130,000,000	132,030,600	
第 1 2 6 回利付国債（ 5 年）	130,000,000	132,146,300	
第 1 2 7 回利付国債（ 5 年）	40,000,000	40,695,600	
第 1 回利付国債（ 4 0 年）	10,000,000	16,353,700	
第 2 回利付国債（ 4 0 年）	20,000,000	31,762,400	
第 3 回利付国債（ 4 0 年）	20,000,000	32,090,800	
第 4 回利付国債（ 4 0 年）	30,000,000	48,549,000	
第 5 回利付国債（ 4 0 年）	30,000,000	46,912,800	
第 6 回利付国債（ 4 0 年）	30,000,000	46,257,600	
第 7 回利付国債（ 4 0 年）	30,000,000	44,447,400	
第 8 回利付国債（ 4 0 年）	40,000,000	55,234,400	
第 2 8 6 回利付国債（ 1 0 年）	100,000,000	102,400,000	
第 2 8 8 回利付国債（ 1 0 年）	20,000,000	20,556,200	
第 2 8 9 回利付国債（ 1 0 年）	90,000,000	92,653,200	
第 2 9 0 回利付国債（ 1 0 年）	130,000,000	134,166,500	
第 2 9 1 回利付国債（ 1 0 年）	40,000,000	41,205,200	
第 2 9 3 回利付国債（ 1 0 年）	90,000,000	94,040,100	
第 2 9 6 回利付国債（ 1 0 年）	90,000,000	93,870,000	
第 2 9 7 回利付国債（ 1 0 年）	110,000,000	114,896,100	
第 2 9 9 回利付国債（ 1 0 年）	70,000,000	73,211,600	
第 3 0 0 回利付国債（ 1 0 年）	40,000,000	42,070,000	
第 3 0 1 回利付国債（ 1 0 年）	110,000,000	116,171,000	
第 3 0 2 回利付国債（ 1 0 年）	10,000,000	10,529,100	
第 3 0 3 回利付国債（ 1 0 年）	130,000,000	137,408,700	
第 3 0 5 回利付国債（ 1 0 年）	70,000,000	74,024,300	
第 3 0 6 回利付国債（ 1 0 年）	160,000,000	170,422,400	
第 3 0 8 回利付国債（ 1 0 年）	170,000,000	181,080,600	
第 3 0 9 回利付国債（ 1 0 年）	20,000,000	21,135,400	
第 3 1 0 回利付国債（ 1 0 年）	130,000,000	137,251,400	
第 3 1 1 回利付国債（ 1 0 年）	30,000,000	31,405,800	
第 3 1 2 回利付国債（ 1 0 年）	140,000,000	149,541,000	
第 3 1 3 回利付国債（ 1 0 年）	170,000,000	183,050,900	
第 3 1 5 回利付国債（ 1 0 年）	170,000,000	182,889,400	
第 3 1 7 回利付国債（ 1 0 年）	50,000,000	53,704,000	
第 3 1 8 回利付国債（ 1 0 年）	100,000,000	106,859,000	

第319回利付国債(10年)	50,000,000	53,877,000	
第320回利付国債(10年)	70,000,000	75,026,000	
第321回利付国債(10年)	40,000,000	42,998,800	
第322回利付国債(10年)	30,000,000	32,069,100	
第323回利付国債(10年)	170,000,000	182,233,200	
第325回利付国債(10年)	70,000,000	74,790,800	
第326回利付国債(10年)	20,000,000	21,287,400	
第327回利付国債(10年)	50,000,000	53,557,000	
第329回利付国債(10年)	70,000,000	75,304,600	
第330回利付国債(10年)	80,000,000	86,214,400	
第332回利付国債(10年)	110,000,000	117,075,200	
第333回利付国債(10年)	80,000,000	85,245,600	
第334回利付国債(10年)	170,000,000	181,434,200	
第335回利付国債(10年)	150,000,000	158,985,000	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	84,861,600	
第338回利付国債(10年)	140,000,000	147,351,400	
第339回利付国債(10年)	90,000,000	94,729,500	
第340回利付国債(10年)	140,000,000	147,421,400	
第341回利付国債(10年)	160,000,000	166,977,600	
第342回利付国債(10年)	30,000,000	30,708,000	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	26,493,800	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	27,090,400	
第10回利付国債(30年)	20,000,000	23,306,200	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	25,356,200	
第12回利付国債(30年)	20,000,000	26,777,400	
第13回利付国債(30年)	30,000,000	39,720,600	
第15回利付国債(30年)	40,000,000	56,719,200	
第17回利付国債(30年)	40,000,000	56,186,000	
第19回利付国債(30年)	20,000,000	27,827,800	
第20回利付国債(30年)	20,000,000	28,623,200	
第21回利付国債(30年)	10,000,000	13,959,700	
第22回利付国債(30年)	20,000,000	28,725,000	
第23回利付国債(30年)	20,000,000	28,803,200	
第24回利付国債(30年)	20,000,000	28,880,200	
第26回利付国債(30年)	20,000,000	28,658,200	
第27回利付国債(30年)	30,000,000	43,898,100	
第28回利付国債(30年)	40,000,000	58,878,000	
第29回利付国債(30年)	40,000,000	58,314,800	
第30回利付国債(30年)	40,000,000	57,768,000	
第31回利付国債(30年)	40,000,000	57,252,800	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	73,125,000	
第33回利付国債(30年)	60,000,000	84,063,000	
第34回利付国債(30年)	50,000,000	72,863,000	

第35回利付国債(30年)	60,000,000	84,988,200	
第36回利付国債(30年)	50,000,000	71,205,000	
第37回利付国債(30年)	60,000,000	84,320,400	
第38回利付国債(30年)	40,000,000	55,492,000	
第39回利付国債(30年)	30,000,000	42,481,800	
第40回利付国債(30年)	30,000,000	41,822,400	
第41回利付国債(30年)	30,000,000	41,095,500	
第42回利付国債(30年)	40,000,000	54,916,800	
第43回利付国債(30年)	40,000,000	55,114,400	
第44回利付国債(30年)	30,000,000	41,430,000	
第45回利付国債(30年)	30,000,000	39,869,700	
第46回利付国債(30年)	50,000,000	66,581,000	
第47回利付国債(30年)	30,000,000	40,841,400	
第48回利付国債(30年)	40,000,000	52,316,800	
第49回利付国債(30年)	50,000,000	65,516,500	
第50回利付国債(30年)	20,000,000	22,807,200	
第45回利付国債(20年)	30,000,000	33,125,700	
第47回利付国債(20年)	60,000,000	66,534,600	
第48回利付国債(20年)	60,000,000	67,756,800	
第50回利付国債(20年)	30,000,000	33,184,800	
第51回利付国債(20年)	10,000,000	11,174,200	
第52回利付国債(20年)	20,000,000	22,574,400	
第53回利付国債(20年)	30,000,000	34,039,800	
第55回利付国債(20年)	20,000,000	22,693,600	
第57回利付国債(20年)	30,000,000	34,025,700	
第58回利付国債(20年)	30,000,000	34,181,700	
第59回利付国債(20年)	30,000,000	33,952,200	
第63回利付国債(20年)	30,000,000	34,434,300	
第64回利付国債(20年)	20,000,000	23,195,400	
第65回利付国債(20年)	50,000,000	58,239,000	
第69回利付国債(20年)	40,000,000	47,431,600	
第70回利付国債(20年)	30,000,000	36,471,600	
第72回利付国債(20年)	30,000,000	35,874,000	
第76回利付国債(20年)	50,000,000	59,363,000	
第78回利付国債(20年)	30,000,000	35,745,900	
第81回利付国債(20年)	50,000,000	60,264,500	
第84回利付国債(20年)	60,000,000	72,541,800	
第85回利付国債(20年)	40,000,000	48,905,600	
第88回利付国債(20年)	40,000,000	49,932,000	
第90回利付国債(20年)	40,000,000	49,733,600	
第92回利付国債(20年)	40,000,000	49,511,200	
第94回利付国債(20年)	70,000,000	86,985,500	
第95回利付国債(20年)	40,000,000	50,778,800	

第97回利付国債(20年)	50,000,000	63,167,500	
第99回利付国債(20年)	40,000,000	50,265,600	
第100回利付国債(20年)	70,000,000	89,083,400	
第103回利付国債(20年)	40,000,000	51,564,800	
第105回利付国債(20年)	40,000,000	50,742,400	
第108回利付国債(20年)	60,000,000	74,862,000	
第111回利付国債(20年)	30,000,000	38,814,300	
第113回利付国債(20年)	40,000,000	51,405,200	
第114回利付国債(20年)	10,000,000	12,886,800	
第116回利付国債(20年)	70,000,000	91,483,700	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	89,826,100	
第121回利付国債(20年)	70,000,000	89,041,400	
第123回利付国債(20年)	90,000,000	117,368,100	
第125回利付国債(20年)	60,000,000	79,325,400	
第128回利付国債(20年)	60,000,000	76,818,000	
第130回利付国債(20年)	50,000,000	63,383,500	
第132回利付国債(20年)	80,000,000	100,436,000	
第134回利付国債(20年)	70,000,000	89,194,000	
第137回利付国債(20年)	70,000,000	88,233,600	
第140回利付国債(20年)	70,000,000	88,371,500	
第141回利付国債(20年)	70,000,000	88,501,700	
第143回利付国債(20年)	50,000,000	62,471,000	
第145回利付国債(20年)	60,000,000	76,068,600	
第146回利付国債(20年)	70,000,000	88,865,000	
第147回利付国債(20年)	50,000,000	62,690,500	
第148回利付国債(20年)	80,000,000	99,008,800	
第149回利付国債(20年)	50,000,000	61,933,500	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	109,863,000	
第151回利付国債(20年)	60,000,000	71,050,200	
第152回利付国債(20年)	80,000,000	94,748,800	
第153回利付国債(20年)	50,000,000	60,149,500	
第154回利付国債(20年)	80,000,000	94,772,800	
第155回利付国債(20年)	70,000,000	80,215,100	
第156回利付国債(20年)	10,000,000	10,274,700	
国債証券 小計	10,540,000,000	12,116,192,300	
地方債証券			
第18回東京都公募公債(20年)	100,000,000	126,930,000	
第654回東京都公募公債	100,000,000	102,640,000	
第678回東京都公募公債	80,000,000	84,056,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	30,603,000	
第164回神奈川県公募公債	100,000,000	104,820,000	
第87回大阪府公募公債(5年)	50,000,000	50,155,000	
第110回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,520,000	
第302回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	40,780,000	

	平成20年度第1回愛知県公募公債（10年）	48,000,000	49,838,400	
	平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	69,445,200	
	平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	104,600,000	
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,780,000	
	第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	52,995,000	
	第485回名古屋市公募公債（10年）	30,000,000	31,509,000	
	平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	30,879,000	
	平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,374,400	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	104,580,000	
地方債証券 小計		1,137,000,000	1,201,505,000	
特殊債券	第33回日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,470,000	
	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	103,810,000	
	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	127,130,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,810,000	
	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	104,500,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,330,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,320,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,080,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	103,262,400	
	い第759号農林債	20,000,000	20,178,000	
	い第766号農林債	50,000,000	50,395,000	
	第274回信金中金債（5年）	100,000,000	100,430,000	
	第13回中日本高速道路社債（財投機関債）	100,000,000	105,370,000	
特殊債券 小計		1,171,000,000	1,237,085,400	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	104,740,000	
	第30回新日鐵住金社債	100,000,000	104,370,000	
	第1回日本電産社債	100,000,000	100,480,000	
	第8回トヨタ自動車社債	100,000,000	105,260,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	117,330,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	104,170,000	
社債券 小計		600,000,000	636,350,000	
合計		13,448,000,000	15,191,132,700	

## 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 - R E I Tマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	4,115,949
コール・ローン	38,795,489	27,406,158
投資証券	2,024,765,760	3,265,999,200
未収入金	958,140	-
未収配当金	12,064,054	17,636,441
未収利息	57	-
流動資産合計	2,076,583,500	3,315,157,748
資産合計	2,076,583,500	3,315,157,748
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	12,340,228	5,600,882
未払利息	-	60
その他未払費用	-	122
流動負債合計	12,340,228	5,601,064
負債合計	12,340,228	5,601,064
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,381,345,829	1,967,227,304
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	682,897,443	1,342,329,380
元本等合計	2,064,243,272	3,309,556,684
純資産合計	2,064,243,272	3,309,556,684
負債純資産合計	2,076,583,500	3,315,157,748

## 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10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 1,381,345,829口	1. 計算日における受益権の総数 1,967,227,304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口当たり純資産額
(1万口当たり純資産額)	(1万口当たり純資産額)
1.4944円 (14,944円)	1.6823円 (16,823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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。 また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	922,067,792円	1,381,345,829円
期中追加設定元本額	473,837,012円	789,753,411円
期中一部解約元本額	14,558,975円	203,871,936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	659,199,851円	568,569,444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）	1,914,134円	2,991,109円
グローバル・ナビ	6,396,586円	11,177,922円
新光J-R E I Tオープン（年2回決算型）	713,835,258円	1,384,488,829円
合計	1,381,345,829円	1,967,227,304円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	24,224,114	235,962,906
合計	24,224,114	235,962,906

(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	135	63,517,500	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	74	26,196,000	
	森ヒルズリート投資法人	487	76,410,300	
	産業ファンド投資法人	98	49,588,000	
	大和ハウスリート投資法人	97	53,738,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	361	100,610,700	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	97	28,847,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	167	94,522,000	
	G L P 投資法人	721	92,648,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	143	34,191,300	
	日本プロロジスリート投資法人	510	131,223,000	
	星野リゾート・リート投資法人	22	29,722,000	
	S I A 不動産投資法人	21	8,767,500	
	イオンリート投資法人	364	48,994,400	
	ヒューリックリート投資法人	264	48,576,000	
	日本リート投資法人	109	30,977,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	151	15,205,700	
	日本ヘルスケア投資法人	21	4,076,100	
	積水ハウス・リート投資法人	221	28,509,000	
	ト・セイ・リート投資法人	45	5,377,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	117	32,502,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	33	3,564,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	45	4,293,000		
ジャパン・シニアリビング投資法人	24	3,962,400		

野村不動産マスタ - ファンド投資法人	1,034	168,128,400	
いちごホテルリート投資法人	38	6,190,200	
ラサ - ルロジポ - ト投資法人	306	31,701,600	
日本ビルファンド投資法人	392	263,032,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	364	238,056,000	
日本リートファンド投資法人	709	186,183,400	
オリックス不動産投資法人	672	119,145,600	
日本プライムリアルティ投資法人	243	114,453,000	
プレミア投資法人	366	51,423,000	
東急リアル・エステート投資法人	272	42,160,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	54	23,598,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	765	138,235,500	
森トラスト総合リート投資法人	367	74,647,800	
インヴィンシブル投資法人	1,015	81,403,000	
フロンティア不動産投資法人	138	73,554,000	
平和不動産リート投資法人	282	24,900,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	245	58,089,500	
福岡リート投資法人	208	39,811,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	113	72,433,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	283	32,969,500	
いちごオフィスリート投資法人	394	34,514,400	
大和証券オフィス投資法人	135	91,395,000	
阪急リート投資法人	166	22,642,400	
スタートアッププロシード投資法人	48	8,361,600	
トップリート投資法人	49	20,629,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	208	53,268,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	923	88,146,500	
日本賃貸住宅投資法人	456	37,939,200	
ジャパンエクセレント投資法人	351	52,965,900	
合計	14,923	3,265,999,200	

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	10,424,549	5,982,202
金銭信託	-	2,412,369
コール・ローン	8,643,985	16,062,822
投資証券	977,458,987	892,724,926
未収配当金	1,192,105	588,304
未収利息	12	-
流動資産合計	997,719,638	917,770,623
資産合計		
	997,719,638	917,770,623
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払利息	-	35
その他未払費用	-	74
流動負債合計	-	109
負債合計		
	-	109
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	664,707,158	629,236,266
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	333,012,480	288,534,248
元本等合計	997,719,638	917,770,514
純資産合計		
	997,719,638	917,770,514
負債純資産合計		
	997,719,638	917,770,623

## 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10月21日 至 平成28年 4月20日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
---------------	---------------

1. 計算日における受益権の総数 664,707,158口	1. 計算日における受益権の総数 629,236,266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 1.5010円 (1万口当たり純資産額) (15,010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 1.4585円 (1万口当たり純資産額) (14,585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27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 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、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。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・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10月20日現在	平成28年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2.時価の算定方法 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して おります。</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)

	自 平成27年 4月21日 至 平成27年10月20日	自 平成27年10月21日 至 平成28年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

### 1 元本の移動

区分	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	707,635,787円	664,707,158円
期中追加設定元本額	4,734,455円	5,612,625円
期中一部解約元本額	47,663,084円	41,083,517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	661,059,740円	624,156,895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）	3,647,418円	5,079,371円
合計	664,707,158円	629,236,266円

### 2 有価証券関係

#### 売買目的有価証券

種類	平成27年10月20日現在	平成28年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	59,267,840	35,246,387
合計	59,267,840	35,246,387

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

### 3 デリバティブ取引等関係

#### 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	700	23,730.00	
		AGREE REALTY CORPORATION	200	8,010.00	
		ALEXANDER'S INC	20	7,825.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	700	65,667.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	400	15,420.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,200	54,672.00	
		AMERICAN FARMLAND CO	100	717.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	1,800	28,800.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	3,900	411,450.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	1,400	57,260.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,500	28,950.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	300	3,429.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	300	3,285.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	800	4,840.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,300	238,706.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	200	2,274.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,400	183,596.00	
		BRANDYWINE REALTY	1,600	22,944.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,600	41,088.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	800	65,768.00	
		CARE CAPITAL PROPERTIES	800	21,120.00	
		CARETRUST REIT INC	400	5,168.00	
		CATCHMARK TIMBER TRUST INC	400	4,464.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,600	19,648.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	800	5,600.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	300	6,549.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	600	15,168.00	
		COLONY STARWOOD HOMES	500	12,550.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1,100	23,980.00	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	1,100	25,817.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	100	1,819.00	
		COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	100	2,000.00	
		CORESITE REALTY CORPORATION	300	21,726.00	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	900	23,877.00	
		CORRECTIONS CORPORATION OF AMERICA	1,000	31,800.00	
		COUSINS PROPERTIES INC	1,900	19,874.00	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3,100	273,079.00	
		CUBESMART	1,600	49,952.00	
		CYRUSONE INC	600	26,472.00	

DCT INDUSTRIAL TRUST INC	800	32,320.00	
DDR CORPORATION	2,800	49,924.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,900	17,803.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,400	124,194.00	
DOUGLAS EMMETT INC	1,300	41,483.00	
DUKE REALTY CORP	3,200	71,648.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	600	25,056.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	100	1,862.00	
EASTGROUP PROPERTIES	300	18,384.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	600	24,264.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	900	16,497.00	
EPR PROPERTIES	600	40,212.00	
EQUINIX INC	600	194,916.00	
EQUITY COMMONWEALTH	1,200	33,804.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	700	50,911.00	
EQUITY ONE INC	800	22,720.00	
EQUITY RESIDENTIAL	3,300	236,775.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	610	139,854.70	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,100	96,855.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT	700	108,773.00	
FELCOR LODGING TRUST	1,300	10,322.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY	1,000	22,990.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	500	4,310.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES	800	8,888.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	800	26,848.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	4,700	138,180.00	
GETTY REALTY CORP	201	4,098.39	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	200	3,372.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	700	13,286.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	3,900	33,579.00	
HCP INC	4,300	151,532.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	900	27,891.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,200	35,184.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	300	6,213.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	900	43,101.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1,400	38,374.00	
HOST HOTELS & RESORTS	7,000	111,020.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	700	20,510.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	300	2,199.00	
INFREIT INC	200	3,320.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,100	7,942.00	
IRON MOUNTAIN INC	1,700	59,517.00	
	900	57,492.00	

KILROY REALTY CORP		
KIMCO REALTY CORP	3,800	108,908.00
KITE REALTY GROUP TRUST	800	22,520.00
LAMAR ADVERTISING COMPANY	800	49,728.00
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,000	24,840.00
LEXINGTON REALTY TRUST	2,200	19,778.00
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,400	48,664.00
LTC PROPERTIES INC	300	14,109.00
MACK-CALI REALTY CORP	800	19,600.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,200	29,480.00
MID-AMERICA APARTMENT	700	69,335.00
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	600	7,032.00
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	1,600	16,448.00
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	300	20,649.00
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,300	60,112.00
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	200	4,182.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	700	7,630.00
NEW YORK REIT INC	1,500	14,925.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	200	2,862.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	600	7,182.00
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORPORATION	1,600	21,040.00
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	1,500	53,655.00
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	100	2,268.00
OUTFRONT MEDIA INC	1,300	28,275.00
PARAMOUNT GROUP INC	1,300	21,138.00
PARKWAY PROPERTIES INC	700	10,773.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	700	19,593.00
PENN REAL ESTATE INVESTMENT	600	13,602.00
PHYSICIANS REALTY TRUST	1,000	18,770.00
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	1,300	26,195.00
POST PROPERTIES INC	500	29,265.00
POTLATCH CORPORATION	300	10,245.00
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	200	2,570.00
PROLOGIS INC	4,800	219,744.00
PS BUSINESS PARKS INC/CA	200	19,720.00
PUBLIC STORAGE	1,300	342,524.00
QTS REALTY TRUST INC-CL A	400	19,976.00
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	700	12,663.00
RAYONIER INC	1,100	27,478.00
REALTY INCOME CORP	2,300	145,567.00
REGENCY CENTERS CORPORATION	900	67,572.00
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	900	17,649.00

RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	2,200	36,410.00
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	500	9,390.00
RLJ LODGING TRUST	1,200	26,868.00
ROUSE PROPERTIES INC	300	5,499.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	400	20,812.00
SABRA HEALTH CARE REIT INC	600	12,108.00
SAUL CENTERS INC	100	5,261.00
SELECT INCOME REIT	600	14,184.00
SENIOR HOUSING PROPERTIES	2,200	40,788.00
SILVER BAY REALTY TRUST CORPORATION	300	4,326.00
SIMON PROPERTY GROUP	2,870	597,706.20
SL GREEN REALTY CORPORATION	900	92,124.00
SOVRAN SELF STORAGE INC	400	44,900.00
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,900	45,045.00
STAG INDUSTRIAL INC	600	12,420.00
STORE CAPITAL CORPORATION	1,000	26,950.00
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	800	9,200.00
SUN COMMUNITIES INC	500	34,900.00
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	1,900	25,555.00
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	900	33,498.00
TAUBMAN CENTERS INC	600	42,372.00
TERRENO REALTY CORP	400	9,152.00
THE GEO GROUP INC	700	23,709.00
THE MACERICH COMPANY	1,500	117,945.00
TIER REIT INC	400	5,804.00
UDR INC	2,400	88,296.00
UMH PROPERTIES INC	200	1,988.00
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	100	5,549.00
URBAN EDGE PROPERTIES	800	20,360.00
URSTADT BIDDLE PROPERTIES INC	200	4,186.00
VENTAS INC	3,100	198,183.00
VEREIT INC	8,400	77,196.00
VORNADO REALTY TRUST	1,600	153,696.00
WASHINGTON REAL ESTATE INV	600	17,688.00
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1,000	37,670.00
WELLTOWER INC	3,300	235,389.00
WEYERHAEUSER COMPANY	7,300	233,454.00
WHITESTONE REIT	200	2,618.00
WINTHROP REALTY TRUST INC	300	3,789.00
WP CAREY INC	800	49,864.00
WP GLIMCHER INC	1,700	17,170.00
XENIA HOTELS & RESORTS INC	1,000	15,330.00

米ドル建小計	199,401	8,175,136.69 (892,724,926)	
合計		892,724,926 (892,724,926)	

(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 165銘柄	97.3%	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28年 4月28日現在)

資産総額	6,316,491,393円
負債総額	3,370,135円
純資産総額( - )	6,313,121,258円
発行済口数	7,271,025,339口
1口当たり純資産額( / )	0.8683円
(1万口当たり純資産額)	(8,683円)

(参考)海外国債マザーファンド

（平成28年 4月28日現在）

資産総額	33,843,490,907円
負債総額	40,002,624円
純資産総額（ - ）	33,803,488,283円
発行済口数	15,358,849,453口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2009円
（1万口当たり純資産額）	（22,009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28年 4月28日現在）

資産総額	11,539,897,794円
負債総額	37,150,831円
純資産総額（ - ）	11,502,746,963円
発行済口数	6,884,269,641口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6709円
（1万口当たり純資産額）	（16,709円）

（参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

（平成28年 4月28日現在）

資産総額	9,991,079,823円
負債総額	22,600,264円
純資産総額（ - ）	9,968,479,559円
発行済口数	5,584,519,407口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7850円
（1万口当たり純資産額）	（17,850円）

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

（平成28年 4月28日現在）

資産総額	15,097,735,198円
負債総額	12,371,508円
純資産総額（ - ）	15,085,363,690円
発行済口数	11,759,342,859口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2828円
（1万口当たり純資産額）	（12,828円）

（参考）新光J - R E I Tマザーファンド

(平成28年 4月28日現在)

資産総額	3,361,868,215円
負債総額	14,000,375円
純資産総額( - )	3,347,867,840円
発行済口数	1,950,172,513口
1口当たり純資産額( / )	1.7167円
(1万口当たり純資産額)	(17,167円)

(参考) 新光米国REITマザーファンド

(平成28年 4月28日現在)

資産総額	912,257,923円
負債総額	188円
純資産総額( - )	912,257,735円
発行済口数	629,578,545口
1口当たり純資産額( / )	1.4490円
(1万口当たり純資産額)	(14,490円)

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<更新後>

##### a．資本金の額（平成28年4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	1,813,864株
直近5カ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。

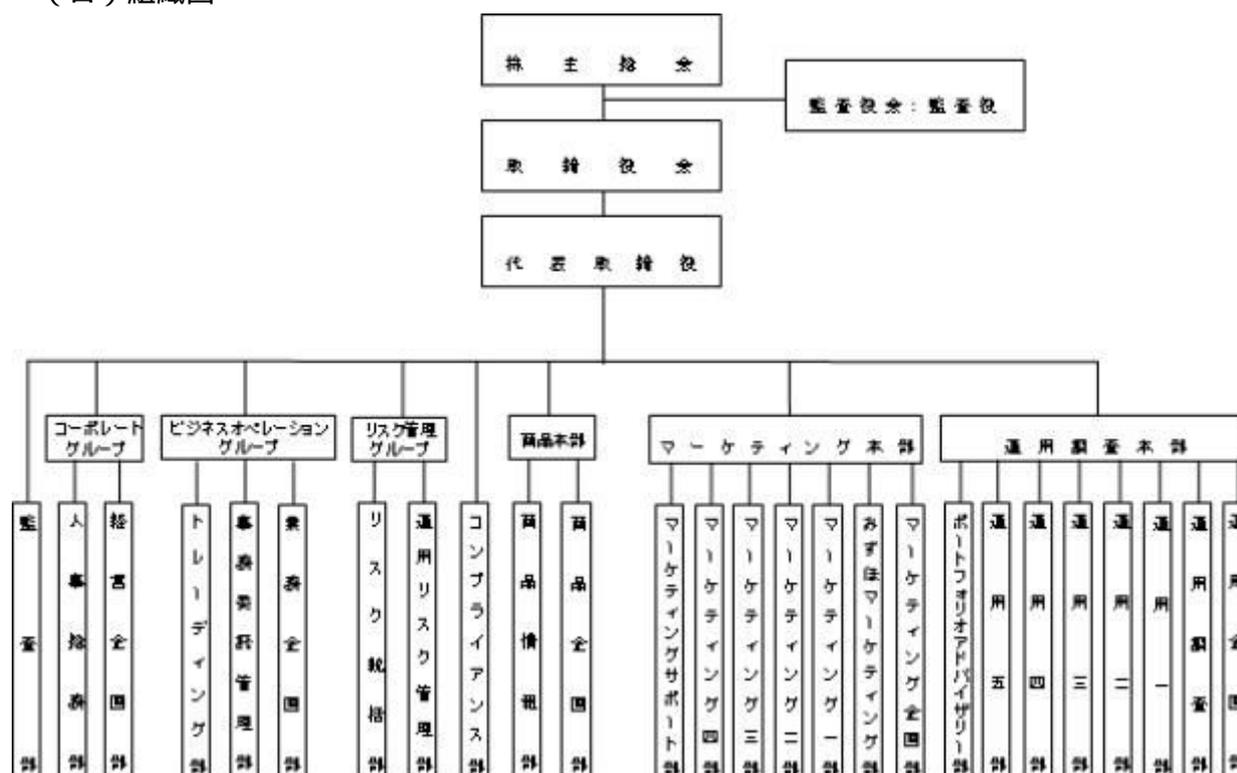
取締役会の決議により、取締役の中から取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

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。

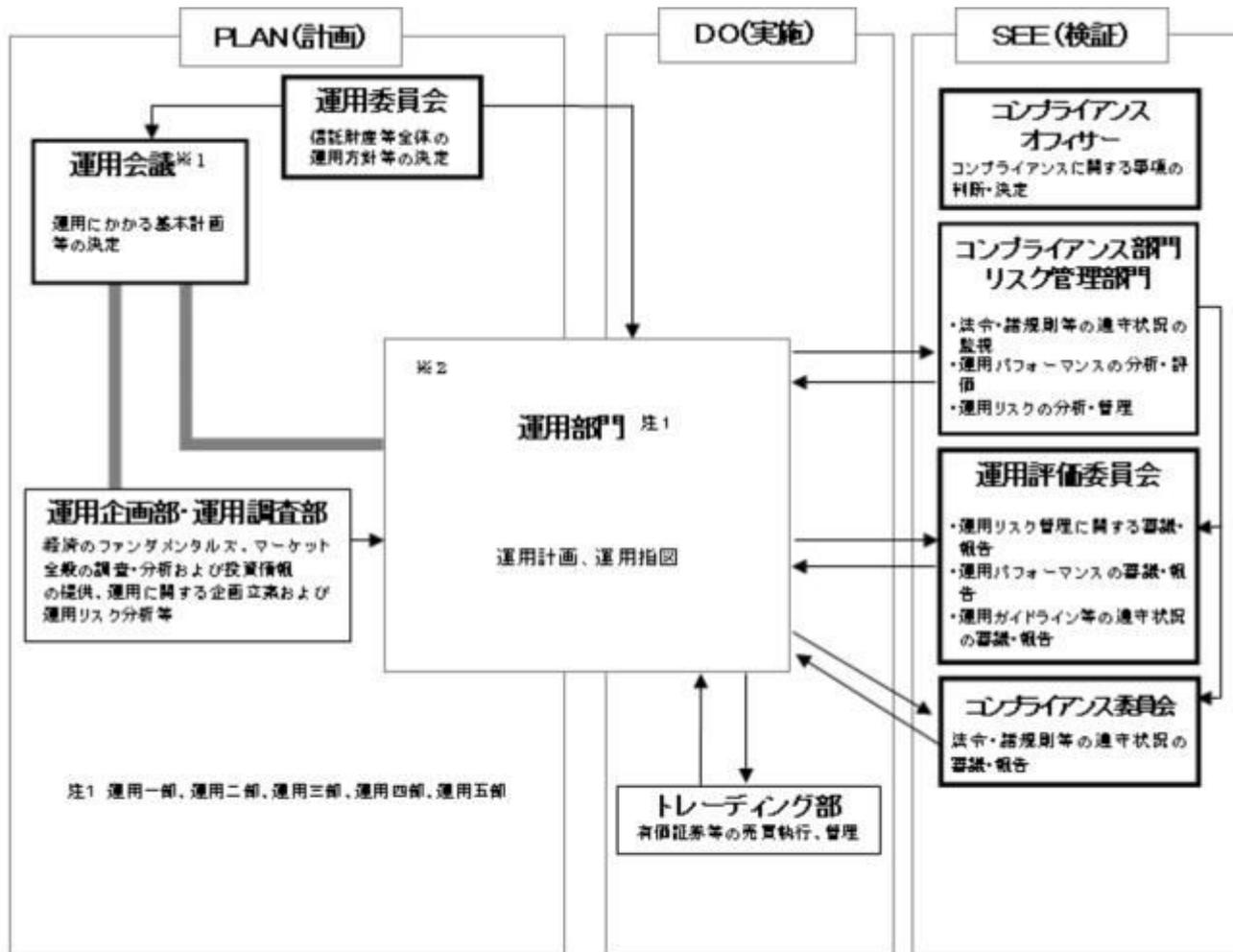
代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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



## (八) 投資運用の意思決定機構



実線の矢印は情報の流れを示します。

※1 運用会議は運用企画部・運用調査部、運用部門(運用一部～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回の承認は各々の上位職者が行います。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

委託者が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は以下のとおりです。

（平成28年4月28日現在）

基本的性格	本数	純資産総額（円）
追加型公社債投資信託	27	693,574,370,548
追加型株式投資信託	244	3,180,720,744,620
単位型公社債投資信託	4	17,578,687,550
単位型株式投資信託	72	260,290,396,387
合計	347	4,152,164,199,105

## 3 【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

## 1．財務諸表の作成方法について

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

なお、財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

## 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160
有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
<b>流動資産合計</b>	<b>20,404,659</b>	<b>21,767,367</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>		
建物（純額）	2 12,687	2 0
構築物（純額）	2 1,444	2 0
器具・備品（純額）	2 86,688	2 44,868
<b>有形固定資産合計</b>	<b>100,820</b>	<b>44,868</b>
<b>無形固定資産</b>		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
<b>無形固定資産合計</b>	<b>86,278</b>	<b>57,152</b>
<b>投資その他の資産</b>		

投資有価証券	5,101,854	2,858,652
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,246	23,339
長期繰延税金資産	-	29,604
前払年金費用	396,211	378,381
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	5,706,044	3,373,710
固定資産合計	5,893,143	3,475,731
資産合計	26,297,802	25,243,098

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	1 1,558,682	1 1,360,372
その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
<b>固定負債</b>		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	4,524,300	4,524,300
<b>資本剰余金</b>		
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	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744
評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		35,876,795		39,283,623
運用受託報酬		238,412		232,145
営業収益合計		36,115,207		39,515,769
営業費用				
支払手数料	1	18,252,669	1	19,472,734
広告宣伝費		456,430		507,020
公告費		548		469
調査費				
調査費		623,792		841,825
委託調査費		5,966,340		7,419,125
図書費		5,254		4,879
調査費合計		6,595,388		8,265,830
委託計算費		1,352,318		1,711,366
営業雑経費				
通信費		32,335		30,454
印刷費		103,093		1,022
協会費		18,150		19,367
諸会費		3,300		3,117
その他		41,594		44,518
営業雑経費合計		198,475		98,480
営業費用合計		26,855,830		30,055,901
一般管理費				
給料				

役員報酬	96,445	91,205
給料・手当	1,368,552	1,480,875
賞与	336,076	428,776
給料合計	1,801,073	2,000,857
交際費	11,426	10,708
寄付金	3,198	2,346
旅費交通費	100,386	109,240
租税公課	68,508	90,795
不動産賃借料	206,753	205,671
賞与引当金繰入	451,000	547,750
役員賞与引当金繰入	66,000	22,000
役員退職慰労引当金繰入	24,930	22,210
退職給付費用	191,900	169,238
減価償却費	70,676	102,532
諸経費	573,824	647,510
一般管理費合計	3,569,678	3,930,859
営業利益	5,689,698	5,529,008

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	163,006	65,772
有価証券利息	3,853	3,333
受取利息	10,741	10,751
時効成立分配金・償還金	5,080	923
受取保険金	-	10,300
雑益	487	2,845
営業外収益合計	183,170	93,926
営業外費用		
支払利息	26	3
時効成立後支払分配金・償還金	3,083	5,532
雑損	3,261	556
営業外費用合計	6,371	6,092
経常利益	5,866,496	5,616,842
特別利益		
投資有価証券売却益	68,179	225,965
外国税支払損失引当金戻入益	-	43,200
特別利益合計	68,179	269,166
特別損失		
固定資産除却損	3,177	13,017
投資有価証券売却損	54,613	60,150

投資有価証券評価損	10,952	62,800
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	10,000
合併関連費用	2	2
その他特別損失	-	164,657
特別損失合計	22,227	-
税引前当期純利益	305,082	310,625
法人税、住民税及び事業税	5,629,593	5,575,383
法人税等調整額	2,111,379	1,832,729
法人税等合計	66,999	19,773
当期純利益	2,044,380	1,852,503
	3,585,212	3,722,880

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自 己 株 式	株 主 資 本 合 計	その他有価証 券評価差額金	
	利 益 剰余金 合 計				
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による 累積的影響額	46,276		46,276		46,276

会計方針の変更を反映した 当期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
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
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

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28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	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰 余金
						別途 積立金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000
当期変動額						
剰余金の配当						
当期純利益						
自己株式の消却			72,415	72,415		
利益剰余金から 資本剰余金への振替			72,415	72,415		
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-
当期末残高	4,524,300	2,761,700	-	2,761,700	360,493	8,900,000

	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		
	その他利益 剰余金	利益 剰余金 合計				
	繰越 利益 剰余金					
当期首残高	3,981,245	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当期変動額						
剰余金の配当	3,446,341	3,446,341		3,446,341		3,446,341
当期純利益	3,722,880	3,722,880		3,722,880		3,722,880

自己株式の消却			72,415	-		-
利益剰余金から資本剰余金への振替	72,415	72,415		-		-
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				-	187,941	187,941
当期変動額合計	204,122	204,122	72,415	276,538	187,941	88,597
当期末残高	4,185,368	13,445,861	-	20,731,861	94,744	20,826,605

## 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

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. 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。

#### （未適用の会計基準）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

##### （1）概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

##### （2）適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

##### （3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

#### （追加情報）

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日に、新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

- 1．商号 アセットマネジメントOne株式会社
- 2．代表者 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
- 3．本店所在地 東京都千代田区丸の内1-8-2
- 4．統合日 平成28年10月1日

## （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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払手数料	777,631千円	570,839千円

2．資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
有形固定資産の減価償却累計額	573,602千円	657,201千円

## （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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
支払手数料	9,189,399千円	8,452,937千円

2．特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
固定資産・敷金の償却	-千円	140,257千円
その他	-千円	24,400千円
合計	-千円	164,657千円

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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	-	9,386	1,813,864

（変動事由の概要）

自己株式の消却

### 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	-

（変動事由の概要）

自己株式の消却

### 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27年11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17日

（金融商品関係）

#### 1．金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

##### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を

得る体制となっております。

#### 市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

#### 流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成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	-

当事業年度（平成28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	14,861,160	14,861,160	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,159,600	6,159,600	-
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	2,884,368	-

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28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	-	-	-

当事業年度(平成28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	14,861,112	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	-	-	-

(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	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-

原価を超えないもの	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。

当事業年度(平成28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	1,119,150	869,274	249,875
	小計	1,119,150	869,274	249,875
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	5,040,450	5,153,936	113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	113,485
合計		6,159,600	6,023,210	136,389

(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

当事業年度(平成28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	2,209,763	225,965	60,150
合計	2,209,763	225,965	60,150

#### 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10,952千円（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62,800千円（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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,424,739	1,348,083
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	1,352,836	1,348,083
勤務費用	90,967	91,804
利息費用	9,476	6,074
数理計算上の差異の発生額	31,927	53,747
退職給付の支払額	73,269	60,817
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,348,083	1,438,892

###### (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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
年金資産の期首残高	1,157,054	1,329,170
期待運用収益	23,141	33,229

数理計算上の差異の発生額	108,961	128,633
事業主からの拠出額	78,464	77,164
退職給付の支払額	38,450	28,253
年金資産の期末残高	1,329,170	1,282,678

## (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 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,111,797	1,185,792
年金資産	1,329,170	1,282,678
	217,373	96,885
非積立型制度の退職給付債務	236,285	253,099
未積立退職給付債務	18,912	156,213
未認識数理計算上の差異	270,020	387,977
未認識過去勤務費用	10,703	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764
退職給付引当金	155,806	146,617
前払年金費用	396,211	378,381
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	240,404	231,764

## (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 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用(注1)	119,135	124,139
利息費用	9,476	6,074
期待運用収益	23,141	33,229
数理計算上の差異の費用処理額	85,138	64,424
過去勤務費用の費用処理額	16,055	10,703
確定給付制度に係る退職給付費用	174,553	150,705

(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28,168千円、当事業年度32,335千円）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 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28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	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%

現金及び預金	1.4%	3.2%
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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
割引率	0.0720% ~ 1.625%	0.0120% ~ 0.8060%
長期期待運用収益率	2.0%	2.5%
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17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

#### (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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	170,920千円	182,614千円
減価償却超過額	896	25,871
退職給付引当金	70,882	71,201
役員退職慰労引当金	12,688	14,799
投資有価証券評価損	15,033	19,229
非上場株式評価損	25,733	24,425
未払事業税	90,342	57,445
外国税支払損失引当金	60,867	-
訴訟損失引当金	9,918	12,344
その他	87,621	120,305
繰延税金資産小計	544,905	528,236
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	544,905	528,236
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	134,624	56,708
前払年金費用	127,817	115,860
繰延税金負債合計	262,442	172,568
繰延税金資産の純額	282,463	355,668

(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	372,215千円	326,063千円
---------------	-----------	-----------

固定資産 - 長期繰延税金資産	-	29,604
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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28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が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については30.86%に、平成30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30.62%となります。

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16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

### （資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

### （セグメント情報等）

#### セグメント情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.98 間接 7.73	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	8,452,937	未払手数料	570,839

(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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	16,314
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	96,300	その他未払金	8,725
							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	18,163	その他未払金	1,728

(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。

なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。

(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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	11,433円05銭	11,481円90銭
1株当たり当期純利益金額	1,976円56銭	2,052円45銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

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

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益金額(千円)	3,585,212	3,722,880
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)	3,585,212	3,722,880
期中平均株式数(千株)	1,813	1,813

## 5【その他】

### <更新後>

#### 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)
- ・ 当社株式に関して、株券を発行する定めを廃止し、株券不発行としました。また、単元株(100株単位)について廃止しました。(平成28年1月25日実施)

#### b. 訴訟事件その他の重要事項

新光投信株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更する予定です(関係当局の認可等を前提とします)。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 3【資本関係】

### <訂正前>

- (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。  
(略)

### <訂正後>

- (1) みずほ証券株式会社は、委託者の株式の76.9%を所有しています。  
(略)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月7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	湯原 尚
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩

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10月21日から平成28年4月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの平成28年4月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10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28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。

## 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日付の統合基本合意書に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる主要事項を内定している。

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、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。