

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年3月15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】	グローバル・ナビ
【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3月16日から平成29年3月15日まで) 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

グローバル・ナビ

愛称として「世界の潮流」という名称を用いることがあります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

（イ）追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

（ロ）当初元本は1口当たり1円です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

（イ）発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

### （５）【申込手数料】

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

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

#### （6）【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

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

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

#### （7）【申込期間】

平成28年 3月16日から平成29年 3月15日までです。

なお、申込期間は原則として更新されます。

#### （8）【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所（販売会社）については、下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### a. ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属し、主としてマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」という場合があります。）および上場投資信託証券（以下「ETF」という場合があります。）に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

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

#### 商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 商品分類の定義

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

#### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)	ファミリーファンド
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回 年4回 年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他( )	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ
不動産投信		中南米	為替ヘッジ
その他資産 ( )		アフリカ 中近東(中東)	
資産複合 (株式 一般、その他 資産(株式 一般、債 券 一般、不動産投 信)(資産配分変更 型))		エマージング	あり(部分ヘッジ)  なし

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

### 属性区分の定義

資産複合(株式 一般、 その他資産(株式 一 般、債券 一般、不動産 投信)(資産配分変更 型))	目論見書または投資信託約款において、複数資産(株式 一般、投資信託証 券への投資を通じて実質的に株式 一般、債券 一般、不動産投信)を投資 対象とするものをいう。 資産配分変更型とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投 資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるもの もしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるもの をいう。
グローバル(含む日本) エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界(含 む日本)・エマージング地域(複数の新興成長国(地域))の資産を源泉と する旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファ ンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをい う。

為替ヘッジあり (部分ヘッジ) (注)	目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
------------------------	--

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

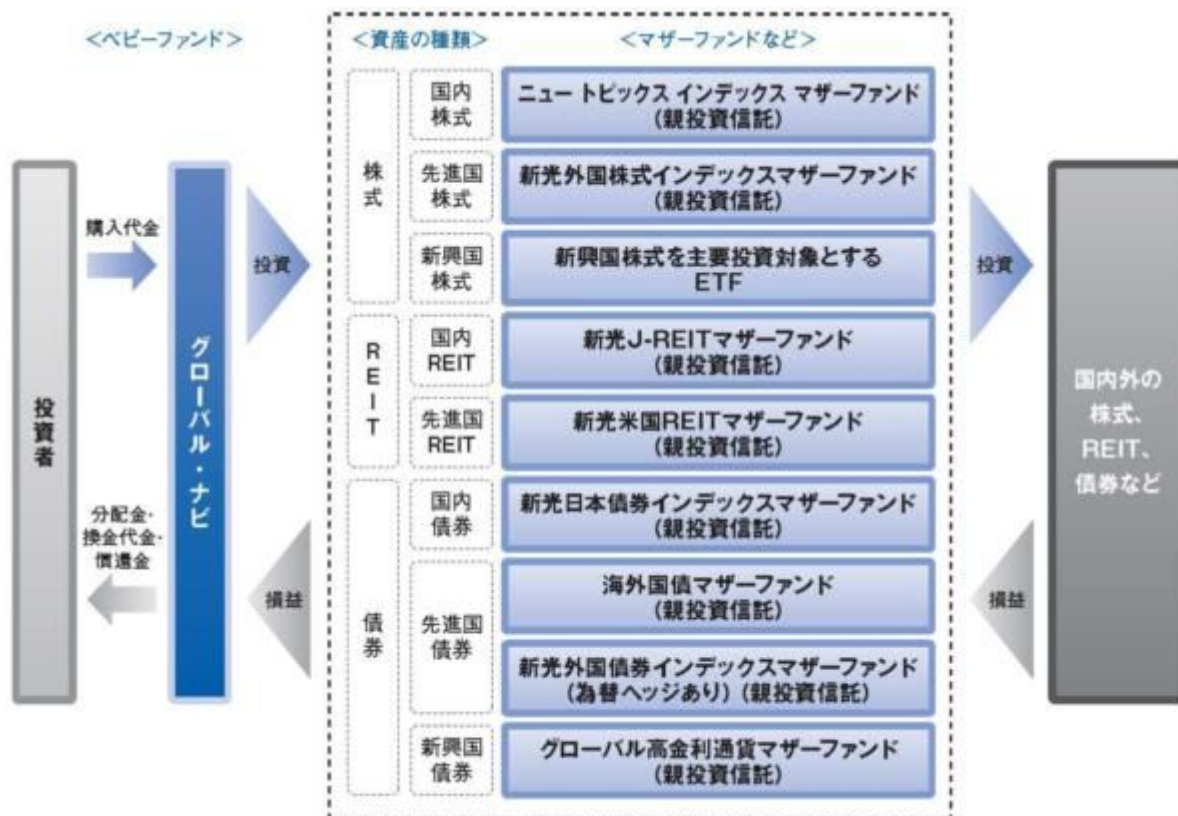
商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

## ファンドの仕組み

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド(当ファンド)としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。

新興国株式については、ベビーファンド(当ファンド)から直接ETFに投資を行います。



### b. ファンドの特色

#### 1. 国内外の株式、債券、REIT<sup>\*1</sup>に分散投資を行います。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

投資信託証券への投資を通じて、国内外の株式、債券およびREITに実質的に投資することに

より、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指します。

新興国株式については、ETF<sup>\*2</sup>への投資を行います。ETFについては、規模、流動性、ベンチマーク指数などを総合的に判断して、銘柄を決定します。

効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、国債先物取引などを利用することがあります。

\*1「REIT」とは、不動産投資信託証券を指します。

\*2「ETF」とは、Exchange Traded Fund（取引所で売買される投資信託）の略で、取引所に上場されている投資信託のことを指します。

## 2. 各資産の配分比率は、世界経済、金融市場の動向などを勘案して機動的に変更します。

各マザーファンドとETFを合算した投資比率は、原則として高位を保ちますが、市場環境などを勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

各マザーファンドとETFへの投資比率の決定にあたっては、みずほ信託銀行株式会社から投資助言および情報提供を受けます。

みずほ信託銀行は、「みずほフィナンシャルグループ」の一員で、グループ内の資産運用業務の一角を担っています。特に年金ビジネスについては、昭和37年以来、半世紀以上の長い実績を有しています。資産配分型運用は年金運用の基本であり、同行はその長年培ったノウハウを通じてさまざまな顧客ニーズに対応しています。

### <当ファンドの資産配分について>

#### Step1 株式と債券の配分比率決定・見直し

主に株式を中心とする投資環境見通しに基づいて、株式（REITを含む）と債券（現預金などを含む）の配分比率を決定します。

配分比率は、株式比率で概ね10%～90%の範囲で、投資環境の変化に応じて機動的に見直しを行います。

#### <配分比率決定・見直しのイメージ>





## Step 2 各資産の配分比率決定

Step 1 の株式・債券の配分比率に基づき、各資産の魅力度評価とリスク判断に応じて、それぞれの配分比率を決定します。

株式・債券の配分比率内において、各資産の配分比率に制限はありません。

当ファンドの資金動向、市況動向などによっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

## (参考)当ファンドが投資する各マザーファンドの運用方針

### 国内株式

#### ニュー トピックス インデックス マザーファンド

- ・東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資し、東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。

### 先進国株式

#### 新光外国株式インデックスマザーファンド

- ・主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

### 国内債券

#### 新光日本債券インデックスマザーファンド

- ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 先進国債券

#### 海外国債マザーファンド

- ・主として日本を除く世界主要先進国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国）が発行する公社債に投資し、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。
- ・シティ世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。

#### 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

- ・主として日本を除く世界主要国の公社債に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

### 新興国債券

## グローバル高金利通貨マザーファンド

- ・新興国を中心とする世界の国の中から、主として地域分散と金利水準の観点により選定した複数の通貨建ての国際機関債などに分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ・通貨配分は、北米・中南米、欧州、アジア・オセアニア、中東・アフリカの4地域について、それぞれ25%程度とすることを基本とします。各地域内における通貨配分は、金利水準や金利・為替動向、流動性などを勘案して決定します。
 

流動性の低下、市場規模の縮小、通貨制度の変更などにより、各地域に対する通貨配分比率を25%程度にできない場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

## 国内REIT

### 新光J-REITマザーファンド

- ・主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。

## 先進国REIT

### 新光米国REITマザーファンド

- ・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（REIT）に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

上記の各マザーファンドの運用方針は、各マザーファンド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、記載内容は平成28年3月15日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

## (参考)当ファンドの投資対象候補であるETFの概要（平成28年3月15日現在）

### 新興国株式

下記の投資対象候補およびその概要は平成28年3月15日現在のものであり、今後予告なく変更する場合があります。

### 名称：iシェアーズ・コア MSCI エマージング・マーケット ETF

投資目的：MSCIエマージング・マーケットIMIインデックスと同等水準の投資成果を目指しています。

運用会社：ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ

上場取引所：NYSEアーカ取引所

## 主な投資制限

株式などへの投資割合

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式などへの投資割合	同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の上場投資信託証券への投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
外貨建資産への投資割合	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

## 分配方針

原則として、年1回（毎年12月15日。休業日の場合は翌営業日。）の決算時に、収益の分配を行います。



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

分配金額は、基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。

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

運用状況により分配金額は変動します。

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

### c. 信託金限度額

委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成25年12月20日

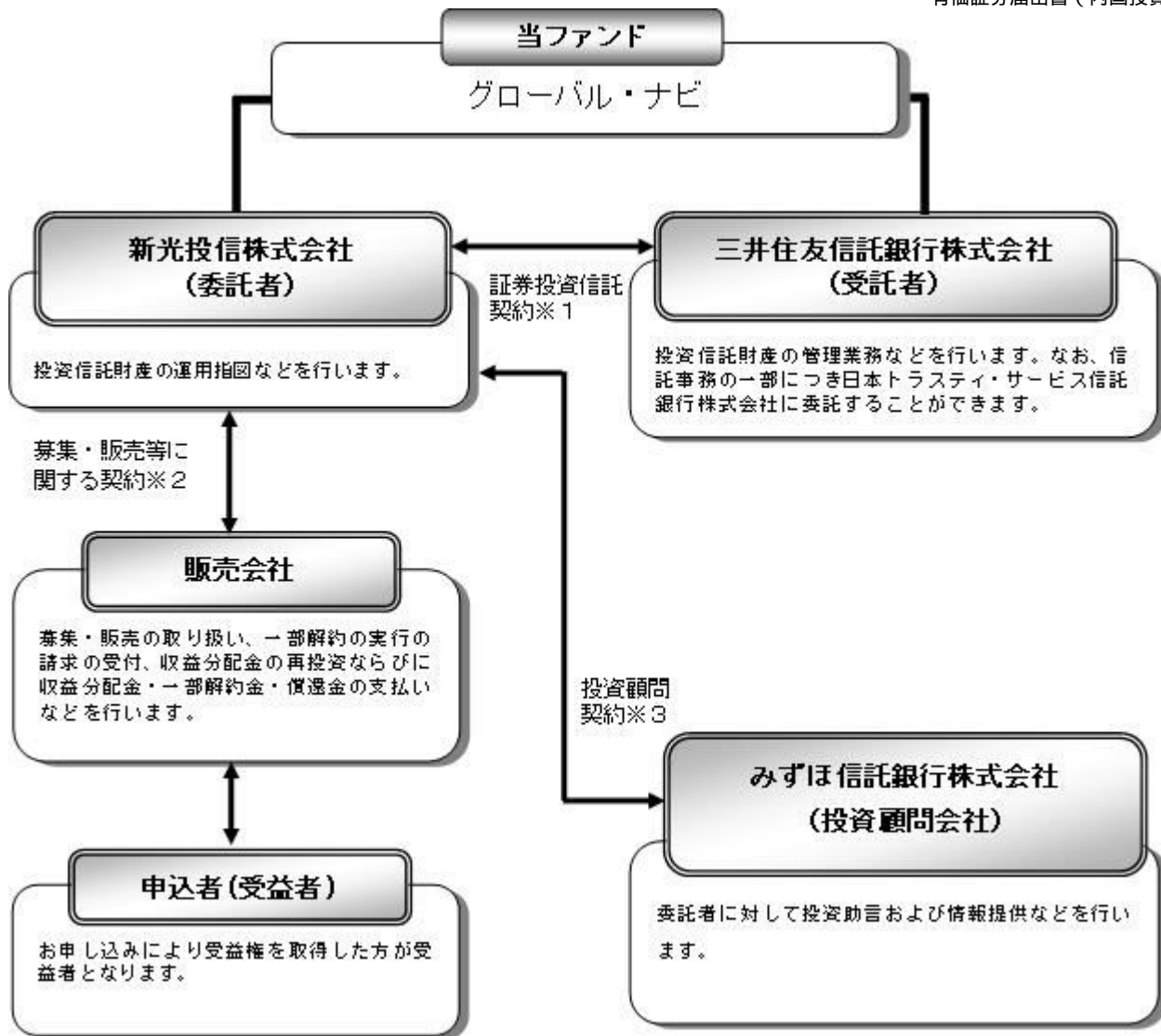
関東財務局長に対して有価証券届出書提出

平成26年1月6日

投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

### a. ファンドの仕組み



### 1 証券投資信託契約

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

### 2 募集・販売等に関する契約

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

### 3 投資顧問契約

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

## b. 委託会社の概況

### (イ) 資本金の額（平成27年12月末現在）

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

### (ロ) 委託会社の沿革

昭和36年6月	大井証券投資信託委託株式会社設立・免許取得
昭和44年10月	新和光投信委託株式会社に社名変更

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

## (八) 大株主の状況

(平成27年12月末現在)

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## a. 基本方針

当ファンドは、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

## b. 運用の方法

## (イ) 主要投資対象

ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券、新光外国株式インデックス マザーファンド受益証券、新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券、海外国債マザーファンド受益証券、新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券、グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券、新光J-REITマザーファンド受益証券、新光米国REITマザーファンド受益証券、および新興国株式を主要投資対象とする上場投資信託証券（以下「新興国株ETF」といいます。）を主要投資対象とします。

## (ロ) 投資態度

主としてマザーファンド受益証券、および新興国株ETFに投資することにより、実質的にわが国および海外の株式、債券および不動産投資信託証券に分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。投資対象のマザーファンド、および上場投資信託証券は以下の通りとします。

内国証券投資信託（親投資信託）	ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	海外国債マザーファンド受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券

内国証券投資信託(親投資信託)	グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光J-REITマザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光米国REITマザーファンド受益証券
新興国株ETF	

新興国株ETFについては、規模、流動性、ベンチマーク指数等を総合的に判断して、銘柄を決定します。

各マザーファンド受益証券、および上場投資信託証券等への投資比率は、世界経済、金融市場の動向等を勘案して機動的に変更します。

各マザーファンド受益証券と上場投資信託証券を合算した投資比率は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げることがあります。

効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、国債先物取引等を利用することがあります。

各マザーファンド受益証券、および上場投資信託証券等への投資比率の決定にあたっては、みずほ信託銀行株式会社から投資助言および情報提供を受けます。

当ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

#### (八) 主な投資制限

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券(マザーファンドおよび上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の上場投資信託証券への投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

#### 各マザーファンドの運用方針

##### ニュー トピックス インデックス マザーファンド

###### 1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数に連動する投資成果をめざした運用を行います。

###### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。

## (2) 投資態度

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。

資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。

株式の組入比率は、高位を保ちます。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、スワップ取引を行うことができます。

株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

## 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## 新光外国株式インデックスマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の

純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## 新光日本債券インデックスマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA - BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方針

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

#### (3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

### 3. 収益分配方針



運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## 海外国債マザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く、シティ世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

シティ世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。

債券ポートフォリオは、日本を除くG7構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国）が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。

運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。

#### (イ) 超過収益獲得の観点から

- ・通貨アロケーション： 投資環境判断に基づいて、通貨圏毎にオーバーウエイトやアンダーウエイトを行うこと。
- ・イールドカーブ戦略： 市場別のイールドカーブの形状予測に基づいて、ポートフォリオの構成を変化させること。
- ・セクターアロケーション： ある公社債と同等の格付けがありながら上乗せ金利のある他の公社債へ投資すること。アメリカを中心に、国債と格付けが同等で上乗せ金利のある政府機関債へ投資します。

#### (ロ) リスク管理の観点から

- ・デュレーション調整： ポートフォリオ全体のデュレーションを、ベンチマークのそれに近似させること。

外貨建資産については、ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額

に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

### 1. 基本方針

この投資信託は、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

主として日本を除く世界主要国の公社債に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

#### (3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## グローバル高金利通貨マザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

世界各国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

新興国を中心とする世界の国の中から主として地域分散と金利水準の観点により複数の通貨を選定し、当該通貨建ての国際機関債や政府機関債、州政府債を中心とする信用力の高い公社債に分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

通貨配分は、北米・中南米、欧州、アジア・オセアニア、中東・アフリカの4地域についてそれぞれ25%程度とすることを基本とします。ただし、流動性の低下、市場規模の縮小、通貨制度の変更等により、各地域に対する通貨配分比率を25%程度とできない場合があります。

各地域内における通貨配分は、金利水準や金利・為替動向、流動性等を勘案して決定します。

投資対象とする公社債は、取得時において、スタンダード・アンド・プアーズ社およびムーディーズ社のいずれかよりAA/Aa2格以上の信用格付けを付与されているものとします。

組入公社債の平均残存期間は、1～3年程度とします。

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## 新光J-REITマザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託受益証券および不動産投資法人投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

## （２）投資態度

主として東証ＲＥＩＴ指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。

大量の追加設定・解約が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

## （３）投資制限

不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。

不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

## ３．収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## 新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

### １．基本方針

この投資信託は、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。

### ２．運用方法

#### （１）投資対象

米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券（以下「ＲＥＩＴ」といいます。）を主要投資対象とします。

#### （２）投資態度

主として米国の取引所上場および店頭市場登録のＲＥＩＴに投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。

ＲＥＩＴの組入比率については、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

大量の追加設定・解約が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

#### （３）投資制限

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

REITへの投資割合には制限を設けません。

同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## (2) 【投資対象】

### a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款に定めるものに限りません。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### b. 有価証券および金融商品の指図範囲等

(イ) 委託者は、信託金を、主として第1号から第8号に掲げる新光投信株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下第1号から第8号までの親投資信託を総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第9号から第29号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券

2. 新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券

3. 新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券

4. 海外国債マザーファンド受益証券

5. 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券

6. グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券

7. 新光J-REITマザーファンド受益証券

8. 新光米国REITマザーファンド受益証券

9. 株券または新株引受権証券

10. 国債証券

11. 地方債証券

12. 特別の法律により法人の発行する債券
13. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
14. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
15. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
16. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
17. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
18. コマーシャル・ペーパー
19. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
20. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第9号から第19号までの証券または証書の性質を有するもの
21. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
22. 投資証券、新投資口予約権証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
23. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
24. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
25. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
26. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
27. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
28. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
29. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第25号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、第9号の証券または証書、第20号、第25号ならびに第26号の証券または証書のうち第9号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第10号から第14号までの証券および第22号の証券のうち投資法人債券ならびに第20号、第25号および第26号の証券または証書のうち第10号から第14号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第21号および第22号の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

c．先物

(イ) 委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

(ロ) 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(ハ) 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

d．スワップ

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 上記(ハ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

e．金利先渡取引および為替先渡取引

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則とし

て信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

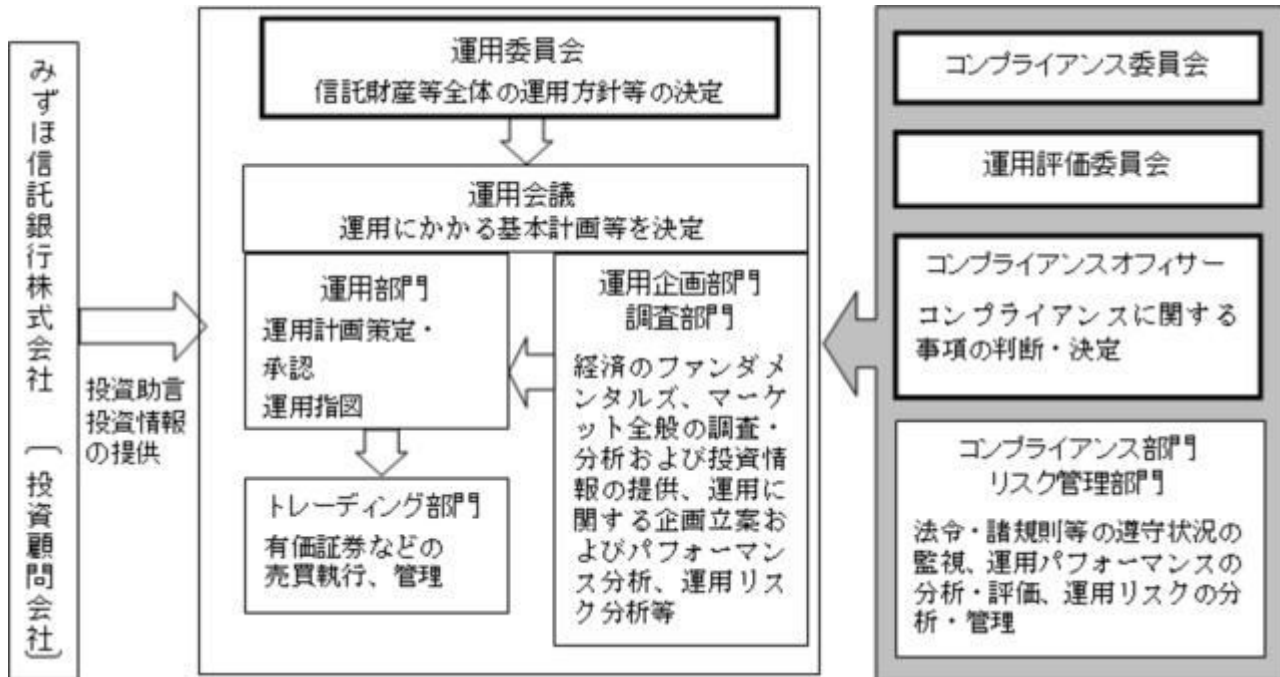
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が当該保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産にかかる保有外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が当該保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ホ) 上記（ハ）（ニ）においてマザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ヘ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ト) 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。
- f. 直物為替先渡取引
- (イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 直物為替先渡取引の評価は、金融商品取引業者または銀行等が提示する価額もしくは価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受け入れが必要と認め



たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

### (3) 【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



上記運用体制は、今後変更になることがあります。

#### PLAN

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

#### DO

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

#### SEE

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

#### < 受託者に対する管理体制 >

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

b．運用体制に関する社内規則

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

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

(4)【分配方針】

a．収益分配は年1回、原則として、12月15日（該当日が休業日の場合は翌営業日。）の決算時に以下の方針に基づき行います。

- 1．分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 2．分配金額は、基準価額水準や市況動向などを勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。
- 3．留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

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

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

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

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

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

(5)【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．株式等への投資割合

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

b．新株引受権証券等への投資割合

委託者は、取得時において投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

上記において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産

の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じ。

c．投資信託証券への投資割合

委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、当該投資信託証券のうち取引所金融商品市場（金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。）または外国市場に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券の時価総額については、合計額の計算においてこれを算入しません。

d．同一銘柄への投資割合

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(ロ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の上場投資信託証券の時価総額が、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(ハ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(ニ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

e．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

f．投資する株式等の範囲

(イ) 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

(ロ) 上記(イ)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

g．信用取引の指図範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1．投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2．株式分割により取得する株券
- 3．有償増資により取得する株券

## 4．売出しにより取得する株券

5．投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6．投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

## h．有価証券の貸し付けの指図および範囲

（イ）委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。

1．株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2．公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

（ロ）上記（イ）に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

（ハ）委託者は、有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

## i．公社債の空売りの指図範囲

（イ）委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算においてする投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。

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

## j．公社債の借り入れ

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

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

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

（ニ）借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

## k．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認め

られる場合には、制約されることがあります。

l. 外国為替予約の指図および範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図することができます。

(ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額（投資信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの投資信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

m. 資金の借入れ

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

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

n. 利害関係人等との取引等

(イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において投資信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

(ロ) 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

(ハ) 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反

しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

（二）上記（イ）（ロ）（ハ）の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

o. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

p. 信用リスク集中回避のための投資制限

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

法令に定める投資制限

a. 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

### 3【投資リスク】

#### （1）ファンドのもつリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券などに実質的に投資しますので、基準価額は変動します。また、外貨建資産に実質的に投資した場合、為替相場の変動などの影響も受けます。

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

a. 資産配分リスク

当ファンドの実質資産配分において、配分比率が大きい資産の収益率が低下した場合や、一つあるいは複数またはすべての資産価値が下落する場合にはその影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

b. 株価変動リスク

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、金利動向、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係などの影響を受け変動します。一般に、株価が下落した場合にはその影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

c. REITの価格変動リスク

REITの保有不動産の評価の下落、REITの配当金の減少、企業体としてのREITに対する評価の悪化などの原因によりREITの価格が下落する場合があります。その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

d. 為替変動リスク

外貨建資産は、為替相場の変動により円換算価格が変動します。一般に、保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも、投資先の通貨に対して円高となった場合には、当該外貨建資産の円換算価格が下落し、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

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

当ファンドが投資対象とする「新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」では、保有する外貨建資産について原則として為替ヘッジを行いますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、円と投資先の通貨の為替変動の影響を受ける場合があります。為替ヘッジを行うにあたり、円金利が当該通貨の金利より低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

#### e．カントリーリスク

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制などの要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。これらの影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。一般に新興国市場は、先進国市場に比べて規模が小さく、流動性も低く、金融インフラが未発達であり、様々な地政学的問題を抱えていることから、カントリーリスクはより高くなる可能性があります。

#### f．金利変動リスク

公社債の価格は、金利水準の変化にともない変動します。一般に、金利が上昇した場合には公社債の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

#### g．信用リスク

有価証券などの発行体が業績悪化・経営不振あるいは倒産に陥った場合、当該有価証券の価値が大きく減少すること、もしくは無くなる場合があります。また、有価証券の信用力の低下や格付けの引き下げ、債務不履行が生じた場合には、当該有価証券の価格は下落します。これらの影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

#### h．流動性リスク

有価証券などを売買する際、当該有価証券などの市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、希望する時期に、希望する価格で、希望する数量を売買することができない可能性があります。特に流動性の低い有価証券などを売却する場合にはその影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

#### i．他のベビーファンドの影響

当ファンドが投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のファンド（ベビーファンド）において、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。これにより、マザーファンドの基準価額が下落した場合には、その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

#### j．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

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

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

- (二) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。
- (ホ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入る有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ヘ) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (ト) 投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
- また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

### 東証株価指数について

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

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

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

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

東証は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東証は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ニュー トピックス インデックス マザーファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、ニュー トピックス インデックス マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

### MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）について



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

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

### **NOMURA - BPI総合について**

NOMURA - BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募利付債券市場全体の動向を表す投資収益指標で、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA - BPIに関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果などに関して一切責任を負うものではありません。

### **シティ世界国債インデックスについて**

シティ世界国債インデックスとは、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均して指数化したもので、Citigroup Index LLCが開発した指数です。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産です。同社は、各指数の算出、公表、利用など各指数に関する一切の権利を有しています。同社は、当ファンドの運用成績などに関する一切の責任を負いません。

### **東証REIT指数（配当込み）について**

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

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

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

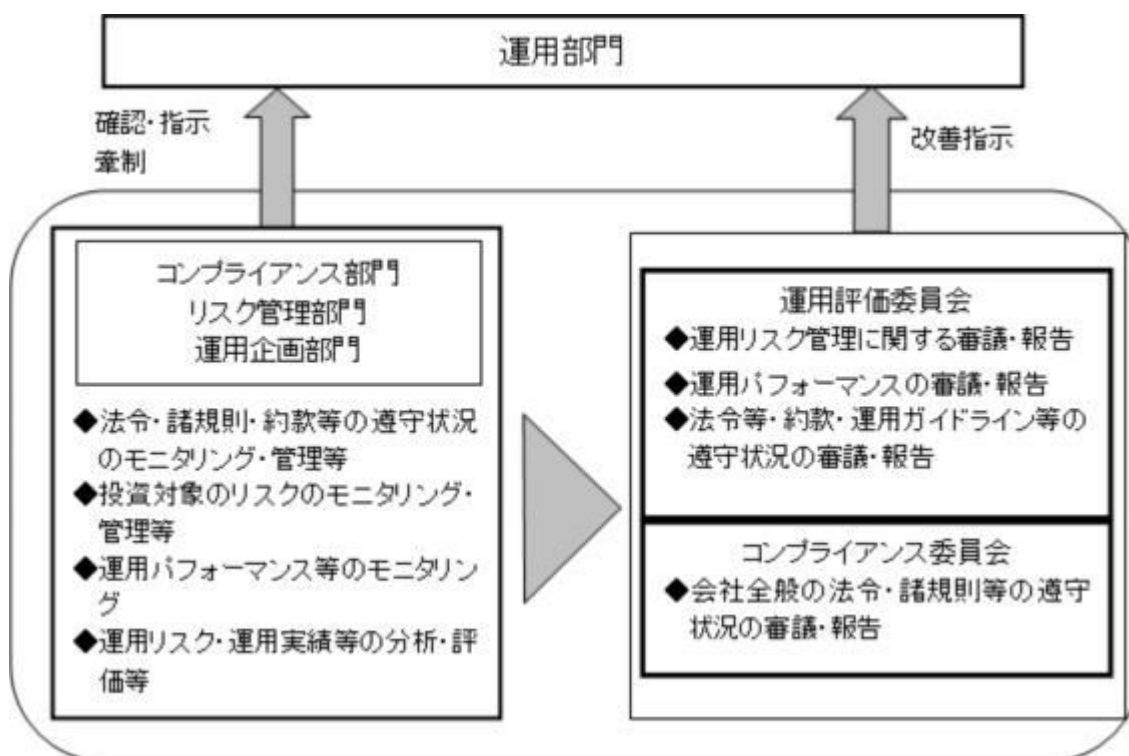
FTSE、London Stock Exchange Plc(以下「ロンドン証券取引所」といいます。)、The Financial Times Limited(以下「FT」といいます。)、National Association of Real Estate Investment Trusts(以下「全米不動産投資信託協会」といいます。 )は、新光米国REITマザーファンドに関して、保証、推奨、販売もしくは奨励を行うものではありません。

FTSE、ロンドン証券取引所、全米不動産投資信託協会は、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの使用により得られる結果もしくは特定日の特定時刻などにおける当該インデックスの数値に関して、明示的であるか黙示的であるかを問わず、一切の表明または保証を行いません。FTSE、ロンドン証券取引所、FT、全米不動産投資信託協会は、過失によるか否かを問わず、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおけるいかなる過誤に対しても、一切の責任を負うものではなくまた通知する義務を負いません。

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

## (2) リスク管理体制

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



上記リスク管理体制は、今後変更になることがあります。

## <参考情報>

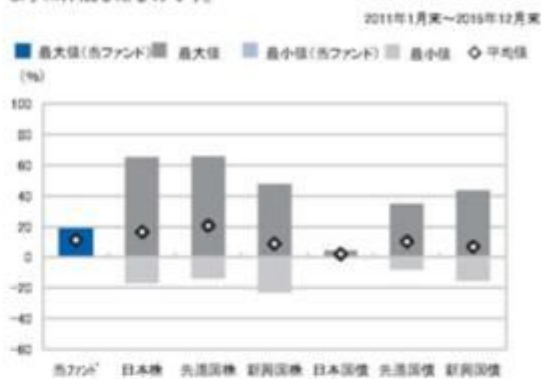
### ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- ※分配金再投資基準価額は、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- ※年間騰落率は、2015年1月から2015年12月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



※最大の騰落率は、2011年1月から2015年12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。

	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	18.7	65.0	65.7	47.4	4.5	34.9	43.7
最小値	0.4	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△7.9	△15.0
平均値	11.3	16.6	20.7	8.8	2.3	10.2	6.9

- ※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1月から2015年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- ※決算日に対応した数値とは異なります。
- ※当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

#### 各資産クラスの指数

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

#### 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

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

#### MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

#### MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

#### NCMJRA-BPI国債

NCMJRA-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、NCMJRA-BPI国債に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

#### シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。

なお、シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

## （2）【換金（解約）手数料】

### a．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

### b．信託財産留保額

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

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

## （3）【信託報酬等】

日々のファンドの純資産総額に年率1.5336%（税抜1.42%）を乗じて得た額とします。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産から支払われます。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬の配分 >

委託者	年率0.67%（税抜）	委託した資金の運用、基準価額の算出などの対価
-----	-------------	------------------------

販売会社	年率0.70%（税抜）	購入後の情報提供、運用報告書など各種書類の送付、分配金・償還金・換金代金支払などの事務手続きなどの対価
受託者	年率0.05%（税抜）	運用財産の管理、委託者からの指図の実行などの対価

（注1）委託者の信託報酬には投資顧問会社（みずほ信託銀行株式会社）に対する報酬（年率0.32%（税抜））が含まれています。

（注2）ファンドが投資対象とするETFおよび実質的に投資対象とするREITについては、市場の需給により価格が形成されるため、その費用を表示することができません。

#### （4）【その他の手数料等】

- a．投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、監査法人に支払うファンドの監査報酬、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。
- b．投資信託財産にかかる監査報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、当該監査報酬にかかる消費税等とともに投資信託財産中から支払われます。
- c．証券取引に伴う手数料・税金等、当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税および資産を外国で保管する場合の費用、先物取引・オプション取引等に要する費用ならびに特定資産の価格調査費用についても投資信託財産が負担します。
- d．「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。

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

#### （5）【課税上の取扱い】

##### a．個人の受益者の場合

##### （イ）収益分配金の取り扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません。）・申告分離課税のいずれかを選択することもできます。

##### （ロ）一部解約金・償還金の取り扱い

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

##### （ハ）損益通算について

一部解約時、償還時に生じた損失（譲渡損）は、確定申告を行うことにより上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額（配当所得については申告分離課税を選択

したものに限りません。)から差し引くこと(損益通算)ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。一部解約時、償還時に生じた差益(譲渡益)は、上場株式等の譲渡損と損益通算ができます。

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合 >

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、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。

b. 法人の受益者の場合

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

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

なお、益金不算入制度は適用されません。

c. 個別元本について

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

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

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

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

d. 収益分配金の課税について

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

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

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

となります。

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

上記は平成28年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等は、上記「（５）課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### （１）【投資状況】

#### グローバル・ナビ

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	186,268,165	95.09
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,611,220	4.90
純資産総額		195,879,385	100.00

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

#### （参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	12,017,844,570	94.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		638,191,685	5.04
純資産総額		12,656,036,255	100.00

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

#### （参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	6,053,519,793	53.54
	カナダ	357,095,572	3.15
	モーリシャス	696,782	0.00
	パナマ	7,761,058	0.06
	ドイツ	379,241,314	3.35
	イタリア	91,421,377	0.80

	フランス	378,888,958	3.35
	オランダ	172,130,563	1.52
	スペイン	135,482,715	1.19
	ベルギー	61,769,385	0.54
	オーストリア	8,001,046	0.07
	ルクセンブルグ	9,977,314	0.08
	フィンランド	39,725,061	0.35
	アイルランド	177,822,388	1.57
	ポルトガル	6,573,680	0.05
	イギリス	731,438,860	6.46
	スイス	465,235,155	4.11
	スウェーデン	134,566,894	1.19
	ノルウェー	27,857,359	0.24
	デンマーク	90,352,634	0.79
	ケイマン諸島	27,589,800	0.24
	リベリア	6,114,833	0.05
	オーストラリア	248,857,513	2.20
	バミューダ諸島	39,270,190	0.34
	ニュージーランド	7,052,281	0.06
	パプアニューギニア	2,056,616	0.01
	香港	104,832,029	0.92
	シンガポール	67,344,468	0.59
	イスラエル	32,596,500	0.28
	キュラソー	30,334,521	0.26
	ジャージー	39,414,976	0.34
	英ヴァージン諸島	2,759,989	0.02
	マン島	1,398,688	0.01
	小計	9,939,180,312	87.91
投資信託受益証券	シンガポール	1,226,000	0.01
投資証券	アメリカ	199,312,020	1.76
	カナダ	1,933,415	0.01
	フランス	14,960,802	0.13
	イギリス	13,830,100	0.12
	オーストラリア	24,369,660	0.21
	香港	5,109,023	0.04
	シンガポール	4,513,984	0.03
	小計	264,029,004	2.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,100,828,281	9.73
純資産総額		11,305,263,597	100.00

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



## （参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	12,849,543,200	80.01
地方債証券	日本	1,192,710,700	7.42
特殊債券	日本	1,222,503,300	7.61
社債券	日本	736,520,000	4.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		57,667,311	0.35
純資産総額		16,058,944,511	100.00

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

## （参考）海外国債マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	16,519,395,790	43.01
	カナダ	528,254,045	1.37
	ドイツ	3,155,701,752	8.21
	イタリア	6,813,994,046	17.74
	フランス	6,107,322,080	15.90
	イギリス	4,528,580,890	11.79
	小計	37,653,248,603	98.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		750,127,714	1.95
純資産総額		38,403,376,317	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）新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	6,547,676,606	42.06
	カナダ	308,822,465	1.98
	メキシコ	147,425,600	0.94
	ドイツ	1,162,514,604	7.46
	イタリア	1,513,963,245	9.72
	フランス	1,479,869,865	9.50
	オランダ	384,503,542	2.47

	スペイン	828,355,632	5.32
	ベルギー	396,679,090	2.54
	オーストリア	241,853,294	1.55
	フィンランド	92,700,195	0.59
	アイルランド	128,436,220	0.82
	イギリス	1,245,454,457	8.00
	スウェーデン	70,611,960	0.45
	ノルウェー	46,642,322	0.29
	デンマーク	96,265,930	0.61
	ポーランド	87,529,933	0.56
	オーストラリア	269,546,894	1.73
	シンガポール	58,402,063	0.37
	南アフリカ	64,163,708	0.41
	小計	15,171,417,625	97.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		393,625,136	2.52
純資産総額		15,565,042,761	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) グローバル高金利通貨マザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
特殊債券	国際機関	8,141,809,635	95.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		392,937,597	4.60
純資産総額		8,534,747,232	100.00

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

(参考) 新光J-REITマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	2,343,790,400	98.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		43,071,479	1.80
純資産総額		2,386,861,879	100.00

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

(参考) 新光米国REITマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	940,399,088	97.75
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		21,596,623	2.24
純資産総額		961,995,711	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】

#### グローバル・ナビ

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	ニュー トピックス インデック スマザーファンド	25,838,860	1.8550	47,931,412	1.9111	49,380,645	25.20
2	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	31,925,627	1.2214	38,993,961	1.2258	39,134,433	19.97
3	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	16,665,787	2.3352	38,917,946	2.3011	38,349,642	19.57
4	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式インデックスマザー ファンド	15,539,236	1.8823	29,250,686	1.9397	30,141,456	15.38
5	日本	親投資信託 受益証券	新光外国債券インデックスマザー ファンド（為替ヘッジあり）	14,585,422	1.3314	19,419,031	1.3248	19,322,767	9.86
6	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	6,404,138	1.4930	9,561,490	1.5520	9,939,222	5.07

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

#### ロ. 種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.09
合計	95.09

#### (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機 器	65,600	7,403.83	485,691,248	7,488.00	491,212,800	3.88

2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	417,800	627.46	262,152,788	757.10	316,316,380	2.49
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	40,300	3,295.08	132,791,724	4,836.00	194,890,800	1.53
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	41,700	4,088.16	170,476,272	4,606.00	192,070,200	1.51
5	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	47,500	3,562.83	169,234,425	3,910.00	185,725,000	1.46
6	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	29,500	6,953.99	205,142,705	6,139.00	181,100,500	1.43
7	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	733,500	197.78	145,071,630	243.50	178,607,250	1.41
8	日本	株式	KDDI	情報・通信業	52,900	2,556.04	135,214,516	3,154.00	166,846,600	1.31
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	34,900	3,282.22	114,549,478	4,471.00	156,037,900	1.23
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	22,000	5,185.20	114,074,400	6,065.00	133,430,000	1.05
11	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	21,800	4,233.18	92,283,324	5,550.00	120,990,000	0.95
12	日本	株式	ファナック	電気機器	5,400	18,976.84	102,474,936	21,080.00	113,832,000	0.89
13	日本	株式	ソニー	電気機器	37,200	2,558.74	95,185,128	3,002.00	111,674,400	0.88
14	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	9,600	9,055.91	86,936,736	11,450.00	109,920,000	0.86
15	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	61,900	1,732.68	107,252,892	1,731.50	107,179,850	0.84
16	日本	株式	キヤノン	電気機器	28,400	3,736.95	106,129,380	3,675.00	104,370,000	0.82
17	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	4,700	18,207.25	85,574,075	21,600.00	101,520,000	0.80
18	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	40,200	1,918.36	77,118,072	2,484.00	99,856,800	0.78
19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	21,100	3,849.22	81,218,542	4,712.00	99,423,200	0.78
20	日本	株式	三菱地所	不動産業	39,000	2,399.11	93,565,290	2,523.50	98,416,500	0.77
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	5,500	13,401.77	73,709,735	17,570.00	96,635,000	0.76
22	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	74,100	1,003.55	74,363,055	1,279.50	94,810,950	0.74
23	日本	株式	日立製作所	電気機器	135,000	859.13	115,982,550	691.50	93,352,500	0.73
24	日本	株式	花王	化学	14,900	4,943.86	73,663,514	6,255.00	93,199,500	0.73
25	日本	株式	三井不動産	不動産業	28,000	3,094.26	86,639,280	3,056.00	85,568,000	0.67
26	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	16,700	4,163.03	69,522,601	5,027.00	83,950,900	0.66
27	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,200	52,501.84	63,002,208	67,080.00	80,496,000	0.63
28	日本	株式	三菱商事	卸売業	39,100	2,064.33	80,715,303	2,028.00	79,294,800	0.62
29	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	18,600	4,256.38	79,168,668	4,174.00	77,636,400	0.61
30	日本	株式	デンソー	輸送用機器	13,000	5,297.96	68,873,480	5,818.00	75,634,000	0.59

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.33
		建設業	2.80
		食料品	4.32

繊維製品	0.67
パルプ・紙	0.22
化学	5.76
医薬品	5.12
石油・石炭製品	0.46
ゴム製品	0.83
ガラス・土石製品	0.88
鉄鋼	1.15
非鉄金属	0.84
金属製品	0.62
機械	4.37
電気機器	11.19
輸送用機器	10.22
精密機器	1.49
その他製品	1.39
電気・ガス業	2.01
陸運業	4.21
海運業	0.23
空運業	0.61
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.06
卸売業	3.75
小売業	4.52
銀行業	8.69
証券、商品先物取引業	1.10
保険業	2.50
その他金融業	1.27
不動産業	2.59
サービス業	3.29
合計	94.95

（参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成27年12月30日現在）

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	15,933	14,541.94	231,696,853	13,115.1314	208,963,389	1.84
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	21,228	6,532.23	138,666,339	6,820.4954	144,785,478	1.28
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	11,649	9,883.98	115,138,594	9,547.4875	111,218,683	0.98

4	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO (US)	資本財	26,369	3,588.14	94,615,861	3,772.6807	99,481,820	0.87
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,737	12,162.31	94,099,811	12,547.0582	97,076,590	0.85
6	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,112	79,058.64	87,913,218	83,699.7221	93,074,091	0.82
7	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	13,625	6,690.23	91,154,475	6,668.5268	90,858,679	0.80
8	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	9,737	9,089.69	88,506,370	9,132.2279	88,920,504	0.78
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	10,332	8,127.90	83,977,545	8,089.3127	83,578,779	0.73
10	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	866	87,428.98	75,713,499	93,665.7263	81,114,519	0.71
11	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	6,003	12,843.75	77,101,084	12,936.6285	77,658,581	0.68
12	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	810	91,032.80	73,736,576	95,759.5160	77,565,208	0.68
13	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	10,778.82	74,902,048	10,633.0000	73,888,717	0.65
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	7,622	9,093.99	69,314,422	9,692.2196	73,874,098	0.65
15	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	17,272	3,960.83	68,411,497	4,212.9073	72,765,335	0.64
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	32,409.38	69,550,538	33,843.3201	72,627,765	0.64
17	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	17,301	4,058.52	70,216,567	3,959.6263	68,505,495	0.60
18	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	11,359	5,463.63	62,061,407	5,693.9980	64,678,124	0.57
19	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	11,634	5,010.13	58,287,961	5,271.8630	61,332,855	0.54
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	29,164	2,132.38	62,188,870	2,084.1407	60,781,882	0.53
21	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	5,283	11,134.71	58,824,700	11,005.6625	58,142,915	0.51
22	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	4,480	14,041.41	62,905,544	12,914.9187	57,858,836	0.51
23	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	3,588	15,015.94	53,877,211	16,125.5571	57,858,499	0.51
24	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	13,329	4,022.34	53,613,817	4,274.4184	56,973,723	0.50
25	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	8,409	6,719.18	56,501,611	6,389.9178	53,732,819	0.47
26	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	3,311	16,161.90	53,512,071	16,178.6254	53,567,429	0.47
27	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	5,500	9,412.40	51,768,225	9,553.5181	52,544,350	0.46
28	アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,129	13,039.14	53,838,639	12,466.2496	51,473,145	0.45
29	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,938	6,541.88	51,929,494	6,433.3373	51,067,832	0.45

30	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	4,104	11,925.91	48,943,963	12,235.8845	50,216,070	0.44
----	------	----	-------------	-----------	-------	-----------	------------	-------------	------------	------

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.88
		素材	3.91
		資本財	6.48
		商業・専門サービス	0.85
		運輸	1.66
		自動車・自動車部品	1.54
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.66
		メディア	2.68
		小売	3.66
		食品・生活必需品小売り	1.92
		食品・飲料・タバコ	5.65
		家庭用品・パーソナル用品	1.95
		ヘルスケア機器・サービス	3.31
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.36
		銀行	8.18
		各種金融	3.76
		保険	4.03
		不動産	0.64
		ソフトウェア・サービス	7.85
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.71		
電気通信サービス	2.84		
公益事業	2.93		
半導体・半導体製造装置	1.68		
投資信託受益証券			0.01
投資証券			2.33
合計			90.26

(参考)新光日本債券インデックスマザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第103回利付 国債(5年)	230,000,000	100.40	230,942,500	100.43	230,995,900	0.3000	2017.03.20	1.43
2	日本	国債証券	第308回利付 国債(10年)	210,000,000	105.83	222,257,700	105.67	221,913,300	1.3000	2020.06.20	1.38
3	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	200,000,000	103.25	206,512,900	103.71	207,426,000	0.6000	2024.06.20	1.29
4	日本	国債証券	第105回利付 国債(5年)	200,000,000	100.32	200,651,200	100.37	200,756,000	0.2000	2017.06.20	1.25
5	日本	国債証券	第313回利付 国債(10年)	180,000,000	106.69	192,056,400	106.59	191,874,600	1.3000	2021.03.20	1.19
6	日本	国債証券	第123回利付 国債(5年)	190,000,000	100.34	190,659,300	100.35	190,678,300	0.1000	2020.03.20	1.18
7	日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	180,000,000	105.97	190,750,000	105.79	190,429,200	1.4000	2020.03.20	1.18
8	日本	国債証券	第323回利付 国債(10年)	180,000,000	105.42	189,756,000	105.50	189,903,600	0.9000	2022.06.20	1.18
9	日本	国債証券	第315回利付 国債(10年)	170,000,000	106.42	180,922,500	106.34	180,781,400	1.2000	2021.06.20	1.12
10	日本	国債証券	第124回利付 国債(5年)	180,000,000	100.34	180,619,200	100.35	180,640,800	0.1000	2020.06.20	1.12
11	日本	国債証券	第303回利付 国債(10年)	170,000,000	105.33	179,064,000	105.17	178,789,000	1.4000	2019.09.20	1.11
12	日本	国債証券	第335回利付 国債(10年)	170,000,000	102.34	173,982,200	102.83	174,812,700	0.5000	2024.09.20	1.08
13	日本	国債証券	第285回利付 国債(10年)	170,000,000	102.30	173,915,100	102.11	173,590,400	1.7000	2017.03.20	1.08
14	日本	国債証券	第338回利付 国債(10年)	170,000,000	101.18	172,014,500	101.76	172,993,700	0.4000	2025.03.20	1.07
15	日本	国債証券	第106回利付 国債(5年)	170,000,000	100.38	170,649,000	100.43	170,739,500	0.2000	2017.09.20	1.06
16	日本	国債証券	第340回利付 国債(10年)	160,000,000	100.92	161,487,600	101.46	162,350,400	0.4000	2025.09.20	1.01
17	日本	国債証券	第107回利付 国債(5年)	160,000,000	100.42	160,679,800	100.46	160,750,400	0.2000	2017.12.20	1.00
18	日本	国債証券	第125回利付 国債(5年)	160,000,000	100.31	160,498,400	100.35	160,563,200	0.1000	2020.09.20	0.99
19	日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	150,000,000	105.93	158,902,500	105.79	158,685,000	1.2000	2020.12.20	0.98
20	日本	国債証券	第310回利付 国債(10年)	150,000,000	104.70	157,053,000	104.55	156,838,500	1.0000	2020.09.20	0.97
21	日本	国債証券	第118回利付 国債(5年)	140,000,000	100.70	140,982,000	100.69	140,966,000	0.2000	2019.06.20	0.87
22	日本	国債証券	第116回利付 国債(5年)	140,000,000	100.60	140,847,000	100.63	140,889,000	0.2000	2018.12.20	0.87
23	日本	国債証券	第122回利付 国債(5年)	140,000,000	100.34	140,484,000	100.37	140,525,000	0.1000	2019.12.20	0.87
24	日本	国債証券	第293回利付 国債(10年)	130,000,000	104.68	136,089,200	104.45	135,794,100	1.8000	2018.06.20	0.84
25	日本	国債証券	第290回利付 国債(10年)	130,000,000	103.29	134,277,000	103.14	134,082,000	1.4000	2018.03.20	0.83
26	日本	国債証券	第117回利付 国債(5年)	130,000,000	100.65	130,848,900	100.67	130,873,600	0.2000	2019.03.20	0.81
27	日本	国債証券	第109回利付 国債(5年)	130,000,000	100.23	130,305,500	100.27	130,357,500	0.1000	2018.03.20	0.81
28	日本	国債証券	第332回利付 国債(10年)	120,000,000	103.39	124,075,200	103.78	124,538,400	0.6000	2023.12.20	0.77
29	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	120.57	120,570,000	2.2200	2029.03.19	0.75



30	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	120.06	120,060,000	2.1000	2029.12.28	0.74
----	----	------	---------------------------	-------------	--------	-------------	--------	-------------	--------	------------	------

(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27年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	80.01
地方債証券	7.42
特殊債券	7.61
社債券	4.58
合計	99.64

#### (参考)海外国債マザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,400,000	12,258.85	1,642,686,942	12,158.9956	1,629,305,414	2.3750	2024.08.15	4.24
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,400,000	12,114.42	1,623,333,226	12,021.4248	1,610,870,928	2.2500	2024.11.15	4.19
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,100,000	12,392.67	1,623,440,752	12,295.6241	1,610,726,768	2.5000	2024.05.15	4.19
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,500,000	11,961.48	1,614,800,104	11,865.9510	1,601,903,394	2.1250	2025.05.15	4.17
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,400,000	11,828.24	1,584,985,125	11,721.7843	1,570,719,107	2.0000	2025.08.15	4.09
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,800,000	11,848.00	1,516,544,335	11,752.8791	1,504,368,537	2.0000	2025.02.15	3.91
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,700,000	12,659.98	1,481,218,043	12,553.8049	1,468,795,181	2.7500	2023.11.15	3.82
8	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,500,000	17,000.96	1,275,072,404	16,886.3254	1,266,474,412	4.2500	2023.10.25	3.29
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,500,000	11,805.46	1,239,574,178	11,725.5534	1,231,183,111	1.7500	2023.05.15	3.20
10	イギリス	国債証券	TSY	6,300,000	19,160.60	1,207,117,911	19,256.2150	1,213,141,546	2.7500	2024.09.07	3.15
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,600,000	12,646.09	1,214,024,834	12,532.1328	1,203,084,750	2.7500	2024.02.15	3.13
12	イギリス	国債証券	TSY	6,400,000	18,514.45	1,184,925,236	18,572.9178	1,188,666,743	2.2500	2023.09.07	3.09
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,800,000	12,066.26	1,182,493,909	11,964.8888	1,172,559,112	2.0000	2023.02.15	3.05
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,900,000	12,447.14	1,107,795,688	12,342.7374	1,098,503,635	2.5000	2023.08.15	2.86
15	イギリス	国債証券	TSY	6,000,000	17,966.22	1,077,973,318	18,026.3874	1,081,583,244	2.0000	2025.09.07	2.81
16	イギリス	国債証券	TSY	4,600,000	22,703.38	1,044,355,527	22,721.5077	1,045,189,357	5.0000	2025.03.07	2.72
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000	16,546.35	943,142,457	16,520.0048	941,640,279	4.7500	2023.08.01	2.45

18	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000	17,106.38	940,850,977	17,091.8866	940,053,768	5.0000	2025.03.01	2.44
19	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,500,000	19,693.02	886,186,193	19,504.5954	877,706,793	6.0000	2025.10.25	2.28
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000	16,361.88	867,179,688	16,347.3862	866,411,469	4.5000	2024.03.01	2.25
21	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,000,000	14,390.60	863,436,102	14,315.4928	858,929,568	1.7500	2023.05.25	2.23
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000	18,337.11	825,170,094	18,264.6396	821,908,786	5.2500	2029.11.01	2.14
23	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,600,000	14,318.12	801,815,179	14,220.6184	796,354,631	1.7500	2024.11.25	2.07
24	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,200,000	14,916.36	775,650,928	14,801.7240	769,689,653	2.2500	2024.05.25	2.00
25	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,800,000	12,776.41	741,032,314	12,746.1121	739,274,502	0.5000	2025.05.25	1.92
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000	15,623.96	718,702,569	15,596.2971	717,429,671	3.7500	2024.09.01	1.86
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,200,000	16,239.33	682,052,061	16,244.6055	682,273,435	4.5000	2023.05.01	1.77
28	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000	14,258.83	670,165,089	14,266.7378	670,536,681	2.5000	2024.12.01	1.74
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,085.49	604,274,945	11,995.0414	599,752,070	2.2500	2025.11.15	1.56
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000	13,119.02	590,355,953	13,146.6928	591,601,180	1.5000	2025.06.01	1.54

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ. 種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.04
合計	98.04

(参考) 新光外国債券インデックスマザーファンド (為替ヘッジあり)

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	11,995.44	335,872,466	11,964.8888	335,016,889	0.5000	2017.07.31	2.15
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,600,000	11,983.66	311,575,205	11,948.3991	310,658,379	0.7500	2018.02.28	1.99
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	12,740.37	254,807,466	12,643.3201	252,866,402	4.5000	2017.05.15	1.62
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	12,609.39	252,187,972	12,554.7472	251,094,944	2.7500	2019.02.15	1.61
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	12,136.38	242,727,624	12,158.9956	243,179,912	2.3750	2024.08.15	1.56

6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	12,185.37	231,522,201	12,182.5522	231,468,493	2.1250	2021.08.15	1.48
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	12,156.16	230,967,207	12,126.9585	230,412,213	1.5000	2018.08.31	1.48
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	12,529.30	225,527,509	12,512.3452	225,222,215	2.6250	2020.11.15	1.44
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	12,999.49	207,991,944	12,934.4801	206,951,682	3.6250	2019.08.15	1.32
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	12,087.32	205,484,577	11,995.0414	203,915,704	2.2500	2025.11.15	1.31
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,539.67	188,095,065	12,513.2875	187,699,313	2.6250	2020.08.15	1.20
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000	17,960.25	179,602,510	18,264.6397	182,646,397	5.2500	2029.11.01	1.17
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	13,851.30	180,066,960	14,030.3350	182,394,356	3.8750	2040.08.15	1.17
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,108.58	181,628,765	12,076.0762	181,141,144	1.0000	2017.03.31	1.16
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,084.55	181,268,350	12,051.5772	180,773,659	0.8750	2017.04.30	1.16
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	12,911.86	180,766,121	12,863.8103	180,093,345	3.3750	2019.11.15	1.15
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	12,895.84	180,541,860	12,826.1196	179,565,675	3.8750	2018.05.15	1.15
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	16,191.89	178,110,818	16,083.5317	176,918,849	8.0000	2021.11.15	1.13
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	11,684.09	175,261,407	11,685.0359	175,275,539	1.6250	2022.11.15	1.12
20	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	800,000	21,328.29	170,626,338	21,340.1515	170,721,212	5.7500	2032.10.25	1.09
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	12,026.13	168,365,906	11,987.5032	167,825,046	0.7500	2017.10.31	1.07
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000	17,991.87	161,926,882	18,434.6230	165,911,607	5.0000	2034.08.01	1.06
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	12,550.03	163,150,468	12,553.8050	163,199,465	2.7500	2023.11.15	1.04
24	イギリス	国債証券	TSY	650,000	24,240.60	157,563,907	24,687.7300	160,470,245	4.2500	2049.12.07	1.03
25	イギリス	国債証券	TSY	650,000	24,238.09	157,547,640	24,627.8389	160,080,953	4.7500	2038.12.07	1.02
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	12,999.49	155,993,959	12,950.4987	155,405,985	3.5000	2020.05.15	0.99
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000	16,956.16	152,605,473	17,091.8866	153,826,980	5.0000	2025.03.01	0.98
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	12,860.98	154,331,802	12,767.6991	153,212,390	4.2500	2017.11.15	0.98
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	12,764.87	153,178,469	12,712.1055	152,545,266	3.1250	2019.05.15	0.98
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000	15,347.25	138,125,266	15,352.5226	138,172,704	4.5000	2020.02.01	0.88

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ. 種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	97.47
合計	97.47

(参考) グローバル高金利通貨マザーファンド

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	16,355,000	4,389.18	717,851,174	4,192.6169	685,702,510	14.0000	2016.07.05	8.03
2	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	23,000,000	3,085.54	709,675,508	2,973.3248	683,864,704	10.0000	2017.06.12	8.01
3	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2,730,000	21,381.27	583,708,834	21,190.7934	578,508,660	5.3750	2021.06.07	6.77
4	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	5,655,000	10,117.23	572,129,694	9,895.3960	559,584,644	5.7500	2020.07.28	6.55
5	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	16,830,000	3,043.60	512,238,198	3,017.2885	507,809,671	9.0000	2016.09.30	5.94
6	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2,555,000	18,470.55	471,922,705	18,430.4301	470,897,491	2.2500	2020.03.07	5.51
7	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	61,760,000	786.76	485,905,384	759.6123	469,136,618	7.5000	2019.01.30	5.49
8	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	5,100,000	9,106.42	464,427,904	8,993.3367	458,660,176	4.5000	2017.03.07	5.37
9	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	46,390,000	814.78	377,976,952	793.4533	368,083,032	8.7500	2017.03.01	4.31
10	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	49,620,000	696.62	345,664,531	701.2367	347,953,700	4.5000	2018.12.18	4.07
11	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	7,500,000	4,523.54	339,266,070	4,271.8246	320,386,852	13.6250	2017.05.09	3.75
12	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	175,000,000	179.70	314,486,900	178.5074	312,387,985	5.1000	2017.02.02	3.66
13	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	29,200,000,000	0.86	253,439,648	0.8740	255,212,672	7.2500	2016.02.08	2.99
14	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	141,000,000	158.26	223,148,573	160.8711	226,828,251	6.7500	2017.05.12	2.65
15	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	27,500,000	700.60	192,667,117	700.3980	192,609,450	4.0000	2018.08.16	2.25
16	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	104,300,000	182.76	190,623,268	180.7805	188,554,165	6.0000	2016.12.20	2.20
17	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,020,000	17,969.17	183,285,614	17,997.7826	183,577,383	1.5000	2019.02.01	2.15
18	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	975,000	18,546.63	180,829,712	18,503.7299	180,411,367	2.5000	2022.10.31	2.11
19	国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	25,200,000	728.63	183,616,675	701.3765	176,746,903	8.0000	2016.01.26	2.07
20	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	107,250,000	153.05	164,152,024	161.6059	173,322,328	7.5000	2017.03.02	2.03
21	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	17,300,000,000	0.90	155,969,213	0.8895	153,899,416	10.0000	2018.11.16	1.80
22	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	17,800,000	685.24	121,972,881	712.3923	126,805,847		2017.04.04	1.48
23	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	66,000,000	184.16	121,549,428	183.6198	121,189,068	7.7500	2016.12.03	1.41
24	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	72,600,000	153.03	111,106,168	162.2070	117,762,354	6.5000	2016.09.30	1.37
25	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	55,000,000	176.18	96,901,750	177.5210	97,636,550	11.0000	2020.01.21	1.14
26	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	11,000,000	796.51	87,616,155	768.2709	84,509,799	7.5000	2020.03.05	0.99
27	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	1,520,000	4,207.54	63,954,702	4,138.2913	62,902,028	10.5000	2016.03.01	0.73

28	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	20,500,000	181.50	37,209,263	179.8342	36,866,011	5.6250	2017.03.15	0.43
----	------	------	----------------------------	------------	--------	------------	----------	------------	--------	------------	------

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
特殊債券	95.39
合計	95.39

#### (参考)新光J-REITマザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	313	571,517.03	178,884,831	577,000	180,601,000	7.56
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	291	559,573.26	162,835,821	587,000	170,817,000	7.15
3	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	567	230,121.1	130,478,664	232,200	131,657,400	5.51
4	日本	投資証券	野村不動産マスタ-ファンド投資法人	826	147,044.25	121,458,553	149,400	123,404,400	5.17
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	611	166,843.34	101,941,285	164,000	100,204,000	4.19
6	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	384	215,630.72	82,802,198	218,500	83,904,000	3.51
7	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	515	157,060.78	80,886,306	156,400	80,546,000	3.37
8	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	194	394,028.56	76,441,542	413,000	80,122,000	3.35
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	289	256,413.37	74,103,465	265,700	76,787,300	3.21
10	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	107	617,640.76	66,087,562	654,000	69,978,000	2.93
11	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	132	509,771.18	67,289,797	513,000	67,716,000	2.83
12	日本	投資証券	GLP投資法人	576	118,413.54	68,206,201	116,800	67,276,800	2.81
13	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	698	81,584.68	56,946,108	89,500	62,471,000	2.61
14	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	293	205,745.73	60,283,499	206,300	60,445,900	2.53
15	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	349	146,479.06	51,121,194	155,000	54,095,000	2.26
16	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	110	476,272.67	52,389,994	484,500	53,295,000	2.23
17	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	90	558,439.85	50,259,587	565,000	50,850,000	2.13
18	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	709	70,506.42	49,989,052	70,400	49,913,600	2.09
19	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	195	221,453.06	43,183,348	234,300	45,688,500	1.91
20	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	108	416,278.14	44,958,040	420,000	45,360,000	1.90
21	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	78	536,438.76	41,842,224	576,000	44,928,000	1.88
22	日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	166	243,393.43	40,403,310	249,600	41,433,600	1.73
23	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	281	132,180.13	37,142,618	132,800	37,316,800	1.56
24	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	78	473,274.69	36,915,426	473,000	36,894,000	1.54

25	日本	投資証券	プレミア投資法人	292	120,140.81	35,081,119	123,300	36,003,600	1.50
26	日本	投資証券	福岡リート投資法人	166	190,557.87	31,632,607	208,500	34,611,000	1.45
27	日本	投資証券	イオンリート投資法人	242	138,842.6	33,599,911	142,700	34,533,400	1.44
28	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	217	145,759.97	31,629,914	152,500	33,092,500	1.38
29	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	364	80,049.78	29,138,122	85,400	31,085,600	1.30
30	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	173	148,796.31	25,741,763	168,500	29,150,500	1.22

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

#### ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.19
合計	98.19

#### (参考)新光米国REITマザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	2,840	24,436.79	69,400,490	23,614.2320	67,064,419	6.97
2	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	3,900	11,673.84	45,527,983	11,989.8400	46,760,376	4.86
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	1,300	27,248.21	35,422,675	30,419.0484	39,544,763	4.11
4	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	3,100	9,968.41	30,902,091	10,613.6800	32,902,408	3.42
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	3,300	9,664.47	31,892,782	9,886.4018	32,625,126	3.39
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,300	22,280.45	28,964,590	22,377.9792	29,091,373	3.02
7	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3,200	8,459.58	27,070,674	8,262.9912	26,441,572	2.74
8	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	4,800	5,101.80	24,488,654	5,254.9777	25,223,893	2.62
9	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	600	35,070.16	21,042,096	36,783.6383	22,070,183	2.29
10	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1,400	14,967.70	20,954,781	15,657.5900	21,920,626	2.27
11	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	3,000	6,998.99	20,996,995	6,815.6710	20,447,013	2.12
12	アメリカ	投資証券	HCP INC	4,300	4,737.56	20,371,511	4,656.7520	20,024,034	2.08
13	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1,500	12,092.35	18,138,538	12,239.5026	18,359,254	1.90
14	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	600	28,629.19	17,177,517	29,463.8166	17,678,290	1.83
15	アメリカ	投資証券	MEYERHAEUSER COMPANY	4,700	3,526.63	16,575,191	3,691.8721	17,351,799	1.80
16	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	4,600	3,351.75	15,418,059	3,309.5384	15,223,877	1.58
17	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2,300	5,907.22	13,586,610	6,293.4300	14,474,889	1.50
18	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	1,400	10,130.03	14,182,048	9,858.6614	13,802,126	1.43
19	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	6,900	2,132.38	14,713,455	1,921.3172	13,257,089	1.37
20	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	900	14,352.59	12,917,331	13,757.9822	12,382,184	1.28
21	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	3,800	3,157.56	11,998,765	3,252.8515	12,360,836	1.28
22	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,100	9,593.32	10,552,652	10,881.4345	11,969,578	1.24
23	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,200	8,632.05	10,358,469	9,288.1758	11,145,811	1.15
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	2,400	4,385.37	10,524,911	4,569.9129	10,967,791	1.14

25	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	600	17,521.01	10,512,608	18,086.6750	10,852,005	1.12
26	アメリカ	投資証券	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	1,600	4,960.68	7,937,102	5,872.5006	9,396,001	0.97
27	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	3,200	2,537.63	8,120,430	2,570.1990	8,224,637	0.85
28	アメリカ	投資証券	VEREIT INC	8,300	1,016.74	8,438,961	970.9104	8,058,557	0.83
29	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT	700	10,336.27	7,235,394	11,144.3642	7,801,055	0.81
30	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE	700	11,386.79	7,970,753	11,096.1200	7,767,284	0.80

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### □.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	97.75
合計	97.75

#### 【投資不動産物件】

##### グローバル・ナビ

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)海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

(参考)グローバル高金利通貨マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光J-R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光米国R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

## グローバル・ナビ

該当事項はありません。

## (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	40	日本円	623,113,200	619,000,000	4.89

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

## (参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	S&P500 EMINI	買建	49	米ドル	4,991,042	601,969,575	5,078,360	612,500,999	5.41
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60IX	買建	1	カナダド ル	148,946	12,985,112	155,300	13,539,054	0.11
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EURO ST50	買建	31	ユーロ	1,004,338	132,341,618	1,022,690	134,759,861	1.19
	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	367,461	32,307,171	393,675	34,611,906	0.30
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	LIFFE FTSE	買建	14	英ポンド	837,774	149,777,235	875,420	156,507,587	1.38

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

外貨建先物取引については、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

## (参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

## (参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。



## （参考）新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

（平成27年12月30日現在）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資比率 （％）
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建		2米ドル	252,547.26	30,459,725	251,312.5	30,310,800	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建		6米ドル	711,798	85,849,957	709,031.28	85,516,263	0.54
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	買建		2英ポンド	234,628	41,946,793	234,360	41,898,880	0.26

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

外貨建先物取引については、平成27年12月30日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

## （参考）グローバル高金利通貨マザーファンド

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】

## グローバル・ナビ

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計算期間末（平成26年12月15日）	156,197,806	156,197,806	1.0986	1.0986
第2計算期間末（平成27年12月15日）	192,855,223	192,855,223	1.1107	1.1107
平成26年12月末日	164,562,493		1.1187	
平成27年1月末日	178,267,100		1.1108	
2月末日	185,780,115		1.1366	

3月末日	194,759,883		1.1417
4月末日	198,940,165		1.1482
5月末日	196,532,344		1.1724
6月末日	192,632,226		1.1460
7月末日	198,485,411		1.1616
8月末日	192,397,712		1.1162
9月末日	188,237,752		1.0849
10月末日	196,279,529		1.1309
11月末日	197,345,925		1.1366
12月末日	195,879,385		1.1227

## 【分配の推移】

## グローバル・ナビ

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	平成26年 1月 6日～平成26年12月15日	0.0000
第2計算期間	平成26年12月16日～平成27年12月15日	0.0000

## 【収益率の推移】

## グローバル・ナビ

期	計算期間	収益率（％）
第1計算期間	平成26年 1月 6日～平成26年12月15日	9.9
第2計算期間	平成26年12月16日～平成27年12月15日	1.1

(注)収益率は各計算期間における騰落率を表示しており、当該計算期間の分配金額を加算して計算しています。

## (4) 【設定及び解約の実績】

## グローバル・ナビ

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1計算期間	平成26年 1月 6日～平成26年12月15日	145,283,614	3,105,708
第2計算期間	平成26年12月16日～平成27年12月15日	46,534,790	15,084,083

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## 参考情報

## 運用実績

2015年12月30日現在

## &lt;基準価額・純資産の推移&gt; (2014年1月6日～2015年12月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控後の価額です。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;

年月	金額 (円)
2015年12月	0円
2014年12月	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0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・銘柄名	純資産比率
ニュー トビックス インデックス マザーファンド	25.20%
新光日本債券インデックスマザーファンド	19.97%
海外国債マザーファンド	19.57%
新光外国株式インデックスマザーファンド	15.38%
新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	9.86%
新光J-REITマザーファンド	5.07%
-	-
-	-
-	-
合計	95.09%

## ニュー トビックス インデックス マザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	業種	純資産比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.88%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.49%
日本電信電話	情報・通信業	1.53%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.51%
本田技研工業	輸送用機器	1.46%

※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、ニュー トビックス インデックス マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光外国株式インデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

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	1.84%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.28%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	0.98%
GENERAL ELECTRIC CO(US)	アメリカ	資本財	0.87%
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	0.85%

※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、新光外国株式インデックスマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

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

2015年12月30日現在

## 新光J-REITマザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	純資産比率
日本ビルファンド投資法人	7.56%
ジャパソリアルエステイト投資法人	7.15%
日本リテールファンド投資法人	5.51%
野村不動産マスターファンド投資法人	5.17%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.19%

※純資産比率は、新光J-REITマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光米国REITマザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	純資産比率

※純資産比率は、新光米国REITマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

※グローバル・ナビは2015年12月30日現在、新光米国REITマザーファンドを組み入れていないため、銘柄名を記載していません。

## 新光日本債券インデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	償還日	利率	純資産比率
第103回利付国債(5年)	2017/03/20	0.300%	1.43%
第308回利付国債(10年)	2020/06/20	1.300%	1.38%
第334回利付国債(10年)	2024/06/20	0.600%	1.29%
第105回利付国債(5年)	2017/06/20	0.200%	1.25%
第313回利付国債(10年)	2021/03/20	1.300%	1.19%

※純資産比率は、新光日本債券インデックスマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 海外国債マザーファンドの組入上位5銘柄

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	4.24%
US TREASURY N/B	2024/11/15	2.250%	米ドル	4.19%
US TREASURY N/B	2024/05/15	2.500%	米ドル	4.19%
US TREASURY N/B	2025/05/15	2.125%	米ドル	4.17%
US TREASURY N/B	2025/08/15	2.000%	米ドル	4.09%

※純資産比率は、海外国債マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)の組入上位5銘柄

銘柄名	償還日	利率	通貨	純資産比率
US TREASURY N/B	2017/07/31	0.500%	米ドル	2.15%
US TREASURY N/B	2018/02/28	0.750%	米ドル	1.99%
US TREASURY N/B	2017/05/15	4.500%	米ドル	1.62%
US TREASURY N/B	2019/02/15	2.750%	米ドル	1.61%
US TREASURY N/B	2024/08/15	2.375%	米ドル	1.56%

※純資産比率は、新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)の純資産総額に対する比率です。

## グローバル高金利通貨マザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	償還日	利率	通貨	純資産比率

※純資産比率は、グローバル高金利通貨マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

※グローバル・ナビは2015年12月30日現在、グローバル高金利通貨マザーファンドを組み入れていないため、銘柄名を記載していません。

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

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

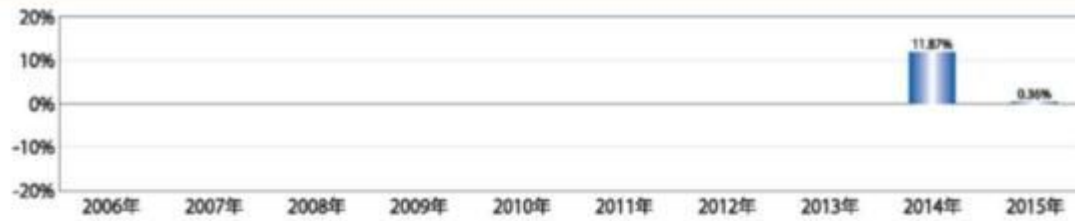
※最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認いただけます。

## 運用実績

2015年12月30日現在

暦年ベース

## &lt;年間収益率の推移&gt;



※割引前の分配金を単純に合算して計算しています。  
※当ファンドにはベンチマークがありません。

・当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。  
・最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認いただけます。

12

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

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

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

(ロ) 「分配金再投資コース」での取得申込者は、販売会社との間で「グローバル・ナビ自動継続投資約款」（別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドン証券取引所の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

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

## 2【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

(イ) 受益者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」の両コースとも、販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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

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

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

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

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

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

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

- (ホ) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (ヘ) 委託者は、以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
  - ・ニューヨークの銀行の休業日
  - ・ロンドン証券取引所の休業日
  - ・ロンドンの銀行の休業日
- (ト) 委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- (チ) 上記(ト)により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日(この日が一部解約の実行の請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。)に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記(二)の規定に準じて計算された価額とします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

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

当ファンドの主な投資対象の評価方法は以下のとおりです。

投資対象	評価方法
親投資信託 受益証券	原則として基準価額計算日の基準価額で評価
株式	原則として基準価額計算日の取引所の最終相場で評価

上場投資信託証券	原則として基準価額計算日 の取引所の最終相場で評価
外貨建資産	原則として基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値で円換算により評価
為替予約取引	原則として基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価
直物為替先渡取引	金融商品取引業者または銀行等が提示する価額もしくは価格情報会社の提供する価額で評価

外国で取引されているものについては、原則として基準価額計算時に知りうる直近の日とします。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から平成40年12月15日までです。

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

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎年12月16日から翌年12月15日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

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

(ロ) 委託者は、上記(イ)の事項について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしています。

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

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

上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「c. 書面決議の手続き」の規定における書面決議が否決となる場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

(ホ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任



務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、下記「b. 投資信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

#### b. 投資信託約款の変更等

(イ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託者は、上記（イ）の事項（投資信託約款の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。）について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしたがいます。

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

この投資信託約款は上記に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

#### c. 書面決議の手続き

(イ) 委託者は、上記「a. 信託の終了（投資信託契約の解約）」（イ）について、または「b. 投資信託約款の変更等」（イ）の事項のうち重大な約款の変更等について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由または重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドにかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

(ロ) 上記（イ）の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ハ) 上記（イ）の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

(ニ) 重大な約款の変更等における書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

(ホ) 上記（イ）から（ニ）までの規定は、委託者が投資信託契約の解約または重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドにかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記（イ）から（ハ）までに規定する当ファンドの解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

(ヘ) 上記（イ）から（ホ）の規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決

された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

d．反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託者が投資信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、投資信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

e．運用報告書

委託者は、毎決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知っている受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

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

f．公告

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

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

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

g．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

h．信託事務処理の再信託

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

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

i．信託業務の委託等

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

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

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

(ハ) 上記(イ)および(ロ)にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができ

るものとしします。

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

j．他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

- 1．他の受益者の氏名または名称および住所
- 2．他の受益者が有する受益権の内容

k．関係法人との契約の更改

委託者と販売会社との間において締結している「証券投資信託に関する基本契約」の有効期間は契約の締結日から1年ですが、期間満了前に委託者、販売会社いずれからも別段の意思表示のないときは自動的に1年間更新されるものとし、その後も同様とします。

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

#### 4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

b．一部解約請求権

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

一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。

c．償還金請求権

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

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの第1期計算期間は、信託約款第42条第1項により、平成26年1月6日から平成26年12月15日までであります。

(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2期計算期間（平成26年12月16日から平成27年12月15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】

## 【グローバル・ナビ】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第1期 平成26年12月15日現在	第2期 平成27年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,709,206	11,290,625
親投資信託受益証券	148,331,421	183,066,726
未収利息	10	16
流動資産合計	157,040,637	194,357,367
資産合計	157,040,637	194,357,367
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	29,575	52,636
未払委託者報酬	810,479	1,442,046
その他未払費用	2,777	7,462
流動負債合計	842,831	1,502,144
負債合計	842,831	1,502,144
純資産の部		
元本等		
元本	142,177,906	173,628,613
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	14,019,900	19,226,610
( 分配準備積立金 )	13,472,611	13,077,951
元本等合計	156,197,806	192,855,223
純資産合計	156,197,806	192,855,223
負債純資産合計	157,040,637	194,357,367

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自	平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
営業収益				
受取利息		2,025		5,248
有価証券売買等損益		15,411,421		4,935,166
営業収益合計		15,413,446		4,940,414
営業費用				
受託者報酬		50,075		102,840
委託者報酬		1,372,192		2,817,466
その他費用		346,134		463,343
営業費用合計		1,768,401		3,383,649
営業利益		13,645,045		1,556,765
経常利益		13,645,045		1,556,765
当期純利益		13,645,045		1,556,765
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		172,434		824,991
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		14,019,900
剰余金増加額又は欠損金減少額		547,289		6,009,552
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		35,267		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		512,022		6,009,552
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,534,616
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,534,616
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,019,900		19,226,610

## （ 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2期
	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	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。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

第1期 平成26年12月15日現在	第2期 平成27年12月15日現在
1. 計算期間末日における受益権の総数 142,177,906口	1. 計算期間末日における受益権の総数 173,628,613口
2. 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0986円 (1万口当たり純資産額) (10,986円)	2. 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1107円 (1万口当たり純資産額) (11,107円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

区分	第1期	第2期
	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. その他費用	主に、海外カस्टディアンに対するカस्टディフィーであります。	同左
2. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,855,720円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（11,616,891円）、信託約款に定める収益調整金（547,289円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は14,019,900円（1万口当たり986.06円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（676,621円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（55,153円）、信託約款に定める収益調整金（6,148,659円）及び分配準備積立金（12,346,177円）より分配対象収益は19,226,610円（1万口当たり1,107.31円）であります。分配を行っておりません。

（ 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1期	第2期
	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15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、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1期 平成26年12月15日現在	第2期 平成27年12月15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



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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

	第1期 自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	第2期 自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15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1期 平成26年12月15日現在	第2期 平成27年12月15日現在
期首元本額	10,000,000円	142,177,906円
期中追加設定元本額	135,283,614円	46,534,790円
期中一部解約元本額	3,105,708円	15,084,083円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第1期 平成26年12月15日現在	第2期 平成27年12月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	14,551,517	3,936,579
合計	14,551,517	3,936,579

## 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
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	16,927,422	39,528,915	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	25,065,501	46,461,412	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	14,949,065	28,120,686	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	32,523,302	39,723,961	
	新光J-REITマザーファンド	6,344,782	9,471,490	
	新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	14,841,717	19,760,262	
	合計		110,651,789	183,066,726

(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、「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」、「海外国債マザーファンド」、「新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」、「グローバル高金利通貨マザーファンド」、「新光J-REITマザーファンド」及び「新光米国REIT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「親投資信託受益証券」は、これら同ファンドの受益証券であります。

（平成27年12月15日現在、「グローバル高金利通貨マザーファンド」及び「新光米国REITマザーファンド」の組入れはありません。）

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。

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

	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	381,598,452	556,591,202
株式	13,662,648,590	11,795,801,650
未収配当金	1,793,750	1,631,000
未収利息	457	796
前払金	5,096,000	12,960,000
流動資産合計	14,051,137,249	12,366,984,648
<b>資産合計</b>	<b>14,051,137,249</b>	<b>12,366,984,648</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	11,884,080	21,638,880
未払解約金	2,250,000	-
流動負債合計	14,134,080	21,638,880
<b>負債合計</b>	<b>14,134,080</b>	<b>21,638,880</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	8,408,521,786	6,660,217,405
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,628,481,383	5,685,128,363
元本等合計	14,037,003,169	12,345,345,768
純資産合計	14,037,003,169	12,345,345,768
<b>負債純資産合計</b>	<b>14,051,137,249</b>	<b>12,366,984,648</b>

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年12月15日現在	平成27年12月15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。	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。

平成26年12月15日現在		平成27年12月15日現在	
	株式 166,133,400円		株式 148,571,400円
2. 計算日における受益権の総数		2. 計算日における受益権の総数	
	8,408,521,786口		6,660,217,405口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額		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	1.6694円	1口当たり純資産額	1.8536円
(1万口当たり純資産額)	(16,694円)	(1万口当たり純資産額)	(18,536円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスクを有しております。	同左

区分	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15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26年12月15日現在	平成27年12月15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>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26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。	同左
派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

## （関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,838,334,980円	8,408,521,786円
期中追加設定元本額	393,456,439円	614,879,466円
期中一部解約元本額	1,823,269,633円	2,363,183,847円
同期末における元本の内訳		
ニュー トピックス インデックス	427,586,134円	357,554,789円
新光7資産バランスファンド	670,566,894円	491,333,859円
ニュー トピックス インデックス（変額年金）	562,216,462円	300,644,064円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,164,234,600円	1,815,619,125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）	1,987,889,940円	1,518,819,921円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	68,098,333円	45,640,167円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,825,499,036円	1,516,243,414円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	644,694,895円	555,754,960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）	3,293,179円	5,001,332円
グローバル・ナビ	22,951,645円	25,065,501円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,975,387円	5,608,461円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	20,636,623円	18,652,103円

区分	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	4,878,658円	4,279,709円
合計	8,408,521,786円	6,660,217,405円

## 2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	1,094,219,349	1,023,953,114
合計	1,094,219,349	1,023,953,114

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

## 3 デリバティブ取引等関係

### 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

種類	平成26年12月15日現在				平成27年12月15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	369,384,080	-	357,500,000	11,884,080	562,178,880	-	540,540,000	21,638,880
東証株価指数先物	369,384,080	-	357,500,000	11,884,080	562,178,880	-	540,540,000	21,638,880
合計	369,384,080	-	357,500,000	11,884,080	562,178,880	-	540,540,000	21,638,880

### 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	260.00	780,000	
日本水産	6,900	449.00	3,098,100	
マルハニチロ	1,200	1,894.00	2,272,800	
サカタのタネ	1,000	2,696.00	2,696,000	

ホクト	600	2,251.00	1,350,600
日鉄鉱業	2,000	541.00	1,082,000
三井松島産業	4,000	130.00	520,000
国際石油開発帝石	31,600	1,135.50	35,881,800
日本海洋掘削	200	2,694.00	538,800
石油資源開発	900	3,180.00	2,862,000
K&Oエナジーグループ	400	1,652.00	660,800
ショーボンドホールディングス	600	4,565.00	2,739,000
ミライト・ホールディングス	1,800	970.00	1,746,000
タマホーム	400	445.00	178,000
ダイセキ環境ソリューション	100	1,322.00	132,200
安藤・間	4,000	672.00	2,688,000
東急建設	2,000	902.00	1,804,000
コムシスホールディングス	2,700	1,704.00	4,600,800
ミサワホーム	700	859.00	601,300
高松コンストラクショングループ	500	2,579.00	1,289,500
東建コーポレーション	200	9,100.00	1,820,000
大成建設	31,000	783.00	24,273,000
大林組	18,000	1,130.00	20,340,000
清水建設	18,000	1,009.00	18,162,000
飛鳥建設	4,300	195.00	838,500
長谷工コーポレーション	7,000	1,301.00	9,107,000
松井建設	700	753.00	527,100
銭高組	1,000	538.00	538,000
鹿島建設	28,000	715.00	20,020,000
不動テトラ	4,200	143.00	600,600
大末建設	200	934.00	186,800
鉄建建設	4,000	292.00	1,168,000
西松建設	7,000	459.00	3,213,000
三井住友建設	23,000	113.00	2,599,000
大豊建設	2,000	579.00	1,158,000
前田建設工業	4,000	740.00	2,960,000
佐田建設	400	485.00	194,000
ナカノフドー建設	500	754.00	377,000
奥村組	6,000	661.00	3,966,000
東鉄工業	700	2,796.00	1,957,200
イチケン	1,000	427.00	427,000
戸田建設	7,000	646.00	4,522,000
熊谷組	9,000	328.00	2,952,000
青木あすなろ建設	400	800.00	320,000
北野建設	1,000	322.00	322,000
植木組	1,000	271.00	271,000



三井ホーム	1,000	555.00	555,000
矢作建設工業	800	798.00	638,400
ピーエス三菱	700	390.00	273,000
日本ハウスホールディングス	1,200	418.00	501,600
大東建託	2,200	13,410.00	29,502,000
新日本建設	700	680.00	476,000
N I P P O	1,000	1,993.00	1,993,000
東亜道路工業	1,000	440.00	440,000
前田道路	2,000	2,036.00	4,072,000
日本道路	2,000	594.00	1,188,000
東亜建設工業	5,000	314.00	1,570,000
若築建設	3,000	143.00	429,000
東洋建設	1,900	514.00	976,600
五洋建設	6,700	480.00	3,216,000
大林道路	1,000	813.00	813,000
世紀東急工業	900	620.00	558,000
福田組	1,000	1,297.00	1,297,000
住友林業	4,100	1,603.00	6,572,300
日本基礎技術	700	504.00	352,800
日成ビルド工業	2,000	366.00	732,000
巴コーポレーション	700	369.00	258,300
パナホーム	2,000	876.00	1,752,000
大和ハウス工業	17,700	3,198.00	56,604,600
ライト工業	1,200	1,096.00	1,315,200
積水ハウス	20,000	1,913.50	38,270,000
日特建設	700	487.00	340,900
北陸電気工事	200	961.00	192,200
ユアテック	1,000	1,100.00	1,100,000
中電工	900	2,619.00	2,357,100
関電工	2,000	781.00	1,562,000
きんでん	3,600	1,561.00	5,619,600
東京エネシス	1,000	1,011.00	1,011,000
トーエネック	1,000	831.00	831,000
住友電設	500	1,490.00	745,000
日本電設工業	1,000	2,480.00	2,480,000
協和エクシオ	2,300	1,237.00	2,845,100
新日本空調	500	1,050.00	525,000
N D S	1,000	343.00	343,000
九電工	1,000	2,078.00	2,078,000
三機工業	1,300	1,020.00	1,326,000
日揮	6,000	1,856.00	11,136,000
中外炉工業	2,000	234.00	468,000

ヤマト	500	483.00	241,500
太平電業	1,000	1,170.00	1,170,000
高砂熱学工業	1,800	1,681.00	3,025,800
朝日工業社	1,000	498.00	498,000
明星工業	1,100	494.00	543,400
大気社	700	2,864.00	2,004,800
ダイダン	1,000	849.00	849,000
日比谷総合設備	700	1,546.00	1,082,200
東芝プラントシステム	1,000	1,256.00	1,256,000
O S J Bホールディングス	1,200	256.00	307,200
東洋エンジニアリング	3,000	320.00	960,000
千代田化工建設	4,000	923.00	3,692,000
新興プランテック	1,200	971.00	1,165,200
日本製粉	4,000	834.00	3,336,000
日清製粉グループ本社	6,600	1,876.00	12,381,600
昭和産業	2,000	463.00	926,000
鳥越製粉	500	778.00	389,000
中部飼料	600	984.00	590,400
日本甜菜製糖	3,000	197.00	591,000
三井製糖	2,000	527.00	1,054,000
森永製菓	5,000	616.00	3,080,000
中村屋	1,000	462.00	462,000
江崎グリコ	1,400	6,190.00	8,666,000
名糖産業	300	1,301.00	390,300
不二家	3,000	201.00	603,000
山崎製パン	4,000	2,387.00	9,548,000
モロゾフ	1,000	421.00	421,000
亀田製菓	300	4,565.00	1,369,500
寿スピリッツ	100	4,635.00	463,500
カルビー	2,200	4,850.00	10,670,000
森永乳業	5,000	539.00	2,695,000
六甲バター	300	1,790.00	537,000
ヤクルト本社	3,200	5,950.00	19,040,000
明治ホールディングス	3,600	9,470.00	34,092,000
雪印メグミルク	1,400	3,050.00	4,270,000
プリマハム	4,000	320.00	1,280,000
日本ハム	4,000	2,285.00	9,140,000
伊藤ハム	3,000	614.00	1,842,000
丸大食品	3,000	454.00	1,362,000
米久	200	2,230.00	446,000
S Foods	400	2,054.00	821,600
サッポロホールディングス	9,000	533.00	4,797,000

アサヒグループホールディングス	11,200	3,826.00	42,851,200
麒麟ホールディングス	24,300	1,698.00	41,261,400
宝ホールディングス	4,300	911.00	3,917,300
オエノンホールディングス	2,000	236.00	472,000
養命酒製造	200	1,989.00	397,800
コカ・コーラウエスト	2,000	2,460.00	4,920,000
コカ・コーライーストジャパン	2,100	1,835.00	3,853,500
サントリー食品インターナショナル	4,100	5,110.00	20,951,000
ダイドードリンコ	300	5,500.00	1,650,000
伊藤園	1,800	2,847.00	5,124,600
キーコーヒー	500	1,897.00	948,500
日清オイリオグループ	3,000	466.00	1,398,000
不二製油グループ本社	1,600	1,762.00	2,819,200
J-オイルミルズ	3,000	333.00	999,000
キッコーマン	5,000	3,940.00	19,700,000
味の素	13,000	2,653.00	34,489,000
キューピー	3,000	2,854.00	8,562,000
ハウス食品グループ本社	2,000	2,318.00	4,636,000
カゴメ	2,200	2,094.00	4,606,800
焼津水産化学工業	300	1,004.00	301,200
アリアケジャパン	500	6,350.00	3,175,000
エバラ食品工業	100	2,029.00	202,900
ニチレイ	6,000	779.00	4,674,000
東洋水産	2,900	4,170.00	12,093,000
日清食品ホールディングス	2,500	6,150.00	15,375,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,045.00	1,045,000
一正蒲鉾	200	1,027.00	205,400
フジッコ	600	2,040.00	1,224,000
ロック・フィールド	300	2,943.00	882,900
日本たばこ産業	35,400	4,319.00	152,892,600
ケンコーマヨネーズ	200	1,903.00	380,600
わらべや日洋	300	2,202.00	660,600
なとり	300	1,696.00	508,800
ユーグレナ	2,000	1,733.00	3,466,000
理研ビタミン	200	3,850.00	770,000
片倉工業	700	1,310.00	917,000
ゲンゼ	5,000	348.00	1,740,000
東洋紡	22,000	166.00	3,652,000
ユニチカ	16,000	57.00	912,000
富士紡ホールディングス	3,000	216.00	648,000
倉敷紡績	6,000	212.00	1,272,000
日本毛織	2,000	874.00	1,748,000

ダイドーリミテッド	600	495.00	297,000
帝国繊維	600	1,616.00	969,600
帝人	23,000	402.00	9,246,000
東レ	41,000	1,072.50	43,972,500
サカイオーベックス	1,000	230.00	230,000
住江織物	1,000	342.00	342,000
芦森工業	1,000	197.00	197,000
アツギ	4,000	119.00	476,000
ダイニック	1,000	173.00	173,000
セーレン	1,400	1,347.00	1,885,800
小松精練	900	663.00	596,700
ワコールホールディングス	3,000	1,416.00	4,248,000
ホギメディカル	400	6,120.00	2,448,000
T S Iホールディングス	2,500	820.00	2,050,000
三陽商会	3,000	279.00	837,000
オンワードホールディングス	4,000	748.00	2,992,000
ルック	1,000	166.00	166,000
ゴールドウイン	200	5,020.00	1,004,000
デサント	1,300	1,402.00	1,822,600
特種東海製紙	3,000	346.00	1,038,000
王子ホールディングス	23,000	483.00	11,109,000
日本製紙	2,900	1,860.00	5,394,000
三菱製紙	9,000	83.00	747,000
北越紀州製紙	3,500	716.00	2,506,000
中越パルプ工業	2,000	198.00	396,000
巴川製紙所	1,000	216.00	216,000
大王製紙	2,500	1,023.00	2,557,500
レンゴー	5,000	501.00	2,505,000
トーモク	2,000	275.00	550,000
ザ・パック	400	3,095.00	1,238,000
クラレ	8,800	1,502.00	13,217,600
旭化成	35,000	761.10	26,638,500
共和レザー	400	919.00	367,600
昭和電工	37,000	145.00	5,365,000
住友化学	41,000	664.00	27,224,000
住友精化	1,000	741.00	741,000
日産化学工業	3,400	2,798.00	9,513,200
クレハ	4,000	455.00	1,820,000
テイカ	1,000	583.00	583,000
石原産業	10,000	100.00	1,000,000
片倉コープアグリ	1,000	245.00	245,000
日東エフシー	300	862.00	258,600

日本曹達	4,000	699.00	2,796,000
東ソー	15,000	620.00	9,300,000
トクヤマ	9,000	254.00	2,286,000
セントラル硝子	6,000	542.00	3,252,000
東亜合成	3,500	1,008.00	3,528,000
大阪ソーダ	2,000	440.00	880,000
関東電化工業	1,000	776.00	776,000
デンカ	12,000	525.00	6,300,000
信越化学工業	10,000	6,557.00	65,570,000
日本カーバイド工業	2,000	175.00	350,000
堺化学工業	2,000	408.00	816,000
エア・ウォーター	5,000	1,877.00	9,385,000
大陽日酸	4,300	1,045.00	4,493,500
日本化学工業	2,000	275.00	550,000
日本パーカライジング	2,900	1,186.00	3,439,400
高压ガス工業	1,000	653.00	653,000
四国化成工業	1,000	1,134.00	1,134,000
戸田工業	1,000	317.00	317,000
ステラ ケミファ	300	1,692.00	507,600
保土谷化学工業	2,000	233.00	466,000
日本触媒	800	8,960.00	7,168,000
大日精化工業	2,000	543.00	1,086,000
カネカ	8,000	1,203.00	9,624,000
三菱瓦斯化学	10,000	588.00	5,880,000
三井化学	24,000	513.00	12,312,000
J S R	5,500	1,826.00	10,043,000
東京応化工業	1,100	3,645.00	4,009,500
大阪有機化学工業	400	605.00	242,000
三菱ケミカルホールディングス	37,500	757.30	28,398,750
日本合成化学工業	1,000	860.00	860,000
ダイセル	7,900	1,777.00	14,038,300
住友ベークライト	5,000	502.00	2,510,000
積水化学工業	13,000	1,499.00	19,487,000
日本ゼオン	5,000	943.00	4,715,000
アイカ工業	1,700	2,356.00	4,005,200
宇部興産	30,000	250.00	7,500,000
積水樹脂	900	1,603.00	1,442,700
タキロン	1,000	559.00	559,000
旭有機材工業	2,000	228.00	456,000
日立化成	2,800	1,907.00	5,339,600
ニチバン	1,000	614.00	614,000
リケンテクノス	900	413.00	371,700

大倉工業	1,000	358.00	358,000
積水化成成品工業	1,000	385.00	385,000
群栄化学工業	1,000	307.00	307,000
タイガースポリマー	300	712.00	213,600
ミライアル	200	1,108.00	221,600
ダイキョーニシカワ	200	8,270.00	1,654,000
日本化薬	4,000	1,347.00	5,388,000
カーリットホールディングス	500	513.00	256,500
日本精化	500	901.00	450,500
A D E K A	2,800	1,689.00	4,729,200
日油	4,000	928.00	3,712,000
新日本理化	900	186.00	167,400
ハリマ化成グループ	500	608.00	304,000
花王	15,100	5,909.00	89,225,900
第一工業製薬	1,000	348.00	348,000
三洋化成工業	2,000	965.00	1,930,000
大日本塗料	3,000	221.00	663,000
日本ペイントホールディングス	4,300	2,747.00	11,812,100
関西ペイント	6,300	1,779.00	11,207,700
中国塗料	2,000	805.00	1,610,000
日本特殊塗料	400	1,058.00	423,200
藤倉化成	800	567.00	453,600
太陽ホールディングス	400	4,600.00	1,840,000
D I C	22,000	342.00	7,524,000
サカタインクス	1,100	1,211.00	1,332,100
東洋インキSCホールディングス	6,000	471.00	2,826,000
T & K T O K A	200	2,269.00	453,800
富士フイルムホールディングス	12,800	4,741.00	60,684,800
資生堂	10,600	2,554.00	27,072,400
ライオン	6,000	1,158.00	6,948,000
高砂香料工業	400	2,865.00	1,146,000
マンダム	500	4,765.00	2,382,500
ミルボン	300	4,650.00	1,395,000
ファンケル	1,300	1,659.00	2,156,700
コーセー	900	10,920.00	9,828,000
コタ	200	1,364.00	272,800
シーズ・ホールディングス	800	1,989.00	1,591,200
ポーラ・オルビスホールディングス	600	7,990.00	4,794,000
ノエビアホールディングス	400	3,415.00	1,366,000
エステー	400	1,127.00	450,800
アグロ カネショウ	200	956.00	191,200
コニシ	400	2,504.00	1,001,600

長谷川香料	700	1,514.00	1,059,800	
星光PMC	300	1,171.00	351,300	
小林製薬	800	9,620.00	7,696,000	
荒川化学工業	500	1,160.00	580,000	
メック	400	847.00	338,800	
日本高純度化学	200	2,301.00	460,200	
JCU	200	4,390.00	878,000	
新田ゼラチン	400	708.00	283,200	
デクセリアルズ	1,300	1,346.00	1,749,800	
アース製薬	400	5,060.00	2,024,000	
イハラケミカル工業	900	1,561.00	1,404,900	
北興化学工業	1,000	446.00	446,000	
大成ラミック	200	3,075.00	615,000	
クミアイ化学工業	1,200	987.00	1,184,400	
日本農薬	1,300	743.00	965,900	
アキレス	5,000	155.00	775,000	
有沢製作所	800	782.00	625,600	
日東電工	4,300	8,416.00	36,188,800	
レック	200	1,310.00	262,000	
きもと	900	276.00	248,400	
藤森工業	500	3,010.00	1,505,000	
前澤化成工業	400	1,115.00	446,000	
JSP	400	2,381.00	952,400	
エフピコ	500	4,405.00	2,202,500	
天馬	400	2,170.00	868,000	
信越ポリマー	1,100	658.00	723,800	
東リ	1,000	337.00	337,000	
ニフコ	1,100	5,320.00	5,852,000	
日本バルカー工業	2,000	302.00	604,000	
ユニ・チャーム	11,300	2,370.00	26,781,000	
協和発酵キリン	7,000	2,046.00	14,322,000	
武田薬品工業	22,300	5,646.00	125,905,800	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	62,700	1,646.00	103,204,200	
大日本住友製薬	4,000	1,396.00	5,584,000	
塩野義製薬	8,200	5,140.00	42,148,000	
田辺三菱製薬	6,500	2,007.00	13,045,500	
わかもと製薬	1,000	289.00	289,000	
あすか製薬	700	1,532.00	1,072,400	
日本新薬	1,000	4,750.00	4,750,000	
ビオフェルミン製薬	100	3,780.00	378,000	
中外製薬	5,600	4,205.00	23,548,000	
科研製薬	1,000	7,870.00	7,870,000	

エーザイ	6,900	7,560.00	52,164,000
ロート製薬	2,700	2,298.00	6,204,600
小野薬品工業	2,500	20,305.00	50,762,500
久光製薬	1,700	4,905.00	8,338,500
持田製薬	400	7,890.00	3,156,000
参天製薬	10,300	1,937.00	19,951,100
扶桑薬品工業	2,000	284.00	568,000
日本ケミファ	1,000	615.00	615,000
ツムラ	1,800	3,455.00	6,219,000
日医工	1,300	2,831.00	3,680,300
キッセイ薬品工業	1,000	2,918.00	2,918,000
生化学工業	1,100	1,614.00	1,775,400
栄研化学	500	2,133.00	1,066,500
日水製薬	200	1,368.00	273,600
鳥居薬品	400	2,625.00	1,050,000
JCRファーマ	400	2,655.00	1,062,000
東和薬品	300	7,320.00	2,196,000
富士製薬工業	200	2,112.00	422,400
沢井製薬	1,000	8,020.00	8,020,000
ゼリア新薬工業	1,100	1,552.00	1,707,200
第一三共	18,800	2,461.50	46,276,200
キョーリン製薬ホールディングス	1,500	2,499.00	3,748,500
大幸薬品	300	1,725.00	517,500
ダイト	200	3,080.00	616,000
大塚ホールディングス	12,000	4,231.00	50,772,000
大正製薬ホールディングス	1,300	8,110.00	10,543,000
日本コークス工業	4,500	100.00	450,000
昭和シェル石油	5,600	1,041.00	5,829,600
ニチレキ	1,000	921.00	921,000
東燃ゼネラル石油	8,000	1,114.00	8,912,000
ユシロ化学工業	300	1,374.00	412,200
ビーピー・カストロール	200	1,273.00	254,600
富士石油	1,300	354.00	460,200
MORESCO	200	1,692.00	338,400
出光興産	2,900	1,913.00	5,547,700
JXホールディングス	66,300	486.90	32,281,470
コスモエネルギーホールディングス	1,700	1,609.00	2,735,300
横浜ゴム	3,400	1,926.00	6,548,400
東洋ゴム工業	2,500	2,385.00	5,962,500
ブリヂストン	18,900	4,158.00	78,586,200
住友ゴム工業	5,200	1,607.00	8,356,400
藤倉ゴム工業	500	570.00	285,000



オカモト	2,000	1,100.00	2,200,000	
フコク	200	1,057.00	211,400	
ニッタ	600	3,205.00	1,923,000	
住友理工	1,200	1,009.00	1,210,800	
三ツ星ベルト	1,000	938.00	938,000	
バンドー化学	2,000	516.00	1,032,000	
日東紡績	4,000	320.00	1,280,000	
旭硝子	30,000	684.00	20,520,000	
日本板硝子	27,000	99.00	2,673,000	
石塚硝子	1,000	226.00	226,000	
日本山村硝子	2,000	183.00	366,000	
日本電気硝子	12,000	607.00	7,284,000	
住友大阪セメント	11,000	441.00	4,851,000	
太平洋セメント	35,000	353.00	12,355,000	
デイ・シイ	500	328.00	164,000	
日本ヒューム	500	726.00	363,000	
日本コンクリート工業	1,200	344.00	412,800	
三谷セキサン	300	1,586.00	475,800	
アジアパイルホールディングス	700	545.00	381,500	
東海カーボン	5,000	342.00	1,710,000	
日本カーボン	3,000	315.00	945,000	
東洋炭素	300	1,764.00	529,200	
ノリタケカンパニーリミテド	3,000	272.00	816,000	
TOTO	4,100	3,940.00	16,154,000	
日本碍子	7,000	2,668.00	18,676,000	
日本特殊陶業	4,800	3,155.00	15,144,000	
MARUWA	200	2,756.00	551,200	
品川リフラクトリーズ	1,000	251.00	251,000	
黒崎播磨	1,000	273.00	273,000	
フジインコーポレーテッド	500	1,593.00	796,500	
ニチアス	3,000	767.00	2,301,000	
ニチハ	700	1,749.00	1,224,300	
新日鐵住金	25,300	2,299.00	58,164,700	
神戸製鋼所	103,000	134.00	13,802,000	
合同製鐵	3,000	236.00	708,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,300	1,757.50	26,889,750	
日新製鋼	2,600	1,264.00	3,286,400	
東京製鐵	3,100	752.00	2,331,200	
共英製鋼	600	2,066.00	1,239,600	
大和工業	1,200	3,035.00	3,642,000	
東京鐵鋼	1,000	572.00	572,000	
大阪製鐵	400	2,164.00	865,600	

淀川製鋼所	800	2,466.00	1,972,800
東洋鋼鋳	1,300	421.00	547,300
丸一鋼管	1,900	3,420.00	6,498,000
モリ工業	1,000	351.00	351,000
大同特殊鋼	9,000	476.00	4,284,000
日本冶金工業	4,100	145.00	594,500
山陽特殊製鋼	3,000	567.00	1,701,000
愛知製鋼	3,000	549.00	1,647,000
日立金属	6,400	1,491.00	9,542,400
大太平洋金属	4,000	308.00	1,232,000
新日本電工	3,200	219.00	700,800
栗本鐵工所	3,000	216.00	648,000
三菱製鋼	4,000	233.00	932,000
日亜鋼業	800	279.00	223,200
シンニッタン	500	608.00	304,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	315.00	315,000
日本軽金属ホールディングス	12,700	204.00	2,590,800
三井金属鉱業	14,000	219.00	3,066,000
東邦亜鉛	3,000	275.00	825,000
三菱マテリアル	35,000	392.00	13,720,000
住友金属鉱山	15,000	1,331.50	19,972,500
D O W Aホールディングス	7,000	850.00	5,950,000
古河機械金属	9,000	227.00	2,043,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	2,532.00	1,519,200
東邦チタニウム	900	1,055.00	949,500
U A C J	8,000	278.00	2,224,000
古河電気工業	18,000	264.00	4,752,000
住友電気工業	22,400	1,608.00	36,019,200
フジクラ	8,000	666.00	5,328,000
昭和電線ホールディングス	7,000	72.00	504,000
タツタ電線	1,200	449.00	538,800
カナレ電気	100	2,053.00	205,300
リョービ	3,000	511.00	1,533,000
アーレスティ	600	746.00	447,600
アサヒホールディングス	800	1,794.00	1,435,200
稲葉製作所	300	1,286.00	385,800
宮地エンジニアリンググループ	2,000	187.00	374,000
トーカロ	400	2,505.00	1,002,000
アルファC o	200	1,282.00	256,400
S U M C O	4,400	1,050.00	4,620,000
川田テクノロジーズ	100	3,710.00	371,000
東洋製罐グループホールディングス	4,000	2,300.00	9,200,000

ホッカホールディングス	1,000	327.00	327,000	
コロナ	300	1,167.00	350,100	
横河ブリッジホールディングス	1,100	1,343.00	1,477,300	
駒井ハルテック	1,000	252.00	252,000	
三和ホールディングス	5,700	964.00	5,494,800	
文化シャッター	1,600	1,021.00	1,633,600	
三協立山	700	1,599.00	1,119,300	
アルインコ	300	1,130.00	339,000	
LIXILグループ	7,800	2,650.00	20,670,000	
日本フィルコン	400	500.00	200,000	
ノーリツ	1,100	1,758.00	1,933,800	
長府製作所	600	2,786.00	1,671,600	
リンナイ	1,000	10,390.00	10,390,000	
ダイニチ工業	300	724.00	217,200	
日東精工	1,000	321.00	321,000	
岡部	1,200	910.00	1,092,000	
ジーテクト	600	1,673.00	1,003,800	
東プレ	1,100	2,709.00	2,979,900	
高周波熱錬	1,000	905.00	905,000	
東京製網	4,000	201.00	804,000	
サンコール	300	584.00	175,200	
パイオラックス	300	6,230.00	1,869,000	
日本発條	5,300	1,186.00	6,285,800	
中央発條	1,000	293.00	293,000	
アドバネクス	100	1,760.00	176,000	
立川ブラインド工業	200	830.00	166,000	
三益半導体工業	400	1,177.00	470,800	
日本製鋼所	9,000	422.00	3,798,000	
三浦工業	2,500	1,702.00	4,255,000	
タクマ	2,000	1,003.00	2,006,000	
ツガミ	2,000	520.00	1,040,000	
オークマ	4,000	1,013.00	4,052,000	
東芝機械	3,000	402.00	1,206,000	
アマダホールディングス	8,300	1,153.00	9,569,900	
アイダエンジニアリング	1,500	1,212.00	1,818,000	
滝澤鉄工所	2,000	164.00	328,000	
富士機械製造	1,800	1,162.00	2,091,600	
牧野フライス製作所	3,000	913.00	2,739,000	
オーエスジー	2,600	2,225.00	5,785,000	
旭ダイヤモンド工業	1,500	1,355.00	2,032,500	
D M G 森精機	3,100	1,458.00	4,519,800	
ソディック	1,100	913.00	1,004,300	

ディスコ	700	11,580.00	8,106,000
日東工器	300	2,628.00	788,400
パンチ工業	200	952.00	190,400
豊和工業	300	636.00	190,800
東洋機械金属	400	428.00	171,200
島精機製作所	800	1,835.00	1,468,000
日阪製作所	700	940.00	658,000
やまびこ	1,000	1,042.00	1,042,000
ペガサスミシン製造	600	487.00	292,200
ナプテスコ	3,000	2,468.00	7,404,000
三井海洋開発	700	1,744.00	1,220,800
レオン自動機	500	817.00	408,500
S M C	1,700	31,090.00	52,853,000
新川	500	566.00	283,000
ホソカワミクロン	1,000	623.00	623,000
ユニオンツール	200	3,280.00	656,000
オイレス工業	700	2,009.00	1,406,300
日精エー・エス・ビー機械	200	2,149.00	429,800
サトーホールディングス	800	2,412.00	1,929,600
日精樹脂工業	400	994.00	397,600
ワイエイシイ	200	916.00	183,200
小松製作所	27,400	1,890.00	51,786,000
住友重機械工業	16,000	510.00	8,160,000
日立建機	2,500	1,790.00	4,475,000
日工	1,000	402.00	402,000
巴工業	200	1,532.00	306,400
井関農機	6,000	193.00	1,158,000
T O W A	500	760.00	380,000
丸山製作所	1,000	197.00	197,000
北川鉄工所	3,000	271.00	813,000
クボタ	27,000	1,924.50	51,961,500
荏原実業	200	1,470.00	294,000
三菱化工機	2,000	262.00	524,000
月島機械	1,100	1,080.00	1,188,000
帝国電機製作所	400	862.00	344,800
新東工業	1,300	989.00	1,285,700
澁谷工業	500	1,783.00	891,500
アイチ コーポレーション	800	814.00	651,200
小森コーポレーション	1,400	1,418.00	1,985,200
鶴見製作所	400	1,841.00	736,400
住友精密工業	1,000	453.00	453,000
酒井重工業	1,000	226.00	226,000

荏原製作所	12,000	570.00	6,840,000
西島製作所	600	1,019.00	611,400
北越工業	600	822.00	493,200
ダイキン工業	7,800	8,119.00	63,328,200
オルガノ	1,000	475.00	475,000
トーヨーカネツ	3,000	251.00	753,000
栗田工業	3,400	2,573.00	8,748,200
椿本チエイン	3,000	873.00	2,619,000
大同工業	1,000	225.00	225,000
日本コンベヤ	2,000	172.00	344,000
木村化工機	500	432.00	216,000
アネスト岩田	900	1,023.00	920,700
ダイフク	2,600	1,922.00	4,997,200
加藤製作所	1,000	527.00	527,000
油研工業	1,000	250.00	250,000
タダノ	3,000	1,481.00	4,443,000
フジテック	1,600	1,221.00	1,953,600
C K D	1,500	1,204.00	1,806,000
キトー	700	1,026.00	718,200
平和	1,700	2,267.00	3,853,900
理想科学工業	600	1,933.00	1,159,800
S A N K Y O	1,500	4,640.00	6,960,000
日本金銭機械	500	1,205.00	602,500
マースエンジニアリング	300	2,044.00	613,200
福島工業	300	2,519.00	755,700
ダイコク電機	200	1,502.00	300,400
竹内製作所	800	2,540.00	2,032,000
アマノ	1,700	1,530.00	2,601,000
J U K I	800	1,115.00	892,000
サンデンホールディングス	3,000	379.00	1,137,000
蛇の目ミシン工業	500	852.00	426,000
マックス	1,000	1,195.00	1,195,000
グローリー	1,800	3,555.00	6,399,000
新晃工業	400	1,375.00	550,000
大和冷機工業	900	954.00	858,600
セガサミーホールディングス	5,700	1,185.00	6,754,500
日本ピストンリング	200	2,028.00	405,600
リケン	2,000	422.00	844,000
T P R	700	3,320.00	2,324,000
ホシザキ電機	1,200	7,770.00	9,324,000
大豊工業	400	1,417.00	566,800
日本精工	11,000	1,401.00	15,411,000

N T N	13,000	524.00	6,812,000
ジェイテクト	5,700	2,031.00	11,576,700
不二越	5,000	547.00	2,735,000
日本トムソン	2,000	526.00	1,052,000
T H K	3,600	2,209.00	7,952,400
ユーシン精機	200	2,273.00	454,600
前澤給装工業	200	1,521.00	304,200
イーグル工業	700	2,176.00	1,523,200
日本ピラー工業	500	1,054.00	527,000
キット	2,600	525.00	1,365,000
日立工機	1,400	873.00	1,222,200
マキタ	3,500	6,660.00	23,310,000
日立造船	4,200	661.00	2,776,200
三菱重工業	95,000	569.70	54,121,500
I H I	41,000	321.00	13,161,000
日清紡ホールディングス	3,000	1,280.00	3,840,000
イビデン	3,500	1,753.00	6,135,500
コニカミノルタ	13,400	1,198.00	16,053,200
ブラザー工業	6,900	1,415.00	9,763,500
ミネベア	9,000	1,121.00	10,089,000
日立製作所	136,000	678.60	92,289,600
東芝	113,000	292.20	33,018,600
三菱電機	57,000	1,252.50	71,392,500
富士電機	16,000	514.00	8,224,000
東洋電機製造	1,000	415.00	415,000
安川電機	6,600	1,624.00	10,718,400
シンフォニアテクノロジー	3,000	192.00	576,000
明電舎	5,000	468.00	2,340,000
オリジン電気	1,000	322.00	322,000
山洋電気	1,000	736.00	736,000
デンヨー	500	1,868.00	934,000
東芝テック	4,000	419.00	1,676,000
芝浦メカトロニクス	1,000	232.00	232,000
マブチモーター	1,500	6,580.00	9,870,000
日本電産	6,400	8,958.00	57,331,200
東光高岳	300	1,495.00	448,500
ダイヘン	3,000	517.00	1,551,000
田淵電機	600	762.00	457,200
J V C ケンウッド	3,900	301.00	1,173,900
ミマキエンジニアリング	400	477.00	190,800
第一精工	200	1,592.00	318,400
日新電機	1,300	1,067.00	1,387,100

大崎電気工業	1,000	652.00	652,000	
オムロン	6,100	4,220.00	25,742,000	
日東工業	900	2,070.00	1,863,000	
I D E C	700	1,027.00	718,900	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	10,000	436.00	4,360,000	
サクサホールディングス	1,000	241.00	241,000	
メルコホールディングス	300	1,950.00	585,000	
テクノメディカ	100	2,770.00	277,000	
日本電気	74,000	379.00	28,046,000	
富士通	52,000	632.70	32,900,400	
沖電気工業	23,000	151.00	3,473,000	
電気興業	1,000	538.00	538,000	
サンケン電気	3,000	456.00	1,368,000	
アイホン	300	1,981.00	594,300	
ルネサスエレクトロニクス	2,800	814.00	2,279,200	
セイコーエプソン	8,000	1,893.00	15,144,000	
ワコム	4,200	465.00	1,953,000	
アルバック	900	3,225.00	2,902,500	
アクセル	300	1,394.00	418,200	
E I Z O	500	2,853.00	1,426,500	
ジャパンディスプレイ	10,000	350.00	3,500,000	
日本信号	1,500	1,263.00	1,894,500	
京三製作所	1,000	351.00	351,000	
能美防災	600	1,531.00	918,600	
ホーチキ	400	1,065.00	426,000	
エレコム	500	1,498.00	749,000	
日本無線	1,000	367.00	367,000	
パナソニック	61,100	1,236.50	75,550,150	代用有価証券 7,500株
シャープ	45,000	124.00	5,580,000	
アンリツ	3,200	784.00	2,508,800	
富士通ゼネラル	2,000	1,580.00	3,160,000	
日立国際電気	1,000	1,713.00	1,713,000	
ソニー	37,700	2,950.50	111,233,850	代用有価証券 3,700株
T D K	3,200	8,290.00	26,528,000	
帝国通信工業	1,000	207.00	207,000	
ミツミ電機	2,000	610.00	1,220,000	
タムラ製作所	2,000	356.00	712,000	
アルプス電気	4,500	3,365.00	15,142,500	
池上通信機	2,000	183.00	366,000	
パイオニア	8,700	340.00	2,958,000	
日本電波工業	500	797.00	398,500	

日本トリム	100	3,945.00	394,500
ローランド ディー.ジー.	300	2,650.00	795,000
フォスター電機	700	2,562.00	1,793,400
クラリオン	3,000	416.00	1,248,000
S M K	2,000	621.00	1,242,000
ヨコオ	400	571.00	228,400
東光	1,000	400.00	400,000
ホシデン	1,600	635.00	1,016,000
ヒロセ電機	900	14,440.00	12,996,000
日本航空電子工業	2,000	1,904.00	3,808,000
T O A	600	1,253.00	751,800
日立マクセル	900	2,054.00	1,848,600
古野電気	600	852.00	511,200
ユニデンホールディングス	2,000	161.00	322,000
アルパイン	1,300	1,538.00	1,999,400
スミダコーポレーション	400	775.00	310,000
アイコム	300	2,430.00	729,000
リオン	200	1,802.00	360,400
船井電機	500	962.00	481,000
横河電機	5,400	1,387.00	7,489,800
新電元工業	2,000	445.00	890,000
アズビル	1,700	2,999.00	5,098,300
日本光電工業	2,200	2,646.00	5,821,200
チノー	200	1,094.00	218,800
共和電業	700	424.00	296,800
堀場製作所	1,000	4,400.00	4,400,000
アドバンテスト	3,600	1,043.00	3,754,800
小野測器	300	926.00	277,800
エスベック	600	1,448.00	868,800
パナソニック デバイス S U N X	500	660.00	330,000
キーエンス	1,200	62,920.00	75,504,000
日置電機	300	2,133.00	639,900
シスメックス	4,200	7,220.00	30,324,000
メガチップス	600	1,116.00	669,600
O B A R A G R O U P	300	4,145.00	1,243,500
コーセル	700	1,154.00	807,800
オブテックス	400	2,689.00	1,075,600
千代田インテグレ	300	2,730.00	819,000
レーザーテック	500	1,325.00	662,500
スタンレー電気	3,800	2,629.00	9,990,200
岩崎電気	2,000	244.00	488,000
ウシオ電機	3,200	1,674.00	5,356,800



ヘリオス テクノ ホールディング	500	439.00	219,500	
日本セラミック	300	1,956.00	586,800	
遠藤照明	300	1,182.00	354,600	
日本デジタル研究所	500	1,598.00	799,000	
山一電機	500	861.00	430,500	
図研	400	1,221.00	488,400	
日本電子	2,000	755.00	1,510,000	
カシオ計算機	5,400	2,641.00	14,261,400	
ファナック	5,500	20,455.00	112,502,500	
日本シイエムケイ	1,200	350.00	420,000	
エンプラス	300	4,570.00	1,371,000	
大真空	1,000	238.00	238,000	
ローム	2,600	6,380.00	16,588,000	
浜松ホトニクス	4,200	3,230.00	13,566,000	
三井ハイテック	800	711.00	568,800	
新光電気工業	2,000	827.00	1,654,000	
京セラ	8,800	5,495.00	48,356,000	
太陽誘電	2,600	1,839.00	4,781,400	
村田製作所	5,600	18,510.00	103,656,000	
ユーシン	700	721.00	504,700	
双葉電子工業	900	1,574.00	1,416,600	
北陸電気工業	2,000	174.00	348,000	
ニチコン	1,700	963.00	1,637,100	
日本ケミコン	4,000	225.00	900,000	
K O A	700	998.00	698,600	
市光工業	1,000	259.00	259,000	
小糸製作所	3,200	4,820.00	15,424,000	
ミツバ	900	1,965.00	1,768,500	
スター精密	1,000	1,526.00	1,526,000	
S C R E E Nホールディングス	5,000	848.00	4,240,000	
キャノン電子	500	1,976.00	988,000	
キャノン	28,800	3,628.00	104,486,400	代用有価証券 4,100株
リコー	17,300	1,201.00	20,777,300	
M U T O Hホールディングス	1,000	276.00	276,000	
東京エレクトロン	4,800	7,610.00	36,528,000	
トヨタ紡織	1,900	2,493.00	4,736,700	
鬼怒川ゴム工業	1,000	670.00	670,000	
ユニプレス	1,100	2,715.00	2,986,500	
豊田自動織機	4,900	6,120.00	29,988,000	
モリタホールディングス	900	1,374.00	1,236,600	
三櫻工業	700	740.00	518,000	
デンソー	13,200	5,586.00	73,735,200	

東海理化電機製作所	1,600	2,963.00	4,740,800	
三井造船	21,000	186.00	3,906,000	
川崎重工業	42,000	444.00	18,648,000	
名村造船所	1,600	1,031.00	1,649,600	
日本車輛製造	2,000	307.00	614,000	
ニチユ三菱フォークリフト	600	484.00	290,400	
近畿車輛	1,000	396.00	396,000	
日産自動車	75,100	1,218.00	91,471,800	
いすゞ自動車	15,500	1,294.50	20,064,750	
トヨタ自動車	68,100	7,324.00	498,764,400	代用有価証券 9,000株
日野自動車	7,600	1,412.00	10,731,200	
三菱自動車工業	21,200	1,043.00	22,111,600	
エフテック	300	1,203.00	360,900	
武蔵精密工業	600	2,492.00	1,495,200	
日産車体	2,600	1,323.00	3,439,800	
新明和工業	2,000	1,094.00	2,188,000	
極東開発工業	1,100	1,326.00	1,458,600	
日信工業	1,200	1,781.00	2,137,200	
トピー工業	4,000	271.00	1,084,000	
ティラド	2,000	191.00	382,000	
曙ブレーキ工業	2,700	319.00	861,300	
タチエス	800	1,948.00	1,558,400	
N O K	2,600	2,932.00	7,623,200	
フタバ産業	1,600	542.00	867,200	
K Y B	6,000	381.00	2,286,000	
シロキ工業	1,000	371.00	371,000	
大同メタル工業	700	1,085.00	759,500	
プレス工業	2,800	528.00	1,478,400	
ミクニ	500	420.00	210,000	
カルソニックカンセイ	4,000	1,017.00	4,068,000	
太平洋工業	1,200	1,325.00	1,590,000	
ケーヒン	1,200	2,116.00	2,539,200	
河西工業	700	1,726.00	1,208,200	
アイシン精機	5,400	5,060.00	27,324,000	
富士機工	600	478.00	286,800	
マツダ	16,900	2,431.00	41,083,900	
ダイハツ工業	6,400	1,603.00	10,259,200	
今仙電機製作所	500	1,222.00	611,000	
本田技研工業	48,100	3,776.00	181,625,600	代用有価証券 6,000株
スズキ	11,200	3,612.00	40,454,400	
富士重工業	16,900	4,861.00	82,150,900	

ヤマハ発動機	7,600	2,776.00	21,097,600
ショーワ	1,400	1,137.00	1,591,800
T B K	600	468.00	280,800
エクセディ	700	2,820.00	1,974,000
豊田合成	1,900	2,757.00	5,238,300
愛三工業	900	1,216.00	1,094,400
ヨロズ	500	2,754.00	1,377,000
エフ・シー・シー	900	2,595.00	2,335,500
シマノ	2,200	18,120.00	39,864,000
タカタ	1,000	869.00	869,000
テイ・エス テック	1,200	3,170.00	3,804,000
ジャムコ	200	4,280.00	856,000
テルモ	8,200	3,745.00	30,709,000
日機装	2,000	903.00	1,806,000
島津製作所	7,000	1,893.00	13,251,000
J M S	1,000	311.00	311,000
長野計器	300	725.00	217,500
ブイ・テクノロジー	100	5,030.00	503,000
東京計器	2,000	225.00	450,000
愛知時計電機	1,000	319.00	319,000
東京精密	1,000	2,699.00	2,699,000
マニー	500	2,251.00	1,125,500
ニコン	10,000	1,556.00	15,560,000
トプコン	1,800	1,985.00	3,573,000
オリンパス	8,000	4,540.00	36,320,000
理研計器	400	1,439.00	575,600
タムロン	400	2,238.00	895,200
H O Y A	12,400	4,814.00	59,693,600
ノーリツ鋼機	500	612.00	306,000
エー・アンド・デイ	500	416.00	208,000
シチズンホールディングス	6,600	840.00	5,544,000
リズム時計工業	2,000	160.00	320,000
大研医器	400	1,028.00	411,200
メニコン	300	3,215.00	964,500
松風	300	1,500.00	450,000
セイコーホールディングス	3,000	722.00	2,166,000
ニプロ	4,000	1,294.00	5,176,000
パラマウントベッドホールディングス	600	4,205.00	2,523,000
ニホンフラッシュ	200	1,218.00	243,600
前田工織	600	1,080.00	648,000
永大産業	1,000	422.00	422,000
アートネイチャー	400	1,074.00	429,600

ダンロップスポーツ	300	1,007.00	302,100
バンダイナムコホールディングス	5,500	2,609.00	14,349,500
共立印刷	900	301.00	270,900
フランスベッドホールディングス	700	984.00	688,800
パイロットコーポレーション	900	4,865.00	4,378,500
萩原工業	100	2,126.00	212,600
トッパン・フォームズ	1,000	1,430.00	1,430,000
フジシールインターナショナル	600	3,675.00	2,205,000
タカラトミー	1,800	741.00	1,333,800
廣済堂	500	380.00	190,000
プロネクサス	500	926.00	463,000
ウッドワン	1,000	259.00	259,000
大建工業	2,000	319.00	638,000
凸版印刷	15,000	1,051.00	15,765,000
大日本印刷	16,000	1,159.00	18,544,000
図書印刷	1,000	526.00	526,000
共同印刷	2,000	328.00	656,000
日本写真印刷	900	2,597.00	2,337,300
宝印刷	300	1,283.00	384,900
アシックス	5,000	2,510.00	12,550,000
ツツミ	300	2,604.00	781,200
小松ウオール工業	200	2,062.00	412,400
ヤマハ	3,900	2,857.00	11,142,300
河合楽器製作所	200	2,163.00	432,600
クリナップ	600	729.00	437,400
ピジョン	3,000	2,791.00	8,373,000
キングジム	400	806.00	322,400
リンテック	1,300	2,592.00	3,369,600
T A S A K I	100	1,691.00	169,100
イトーキ	1,100	907.00	997,700
任天堂	3,300	16,910.00	55,803,000
三菱鉛筆	400	5,190.00	2,076,000
タカラスタANDARD	2,000	940.00	1,880,000
コクヨ	2,800	1,313.00	3,676,400
ナカバヤシ	1,000	301.00	301,000
グローブライド	300	1,627.00	488,100
岡村製作所	1,900	1,196.00	2,272,400
美津濃	3,000	555.00	1,665,000
アデランス	900	819.00	737,100
東京電力	45,400	731.00	33,187,400
中部電力	16,400	1,656.50	27,166,600
関西電力	21,800	1,374.00	29,953,200

中国電力	7,400	1,508.00	11,159,200
北陸電力	5,200	1,696.00	8,819,200
東北電力	13,400	1,423.00	19,068,200
四国電力	4,800	1,758.00	8,438,400
九州電力	11,800	1,252.00	14,773,600
北海道電力	5,000	1,128.00	5,640,000
沖縄電力	600	3,040.00	1,824,000
電源開発	4,600	4,125.00	18,975,000
東京瓦斯	60,000	568.00	34,080,000
大阪瓦斯	55,000	424.90	23,369,500
東邦瓦斯	13,000	759.00	9,867,000
北海道瓦斯	1,000	277.00	277,000
広島ガス	900	431.00	387,900
西部瓦斯	6,000	266.00	1,596,000
静岡ガス	1,500	760.00	1,140,000
メタウォーター	300	3,065.00	919,500
SBSホールディングス	500	957.00	478,500
東武鉄道	29,000	575.00	16,675,000
相鉄ホールディングス	9,000	681.00	6,129,000
東京急行電鉄	31,000	913.00	28,303,000
京浜急行電鉄	15,000	974.00	14,610,000
小田急電鉄	17,000	1,202.00	20,434,000
京王電鉄	15,000	982.00	14,730,000
京成電鉄	8,000	1,422.00	11,376,000
富士急行	1,000	1,085.00	1,085,000
新京成電鉄	1,000	431.00	431,000
東日本旅客鉄道	9,800	11,050.00	108,290,000
西日本旅客鉄道	5,100	7,533.00	38,418,300
東海旅客鉄道	4,800	20,460.00	98,208,000
西武ホールディングス	4,300	2,453.00	10,547,900
鴻池運輸	800	1,459.00	1,167,200
西日本鉄道	7,000	659.00	4,613,000
ハマキョウレックス	400	2,239.00	895,600
サカイ引越センター	100	6,510.00	651,000
近鉄グループホールディングス	54,000	467.00	25,218,000
阪急阪神ホールディングス	36,000	761.00	27,396,000
南海電気鉄道	12,000	650.00	7,800,000
京阪電気鉄道	12,000	789.00	9,468,000
神戸電鉄	1,000	355.00	355,000
名古屋鉄道	19,000	472.00	8,968,000
山陽電気鉄道	2,000	451.00	902,000
日本通運	21,000	545.00	11,445,000

ヤマトホールディングス	9,900	2,408.00	23,839,200
山九	7,000	576.00	4,032,000
丸全昭和運輸	2,000	423.00	846,000
センコー	2,000	770.00	1,540,000
トナミホールディングス	1,000	351.00	351,000
ニッコンホールディングス	1,800	2,250.00	4,050,000
福山通運	3,000	573.00	1,719,000
セイノーホールディングス	3,800	1,233.00	4,685,400
神奈川中央交通	1,000	686.00	686,000
日立物流	1,100	1,950.00	2,145,000
丸和運輸機関	100	2,570.00	257,000
C & F ロジホールディングス	500	877.00	438,500
日本郵船	48,000	291.00	13,968,000
商船三井	26,000	297.00	7,722,000
川崎汽船	23,000	242.00	5,566,000
N S ユナイテッド海運	2,000	223.00	446,000
飯野海運	2,800	474.00	1,327,200
乾汽船	400	940.00	376,000
日本航空	10,200	4,248.00	43,329,600
A N A ホールディングス	99,000	345.10	34,164,900
トランコム	200	6,260.00	1,252,000
日新	2,000	365.00	730,000
三菱倉庫	4,000	1,539.00	6,156,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	332.00	996,000
住友倉庫	4,000	622.00	2,488,000
澁澤倉庫	1,000	314.00	314,000
東陽倉庫	1,000	258.00	258,000
日本トランスシティ	1,000	469.00	469,000
ケイヒン	1,000	175.00	175,000
中央倉庫	300	975.00	292,500
安田倉庫	400	901.00	360,400
東洋埠頭	2,000	184.00	368,000
宇徳	400	417.00	166,800
上組	6,000	1,018.00	6,108,000
キューソー流通システム	100	2,738.00	273,800
郵船ロジスティクス	500	1,543.00	771,500
近鉄エクスプレス	1,000	2,132.00	2,132,000
エーアイティー	200	1,128.00	225,600
N E C ネットズエスアイ	700	2,099.00	1,469,300
システナ	500	1,378.00	689,000
デジタルアーツ	300	1,986.00	595,800
新日鉄住金ソリューションズ	400	5,430.00	2,172,000

コア	200	1,241.00	248,200
ソフトクリエイトホールディングス	200	967.00	193,400
ITホールディングス	1,700	2,803.00	4,765,100
電算システム	200	2,004.00	400,800
グリー	3,200	593.00	1,897,600
コーエーテクモホールディングス	1,300	1,783.00	2,317,900
三菱総合研究所	200	3,160.00	632,000
ファインデックス	300	804.00	241,200
K L a b	800	869.00	695,200
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	300	1,069.00	320,700
ネクソン	5,000	1,929.00	9,645,000
アイスタイル	400	2,038.00	815,200
エイチーム	200	1,920.00	384,000
コロプラ	1,500	2,515.00	3,772,500
ブロードリーフ	500	1,149.00	574,500
ハーツユナイテッドグループ	200	2,161.00	432,200
ブイキューブ	100	1,837.00	183,700
VOYAGE GROUP	100	1,502.00	150,200
ティーガイア	500	1,298.00	649,000
豆蔵ホールディングス	400	621.00	248,400
テクマトリックス	200	1,364.00	272,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,200	351.00	3,229,200
GMOペイメントゲートウェイ	500	6,040.00	3,020,000
インターネットイニシアティブ	900	2,466.00	2,219,400
SRAホールディングス	300	2,826.00	847,800
朝日ネット	500	519.00	259,500
コムチュア	100	2,124.00	212,400
gumi	500	872.00	436,000
フェイス	100	1,487.00	148,700
野村総合研究所	3,700	4,540.00	16,798,000
インテージホールディングス	300	1,692.00	507,600
クレスコ	100	1,874.00	187,400
フジ・メディア・ホールディングス	5,500	1,416.00	7,788,000
オービック	1,800	6,270.00	11,286,000
ジャストシステム	1,000	949.00	949,000
ヤフー	37,800	499.00	18,862,200
トレンドマイクロ	2,600	5,150.00	13,390,000
日本オラクル	800	6,010.00	4,808,000
アルファシステムズ	200	1,894.00	378,800
フューチャーアーキテクト	600	736.00	441,600
CAC Holdings	400	974.00	389,600
オービックビジネスコンサルタント	300	6,650.00	1,995,000

伊藤忠テクノソリューションズ	1,200	2,421.00	2,905,200
アイティフォー	700	584.00	408,800
東計電算	100	2,338.00	233,800
大塚商会	1,400	6,090.00	8,526,000
サイボウズ	700	313.00	219,100
電通国際情報サービス	300	2,340.00	702,000
E Mシステムズ	100	2,434.00	243,400
ウェザーニューズ	200	4,210.00	842,000
C I J	500	502.00	251,000
WOWOW	300	3,030.00	909,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	400	447.00	178,800
ネットワンシステムズ	2,300	759.00	1,745,700
アルゴグラフィックス	200	1,863.00	372,600
マーベラス	900	954.00	858,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,000	1,362.00	1,362,000
日本ユニシス	1,500	1,292.00	1,938,000
兼松エレクトロニクス	300	2,100.00	630,000
東京放送ホールディングス	3,200	1,836.00	5,875,200
日本テレビホールディングス	4,800	2,242.00	10,761,600
朝日放送	500	810.00	405,000
テレビ朝日ホールディングス	1,400	2,093.00	2,930,200
スカパーJ S A Tホールディングス	4,000	663.00	2,652,000
テレビ東京ホールディングス	500	2,342.00	1,171,000
コネクシオ	500	1,119.00	559,500
日本通信	2,800	304.00	851,200
日本電信電話	40,800	4,597.00	187,557,600
K D D I	53,600	2,887.50	154,770,000
光通信	600	8,120.00	4,872,000
N T T ドコモ	40,700	2,323.00	94,546,100
エムティーアイ	700	660.00	462,000
G M O インターネット	2,000	1,676.00	3,352,000
カドカワ	1,600	1,860.00	2,976,000
学研ホールディングス	2,000	266.00	532,000
ゼンリン	700	2,175.00	1,522,500
昭文社	300	701.00	210,300
アイネット	300	1,215.00	364,500
松竹	3,000	1,143.00	3,429,000
東宝	3,800	3,245.00	12,331,000
東映	2,000	1,175.00	2,350,000
A O I P r o .	300	1,099.00	329,700
エヌ・ティ・ティ・データ	3,300	5,840.00	19,272,000
D T S	600	2,761.00	1,656,600



スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,200	2,868.00	6,309,600
シーイーシー	300	1,129.00	338,700
カブコン	1,300	2,928.00	3,806,400
ジャステック	300	986.00	295,800
S C S K	1,300	4,750.00	6,175,000
日本システムウエア	200	901.00	180,200
アイネス	700	1,067.00	746,900
T K C	500	3,100.00	1,550,000
富士ソフト	800	2,726.00	2,180,800
N S D	1,100	1,670.00	1,837,000
コナミホールディングス	2,400	2,940.00	7,056,000
J B C Cホールディングス	400	756.00	302,400
ミロク情報サービス	400	884.00	353,600
ソフトバンクグループ	29,900	6,007.00	179,609,300
高千穂交易	200	1,019.00	203,800
伊藤忠食品	100	4,165.00	416,500
エレマテック	200	2,879.00	575,800
J A L U X	200	2,537.00	507,400
あらた	200	2,720.00	544,000
東京エレクトロン デバイス	200	1,595.00	319,000
フィールズ	300	2,073.00	621,900
双日	33,300	257.00	8,558,100
アルフレッサ ホールディングス	6,600	2,307.00	15,226,200
横浜冷凍	1,300	1,015.00	1,319,500
アルコニックス	300	1,563.00	468,900
神戸物産	300	3,945.00	1,183,500
あい ホールディングス	800	2,969.00	2,375,200
ダイワボウホールディングス	5,000	249.00	1,245,000
マクニカ・富士エレホールディングス	900	1,546.00	1,391,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	900	965.00	868,500
八洲電機	400	570.00	228,000
U K Cホールディングス	300	2,778.00	833,400
T O K A Iホールディングス	2,600	533.00	1,385,800
三洋貿易	300	1,401.00	420,300
ウイン・パートナーズ	200	1,721.00	344,200
シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,771.00	3,048,100
明治電機工業	200	1,189.00	237,800
小野建	500	1,081.00	540,500
佐島電機	400	785.00	314,000
伯東	400	1,267.00	506,800
コンドーテック	400	757.00	302,800
中山福	300	842.00	252,600

ナガイレーベン	800	2,154.00	1,723,200
三菱食品	600	2,911.00	1,746,600
松田産業	400	1,390.00	556,000
メディカルホールディングス	5,300	2,035.00	10,785,500
アドヴァン	500	1,002.00	501,000
S P K	100	2,212.00	221,200
萩原電気	100	2,029.00	202,900
アズワン	400	4,615.00	1,846,000
シモジマ	400	1,090.00	436,000
ドウシシャ	600	2,441.00	1,464,600
小津産業	100	2,067.00	206,700
高速	300	951.00	285,300
たけびし	200	1,051.00	210,200
黒田電気	1,000	2,240.00	2,240,000
丸文	500	949.00	474,500
ハピネット	500	1,167.00	583,500
エクセル	300	1,527.00	458,100
マルカキカイ	200	1,747.00	349,400
ガリバーインターナショナル	1,400	1,110.00	1,554,000
日本エム・ディ・エム	400	637.00	254,800
進和	300	1,682.00	504,600
ダイトエレクトロン	200	815.00	163,000
シークス	300	3,530.00	1,059,000
オーハシテクニカ	300	1,353.00	405,900
白銅	200	1,234.00	246,800
伊藤忠商事	41,400	1,415.50	58,601,700
丸紅	52,000	640.10	33,285,200
高島	1,000	232.00	232,000
長瀬産業	3,200	1,501.00	4,803,200
蝶理	300	1,687.00	506,100
豊田通商	5,900	2,729.00	16,101,100
三共生興	800	454.00	363,200
兼松	11,000	194.00	2,134,000
三井物産	47,700	1,417.00	67,590,900
日本紙パルプ商事	3,000	330.00	990,000
日立ハイテクノロジーズ	1,800	3,185.00	5,733,000
カメイ	700	1,181.00	826,700
O U Gホールディングス	1,000	243.00	243,000
スターゼン	200	3,315.00	663,000
山善	2,000	1,096.00	2,192,000
椿本興業	1,000	331.00	331,000
住友商事	33,200	1,229.50	40,819,400

内田洋行	1,000	462.00	462,000	
三菱商事	39,600	1,972.00	78,091,200	代用有価証券 5,200株
第一実業	1,000	529.00	529,000	
キャノンマーケティングジャパン	1,500	1,843.00	2,764,500	
西華産業	2,000	292.00	584,000	
佐藤商事	500	783.00	391,500	
菱洋エレクトロ	600	1,373.00	823,800	
東京産業	500	502.00	251,000	
ユアサ商事	500	2,946.00	1,473,000	
神鋼商事	1,000	242.00	242,000	
阪和興業	5,000	532.00	2,660,000	
カナデン	500	980.00	490,000	
菱電商事	1,000	825.00	825,000	
フルサト工業	300	1,784.00	535,200	
岩谷産業	6,000	625.00	3,750,000	
すてきナイスグループ	2,000	170.00	340,000	
ニチモウ	1,000	196.00	196,000	
極東貿易	1,000	250.00	250,000	
三愛石油	1,000	980.00	980,000	
稲畑産業	1,300	1,207.00	1,569,100	
明和産業	500	413.00	206,500	
ワキタ	1,100	1,002.00	1,102,200	
東邦ホールディングス	1,700	2,854.00	4,851,800	
サンゲツ	1,900	2,237.00	4,250,300	
ミツウロコグループホールディングス	800	585.00	468,000	
シナネンホールディングス	1,000	467.00	467,000	
伊藤忠エネクス	1,400	937.00	1,311,800	
サンリオ	1,600	2,850.00	4,560,000	
サンワテクノス	300	952.00	285,600	
リョーサン	800	3,120.00	2,496,000	
新光商事	600	1,293.00	775,800	
トーホー	200	2,410.00	482,000	
三信電気	700	1,242.00	869,400	
東陽テクニカ	800	1,033.00	826,400	
モスフードサービス	700	3,115.00	2,180,500	
加賀電子	500	1,667.00	833,500	
ソーダニッカ	500	497.00	248,500	
立花エレテック	400	1,363.00	545,200	
PALTAC	800	2,182.00	1,745,600	
三谷産業	600	370.00	222,000	
ヤマタネ	2,000	186.00	372,000	
日鉄住金物産	3,000	402.00	1,206,000	

トラスコ中山	600	4,420.00	2,652,000
オートバックスセブン	2,000	2,118.00	4,236,000
加藤産業	800	2,634.00	2,107,200
イノテック	500	586.00	293,000
イエローハット	500	2,456.00	1,228,000
J Kホールディングス	500	468.00	234,000
日伝	200	3,000.00	600,000
杉本商事	300	1,419.00	425,700
因幡電機産業	700	3,705.00	2,593,500
バイテックホールディングス	200	1,212.00	242,400
ミスミグループ本社	5,900	1,604.00	9,463,600
タキヒヨー	1,000	474.00	474,000
スズケン	2,400	4,510.00	10,824,000
ジェコス	400	1,021.00	408,400
ローソン	2,000	9,410.00	18,820,000
サンエー	400	5,050.00	2,020,000
カワチ薬品	400	2,340.00	936,000
エービーシー・マート	700	6,440.00	4,508,000
ハードオフコーポレーション	300	1,500.00	450,000
アスクル	600	4,595.00	2,757,000
ゲオホールディングス	1,000	1,983.00	1,983,000
アダストリア	500	6,160.00	3,080,000
くらコーポレーション	300	4,505.00	1,351,500
キャンドウ	300	1,537.00	461,100
パル	300	2,825.00	847,500
エディオン	2,200	920.00	2,024,000
サーラコーポレーション	500	618.00	309,000
ワッツ	200	883.00	176,600
あみやき亭	100	4,605.00	460,500
ひらまつ	700	723.00	506,100
ゲンキー	100	3,890.00	389,000
大黒天物産	100	4,370.00	437,000
ハニーズ	500	1,000.00	500,000
アルペン	500	2,011.00	1,005,500
クオール	500	1,651.00	825,500
ジェイアイエヌ	400	4,310.00	1,724,000
ビックカメラ	2,700	1,002.00	2,705,400
D C Mホールディングス	2,600	762.00	1,981,200
MonotaRO	1,900	3,365.00	6,393,500
アーランドサービス	100	5,010.00	501,000
J . フロント リテイリング	6,700	1,781.00	11,932,700
ドトール・日レスホールディングス	900	1,833.00	1,649,700

マツモトキヨシホールディングス	1,100	6,010.00	6,611,000
ブロンコピリー	200	2,346.00	469,200
スタートトゥデイ	1,600	3,910.00	6,256,000
トレジャー・ファクトリー	100	1,071.00	107,100
物語コーポレーション	100	5,520.00	552,000
ココカラファイン	600	5,010.00	3,006,000
三越伊勢丹ホールディングス	10,500	1,594.00	16,737,000
ウエルシアホールディングス	500	6,390.00	3,195,000
クリエイティブSDホールディングス	900	2,538.00	2,284,200
丸善CHIホールディングス	600	351.00	210,600
チムニー	100	3,105.00	310,500
ジョイフル本田	800	2,400.00	1,920,000
キリン堂ホールディングス	200	1,276.00	255,200
ホットランド	100	1,506.00	150,600
すかいらーく	1,600	1,584.00	2,534,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,700	993.00	1,688,100
ブックオフコーポレーション	300	901.00	270,300
あさひ	400	1,312.00	524,800
日本調剤	100	4,605.00	460,500
コスモス薬品	300	17,520.00	5,256,000
トーエル	300	625.00	187,500
セブン&アイ・ホールディングス	22,100	5,296.00	117,041,600
薬王堂	100	2,868.00	286,800
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	500	3,195.00	1,597,500
ツルハホールディングス	1,100	10,430.00	11,473,000
サンマルクホールディングス	400	3,315.00	1,326,000
トリドール	600	2,072.00	1,243,200
クスリのアオキ	400	5,830.00	2,332,000
メディカルシステムネットワーク	600	640.00	384,000
総合メディカル	300	4,280.00	1,284,000
カップ・クリエイティブ	700	1,191.00	833,700
ライトオン	400	1,346.00	538,400
良品計画	600	24,520.00	14,712,000
三城ホールディングス	700	461.00	322,700
アルビス	100	2,198.00	219,800
コナカ	600	621.00	372,600
G-7ホールディングス	200	1,595.00	319,000
イオン北海道	400	533.00	213,200
コジマ	800	276.00	220,800
ヒマラヤ	200	1,079.00	215,800
コーナン商事	700	1,657.00	1,159,900

エコス	200	1,475.00	295,000
ワタミ	600	829.00	497,400
ドンキホーテホールディングス	3,400	4,395.00	14,943,000
西松屋チェーン	1,000	1,060.00	1,060,000
ゼンショーホールディングス	2,700	1,460.00	3,942,000
幸楽苑ホールディングス	300	1,569.00	470,700
ハークスレイ	100	1,425.00	142,500
サイゼリヤ	900	2,890.00	2,601,000
V Tホールディングス	1,800	689.00	1,240,200
魚力	200	1,452.00	290,400
ユナイテッドアローズ	800	4,940.00	3,952,000
ハイデイ日高	400	3,430.00	1,372,000
京都きもの友禅	400	962.00	384,800
コロワイド	1,800	1,754.00	3,157,200
壱番屋	200	5,590.00	1,118,000
スギホールディングス	900	6,480.00	5,832,000
スクロール	800	418.00	334,400
ヨンドシーホールディングス	400	2,732.00	1,092,800
ファミリーマート	1,600	5,610.00	8,976,000
木曽路	600	2,134.00	1,280,400
サトレストランシステムズ	600	880.00	528,000
千趣会	1,000	799.00	799,000
ケーヨー	900	496.00	446,400
上新電機	1,000	1,049.00	1,049,000
日本瓦斯	600	2,847.00	1,708,200
ロイヤルホールディングス	900	2,249.00	2,024,100
いなげや	600	1,269.00	761,400
島忠	1,400	2,641.00	3,697,400
チヨダ	600	3,860.00	2,316,000
ライフコーポレーション	300	2,968.00	890,400
リンガーハット	500	2,611.00	1,305,500
テンアライド	500	391.00	195,500
A O K Iホールディングス	1,200	1,552.00	1,862,400
オークワ	1,000	1,142.00	1,142,000
コメリ	800	2,469.00	1,975,200
青山商事	1,000	4,755.00	4,755,000
しまむら	600	13,580.00	8,148,000
高島屋	8,000	1,018.00	8,144,000
松屋	1,100	1,266.00	1,392,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,700	2,339.00	6,315,300
近鉄百貨店	2,000	321.00	642,000
パルコ	500	1,064.00	532,000

丸井グループ	6,500	1,803.00	11,719,500
アクシアル リテイリング	400	4,005.00	1,602,000
イオン	21,700	1,762.50	38,246,250
ユニーグループ・ホールディングス	5,100	752.00	3,835,200
イズミ	1,000	4,495.00	4,495,000
東武ストア	1,000	301.00	301,000
平和堂	1,100	2,691.00	2,960,100
フジ	600	2,517.00	1,510,200
ヤオコー	600	4,915.00	2,949,000
ゼビオホールディングス	700	2,300.00	1,610,000
ケーズホールディングス	1,100	4,230.00	4,653,000
O l y m p i cグループ	300	601.00	180,300
日産東京販売ホールディングス	900	300.00	270,000
アインホールディングス	600	5,620.00	3,372,000
元気寿司	100	2,149.00	214,900
ヤマダ電機	16,100	528.00	8,500,800
アークランドサカモト	400	2,471.00	988,400
ニトリホールディングス	2,300	9,980.00	22,954,000
ケーユーホールディングス	300	780.00	234,000
吉野家ホールディングス	1,900	1,530.00	2,907,000
松屋フーズ	300	2,799.00	839,700
サガミチェーン	700	1,248.00	873,600
関西スーパーマーケット	400	823.00	329,200
王将フードサービス	400	4,085.00	1,634,000
プレナス	600	1,999.00	1,199,400
ミニストップ	400	2,163.00	865,200
アークス	1,000	2,525.00	2,525,000
パローホールディングス	1,100	2,750.00	3,025,000
ベルク	300	4,265.00	1,279,500
大庄	200	1,502.00	300,400
ファーストリテイリング	1,100	43,980.00	48,378,000
サンドラッグ	1,100	7,450.00	8,195,000
サックスパー ホールディングス	500	1,760.00	880,000
ヤマザワ	100	1,675.00	167,500
やまや	100	2,134.00	213,400
ベルーナ	1,300	650.00	845,000
じもとホールディングス	3,800	195.00	741,000
足利ホールディングス	3,900	446.00	1,739,400
東京ＴＹフィナンシャルグループ	700	3,760.00	2,632,000
九州フィナンシャルグループ	8,100	817.00	6,617,700
新生銀行	46,000	211.00	9,706,000
あおぞら銀行	33,000	411.00	13,563,000

三菱UFJフィナンシャル・グループ	423,700	743.00	314,809,100
りそなホールディングス	61,800	572.60	35,386,680
三井住友トラスト・ホールディングス	110,000	441.10	48,521,000
三井住友フィナンシャルグループ	42,300	4,492.00	190,011,600
第四銀行	7,000	503.00	3,521,000
北越銀行	6,000	243.00	1,458,000
西日本シティ銀行	17,000	302.00	5,134,000
千葉銀行	20,000	797.00	15,940,000
横浜銀行	35,000	685.00	23,975,000
常陽銀行	19,000	538.00	10,222,000
群馬銀行	12,000	674.00	8,088,000
武蔵野銀行	800	4,295.00	3,436,000
千葉興業銀行	1,400	678.00	949,200
筑波銀行	2,200	387.00	851,400
七十七銀行	8,000	613.00	4,904,000
青森銀行	4,000	373.00	1,492,000
秋田銀行	3,000	394.00	1,182,000
山形銀行	3,000	455.00	1,365,000
岩手銀行	400	4,765.00	1,906,000
東邦銀行	5,000	417.00	2,085,000
東北銀行	3,000	156.00	468,000
みちのく銀行	3,000	199.00	597,000
ふくおかフィナンシャルグループ	23,000	545.00	12,535,000
静岡銀行	15,000	1,124.00	16,860,000
十六銀行	7,000	452.00	3,164,000
スルガ銀行	5,600	2,322.00	13,003,200
八十二銀行	10,000	704.00	7,040,000
山梨中央銀行	3,000	583.00	1,749,000
大垣共立銀行	7,000	472.00	3,304,000
福井銀行	5,000	233.00	1,165,000
北國銀行	6,000	387.00	2,322,000
清水銀行	200	2,965.00	593,000
滋賀銀行	5,000	577.00	2,885,000
南都銀行	5,000	377.00	1,885,000
百五銀行	5,000	563.00	2,815,000
京都銀行	10,000	1,072.00	10,720,000
紀陽銀行	2,100	1,699.00	3,567,900
三重銀行	2,000	259.00	518,000
ほくほくフィナンシャルグループ	36,000	238.00	8,568,000
広島銀行	16,000	662.00	10,592,000
山陰合同銀行	3,200	937.00	2,998,400
中国銀行	3,700	1,568.00	5,801,600



鳥取銀行	2,000	213.00	426,000
伊予銀行	5,600	1,108.00	6,204,800
百十四銀行	6,000	439.00	2,634,000
四国銀行	4,000	261.00	1,044,000
阿波銀行	4,000	666.00	2,664,000
大分銀行	3,000	466.00	1,398,000
宮崎銀行	4,000	386.00	1,544,000
佐賀銀行	3,000	263.00	789,000
十八銀行	3,000	352.00	1,056,000
沖縄銀行	400	4,545.00	1,818,000
琉球銀行	1,100	1,674.00	1,841,400
セブン銀行	19,800	511.00	10,117,800
みずほフィナンシャルグループ	743,700	235.50	175,141,350
山口フィナンシャルグループ	5,000	1,349.00	6,745,000
長野銀行	2,000	203.00	406,000
名古屋銀行	4,000	417.00	1,668,000
北洋銀行	8,000	424.00	3,392,000
愛知銀行	200	6,340.00	1,268,000
第三銀行	3,000	175.00	525,000
中京銀行	2,000	224.00	448,000
東日本銀行	3,000	369.00	1,107,000
大光銀行	2,000	238.00	476,000
愛媛銀行	3,000	245.00	735,000
トマト銀行	2,000	171.00	342,000
みなと銀行	5,000	198.00	990,000
京葉銀行	4,000	542.00	2,168,000
関西アーバン銀行	700	1,297.00	907,900
栃木銀行	3,000	671.00	2,013,000
北日本銀行	200	3,260.00	652,000
東和銀行	7,000	108.00	756,000
福島銀行	6,000	95.00	570,000
大東銀行	3,000	208.00	624,000
トモニホールディングス	4,100	436.00	1,787,600
フィデアホールディングス	3,200	258.00	825,600
池田泉州ホールディングス	5,600	481.00	2,693,600
F P G	1,600	845.00	1,352,000
S B I ホールディングス	6,300	1,300.00	8,190,000
ジャフコ	900	4,595.00	4,135,500
大和証券グループ本社	49,000	744.80	36,495,200
野村ホールディングス	101,600	681.50	69,240,400
岡三証券グループ	4,000	690.00	2,760,000
丸三証券	1,600	1,197.00	1,915,200

東洋証券	2,000	372.00	744,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,100	683.00	4,166,300
光世証券	1,000	176.00	176,000
水戸証券	1,600	398.00	636,800
いちよし証券	1,200	1,082.00	1,298,400
松井証券	2,700	1,089.00	2,940,300
だいこう証券ビジネス	300	1,047.00	314,100
マネックスグループ	6,200	310.00	1,922,000
カブドットコム証券	4,700	367.00	1,724,900
極東証券	700	1,551.00	1,085,700
岩井コスモホールディングス	500	1,336.00	668,000
藍澤證券	700	698.00	488,600
マネースクウェアHD	200	1,420.00	284,000
マネーパートナーズグループ	500	371.00	185,500
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	11,700	3,703.00	43,325,100
アニコムホールディングス	400	2,720.00	1,088,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	15,800	3,315.00	52,377,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	5,100	2,099.00	10,704,900
第一生命保険	33,800	1,986.50	67,143,700
東京海上ホールディングス	21,400	4,377.00	93,667,800
T&Dホールディングス	19,200	1,604.00	30,796,800
全国保証	1,400	3,825.00	5,355,000
クレディセゾン	4,000	2,424.00	9,696,000
アクリーティブ	400	503.00	201,200
芙蓉総合リース	600	5,520.00	3,312,000
興銀リース	1,000	2,498.00	2,498,000
東京センチュリーリース	1,200	3,995.00	4,794,000
日本証券金融	2,300	619.00	1,423,700
アイフル	8,800	390.00	3,432,000
ポケットカード	500	540.00	270,000
リコーリース	400	3,605.00	1,442,000
イオンフィナンシャルサービス	3,500	2,729.00	9,551,500
アコム	10,600	585.00	6,201,000
ジャックス	3,000	444.00	1,332,000
オリエントコーポレーション	22,800	265.00	6,042,000
日立キャピタル	1,200	3,240.00	3,888,000
オリックス	37,400	1,634.50	61,130,300
三菱UFJリース	13,400	620.00	8,308,000
日本取引所グループ	15,500	1,830.00	28,365,000
イー・ギャランティ	200	2,651.00	530,200
NECキャピタルソリューション	200	1,668.00	333,600
日本駐車場開発	5,800	134.00	777,200

ヒューリック	11,000	1,037.00	11,407,000
三栄建築設計	200	1,329.00	265,800
野村不動産ホールディングス	3,500	2,292.00	8,022,000
三重交通グループホールディングス	900	467.00	420,300
日本商業開発	200	1,804.00	360,800
プレサンスコーポレーション	200	4,005.00	801,000
ユニゾホールディングス	300	4,600.00	1,380,000
日本管理センター	300	1,410.00	423,000
フージャースホールディングス	700	529.00	370,300
オープンハウス	800	2,303.00	1,842,400
東急不動産ホールディングス	12,800	751.00	9,612,800
飯田グループホールディングス	4,900	2,215.00	10,853,500
パーク24	2,700	2,586.00	6,982,200
パラカ	200	1,557.00	311,400
三井不動産	28,000	2,996.00	83,888,000
三菱地所	39,000	2,440.50	95,179,500
平和不動産	1,000	1,336.00	1,336,000
東京建物	5,800	1,356.00	7,864,800
ダイビル	1,400	926.00	1,296,400
京阪神ビルディング	900	689.00	620,100
住友不動産	13,000	3,512.00	45,656,000
大京	10,000	193.00	1,930,000
テーオーシー	2,000	964.00	1,928,000
東京楽天地	1,000	511.00	511,000
レオパレス21	6,200	681.00	4,222,200
スターツコーポレーション	600	2,185.00	1,311,000
フジ住宅	700	725.00	507,500
空港施設	600	568.00	340,800
住友不動産販売	400	2,737.00	1,094,800
ゴールドクレスト	400	2,266.00	906,400
日本エスリード	200	1,126.00	225,200
日神不動産	700	408.00	285,600
タカラレーベン	2,300	695.00	1,598,500
サンヨーハウジング名古屋	300	1,154.00	346,200
イオンモール	3,400	2,121.00	7,211,400
ファースト住建	200	1,305.00	261,000
トーセイ	800	735.00	588,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,300	1,139.00	3,758,700
サンフロンティア不動産	600	879.00	527,400
エフ・ジェー・ネクスト	500	500.00	250,000
グランディハウス	500	393.00	196,500
日本空港ビルデング	1,700	5,490.00	9,333,000

日本工営	2,000	437.00	874,000
ネクスト	1,600	1,245.00	1,992,000
ジェイエイシーリクルートメント	300	826.00	247,800
日本M&Aセンター	900	5,390.00	4,851,000
アコーディア・ゴルフ	1,500	1,113.00	1,669,500
タケエイ	500	1,013.00	506,500
トラスト・テック	100	2,437.00	243,700
パソナグループ	400	910.00	364,000
G C Aサヴィアン	500	1,213.00	606,500
エス・エム・エス	700	2,290.00	1,603,000
テンプホールディングス	3,900	1,827.00	7,125,300
リニカル	200	3,450.00	690,000
クックパッド	1,200	2,569.00	3,082,800
エスクリ	200	1,020.00	204,000
学情	200	1,096.00	219,200
スタジオアリス	300	2,173.00	651,900
シミックホールディングス	300	1,569.00	470,700
総合警備保障	1,900	5,510.00	10,469,000
カカクコム	4,100	2,303.00	9,442,300
アイロムグループ	200	1,242.00	248,400
ルネサンス	300	1,258.00	377,400
ディップ	600	2,587.00	1,552,200
オプトホールディング	300	614.00	184,200
新日本科学	500	431.00	215,500
ツクイ	700	1,247.00	872,900
エムスリー	4,800	2,613.00	12,542,400
ツカダ・グローバルホールディング	400	797.00	318,800
アウトソーシング	300	3,190.00	957,000
ウェルネット	200	2,642.00	528,400
ディー・エヌ・エー	2,500	1,912.00	4,780,000
博報堂D Yホールディングス	7,700	1,314.00	10,117,800
ぐるなび	600	2,592.00	1,555,200
エスアールジータカミヤ	400	470.00	188,000
一休	400	2,411.00	964,400
ファンコミュニケーションズ	1,300	772.00	1,003,600
WDBホールディングス	200	1,171.00	234,200
バリューコマース	500	498.00	249,000
J Pホールディングス	1,400	329.00	460,600
E P Sホールディングス	500	1,389.00	694,500
プレステージ・インターナショナル	500	1,153.00	576,500
アミューズ	200	5,600.00	1,120,000
ドリームインキュベータ	200	2,296.00	459,200

クイック	300	984.00	295,200
ケネディクス	7,500	448.00	3,360,000
電通	6,200	6,580.00	40,796,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	697.00	209,100
ぴあ	200	2,317.00	463,400
イオンファンタジー	200	1,994.00	398,800
みらかホールディングス	1,400	5,330.00	7,462,000
アルプス技研	200	2,545.00	509,000
日本空調サービス	300	1,212.00	363,600
オリエンタルランド	6,000	6,879.00	41,274,000
ダスキン	1,600	2,188.00	3,500,800
明光ネットワークジャパン	600	1,415.00	849,000
ファルコホールディングス	200	1,461.00	292,200
ラウンドワン	1,700	532.00	904,400
リゾートトラスト	2,300	2,985.00	6,865,500
ビー・エム・エル	300	3,555.00	1,066,500
りらいあコミュニケーションズ	900	1,137.00	1,023,300
ユー・エス・エス	6,800	1,832.00	12,457,600
サイバーエージェント	1,400	5,070.00	7,098,000
楽天	26,100	1,402.50	36,605,250
テー・オー・ダブリュー	300	699.00	209,700
セントラルスポーツ	200	2,280.00	456,000
フルキャストホールディングス	500	692.00	346,000
テクノプロ・ホールディングス	800	3,345.00	2,676,000
ジャパンマテリアル	200	2,472.00	494,400
ベクトル	200	1,939.00	387,800
アサンテ	200	1,465.00	293,000
N・フィールド	200	1,353.00	270,600
リクルートホールディングス	11,300	3,600.00	40,680,000
リロ・ホールディング	200	12,040.00	2,408,000
東祥	200	3,090.00	618,000
エイチ・アイ・エス	900	3,775.00	3,397,500
共立メンテナンス	400	9,670.00	3,868,000
イチネンホールディングス	600	1,106.00	663,600
建設技術研究所	300	1,273.00	381,900
スペース	300	1,371.00	411,300
よみうりランド	1,000	401.00	401,000
東京都競馬	4,000	266.00	1,064,000
常磐興産	2,000	153.00	306,000
カナモト	800	2,907.00	2,325,600
東京ドーム	4,000	548.00	2,192,000
西尾レントオール	400	3,060.00	1,224,000

トランス・コスモス	600	2,920.00	1,752,000	
乃村工藝社	1,200	1,762.00	2,114,400	
藤田観光	2,000	547.00	1,094,000	
KNT-CTホールディングス	3,000	234.00	702,000	
日本管財	500	1,852.00	926,000	
トーカイ	200	3,580.00	716,000	
セコム	5,800	7,970.00	46,226,000	
セントラル警備保障	200	1,678.00	335,600	
丹青社	1,000	936.00	936,000	
メイテック	700	4,180.00	2,926,000	
アサツー ディ・ケイ	1,000	3,390.00	3,390,000	
応用地質	600	1,408.00	844,800	
船井総研ホールディングス	600	2,036.00	1,221,600	
進学会	300	608.00	182,400	
ベネッセホールディングス	1,900	3,295.00	6,260,500	
イオンディライト	500	3,595.00	1,797,500	
ナック	300	961.00	288,300	
ニチイ学館	1,000	817.00	817,000	
ダイセキ	1,000	2,039.00	2,039,000	
ステップ	200	1,103.00	220,600	
合 計	8,653,900		11,795,801,650	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,272,874,852	771,736,055
コール・ローン	10,167,966	10,202,760
株式	11,631,595,909	9,668,285,807

	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
投資信託受益証券	1,554,977	1,220,081
投資証券	296,362,105	254,142,746
派生商品評価勘定	780,289	29,668,954
未収入金	5,191,376	103,707
未収配当金	20,212,673	15,792,222
未収利息	12	14
差入委託証拠金	110,223,583	430,348,710
流動資産合計	13,348,963,742	11,181,501,056
資産合計	13,348,963,742	11,181,501,056
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	51,122,977	19,177,258
未払解約金	-	13,400,000
流動負債合計	51,122,977	32,577,258
負債合計	51,122,977	32,577,258
純資産の部		
元本等		
元本	7,127,974,226	5,926,931,068
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,169,866,539	5,221,992,730
元本等合計	13,297,840,765	11,148,923,798
純資産合計	13,297,840,765	11,148,923,798
負債純資産合計	13,348,963,742	11,181,501,056

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式及び投資証券 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>
----------------------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

平成26年12月15日現在		平成27年12月15日現在	
1. 計算日における受益権の総数	7,127,974,226口	1. 計算日における受益権の総数	5,926,931,068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	1.8656円	1口当たり純資産額	1.8811円
(1万口当たり純資産額)	(18,656円)	(1万口当たり純資産額)	(18,811円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスク、為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左



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

## 金融商品の時価等に関する事項

平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,068,038,334円	7,127,974,226円
期中追加設定元本額	446,287,363円	420,598,874円
期中一部解約元本額	2,386,351,471円	1,621,642,032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	598,200,702円	497,173,395円
新光外国株式インデックスV A	3,261,086,733円	2,520,014,000円
新光世界バランスファンド3 5 V A（適格機関投資家私募）	776,841,296円	713,424,616円
新光ワールドバランスファンドV A（適格機関投資家私募）	609,455,114円	500,693,861円
新光世界バランス3 5 V A T（適格機関投資家私募）	152,584,277円	117,252,540円
ワールドバランスファンド3 0 V A（適格機関投資家私募）	1,126,906,750円	1,005,488,134円
ワールドバランスファンド3 0 V A 2（適格機関投資家私募）	586,124,035円	554,022,332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）	4,576,205円	3,913,125円
グローバル・ナビ	12,199,114円	14,949,065円
合計	7,127,974,226円	5,926,931,068円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	220,130,348	417,073,500
投資信託受益証券	22,536	46,041
投資証券	5,087,879	563,335
合計	215,019,933	416,556,206

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

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

種類	平成26年12月15日現在				平成27年12月15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	1,282,695,264	-	1,231,068,358	51,626,906	1,249,880,657	-	1,198,003,546	51,877,111
S&P500 EMINI	747,726,394	-	722,508,070	25,218,324	816,473,311	-	794,785,368	21,687,943
S&P/TSE 601X	35,880,959	-	32,831,902	3,049,057	27,861,476	-	26,482,936	1,378,540
DJ EURO ST50	242,400,572	-	230,807,436	11,593,136	187,181,092	-	171,716,585	15,464,507
LIFFE FTSE	150,139,302	-	141,050,255	9,089,047	184,657,820	-	172,602,800	12,055,020
SWISS MKT IX	66,453,957	-	65,713,557	740,400	-	-	-	-
SPI 200	40,094,080	-	38,157,138	1,936,942	33,706,958	-	32,415,857	1,291,101
合計	1,282,695,264	-	1,231,068,358	51,626,906	1,249,880,657	-	1,198,003,546	51,877,111

## 時価の算定方法

## 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

契約額等及び時価の邦貨換算額は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

種類	平成26年12月15日現在				平成27年12月15日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	27,974,628	-	27,922,610	52,018	-	-	-	-
米ドル	13,671,269	-	13,639,000	32,269	-	-	-	-
ユーロ	8,140,517	-	8,128,450	12,067	-	-	-	-
英ポンド	6,162,842	-	6,155,160	7,682	-	-	-	-
売建	149,362,528	-	149,058,210	304,318	24,807,850	-	24,838,400	30,550
米ドル	96,887,269	-	96,659,000	228,269	18,141,000	-	18,171,900	30,900
カナダドル	17,450,500	-	17,425,000	25,500	-	-	-	-
ユーロ	28,861,917	-	28,819,050	42,867	6,666,850	-	6,666,500	350
英ポンド	6,162,842	-	6,155,160	7,682	-	-	-	-
合計	177,337,156	-	176,980,820	252,300	24,807,850	-	24,838,400	30,550

時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	1,471	47.59	70,004.89	
	ANTERO RESOURCES CORPORATION	240	19.58	4,699.20	
	APACHE CORP	1,069	43.49	46,490.81	
	BAKER HUGHES INC	1,264	46.78	59,129.92	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,174	15.65	18,373.10	
	CAMERON INTERNATIONAL CORPORATION	565	63.15	35,679.75	
	CHENIERE ENERGY INC	699	40.14	28,057.86	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,800	4.00	7,200.00	
	CHEVRON CORP	5,283	89.33	471,930.39	
	CIMAREX ENERGY CO	264	102.19	26,978.16	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	927	18.61	17,251.47	
	CONCHO RESOURCES INC	351	102.43	35,952.93	
	CONOCOPHILLIPS	3,464	49.53	171,571.92	
	CONTINENTAL RESOURCES INC	289	26.66	7,704.74	
	CORE LABORATORIES NV	136	116.03	15,780.08	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,116	31.54	35,198.64	
	ENERGEN CORPORATION	227	48.50	11,009.50	
	ENSCO PLC-CLASS A	676	15.19	10,268.44	
	EOG RESOURCES INC	1,534	76.86	117,903.24	
	EQT CORPORATION	436	48.07	20,958.52	
	EXXON MOBIL CORP	11,649	76.03	885,673.47	
	FMC TECHNOLOGIES INC	641	29.18	18,704.38	
	HALLIBURTON CO	2,469	36.55	90,241.95	
	HELMERICH & PAYNE INC	336	51.96	17,458.56	
	HESS CORPORATION	749	50.12	37,539.88	
	HOLLYFRONTIER CORPORATION	578	41.83	24,177.74	
	KINDER MORGAN INC	5,214	16.00	83,424.00	
	MARATHON OIL CORP	1,933	13.96	26,984.68	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	1,526	47.99	73,232.74	
	MURPHY OIL CORPORATION	496	22.26	11,040.96	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,072	33.56	35,976.32	
	NOBLE ENERGY INC	1,154	31.75	36,639.50	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,158	66.65	143,830.70	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	285	37.60	10,716.00		
ONEOK INC	672	20.60	13,843.20		
PHILLIPS 66	1,524	81.40	124,053.60		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	421	141.11	59,407.31		
PLAINS GP HOLDINGS LP(LP)	627	8.60	5,392.20		
RANGE RESOURCES CORP	524	21.86	11,454.64		
SCHLUMBERGER LIMITED	3,567	70.02	249,761.34		

SOUTHWESTERN ENERGY CO	1,224	5.33	6,523.92
SPECTRA ENERGY CORPORATION	1,945	22.84	44,423.80
TESORO CORPORATION	344	101.83	35,029.52
VALERO ENERGY CORP	1,389	67.55	93,826.95
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	2,157	8.73	18,830.61
WHITING PETROLEUM CORPORATION	517	10.92	5,645.64
WILLIAMS COS INC	2,030	25.57	51,907.10
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	571	128.96	73,636.16
AIRGAS INC	209	136.28	28,482.52
ALBEMARLE CORPORATION	350	47.76	16,716.00
ALCOA INC	3,537	9.00	31,833.00
ASHLAND INC	205	102.88	21,090.40
AVERY DENNISON CORPORATION	283	62.82	17,778.06
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	333	26.69	8,887.77
BALL CORPORATION	381	70.85	26,993.85
CELANESE CORP-SERIES A	477	65.04	31,024.08
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	705	40.07	28,249.35
CROWN HOLDINGS INC	408	48.98	19,983.84
DOW CHEMICAL	3,141	51.29	161,101.89
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	2,543	67.92	172,720.56
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	434	66.70	28,947.80
ECOLAB INC	742	113.64	84,320.88
FMC CORPORATION	414	37.06	15,342.84
FREEMONT-MCMORAN INC	3,229	6.46	20,859.34
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	252	116.32	29,312.64
INTERNATIONAL PAPER CO	1,174	37.57	44,107.18
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	1,130	85.72	96,863.60
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	166	142.62	23,674.92
MONSANTO CO	1,338	93.75	125,437.50
NEWMONT MINING CORP	1,504	18.35	27,598.40
NUCOR CORP	893	40.14	35,845.02
PACKAGING CORPORATION OF AMERICA	288	63.79	18,371.52
PPG INDUSTRIES INC	756	97.73	73,883.88
PRAXAIR INC	800	104.72	83,776.00
SEALED AIR CORPORATION	623	42.17	26,271.91
THE MOSAIC COMPANY	995	28.70	28,556.50
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	221	263.34	58,198.14
VULCAN MATERIALS CO	409	94.69	38,728.21
WESTLAKE CHEMICAL CORPORATION	145	52.86	7,664.70
WESTROCK COMPANY	734	44.15	32,406.10
3M CO	1,745	157.63	275,064.35
ACUITY BRANDS INC	125	232.97	29,121.25

AERCAP HOLDINGS NV	248	39.52	9,800.96
AGCO CORPORATION	232	49.42	11,465.44
AMETEK INC	679	53.42	36,272.18
B/E AEROSPACE INC	366	41.10	15,042.60
BOEING CO	1,804	143.00	257,972.00
CATERPILLAR INC	1,642	66.12	108,569.04
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	303	38.40	11,635.20
CUMMINS INC	499	86.83	43,328.17
DANAHER CORP	1,723	93.37	160,876.51
DEERE & CO	871	78.94	68,756.74
DOVER CORP	437	62.05	27,115.85
EATON CORPORATION PLC	1,306	50.38	65,796.28
EMERSON ELECTRIC CO	1,878	44.99	84,491.22
FASTENAL CO	770	39.90	30,723.00
FLOWERVE CORPORATION	424	41.40	17,553.60
FLUOR CORP	485	44.95	21,800.75
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	465	55.64	25,872.60
GENERAL DYNAMICS CORP	785	139.19	109,264.15
GENERAL ELECTRIC CO(US)	26,369	30.26	797,925.94
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,086	98.98	206,472.28
ILLINOIS TOOL WORKS	930	92.89	86,387.70
INGERSOLL-RAND PLC	776	54.16	42,028.16
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	376	41.70	15,679.20
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	224	119.51	26,770.24
LOCKHEED MARTIN CORP	781	216.58	169,148.98
MASCO CORP	1,033	29.22	30,184.26
NORTHROP GRUMMAN CORP	517	187.07	96,715.19
PACCAR INC	1,029	47.51	48,887.79
PARKER HANNIFIN CORP	414	95.49	39,532.86
PENTAIR PLC	503	52.25	26,281.75
PRECISION CASTPARTS CORP	388	231.78	89,930.64
QUANTA SERVICES INC	605	19.84	12,003.20
RAYTHEON COMPANY	848	126.32	107,119.36
ROCKWELL AUTOMATION INC	378	103.34	39,062.52
ROCKWELL COLLINS INC.	372	89.43	33,267.96
ROPER TECHNOLOGIES INC	282	184.12	51,921.84
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	498	43.57	21,697.86
SNAP-ON INC	170	168.34	28,617.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	462	108.73	50,233.26
TEXTRON INC	858	41.25	35,392.50
TRANSDIGM GROUP INC	155	218.08	33,802.40
UNITED RENTALS INC	256	66.13	16,929.28

UNITED TECHNOLOGIES CORP	2,395	93.03	222,806.85
WABCO HOLDINGS INC	159	96.80	15,391.20
WABTEC CORPORATION	299	69.21	20,693.79
WW GRAINGER INC	169	194.13	32,807.97
XYLEM INC	565	36.64	20,701.60
CINTAS CORPORATION	262	89.91	23,556.42
DUN & BRADSTREET CORP	112	101.86	11,408.32
EQUIFAX INC	330	108.40	35,772.00
IHS INC-CLASS A	212	114.08	24,184.96
MANPOWER GROUP	229	82.37	18,862.73
NIELSEN HOLDINGS PLC	977	44.78	43,750.06
REPUBLIC SERVICES INC	725	43.07	31,225.75
ROBERT HALF INTL INC	423	45.99	19,453.77
STERICYCLE INC	264	117.09	30,911.76
THE ADT CORPORATION	573	33.20	19,023.60
TOWERS WATSON & COMPANY-CL A	217	130.50	28,318.50
TYCO INTERNATIONAL PLC	1,178	31.77	37,425.06
VERISK ANALYTICS INC	500	76.13	38,065.00
WASTE MANAGEMENT INC	1,264	51.83	65,513.12
AMERCO	22	392.54	8,635.88
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	512	41.77	21,386.24
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	410	61.68	25,288.80
CSX CORP	2,880	25.29	72,835.20
DELTA AIR LINES INC	573	50.18	28,753.14
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	600	46.75	28,050.00
FEDEX CORP	757	143.69	108,773.33
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	1,115	13.84	15,431.60
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	291	73.56	21,405.96
KANSAS CITY SOUTHERN	343	74.08	25,409.44
NORFOLK SOUTHERN CORP	842	89.35	75,232.70
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	469	43.77	20,528.13
UNION PACIFIC CORP	2,469	76.88	189,816.72
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	287	57.30	16,445.10
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,971	97.87	192,901.77
AUTOLIV INC	246	122.56	30,149.76
BORGWARNER INC	707	39.97	28,258.79
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	794	82.15	65,227.10
FORD MOTOR CO	10,422	13.62	141,947.64
GENERAL MOTORS CO	4,064	34.39	139,760.96
HARLEY-DAVIDSON INC	585	45.53	26,635.05
JOHNSON CONTROLS INC	1,840	39.67	72,992.80
LEAR CORPORATION	224	120.00	26,880.00



TESLA MOTORS INC	279	218.58	60,983.82
THE GOODYEAR TIRE & RUBBER COMPANY	787	31.78	25,010.86
COACH INC	856	31.09	26,613.04
DR HORTON INC	927	31.15	28,876.05
GARMIN LIMITED	374	34.80	13,015.20
HANESBRANDS INC	1,240	29.38	36,431.20
HARMAN INTERNATIONAL	200	90.02	18,004.00
HASBRO INC	315	69.19	21,794.85
JARDEN CORPORATION	568	54.09	30,723.12
LEGGETT & PLATT INC	409	43.08	17,619.72
LENNAR CORPORATION-CLASS A	508	48.61	24,693.88
LULULEMON ATHLETICA INC	334	47.79	15,961.86
MATTEL INC	977	27.07	26,447.39
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	558	40.15	22,403.70
MOHAWK INDUSTRIES INC	193	191.76	37,009.68
NEWELL RUBBERMAID INC	748	42.15	31,528.20
NIKE INC -CL B	1,917	127.86	245,107.62
POLARIS INDUSTRIES INC	196	93.38	18,302.48
PULTEGROUP INC	962	17.18	16,527.16
PVH CORPORATION	256	76.21	19,509.76
RALPH LAUREN CORPORATION	191	113.04	21,590.64
TOLL BROTHERS INC	479	33.11	15,859.69
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	504	83.16	41,912.64
VF CORP	955	62.43	59,620.65
WHIRLPOOL CORP	242	144.03	34,855.26
ARAMARK	583	32.58	18,994.14
CARNIVAL CORP(US)	1,167	50.79	59,271.93
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	87	558.16	48,559.92
DARDEN RESTAURANTS INC	329	58.59	19,276.11
H&R BLOCK INC	659	32.82	21,628.38
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	1,450	21.28	30,856.00
LAS VEGAS SANDS CORP	1,122	40.42	45,351.24
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	647	66.43	42,980.21
MCDONALD'S CORP	2,631	116.26	305,880.06
MELCO CROWN ENTERTAINMENT LTD-ADR	266	15.20	4,043.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,287	20.81	26,782.47
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	403	59.46	23,962.38
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	494	92.27	45,581.38
STARBUCKS CORP	4,147	59.92	248,488.24
STARWOOD HOTELS & RESORTS	501	67.63	33,882.63
WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	383	73.04	27,974.32
WYNN RESORTS LTD	254	62.77	15,943.58

YUM! BRANDS INC	1,205	71.65	86,338.25
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	559	29.75	16,630.25
CBS CORP-CLASS B	1,242	46.34	57,554.28
CHARTER COMMUNICATION INC-A	238	174.81	41,604.78
COMCAST CORP-CL A	6,994	57.37	401,245.78
DISCOVERY COMMUNICATIONS -C	848	25.35	21,496.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC -A	450	26.45	11,902.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	691	57.59	39,794.69
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	1,160	22.47	26,065.20
LIBERTY GLOBAL PLC-A	770	39.77	30,626.75
LIBERTY GLOBAL PLC-C	1,709	38.38	65,591.42
LIBERTY MEDIA CORPORATION	276	38.09	10,512.84
LIBERTY MEDIA CORPORATION-C	573	36.87	21,126.51
NEWS CORPRATION-CLASS A	1,325	13.26	17,569.50
OMNICOM GROUP	717	74.09	53,122.53
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	240	53.32	12,796.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	7,183	4.00	28,732.00
TEGNA INC	632	25.38	16,040.16
THE WALT DISNEY CO.	4,480	109.35	489,888.00
TIME WARNER CABLE INC	813	178.81	145,372.53
TIME WARNER INC	2,317	64.26	148,890.42
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	3,537	27.25	96,383.25
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	1,227	28.00	34,356.00
VIACOM INC-CLASS B	974	40.74	39,680.76
ADVANCE AUTO PARTS INC	227	147.61	33,507.47
AMAZON.COM INC	1,112	657.91	731,595.92
AUTONATION INC	255	61.11	15,583.05
AUTOZONE INC	86	760.50	65,403.00
BED BATH & BEYOND INC	481	52.20	25,108.20
BEST BUY CO INC	1,000	29.90	29,900.00
CARMAX INC	588	57.86	34,021.68
DICK'S SPORTING GOODS INC	278	36.71	10,205.38
DOLLAR GENERAL CORPORATION	823	71.01	58,441.23
DOLLAR TREE INC	626	77.71	48,646.46
EXPEDIA INC	318	124.30	39,527.40
FOOT LOCKER INC	418	66.03	27,600.54
GAMESTOP CORP-CLASS A	301	30.27	9,111.27
GAP INC/THE	708	25.73	18,216.84
GENUINE PARTS CO	424	86.15	36,527.60
HOME DEPOT INC	3,588	132.01	473,651.88
KOHL'S CORP	591	46.76	27,635.16
L BRANDS INC	698	97.21	67,852.58

LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	1,389	26.69	37,072.41
LKQ CORPORATION	969	28.45	27,568.05
LOWE'S COS INC	2,585	75.65	195,555.25
MACY'S INC	1,002	36.37	36,442.74
NETFLIX INC	1,133	120.67	136,719.11
NORDSTROM INC	443	54.76	24,258.68
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	278	251.73	69,980.94
PRICELINE GROUP INC/THE	142	1,297.88	184,298.96
ROSS STORES INC	1,224	54.41	66,597.84
SIGNET JEWELERS LTD	237	116.79	27,679.23
STAPLES INC	1,905	9.40	17,907.00
TARGET CORP	1,704	72.72	123,914.88
TIFFANY & CO	402	73.98	29,739.96
TJX COMPANIES INC	1,912	70.93	135,618.16
TRACTOR SUPPLY COMPANY	422	88.22	37,228.84
TRIPADVISOR INC	337	83.80	28,240.60
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	190	185.54	35,252.60
COSTCO WHOLESALE CORP	1,236	161.84	200,034.24
CVS HEALTH CORPORATION	3,114	94.11	293,058.54
KROGER CO	2,708	41.86	113,356.88
RITE AID CORPORATION	2,901	7.76	22,511.76
SYSCO CORP	1,715	41.21	70,675.15
WAL-MART STORES INC	4,531	60.39	273,627.09
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,452	82.56	202,437.12
WHOLE FOODS MARKET INC	1,118	33.34	37,274.12
ALTRIA GROUP INC	5,525	57.52	317,798.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,743	34.18	59,575.74
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	337	101.01	34,040.37
BUNGE LIMITED	429	61.81	26,516.49
CAMPBELL SOUP COMPANY	526	53.25	28,009.50
COCA-COLA CO/THE	11,634	42.45	493,863.30
COCA-COLA ENTERPRISES INC	622	49.73	30,932.06
CONAGRA FOODS INC	1,200	39.29	47,148.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	481	137.69	66,228.89
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	539	91.83	49,496.37
GENERAL MILLS INC	1,675	58.43	97,870.25
HERSHEY CO/THE	423	89.91	38,031.93
HORMEL FOODS CORPORATION	408	77.98	31,815.84
KELLOGG COMPANY	773	71.08	54,944.84
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	378	89.27	33,744.06
KRAFT HEINZ CO/THE	1,715	70.97	121,722.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	325	84.59	27,491.75

MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	585	77.40	45,279.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	427	91.91	39,245.57
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	4,570	43.32	197,972.40
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	402	151.91	61,067.82
PEPSICO INC	4,104	97.95	401,986.80
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	4,352	87.16	379,320.32
REYNOLDS AMERICAN INC	2,412	45.04	108,636.48
THE JM SMUCKER COMPANY	316	120.17	37,973.72
TYSON FOODS INC-CL A	850	52.71	44,803.50
WHITEWAVE FOODS COMPANY	521	36.56	19,047.76
CHURCH & DWIGHT CO INC	366	83.99	30,740.34
CLOROX COMPANY	359	126.47	45,402.73
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,414	65.85	158,961.90
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	193	75.94	14,656.42
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	670	85.55	57,318.50
KIMBERLY-CLARK CORP	1,023	122.65	125,470.95
PROCTER & GAMBLE CO	7,622	78.29	596,726.38
ABBOTT LABORATORIES	4,183	44.81	187,440.23
AETNA INC	981	105.80	103,789.80
AMERISOURCEBERGEN CORP	608	102.53	62,338.24
ANTHEM INC	743	135.53	100,698.79
BARD (C.R.) INC	209	186.36	38,949.24
BAXTER INTERNATIONAL INC.	1,579	36.53	57,680.87
BECTON DICKINSON & CO	614	153.19	94,058.66
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,767	18.39	69,275.13
CARDINAL HEALTH INC	915	86.52	79,165.80
CENTENE CORPORATION	335	56.80	19,028.00
CERNER CORPORATION	870	59.94	52,147.80
CIGNA CORP	723	140.69	101,718.87
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	534	68.07	36,349.38
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	417	59.68	24,886.56
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	604	80.53	48,640.12
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	537	24.05	12,914.85
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	1,888	85.82	162,028.16
HCA HOLDINGS INC	931	65.46	60,943.26
HENRY SCHEIN INC	233	153.80	35,835.40
HOLOGIC INC	671	37.49	25,155.79
HUMANA INC	437	174.89	76,426.93
IMS HEALTH HOLDINGS INC	459	25.62	11,759.58
INTUITIVE SURGICAL INC	104	528.75	54,990.00
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	300	119.68	35,904.00
MCKESSON CORP	651	190.58	124,067.58

MEDNAX INC	262	69.97	18,332.14
MEDTRONIC PLC	3,979	76.65	304,990.35
PATTERSON COMPANIES INC	259	43.56	11,282.04
QUEST DIAGNOSTICS	401	67.46	27,051.46
RESMED INC	433	55.66	24,100.78
ST JUDE MEDICAL INC	824	60.25	49,646.00
STRYKER CORP	957	91.41	87,479.37
THE COOPER COS INC	150	134.82	20,223.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,674	115.85	309,782.90
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	285	116.16	33,105.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	311	77.90	24,226.90
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	483	99.49	48,053.67
ABBVIE INC	4,625	55.44	256,410.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	971	40.25	39,082.75
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	630	187.79	118,307.70
ALKERMES PLC	454	71.63	32,520.02
ALLERGAN PLC	1,103	303.02	334,231.06
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	221	88.33	19,520.93
AMGEN INC	2,136	158.11	337,722.96
BAXALTA INC	1,579	38.16	60,254.64
BIOGEN INC	661	282.39	186,659.79
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	450	94.23	42,403.50
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,684	68.64	321,509.76
CELGENE CORP	2,228	110.26	245,659.28
ELI LILLY & CO	2,809	84.68	237,866.12
ENDO INTERNATIONAL PLC	549	57.43	31,529.07
GILEAD SCIENCES INC	4,129	100.49	414,923.21
ILLUMINA INC	405	174.66	70,737.30
INCYTE CORP	454	109.41	49,672.14
ISIS PHARMACEUTICALS INC	367	53.05	19,469.35
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	177	135.21	23,932.17
JOHNSON & JOHNSON	7,737	102.15	790,334.55
MALLINCKRODT PLC	361	69.22	24,988.42
MEDIVATION INC	482	40.28	19,414.96
MERCK & CO. INC.	7,938	52.20	414,363.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	77	334.45	25,752.65
MYLAN NV	1,167	53.37	62,282.79
PERRIGO CO PLC	406	148.99	60,489.94
PFIZER INC	17,301	32.18	556,746.18
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	267	68.14	18,193.38
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	213	539.94	115,007.22
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,118	135.41	151,388.38

UNITED THERAPEUTICS CORPORATION	135	152.49	20,586.15
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	685	115.70	79,254.50
WATERS CORP	259	129.68	33,587.12
ZOETIS INC	1,324	46.59	61,685.16
BANK OF AMERICA CORPORATION	29,164	16.80	489,955.20
BB&T CORPORATION	2,115	36.91	78,064.65
CIT GROUP INC	569	40.19	22,868.11
CITIGROUP INC	8,409	51.10	429,699.90
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	1,474	25.72	37,911.28
COMERICA INC	526	41.21	21,676.46
FIFTH THIRD BANCORP	2,276	19.85	45,178.60
FIRST REPUBLIC BANK/CA	408	65.80	26,846.40
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,272	10.84	24,628.48
JPMORGAN CHASE & CO	10,332	64.27	664,037.64
KEYCORP	2,498	12.70	31,724.60
M & T BANK CORP	402	120.87	48,589.74
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	1,457	16.37	23,851.09
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	1,060	15.99	16,949.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,455	92.77	134,980.35
REGIONS FINANCIAL CORP	3,927	9.36	36,756.72
SIGNATURE BANK	142	151.13	21,460.46
SUNTRUST BANKS INC	1,450	41.99	60,885.50
US BANCORP	4,982	42.43	211,386.26
WELLS FARGO & COMPANY	13,625	53.20	724,850.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	173	144.01	24,913.73
ALLY FINANCIAL INC	1,200	18.47	22,164.00
AMERICAN EXPRESS CO	2,569	68.83	176,824.27
AMERIPRISE FINANCIAL INC	532	104.96	55,838.72
BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	3,151	40.39	127,268.89
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,311	132.02	437,118.22
BLACKROCK INC	347	319.60	110,901.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,535	73.31	112,530.85
CME GROUP INC	896	94.69	84,842.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,216	52.55	63,900.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	846	29.01	24,542.46
EATON VANCE CORPORATION	429	31.24	13,401.96
FRANKLIN RESOURCES INC	1,131	35.12	39,720.72
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,092	176.40	192,628.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	309	245.58	75,884.22
INVESCO LIMITED	1,210	30.39	36,771.90
LEGG MASON INC	296	38.12	11,283.52
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	1,100	16.08	17,688.00

MCGRAW HILL FINANCIAL INC	801	94.41	75,622.41
MOODY'S CORP	531	96.78	51,390.18
MORGAN STANLEY	4,151	31.88	132,333.88
NASDAQ INC	347	56.08	19,459.76
NAVIENT CORPORATION	1,179	12.16	14,336.64
NORTHERN TRUST CORP	623	70.03	43,628.69
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	396	56.32	22,302.72
SEI INVESTMENTS COMPANY	397	51.05	20,266.85
STATE STREET CORP	1,157	65.73	76,049.61
SYNCHRONY FINANCIAL	2,330	29.68	69,154.40
T ROWE PRICE GROUP INC	732	70.04	51,269.28
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	845	34.29	28,975.05
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	3,321	32.25	107,102.25
VOYA FINANCIAL INC	639	36.83	23,534.37
ACE LIMITED	918	114.10	104,743.80
AFLAC INC	1,219	59.54	72,579.26
ALLEGHANY CORPORATION	50	478.52	23,926.00
ALLSTATE CORP	1,119	61.39	68,695.41
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,615	58.42	211,188.30
AON PLC	792	94.08	74,511.36
ARCH CAPITAL GROUP LTD	342	69.83	23,881.86
ARTHUR J GALLAGHER & CO	477	42.79	20,410.83
ASSURANT INC	218	81.43	17,751.74
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	350	56.33	19,715.50
CHUBB CORP	634	130.54	82,762.36
CINCINNATI FINANCIAL CORP	483	58.98	28,487.34
EVEREST RE GROUP LTD	141	184.18	25,969.38
FNF GROUP	777	33.35	25,912.95
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,230	43.22	53,160.60
LINCOLN NATIONAL CORP	753	50.37	37,928.61
LOEWS CORPORATION	876	36.77	32,210.52
MARKEL CORPORATION	39	886.10	34,557.90
MARSH & MCLENNAN COS	1,481	54.97	81,410.57
METLIFE INC	2,665	46.42	123,709.30
PARTNERRE LTD	137	139.00	19,043.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	828	44.99	37,251.72
PROGRESSIVE CORP	1,735	30.77	53,385.95
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,273	80.69	102,718.37
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	120	110.62	13,274.40
TORCHMARK CORPORATION	400	57.28	22,912.00
TRAVELERS COS INC/THE	895	111.03	99,371.85
UNUM GROUP	701	33.30	23,343.30

WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	495	45.59	22,567.05
WR BERKLEY CORP	295	54.40	16,048.00
XL GROUP PLC	802	37.69	30,227.38
CBRE GROUP INC	872	34.69	30,249.68
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,643	6.88	11,303.84
JONES LANG LASALLE INCORPORATED	130	157.55	20,481.50
REALOGY HOLDINGS CORPORATION	500	37.53	18,765.00
ACCENTURE PLC	1,760	106.36	187,193.60
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,492	37.96	56,636.32
ADOBE SYSTEMS INC	1,406	93.26	131,123.56
AKAMAI TECHNOLOGIES	519	51.08	26,510.52
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	184	269.99	49,678.16
ALPHABET INC-CL A	810	762.54	617,657.40
ALPHABET INC-CL C	866	747.77	647,568.82
ANSYS INC	286	90.11	25,771.46
AUTODESK INC	632	60.74	38,387.68
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,319	84.60	111,587.40
CA INC	1,037	27.74	28,766.38
CDK GLOBAL INC	398	46.47	18,495.06
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	189	85.24	16,110.36
CITRIX SYSTEMS INC	500	75.46	37,730.00
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	1,715	59.76	102,488.40
EBAY INC	3,072	28.03	86,123.52
ELECTRONIC ARTS INC	884	69.66	61,579.44
FACEBOOK INC-A	6,003	104.66	628,273.98
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	796	61.11	48,643.56
FIREEYE INC	296	20.55	6,082.80
FISERV INC	655	93.43	61,196.65
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	242	139.31	33,713.02
FORTINET INC	406	30.42	12,350.52
GARTNER INC	259	88.46	22,911.14
GLOBAL PAYMENTS INC	360	70.33	25,318.80
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	2,628	135.93	357,224.04
INTUIT INC	769	96.30	74,054.70
LINKEDIN CORPORATION-A	310	231.99	71,916.90
MASTERCARD INC. -CLASS A	2,822	96.30	271,758.60
MICROSOFT CORP	21,228	55.14	1,170,511.92
MOBILEYE NV	227	41.70	9,465.90
NETSUITE INC	107	79.28	8,482.96
NUANCE COMMUNICATIONS INC	692	20.06	13,881.52
ORACLE CORPORATION	9,692	37.65	364,903.80
PAYCHEX INC	918	52.78	48,452.04



PAYPAL HOLDINGS INC	3,060	35.01	107,130.60
RED HAT INC	515	77.49	39,907.35
SABRE CORPORATION	498	27.92	13,904.16
SALESFORCE COM INC	1,725	76.99	132,807.75
SERVICENOW INC	460	83.57	38,442.20
SPLUNK INC	379	52.40	19,859.60
SYMANTEC CORP	2,026	19.54	39,588.04
SYNOPSYS INC	484	45.43	21,988.12
TABLEAU SOFTWARE INC	140	88.24	12,353.60
TERADATA CORPORATION	426	26.88	11,450.88
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	520	54.89	28,542.80
TWITTER INC	1,606	24.92	40,021.52
VANTIV INC-CLASS A	461	50.36	23,215.96
VERISIGN INC	285	88.86	25,325.10
VISA INC-CLASS A SHARES	5,500	76.87	422,785.00
VMWARE INC-CLASS A	242	57.25	13,854.50
WESTERN UNION COMPANY	1,498	18.14	27,173.72
WORKDAY INC-CLASS A	310	79.00	24,490.00
XEROX CORPORATION	2,942	9.86	29,008.12
YAHOO! INC	2,603	32.59	84,831.77
ZILLOW GROUP INC-C	280	23.55	6,594.00
AMPHENOL CORPORATION-CL A	868	52.83	45,856.44
APPLE INC	15,933	112.48	1,792,143.84
ARROW ELECTRONICS INC	301	54.71	16,467.71
AVNET INC	404	43.78	17,687.12
CDR CORPORATION	403	42.68	17,200.04
CISCO SYSTEMS INC	14,289	26.49	378,515.61
CORNING INC	3,425	18.07	61,889.75
EMC CORP/MASSACHUSETTS	5,456	25.75	140,492.00
F5 NETWORKS INC	229	96.31	22,054.99
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	1,583	10.83	17,143.89
FLIR SYSTEMS INC	473	28.53	13,494.69
HARRIS CORPORATION	325	81.91	26,620.75
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE COMPANY	5,107	14.44	73,745.08
HEWLETT-PACKARD COMPANY	5,107	12.16	62,101.12
JUNIPER NETWORKS INC	998	28.77	28,712.46
MOTOROLA SOLUTIONS INC	444	68.14	30,254.16
NETAPP INC	969	28.67	27,781.23
PALO ALTO NETWORKS INC	213	183.69	39,125.97
QUALCOMM INC	4,390	46.83	205,583.70
SANDISK CORP	584	75.33	43,992.72
SEAGATE TECHNOLOGY	892	33.67	30,033.64

TE CONNECTIVITY LIMITED	1,124	62.67	70,441.08
TRIMBLE NAVIGATION LIMITED	886	21.81	19,323.66
WESTERN DIGITAL CORPORATION	686	59.37	40,731.25
AT&T INC	17,272	33.60	580,339.20
CENTURYLINK INC	1,584	24.38	38,617.92
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	3,419	4.50	15,385.50
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	868	50.47	43,807.96
SBA COMMUNICATIONS CORPORATION-CL A	364	101.76	37,040.64
SPRINT CORPORATION	2,709	3.52	9,535.68
T-MOBILE US INC	750	36.52	27,390.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	11,359	45.45	516,266.55
AES CORP	2,257	8.83	19,929.31
AGL RESOURCES INC	335	63.00	21,105.00
ALLIANT ENERGY CORP	369	58.79	21,693.51
AMEREN CORPORATION	754	41.80	31,517.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,371	54.54	74,774.34
AMERICAN WATER WORKS CO INC	523	56.72	29,664.56
CALPINE CORPORATION	1,200	11.80	14,160.00
CENTERPOINT ENERGY INC	1,148	16.54	18,987.92
CMS ENERGY CORPORATION	858	35.03	30,055.74
CONSOLIDATED EDISON INC	823	62.04	51,058.92
DOMINION RESOURCES INC/VA	1,700	65.40	111,180.00
DTE ENERGY COMPANY	550	78.47	43,158.50
DUKE ENERGY CORPORATION	1,943	68.45	132,998.35
EDISON INTERNATIONAL	962	59.31	57,056.22
ENERGY CORP	504	65.44	32,981.76
EVERSOURCE ENERGY	892	49.19	43,877.48
EXELON CORP	2,509	25.46	63,879.14
FIRSTENERGY CORP	1,308	30.98	40,521.84
NEXTERA ENERGY INC	1,248	97.98	122,279.04
NRG ENERGY INC	989	9.20	9,098.80
OGE ENERGY CORPORATION	703	24.75	17,399.25
P G & E CORPORATION	1,349	52.28	70,525.72
PEPCO HOLDINGS INC	783	26.35	20,632.05
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	365	61.45	22,429.25
PPL CORPORATION	1,874	32.77	61,410.98
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	1,472	37.46	55,141.12
SCANA CORPORATION	421	58.51	24,632.71
SEMPRA ENERGY	661	91.90	60,745.90
SOUTHERN CO	2,552	44.95	114,712.40
WEC ENERGY GROUP INC	887	49.54	43,941.98
XCEL ENERGY INC	1,480	35.29	52,229.20

	ALTERA CORPORATION	881	52.99	46,684.19
	ANALOG DEVICES INC	881	56.82	50,058.42
	APPLIED MATERIALS INC	3,460	18.05	62,453.00
	AVAGO TECHNOLOGIES LIMITED	729	142.51	103,889.79
	BROADCOM CORP-CL A	1,554	57.05	88,655.70
	INTEL CORP	13,329	34.47	459,450.63
	KLA-TENCOR CORPORATION	490	67.63	33,138.70
	LAM RESEARCH CORP	494	77.56	38,314.64
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	741	43.53	32,255.73
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,274	8.04	10,242.96
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	842	38.06	32,046.52
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	600	44.61	26,766.00
	MICRON TECHNOLOGY INC	3,039	13.66	41,512.74
	NVIDIA CORP	1,512	32.57	49,245.84
	NXP SEMICONDUCTORS NV	447	83.44	37,297.68
	QORVO INC	457	52.48	23,983.36
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	537	78.50	42,157.18
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,923	56.22	164,331.06
	XILINX INC	723	47.30	34,201.51
	米ドル 建小計	903,293		51,679,716.80 (6,261,514,487)
カナダドル	ALTAGAS LIMITED	479	29.33	14,049.07
	ARC RESOURCES LIMITED	1,119	15.97	17,870.43
	CAMECO CORP (CA)	1,372	15.52	21,293.44
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,195	28.82	92,079.90
	CANADIAN OIL SANDS LIMITED	1,728	8.02	13,858.56
	CENOVUS ENERGY INC	2,296	17.23	39,560.08
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,193	14.99	17,883.07
	ENBRIDGE INC	2,485	41.09	102,108.65
	ENCANA CORP	2,496	7.63	19,044.48
	HUSKY ENERGY INC	1,200	14.25	17,100.00
	IMPERIAL OIL LTD	997	40.90	40,777.30
	INTER PIPELINE LIMITED	1,090	20.75	22,617.50
	KEYERA CORP	510	37.53	19,140.30
	MEG ENERGY CORPORATION	585	8.67	5,071.95
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	1,067	28.66	30,580.22
	PEYTO EXPLORATION & DEVELOPMENT CORP	500	22.07	11,035.00
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	500	21.60	10,800.00
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	500	13.63	6,815.00
	SUNCOR ENERGY INC	4,227	34.55	146,042.85
	TOURMALINE OIL CORPORATION	600	21.33	12,798.00
	TRANSCANADA CORPORATION	2,062	46.37	95,614.94

VERESEN INC	800	8.69	6,952.00
VERMILION ENERGY INC	354	33.81	11,968.74
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	731	36.52	26,696.12
AGRIUM INC	424	127.74	54,161.76
BARRICK GOLD CORP	3,416	9.69	33,101.04
CCL INDUSTRIES INC - CL B	100	224.90	22,490.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	2,400	4.01	9,624.00
FIRST QUANTUM MINERALS LIMITED	2,000	3.93	7,860.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	521	63.17	32,911.57
GOLDCORP INC	2,534	15.24	38,618.16
KINROSS GOLD CORP	3,830	2.58	9,881.40
METHANEX CORPORATION	234	44.61	10,438.74
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	2,594	23.02	59,713.88
SILVER WHEATON CORPORATION	1,209	17.35	20,976.15
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	1,897	4.57	8,669.29
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	2,700	3.26	8,802.00
WEST FRASER TIMBER CO LIMITED	200	49.62	9,924.00
YAMANA GOLD INC	3,000	2.67	8,010.00
BOMBARDIER INC 'B'	4,812	1.15	5,533.80
CAE INC	904	14.93	13,496.72
FINNING INTERNATIONAL INC	637	17.60	11,211.20
SNC-LAVALIN GROUP INC	441	40.78	17,983.98
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,306	74.08	170,828.48
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	441	169.08	74,564.28
LINAMAR CORPORATION	100	71.69	7,169.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,210	56.73	68,643.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	642	39.90	25,615.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	600	48.15	28,890.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,191	26.34	31,370.94
THOMSON REUTERS CORP(CA)	1,033	52.82	54,563.06
CANADIAN TIRE CORP -CL A	226	119.88	27,092.88
DOLLARAMA INC	300	80.00	24,000.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,215	62.28	75,670.20
EMPIRE COMPANY LIMITED A	450	25.05	11,272.50
GEORGE WESTON LIMITED	100	105.00	10,500.00
JEAN COUTU GROUP INC A	300	17.59	5,277.00
LOBLAW COMPANIES LTD	713	65.32	46,573.16
METRO INC	813	38.55	31,341.15
SAPUTO INC	700	31.91	22,337.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	884	129.24	114,248.16
BANK OF MONTREAL	1,907	77.02	146,877.14
BANK OF NOVA SCOTIA	3,493	55.66	194,420.38

	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,092	92.16	100,638.72	
	NATIONAL BANK OF CANADA	900	39.97	35,973.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	4,333	72.45	313,925.85	
	TORONTO-DOMINION BANK(CA)	5,262	53.25	280,201.50	
	CI FINANCIAL CORPORATION	783	30.02	23,505.66	
	ELEMENT FINANCIAL CORPORATION	1,100	15.81	17,391.00	
	IGM FINANCIAL INC	393	34.97	13,743.21	
	ONEX CORPORATION	200	81.71	16,342.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	88	630.50	55,484.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	1,000	33.96	33,960.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	442	43.01	19,010.42	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	400	88.85	35,540.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	5,660	20.36	115,237.60	
	POWER CORP OF CANADA	1,129	28.58	32,266.82	
	POWER FINANCIAL CORP	673	31.84	21,428.32	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,850	42.76	79,106.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,602	43.04	111,990.08	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	400	18.52	7,408.00	
	CGI GROUP INC -CL A	577	56.45	32,571.65	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	100	581.01	58,101.00	
	OPEN TEXT CORPORATION	389	64.00	24,896.00	
	BLACKBERRY LIMITED	1,700	10.39	17,663.00	
	BCE INC	436	54.58	23,796.88	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	983	49.21	48,373.43	
	TELUS CORPORATION	44	39.82	1,752.08	
	ATCO LIMITED	294	33.35	9,804.90	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	328	29.87	9,797.36	
	FORTIS INC	800	36.17	28,936.00	
	カナダドル 建小計	118,521		3,925,264.20 (346,600,828)	
ユーロ	ENI SPA	6,888	13.24	91,197.12	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,261	9.55	12,042.55	
	KONINKLIJKE VOPAK NV	230	35.05	8,061.50	
	NESTE OYJ	420	26.09	10,957.80	
	OMV AG	482	24.36	11,741.52	
	REPSOL SA	2,983	10.24	30,560.83	
	SAIPEM	866	7.32	6,343.45	
	TECHNIP S.A.	335	45.24	15,157.07	
	TENARIS SA	1,544	10.60	16,366.40	
	TOTAL SA	5,883	40.58	238,732.14	
	AIR LIQUIDE SA	931	102.05	95,008.55	
	AKZO NOBEL	670	60.43	40,488.10	

ARCELORMITTAL	2,882	3.37	9,712.34
ARKEMA	214	61.24	13,105.36
BASF SE	2,487	68.01	169,140.87
CRH PLC(IE)	2,530	25.68	64,983.05
EVONIK INDUSTRIES AG	393	29.12	11,444.16
FUCHS PETROLUB SE-PREF	228	41.64	9,493.92
HEIDELBERGCEMENT AG	397	70.05	27,809.85
IMERYS SA	113	59.49	6,722.37
K+S AG	564	23.25	13,113.00
KONINKLIJKE DSM NV	564	44.14	24,897.78
LANXESS AG	300	42.01	12,603.00
LINDE AG	523	128.05	66,970.15
OCI NV	248	21.71	5,385.32
SOLVAY SA	194	91.91	17,830.54
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	1,799	8.09	14,553.91
SYMRISE AG	334	59.40	19,839.60
THYSSENKRUPP AG	1,079	16.82	18,154.17
UMICORE	353	35.90	12,672.70
UPM-KYMMENE OYJ	1,445	16.30	23,553.50
VOESTALPINE AG	367	26.81	9,841.10
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	573	25.98	14,889.40
AIRBUS GROUP SE	1,599	61.30	98,018.70
ALSTOM	708	27.13	19,208.04
ANDRITZ AG	238	45.45	10,818.29
BOSKALIS WESTMINSTER NV	282	36.82	10,383.24
BOUYGUES SA	549	35.16	19,305.58
BRENTAG AG	418	46.57	19,466.26
CNH INDUSTRIAL NV	3,097	6.44	19,944.68
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,396	38.08	53,159.68
FERROVIAL SA	1,362	20.60	28,057.20
FINMECCANICA SPA	1,323	12.47	16,497.81
GEA GROUP AG	495	36.00	17,820.00
KONE OYJ-B	914	38.21	34,923.94
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,579	23.34	60,206.75
LEGRAND SA	787	51.83	40,790.21
MAN SE	116	90.97	10,552.52
METSO OYJ	369	20.24	7,468.56
OSRAM LICHT AG	291	38.50	11,203.50
PRYSMIAN SPA	667	19.15	12,773.05
REXEL SA	912	11.58	10,560.96
SAFRAN SA	822	60.89	50,051.58
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,563	52.42	81,932.46

SIEMENS AG-REG	2,147	86.25	185,178.75
THALES SA	305	67.23	20,505.15
VINCI SA	1,295	57.16	74,022.20
WARTSILA OYJ-B SHARES	484	40.69	19,693.96
ZARDOYA OTIS SA	569	10.41	5,923.29
ZODIAC AEROSPACE	608	22.78	13,850.24
BUREAU VERITAS SA	723	17.97	12,995.92
ELENRED	674	16.39	11,050.23
RANDSTAD HOLDING NV	347	54.70	18,980.90
SOCIETE BIC SA	94	149.50	14,053.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,322	13.42	17,747.85
AENA SA	186	105.10	19,548.60
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	98	103.35	10,128.30
ATLANTIA SPA	1,162	23.69	27,527.78
BOLLORE	2,530	4.03	10,203.49
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	689	13.11	9,036.23
DEUTSCHE POST AG-REG	2,623	24.18	63,424.14
FRAPORT AG	121	55.97	6,772.37
GROUPE EUROTUNNEL SE	1,528	11.18	17,083.04
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	2,534	7.76	19,673.97
TNT EXPRESS NV	1,434	7.70	11,043.23
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	896	91.90	82,342.40
BMW-PFD	178	71.37	12,703.86
CONTINENTAL AG	298	211.35	62,982.30
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	2,607	72.95	190,180.65
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	2,531	11.85	29,992.35
MICHELIN (CGDE)-B	537	84.94	45,612.78
NOKIAN RENKAAT OYJ	371	32.40	12,020.40
PEUGEOT SA	1,280	15.33	19,622.40
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	442	46.67	20,628.14
RENAULT SA	551	85.50	47,110.50
VALEO SA	215	130.60	28,079.00
VOLKSWAGEN AG	97	131.70	12,774.90
VOLKSWAGEN AG-PFD	475	123.25	58,543.75
ADIDAS AG	604	85.93	51,901.72
CHRISTIAN DIOR SE	153	155.60	23,806.80
HERMES INTERNATIONAL	82	310.50	25,461.00
HUGO BOSS AG-ORD	175	74.51	13,039.25
KERING	221	153.25	33,868.25
LUXOTTICA GROUP SPA	475	58.15	27,621.25
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	757	142.20	107,645.40
ACCOR SA	565	38.04	21,492.60

SODEXO	255	88.86	22,659.30
ALTICE NV - B	296	10.19	3,016.24
ALTICE SA-A	998	10.00	9,980.00
AXEL SPRINGER SE	130	48.70	6,331.65
EUTELSAT COMMUNICATIONS	504	27.11	13,665.96
JC DECAUX SA	220	34.18	7,519.60
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	73	104.80	7,650.40
LAGARDERE S.C.A.	386	25.92	10,005.12
NUMERICABLE GROUP	302	33.15	10,011.30
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	616	46.09	28,394.52
PUBLICIS GROUPE	545	57.93	31,571.85
RELX NV	2,694	14.90	40,154.07
RTL GROUP SA	127	76.58	9,725.66
SES	994	23.93	23,791.39
TELENET GROUP HOLDING NV	172	46.04	7,918.88
VIVENDI	3,148	18.80	59,198.14
WOLTERS KLUWER NV-CVA	850	30.06	25,551.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	2,953	31.42	92,783.26
ZALANDO SE	234	34.88	8,163.09
CARREFOUR SA	1,613	26.00	41,946.06
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	185	44.91	8,309.27
COLRUYT SA	230	45.24	10,406.35
DELHAIZE GROUP	281	86.45	24,292.45
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION	2,022	5.34	10,807.59
JERONIMO MARTINS SGPS SA	823	11.49	9,460.38
KONINKLIJKE AHOLD NV	2,259	18.82	42,514.38
METRO AG	530	27.04	14,333.85
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	2,177	110.40	240,340.80
DANONE	1,631	60.95	99,409.45
HEINEKEN HOLDING NV	273	68.94	18,820.62
HEINEKEN NV	624	77.47	48,341.28
KERRY GROUP PLC-A	491	75.70	37,168.70
PERNOD-RICARD SA	598	100.45	60,069.10
REMY COINTREAU SA	80	62.38	4,990.40
BEIERSDORF AG	273	81.35	22,208.55
HENKEL AG & CO KGAA	309	82.69	25,551.21
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	482	98.06	47,264.92
L'OREAL	682	152.00	103,664.00
UNILEVER NV-CVA	4,411	38.19	168,456.09
ESSILOR INTERNATIONAL SA	556	111.80	62,160.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	592	73.86	43,725.12
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,033	61.95	63,994.35



BAYER AG	2,239	109.85	245,954.15
GRIFOLS SA	488	41.00	20,008.00
MERCK KGAA	381	85.80	32,689.80
ORION OYJ-CLASS B	327	29.97	9,800.19
QIAGEN NV	599	23.35	13,989.64
SANOFI	3,198	74.73	238,986.54
UCB SA	356	79.94	28,458.64
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	7,128	1.15	8,225.71
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	17,745	6.80	120,701.49
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-R	115,136	0.04	5,584.09
BANCO DE SABADELL SA	14,354	1.62	23,368.31
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.00	0.00
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	1,184	11.62	13,758.08
BANCO POPULAR ESPANOL SA	4,978	3.12	15,576.16
BANCO SANTANDER SA	39,139	4.44	173,972.85
BANK OF IRELAND	85,435	0.33	28,620.72
BANKIA SA	15,058	1.09	16,413.22
BANKINTER SA	2,204	6.46	14,255.47
BNP PARIBAS	2,868	50.28	144,203.04
CAIXABANK	7,399	3.40	25,208.39
COMMERZBANK AG	3,163	8.97	28,378.43
CREDIT AGRICOLE SA	3,005	10.12	30,410.60
ERSTE GROUP BANK AG	756	26.71	20,192.76
ING GROEP NV-CVA	10,477	11.92	124,885.84
INTESA SANPAOLO	34,344	2.96	101,726.92
INTESA SANPAOLO-RSP	3,048	2.70	8,235.69
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
KBC GROEP NV	742	53.69	39,837.98
NATIXIS SA	3,056	4.82	14,754.36
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	384	13.32	5,114.88
SOCIETE GENERALE	1,964	40.14	78,844.78
UNICREDIT SPA	13,465	4.91	66,140.08
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	2,800	5.88	16,464.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	3,734	20.77	77,555.18
DEUTSCHE BOERSE AG	523	73.84	38,618.32
EURAZEO	131	59.57	7,803.67
EXOR SPA	322	39.36	12,673.92
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	264	72.94	19,256.16
MEDIOBANCA SPA	1,526	8.24	12,581.87
WENDEL	104	102.50	10,660.00
AEGON NV	5,225	4.92	25,754.02
AGEAS	606	39.79	24,112.74

ALLIANZ SE-REG	1,237	155.70	192,600.90
ASSICURAZIONI GENERALI	3,161	16.44	51,966.84
AXA	5,296	24.12	127,766.00
CNP ASSURANCES	562	11.63	6,538.87
HANNOVER RUECK SE	163	103.60	16,886.80
MAPFRE SA	3,020	2.35	7,121.16
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	470	179.65	84,435.50
NN GROUP NV	560	31.28	17,516.80
SAMPO OYJ-A SHS	1,210	44.72	54,111.20
SCOR SE	502	33.50	16,817.00
UNIPOLSAI SPA	2,976	2.21	6,582.91
DEUTSCHE WOHNEN AG	936	24.04	22,506.12
VONOVIA SE	1,311	26.55	34,807.05
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	1,260	37.15	46,815.30
ATOS SE	264	76.31	20,145.84
CAP GEMINI SA	468	83.64	39,143.52
DASSAULT SYSTEMES SA	346	71.64	24,787.44
GEMALTO NV	259	52.85	13,688.15
SAP SE	2,661	69.40	184,673.40
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	403	49.08	19,779.24
ALCATEL-LUCENT	7,948	3.37	26,840.39
INGENICO GROUP	154	112.25	17,286.50
NOKIA OYJ	10,352	6.23	64,544.72
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	8,935	15.48	138,313.80
ELISA OYJ	465	33.02	15,354.30
ILIAD SA	86	209.50	18,017.00
KONINKLIJKE KPN NV	9,013	3.31	29,896.12
ORANGE	5,471	14.74	80,669.89
PROXIMUS	498	27.93	13,911.63
TELECOM ITALIA SPA	28,434	1.08	30,936.19
TELECOM ITALIA-RSP	19,696	0.88	17,332.48
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,945	4.81	9,363.23
TELEFONICA SA	12,508	10.24	128,081.92
E.ON SE	5,418	7.83	42,460.86
ELECTRICITE DE FRANCE	791	12.60	9,966.60
ENAGAS SA	664	27.23	18,080.72
ENDESA SA	986	18.71	18,452.99
ENEL GREEN POWER SPA	5,720	1.81	10,370.36
ENEL SPA	19,095	3.75	71,682.63
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	6,270	3.02	18,985.56
ENGIE	4,112	15.51	63,777.12
FORTUM OYJ	1,452	12.96	18,817.92

	GAS NATURAL SDG SA	948	19.06	18,073.62
	IBERDROLA SA	14,584	6.42	93,687.61
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	293	77.34	22,660.62
	RWE AG	1,423	10.27	14,621.32
	SNAM SPA	5,687	4.66	26,524.16
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	972	17.05	16,577.46
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	4,082	4.54	18,532.28
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,379	21.76	30,013.93
	ASML HOLDING NV	975	77.71	75,767.25
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,177	13.00	41,301.00
	STMICROELECTRONICS NV	2,084	5.90	12,297.68
	ユーロ 建小計	772,371		9,084,382.21 (1,211,311,523)
英債券	AMEC FOSTER WHEELER PLC	1,278	3.83	4,906.24
	BG GROUP PLC	8,795	9.19	80,870.02
	BP PLC	45,847	3.29	150,974.17
	PETROFAC LIMITED	856	7.64	6,539.84
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	9,822	14.18	139,325.07
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	6,118	14.28	87,365.04
	ANGLO AMERICAN PLC	3,610	2.80	10,136.88
	ANTOFAGASTA PLC	1,301	4.12	5,364.02
	BHP BILLITON PLC(UK)	5,439	6.69	36,403.22
	CRODA INTERNATIONAL PLC	350	29.33	10,265.50
	FRESNILLO PLC	729	6.65	4,847.85
	GLENCORE PLC	28,643	0.80	22,914.40
	JOHNSON MATTHEY PLC	528	25.21	13,310.88
	MONDI PLC	1,059	12.75	13,502.25
	RANDGOLD RESOURCES LIMITED	291	40.42	11,762.22
	REXAM PLC	1,768	5.92	10,475.40
	RIO TINTO PLC(UK)	3,257	18.48	60,189.36
	SOUTH32 LIMITED (GBP)	6,559	0.47	3,082.73
	ASHTED GROUP PLC	1,432	10.77	15,422.64
	BAE SYSTEMS PLC	8,149	4.83	39,392.26
	BUNZL PLC	863	18.05	15,577.15
	COBHAM PLC	3,755	2.85	10,716.77
	IMI PLC	896	8.78	7,866.88
	MEGGITT PLC	2,027	3.53	7,161.39
	MELROSE INDUSTRIES PLC	3,281	2.79	9,180.23
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,735	5.37	25,450.62
	SMITHS GROUP PLC	1,017	9.19	9,351.31
	THE WEIR GROUP PLC	704	9.59	6,754.88
	TRAVIS PERKINS PLC	641	19.26	12,345.66

WOLSELEY PLC	670	36.53	24,475.10
AGGREKO PLC	845	9.10	7,689.50
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	828	9.75	8,077.14
CAPITA PLC	1,666	11.45	19,075.70
EXPERIAN PLC	2,541	11.21	28,484.61
G4S PLC	3,996	2.11	8,447.54
INTERTEK GROUP PLC	416	26.61	11,069.76
ROYAL MAIL PLC	2,144	4.37	9,384.28
GKN PLC	4,244	2.80	11,900.17
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,887	5.95	17,177.65
BURBERRY GROUP PLC	1,298	11.19	14,524.62
PERSIMMON PLC	789	19.03	15,014.67
TAYLOR WIMPEY PLC	9,436	1.93	18,249.22
CARNIVAL PLC(UK)	474	34.35	16,281.90
COMPASS GROUP PLC	4,273	11.09	47,387.57
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	608	25.11	15,266.88
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	1,672	4.35	7,278.21
TUI AG	1,406	11.65	16,379.90
WHITBREAD PLC	468	43.62	20,414.16
WILLIAM HILL PLC	2,886	3.64	10,528.12
ITV PLC	9,864	2.61	25,784.49
PEARSON PLC	2,113	6.95	14,685.35
RELX PLC	2,892	11.37	32,882.04
SKY PLC	2,659	10.69	28,424.71
WPP PLC	3,355	14.67	49,217.85
DIXONS CARPHONE PLC	2,521	4.64	11,710.04
KINGFISHER PLC	5,990	3.19	19,156.02
MARKS & SPENCER GROUP PLC	4,122	4.55	18,783.95
NEXT PLC	374	73.25	27,395.50
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	889	5.74	5,102.86
SAINSBURY (J) PLC	4,101	2.36	9,715.26
TESCO PLC	20,954	1.43	29,974.69
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	6,930	1.40	9,715.86
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	917	33.48	30,701.16
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	4,673	35.90	167,760.70
COCA-COLA HBC AG-CDI	661	14.14	9,346.54
DIAGEO PLC	6,306	17.96	113,255.76
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	2,465	34.00	83,810.00
SABMILLER PLC	2,498	40.05	100,044.90
TATE & LYLE PLC	1,542	5.87	9,051.54
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,604	60.88	97,651.52
UNILEVER PLC	3,305	27.20	89,896.00

	SMITH & NEPHEW PLC	2,303	10.60	24,411.80
	ASTRAZENECA PLC	3,168	42.85	135,764.64
	GLAXOSMITHKLINE PLC	12,200	12.80	156,160.00
	SHIRE PLC	1,524	40.89	62,316.36
	BARCLAYS PLC	43,142	2.09	90,209.92
	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	49,038	4.94	242,321.27
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	143,137	0.68	98,306.49
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	8,332	2.82	23,546.23
	STANDARD CHARTERED PLC(UK)	8,208	4.76	39,086.49
	3I GROUP PLC	2,505	4.51	11,307.57
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	3,034	2.80	8,507.33
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	782	14.21	11,112.22
	ICAP PLC	1,818	4.85	8,820.93
	INVESTEC PLC	1,821	4.32	7,870.36
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	805	24.86	20,012.30
	PROVIDENT FINANCIAL PLC(UK)	368	32.74	12,048.32
	SCHRODERS PLC	312	26.78	8,355.36
	ADMIRAL GROUP PLC	639	16.11	10,294.29
	AVIVA PLC	10,419	4.82	50,219.58
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	3,541	4.00	14,178.16
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	15,305	2.53	38,752.26
	OLD MUTUAL PLC	12,354	1.57	19,494.61
	PRUDENTIAL PLC	6,445	14.39	92,775.77
	RSA INSURANCE GROUP PLC	2,619	4.12	10,803.37
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,348	9.27	12,495.96
	STANDARD LIFE PLC	4,937	3.65	18,064.48
	AUTO TRADER GROUP PLC	1,882	4.37	8,228.10
	SAGE GROUP PLC (THE)	2,776	5.79	16,086.92
	BT GROUP PLC	20,983	4.56	95,860.83
	INMARSAT PLC	1,127	10.85	12,227.95
	VODAFONE GROUP PLC	66,550	2.03	135,595.62
	CENTRICA PLC	12,812	2.08	26,661.77
	NATIONAL GRID PLC	9,635	8.94	86,156.17
	SEVERN TRENT PLC	612	21.09	12,907.08
	SSE PLC	2,558	14.07	35,991.06
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,756	9.23	16,216.66
	ARM HOLDINGS PLC	3,635	10.41	37,840.35
	英ボンド 建小計	752,462		3,853,636.90 (707,604,807)
スイスフラン	TRANSOCEAN LIMITED(CHF)	1,183	12.04	14,243.32
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	27	399.50	10,786.50
	GIVAUDAN-REG	30	1,776.00	53,280.00

	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	1,423	49.12	69,897.76
	SIKA AG-BR	6	3,444.00	20,664.00
	SYNGENTA AG(CH)	307	365.50	112,208.50
	ABB LIMITED-REG	7,032	17.51	123,130.32
	GEBERIT AG-REG	126	331.40	41,756.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	67	162.50	10,887.50
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	146	161.40	23,564.40
	SULZER AG-REG	79	98.15	7,753.85
	ADECCO SA-REG	567	65.00	36,855.00
	SGS SA-REG	18	1,835.00	33,030.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	177	132.50	23,452.50
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	1,669	69.50	115,995.50
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	163	61.30	9,991.90
	THE SWATCH GROUP AG-B	100	325.20	32,520.00
	DUFREY AG	132	118.00	15,576.00
	ARYZTA AG	285	46.36	13,212.60
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	8	1,059.00	8,472.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	3	6,005.00	18,015.00
	NESTLE SA-REGISTERED	10,197	71.55	729,595.35
	SONOVA HOLDING AG-REG	176	121.80	21,436.80
	ACTELION LTD-REG	340	129.60	44,064.00
	GALENICA AG-REG	12	1,466.00	17,592.00
	LONZA GROUP AG-REG	173	150.70	26,071.10
	NOVARTIS AG-REG SHS	7,277	82.20	598,169.40
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,247	262.60	590,062.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5,743	20.02	114,974.86
	JULIUS BAER GROUP LIMITED	742	43.42	32,217.64
	PARGESA HOLDING SA-BR	101	59.90	6,049.90
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	57	347.25	19,793.25
	UBS GROUP AG	11,693	17.89	209,187.77
	BALOISE HOLDING AG-REG	156	124.80	19,468.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	105	255.60	26,838.00
	SWISS RE LIMITED	1,167	94.55	110,339.85
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	481	245.90	118,277.90
	SWISS PRIME SITE AG-REG	188	73.35	13,789.80
	SWISSCOM AG-REG	86	471.20	40,523.20
	スイスフラン 建小計	54,489		3,533,744.87 (434,862,643)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	714	119.80	85,537.20
	BOLIDEN AB	897	140.10	125,669.70
	ALFA LAVAL AB	1,032	150.50	155,316.00
	ASSA ABLOY AB-B	3,081	174.40	537,326.40

	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,065	204.90	423,118.50
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,279	191.60	245,056.40
	SANDVIK AB	3,495	76.20	266,319.00
	SKANSKA AB-B SHS	1,246	160.90	200,481.40
	SKF AB-B SHARES	1,299	136.50	177,313.50
	VOLVO AB-B SHS	5,143	76.10	391,382.30
	SECURITAS AB-B SHS	1,027	124.90	128,272.30
	ELECTROLUX AB-SER B	789	194.00	153,066.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,338	52.55	70,311.90
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,919	295.50	862,564.50
	ICA GRUPPEN AB	254	302.70	76,885.80
	SWEDISH MATCH AB	658	289.00	190,162.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	1,811	231.30	418,884.30
	GETINGE AB-B SHS	656	211.30	138,612.80
	NORDEA BANK AB	9,338	88.15	823,144.70
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	4,670	83.50	389,945.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,604	108.40	499,073.60
	SWEDBANK AB-A SHARES	2,784	177.60	494,438.40
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	537	142.30	76,415.10
	INVESTOR AB-B SHS	1,400	299.00	418,600.00
	KINNEVIK INVESTMENT AB	772	244.00	188,368.00
	ERICSSON LM-B SHS	9,356	75.35	704,974.60
	HEXAGON AB-B SHS	837	299.10	250,346.70
	MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	217	486.80	105,635.60
	TELE2 AB-B SHS	1,047	82.30	86,168.10
	TELIASONERA AB	8,692	40.05	348,114.60
	スウェーデンクローナ 建小計	73,957		9,031,504.40 (129,150,512)
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	3,769	120.10	452,656.90
	NORSK HYDRO ASA	4,426	29.58	130,921.08
	YARA INTERNATIONAL ASA	591	376.70	222,629.70
	SCHIBSTED ASA-A	241	291.20	70,179.20
	SCHIBSTED ASA-B SHS	284	277.00	78,668.00
	ORKLA ASA	2,683	69.35	186,066.05
	DNB ASA	3,301	103.60	341,983.60
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	659	137.90	90,876.10
	TELENOR ASA	2,535	146.80	372,138.00
	ノルウェークローネ 建小計	18,489		1,946,118.63 (27,226,199)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	312	407.80	127,233.60
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	783	318.30	249,228.90
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	733	446.10	326,991.30

	ISS A/S	427	240.70	102,778.90
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	13	9,045.00	117,585.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	22	9,150.00	201,300.00
	DSV A/S	579	259.00	149,961.00
	PANDORA A/S	333	808.50	269,230.50
	CARLSBERG AS-B	350	567.00	198,450.00
	COLOPLAST A/S	364	528.50	192,374.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	75	665.00	49,875.00
	NOVO NORDISK A/S-B	6,176	376.50	2,325,264.00
	DANSKE BANK A/S	2,299	177.10	407,152.90
	TRYG A/S	345	132.40	45,678.00
	TDC A/S	2,655	32.53	86,367.15
	デンマーククローネ 建小計	15,466		4,849,470.25 (86,660,033)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	770	33.28	25,625.60
	OIL SEARCH LIMITED	3,555	5.86	20,832.30
	ORIGIN ENERGY LIMITED	4,524	4.47	20,222.28
	SANTOS LTD	3,221	3.34	10,758.14
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,924	26.41	50,812.84
	ALUMINA LIMITED	8,314	1.10	9,186.97
	AMCOR LTD	3,061	12.78	39,119.58
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	8,333	16.60	138,327.80
	BORAL LIMITED	2,577	5.30	13,658.10
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	5,125	1.79	9,199.37
	ILUKA RESOURCES LIMITED	1,379	5.09	7,019.11
	INCITEC PIVOT LIMITED	5,448	3.76	20,484.48
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,465	14.99	21,960.35
	NEWCREST MINING LIMITED	2,080	12.74	26,499.20
	ORICA LTD	1,227	14.42	17,693.34
	RIO TINTO LIMITED(AU)	1,101	42.18	46,440.18
	SOUTH32 LIMITED	9,929	0.99	9,879.35
	CIMIC GROUP LIMITED	335	22.25	7,453.75
	BRAMBLES LTD	4,475	10.53	47,121.75
	SEEK LIMITED	1,065	13.93	14,835.45
	ASCIANO LIMITED	1,645	8.70	14,311.50
	AURIZON HOLDINGS LIMITED	6,031	4.96	29,913.76
	QANTAS AIRWAYS LTD	1,697	3.78	6,414.66
	SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	3,575	5.99	21,414.25
TRANSURBAN GROUP	5,310	9.91	52,622.10	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,459	9.38	13,685.42	
CROWN RESORTS LIMITED	1,199	10.66	12,781.34	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	183	34.30	6,276.90	



TABCORP HOLDINGS LIMITED	2,512	4.57	11,479.84		
TATTS GROUP LTD	4,723	4.18	19,742.14		
REA GROUP LIMITED	174	50.20	8,734.80		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,749	3.83	6,698.67		
WESFARMERS LIMITED	2,916	37.23	108,562.68		
WOOLWORTHS LIMITED	3,286	22.59	74,230.74		
COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,886	8.63	16,276.18		
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	2,144	7.79	16,701.76		
COCHLEAR LIMITED	188	90.96	17,100.48		
HEALTHSCOPE LTD	3,707	2.40	8,896.80		
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	433	63.34	27,426.22		
SONIC HEALTHCARE LTD	1,254	19.67	24,666.18		
CSL LIMITED	1,206	99.86	120,431.16		
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	7,460	25.68	191,572.80		
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	1,194	13.06	15,593.64		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	1,477	10.72	15,833.44		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	4,406	77.44	341,200.64		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	6,812	27.94	190,327.28		
WESTPAC BANKING CORPORATION	8,620	30.66	264,289.20		
ASX LTD	502	39.50	19,829.00		
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	1,478	7.99	11,809.22		
MACQUARIE GROUP LIMITED	842	78.14	65,793.88		
PLATINUM ASSET MANAGEMENT LIMITED	720	7.36	5,299.20		
AMP LIMITED	8,393	5.46	45,825.78		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	6,690	5.25	35,122.50		
MEDIBANK PRIVATE LIMITED	8,514	2.12	18,049.68		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	3,969	11.58	45,961.02		
SUNCORP GROUP LIMITED	3,701	11.77	43,560.77		
LENDLEASE GROUP	1,806	12.86	23,225.16		
COMPUTERSHARE LIMITED	1,557	11.32	17,625.24		
TELSTRA CORPORATION	12,016	5.17	62,122.72		
TPG TELECOM LIMITED	915	9.69	8,866.35		
AGL ENERGY LIMITED	2,081	16.59	34,523.79		
APA GROUP	3,445	8.25	28,421.25		
AUSNET SERVICES	5,638	1.41	7,949.58		
DUET GROUP	6,022	2.32	13,971.04		
オーストラリアドル 建小計	215,443		2,682,270.70 (235,583,835)		
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	2,266	6.96	15,771.36	
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	3,137	5.30	16,626.10	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	1,235	8.14	10,052.90	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	6,022	3.15	18,999.41	

	CONTACT ENERGY LIMITED	1,208	4.65	5,617.20
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,656	2.34	8,573.32
	MIGHTY RIVER POWER LTD	2,306	2.75	6,341.50
	ニュージーランドドル 建小計	19,830		81,981.79 (6,728,245)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	8,534	101.50	866,201.00
	NWS HOLDINGS LIMITED	4,500	10.92	49,140.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LIMITED	4,000	12.98	51,920.00
	MTR CORPORATION	4,903	36.20	177,488.60
	LI & FUNG LIMITED	20,000	5.01	100,200.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED	4,773	29.75	141,996.75
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	2,338	25.85	60,437.30
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	6,537	22.60	147,736.20
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	3,355	9.52	31,939.60
	SANDS CHINA LIMITED	8,574	25.40	217,779.60
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	3,813	6.91	26,347.83
	SJM HOLDINGS LIMITED	7,000	5.29	37,030.00
	WYNN MACAU LIMITED	5,099	9.02	45,992.98
	WH GROUP LTD	12,500	3.95	49,375.00
	BANK OF EAST ASIA	3,267	26.30	85,922.10
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	11,684	22.95	268,147.80
	HANG SENG BANK LTD	2,400	144.40	346,560.00
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	8,000	4.87	38,960.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	3,566	195.60	697,509.60
	AIA GROUP LIMITED	37,751	45.85	1,730,883.35
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	8,534	51.00	435,234.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	7,864	17.70	139,192.80
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,245	46.60	197,817.00
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	2,000	32.25	64,500.00
	KERRY PROPERTIES LIMITED	2,452	20.85	51,124.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	17,562	7.62	133,822.44
	SINO LAND CO	10,576	11.34	119,931.84
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	5,000	93.85	469,250.00
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,000	84.00	168,000.00
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	4,032	22.35	90,115.20
	WHARF HOLDINGS LTD	4,000	42.15	168,600.00
	WHELOCK AND COMPANY LTD	3,000	31.90	95,700.00
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	9,080	9.51	86,350.80
	PCCW LIMITED	13,884	4.52	62,755.68
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	2,000	69.00	138,000.00
	CLP HOLDINGS LTD	6,235	64.60	402,781.00
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	8,500	6.13	52,105.00

	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	23,556	14.90	350,984.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	4,567	70.00	319,690.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	800	58.00	46,400.00	
	香港ドル 建小計	302,481		8,763,922.07 (136,980,101)	
シンガポールドル	KEPPEL CORPORATION LIMITED	4,200	6.22	26,124.00	
	NOBLE GROUP LIMITED	14,636	0.38	5,634.86	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	4,000	2.98	11,920.00	
	SEMBCORP MARINE LIMITED	2,987	1.67	4,988.29	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	4,400	2.92	12,848.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	7,069	1.07	7,599.17	
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	7,000	3.00	21,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,500	10.96	16,440.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	21,000	0.76	16,065.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	4,600	3.88	17,848.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	300	33.10	9,930.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	24,000	0.32	7,680.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	7,000	2.79	19,530.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LIMITED	5,800	16.32	94,656.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	10,000	8.54	85,400.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	4,300	19.16	82,388.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	2,300	7.53	17,319.00	
	CAPITALAND LTD	7,200	3.12	22,464.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,300	7.03	9,139.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	9,000	1.98	17,820.00	
UOL GROUP LIMITED	2,000	5.98	11,960.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	26,500	3.79	100,435.00		
STARHUB LIMITED	2,000	3.59	7,180.00		
	シンガポールドル 建小計	173,092		626,368.32 (53,905,257)	
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LIMITED	16	729.30	11,668.80	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	1,458	16.70	24,348.60	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LIMITED	2,690	250.20	673,038.00	
	BANK HAPOLIM BM	3,465	19.45	67,394.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,349	13.18	57,319.82	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	454	45.70	20,747.80	
	AZRIELI GROUP	107	141.80	15,172.60	
	NICE SYSTEMS LIMITED	187	219.20	40,990.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	6,284	8.11	50,969.52	
	イスラエルシュケル 建小計	19,010		961,649.79 (30,157,337)	
		3,438,904		9,668,285,807	

合 計			(9,668,285,807)
-----	--	--	-----------------

(注)外貨建株式の評価額の単価は、小数点第3位以下を切り捨てて表示しております。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資信託受益証券	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	19,000	10,070.00	
	投資信託受益証券 小計		19,000	10,070.00 (1,220,081)	
	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORPORATION	1,025	17,384.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	1,183	111,249.32	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	2,787	25,250.22	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	371	64,672.72	
		BOSTON PROPERTIES INC	431	54,021.54	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	520	12,911.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	243	18,161.82	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	977	83,240.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	421	29,756.28	
		DUKE REALTY CORP	965	19,676.35	
		EQUINIX INC	175	51,371.25	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,017	79,519.23	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	199	46,339.14	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	322	27,756.40	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	212	30,566.16	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	1,608	41,936.64	
		HCP INC	1,297	46,536.36	
		HOST HOTELS & RESORTS	2,214	34,781.94	
		IRON MOUNTAIN INC	512	13,378.56	
		KIMCO REALTY CORP	1,216	30,740.48	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	500	15,795.00	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	488	22,965.28	
		PROLOGIS INC	1,554	64,164.66	
		PUBLIC STORAGE	411	102,375.99	
		REALTY INCOME CORP	692	34,143.28	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	290	19,047.20	
		SIMON PROPERTY GROUP	875	162,723.75	
		SL GREEN REALTY CORPORATION	300	33,435.00	
	THE MACERICH COMPANY	393	30,123.45		
	UDR INC	765	27,922.50		
	VENTAS INC	955	51,980.65		
	VEREIT INC	2,950	23,393.50		

		VORNADO REALTY TRUST	476	46,481.40
		WELLTOWER INC	985	62,586.90
		WEYERHAEUSER COMPANY	1,455	43,664.55
	投資証券	小計	30,784	1,580,053.52 (191,439,284)
米ドル	建小計		49,784	1,590,123.52 (192,659,365)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	500	9,890.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	497	11,898.18
カナダドル	建小計		997	21,788.18 (1,923,896)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	93	7,394.43
		GECINA SA	93	10,295.10
		ICADE	121	7,257.58
		KLEPIERRE	537	21,616.93
		UNIBAIL-RODAMCO SE	277	62,103.40
ユーロ	建小計		1,121	108,667.44 (14,489,716)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	2,497	19,027.14
		HAMMERSON PLC	2,020	11,766.50
		INTU PROPERTIES PLC	3,027	9,126.40
		LAND SECURITIES GROUP PLC	2,036	23,210.40
		SEGRO PLC	2,448	10,239.98
英ポンド	建小計		12,028	73,370.42 (13,472,276)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	2,981	22,268.07
		GOODMAN GROUP	4,592	27,138.72
		GPT GROUP	5,549	25,358.93
		MIRVAC GROUP	12,171	23,368.32
		SCENTRE GROUP	15,100	60,702.00
		STOCKLAND	6,168	24,795.36
		VICINITY CENTRES	10,481	28,613.13
		WESTFIELD CORPORATION	5,646	52,790.10
オーストラリアドル	建小計		62,688	265,034.63 (23,277,991)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	7,107	327,988.05
香港ドル	建小計		7,107	327,988.05 (5,126,453)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,000	15,610.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	6,669	8,669.70
		CAPITALAND MALL TRUST	8,000	14,920.00
		SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,000	12,080.00
			29,669	51,279.70

シンガポールドル建小計		(4,413,130)	
合計		255,362,827	(255,362,827)

(注)投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、口数及び証券数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	株式 605銘柄	56.2%			63.1%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			1.7%	1.9%
カナダドル	株式 91銘柄	3.1%			3.5%
	投資証券 2銘柄			0.0%	0.0%
ユーロ	株式 233銘柄	10.9%			12.2%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.1%
英ポンド	株式 108銘柄	6.3%			7.1%
	投資証券 5銘柄			0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.9%			4.4%
スウェーデンクロー ナ	株式 30銘柄	1.2%			1.3%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.2%			0.3%
デンマーククローネ	株式 15銘柄	0.8%			0.9%
オーストラリアドル	株式 64銘柄	2.1%			2.4%
	投資証券 8銘柄			0.2%	0.2%
ニュージーランドド ル	株式 7銘柄	0.1%			0.1%
香港ドル	株式 40銘柄	1.2%			1.4%
	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%			0.5%
	投資証券 4銘柄			0.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	0.3%			0.3%

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	18,526,634	27,167,345
国債証券	13,868,988,500	12,919,883,400
地方債証券	1,281,257,900	1,192,139,300
特殊債券	1,349,693,600	1,221,508,700
社債券	845,310,000	736,600,000
未収利息	68,989,245	61,104,121
前払費用	3,197,433	1,039,978
流動資産合計	17,435,963,312	16,159,442,844
資産合計	17,435,963,312	16,159,442,844
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	290,000	10,870,000
流動負債合計	290,000	10,870,000
負債合計	290,000	10,870,000
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,468,670,820	13,221,766,651
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,967,002,492	2,926,806,193
元本等合計	17,435,673,312	16,148,572,844
純資産合計	17,435,673,312	16,148,572,844
負債純資産合計	17,435,963,312	16,159,442,844

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配は使用いたしません。）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
---------------	---------------

1. 計算日における受益権の総数 14,468,670,820口	1. 計算日における受益権の総数 13,221,766,651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 1.2051円 (1万口当たり純資産額) (12,051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 1.2214円 (1万口当たり純資産額) (12,214円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券であり、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。 また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左



## 金融商品の時価等に関する事項

平成26年12月15日現在	平成27年12月15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 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。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	15,199,274,779円	14,468,670,820円
期中追加設定元本額	1,019,956,911円	848,782,788円
期中一部解約元本額	1,750,560,870円	2,095,686,957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）	112,607,832円	109,724,626円
新光7資産バランスファンド	920,382,291円	786,651,829円
日本債券ファンド	632,974,278円	1,053,580,067円
新光日本債券インデックスVA	2,531,782,780円	1,725,748,927円

新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,418,972,286円	2,270,232,969円
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	2,773,886,288円	2,451,269,840円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	195,951,533円	150,444,389円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	3,349,638,531円	3,192,950,288円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,506,277,990円	1,448,640,414円
グローバル・ナビ	26,197,011円	32,523,302円
合計	14,468,670,820円	13,221,766,651円

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	105,480,300	35,745,400
地方債証券	3,457,300	1,022,200
特殊債券	4,263,800	2,099,500
社債券	1,280,000	50,000
合計	114,481,400	38,817,100

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

## 3 デリバティブ取引等関係

### 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

### 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

国債証券	第103回利付国債(5年)	240,000,000	241,008,000	
	第105回利付国債(5年)	220,000,000	220,778,800	
	第106回利付国債(5年)	170,000,000	170,702,100	
	第107回利付国債(5年)	170,000,000	170,768,400	
	第109回利付国債(5年)	130,000,000	130,351,000	
	第112回利付国債(5年)	50,000,000	50,520,000	
	第113回利付国債(5年)	50,000,000	50,394,500	
	第114回利付国債(5年)	130,000,000	131,111,500	
	第116回利付国債(5年)	140,000,000	140,883,400	
	第117回利付国債(5年)	130,000,000	130,867,100	
	第118回利付国債(5年)	150,000,000	151,051,500	
	第120回利付国債(5年)	110,000,000	110,805,200	
	第122回利付国債(5年)	150,000,000	150,540,000	
	第123回利付国債(5年)	190,000,000	190,646,000	
	第124回利付国債(5年)	180,000,000	180,606,600	
	第125回利付国債(5年)	160,000,000	160,531,200	
	第1回利付国債(40年)	10,000,000	12,614,400	
	第2回利付国債(40年)	20,000,000	24,207,200	
	第3回利付国債(40年)	20,000,000	24,208,600	
	第4回利付国債(40年)	30,000,000	36,351,300	
	第5回利付国債(40年)	30,000,000	34,662,000	
	第6回利付国債(40年)	40,000,000	45,062,000	
	第7回利付国債(40年)	40,000,000	42,723,200	
	第8回利付国債(40年)	40,000,000	39,108,000	
	第285回利付国債(10年)	170,000,000	173,690,700	
	第286回利付国債(10年)	100,000,000	102,766,000	
	第288回利付国債(10年)	30,000,000	30,915,900	
	第289回利付国債(10年)	90,000,000	92,757,600	
	第290回利付国債(10年)	130,000,000	134,163,900	
	第291回利付国債(10年)	40,000,000	41,190,800	
	第293回利付国債(10年)	130,000,000	135,916,300	
	第296回利付国債(10年)	110,000,000	114,599,100	
	第297回利付国債(10年)	110,000,000	114,683,800	
	第299回利付国債(10年)	80,000,000	83,425,600	
	第300回利付国債(10年)	50,000,000	52,466,500	
	第301回利付国債(10年)	110,000,000	115,786,000	
	第302回利付国債(10年)	10,000,000	10,490,900	
	第303回利付国債(10年)	180,000,000	189,435,600	
	第305回利付国債(10年)	50,000,000	52,573,500	
	第306回利付国債(10年)	190,000,000	201,103,600	
第308回利付国債(10年)	210,000,000	222,001,500		
第309回利付国債(10年)	20,000,000	20,963,000		

第310回利付国債(10年)	150,000,000	156,913,500	
第311回利付国債(10年)	30,000,000	31,097,700	
第312回利付国債(10年)	150,000,000	158,736,000	
第313回利付国債(10年)	180,000,000	191,943,000	
第315回利付国債(10年)	170,000,000	180,834,100	
第317回利付国債(10年)	60,000,000	63,635,400	
第318回利付国債(10年)	100,000,000	105,485,000	
第319回利付国債(10年)	60,000,000	63,792,600	
第320回利付国債(10年)	100,000,000	105,722,000	
第321回利付国債(10年)	40,000,000	42,369,200	
第322回利付国債(10年)	40,000,000	42,120,000	
第323回利付国債(10年)	180,000,000	189,860,400	
第325回利付国債(10年)	110,000,000	115,440,600	
第326回利付国債(10年)	40,000,000	41,742,800	
第327回利付国債(10年)	80,000,000	84,043,200	
第328回利付国債(10年)	10,000,000	10,363,800	
第329回利付国債(10年)	100,000,000	105,137,000	
第330回利付国債(10年)	100,000,000	105,186,000	
第332回利付国債(10年)	120,000,000	124,370,400	
第333回利付国債(10年)	100,000,000	103,584,000	
第334回利付国債(10年)	200,000,000	207,036,000	
第335回利付国債(10年)	180,000,000	184,726,800	
第336回利付国債(10年)	110,000,000	112,819,300	
第338回利付国債(10年)	170,000,000	172,618,000	
第339回利付国債(10年)	90,000,000	91,252,800	
第340回利付国債(10年)	150,000,000	151,854,000	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	24,413,600	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	24,749,600	
第10回利付国債(30年)	20,000,000	20,846,400	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	22,746,600	
第12回利付国債(30年)	20,000,000	24,042,800	
第13回利付国債(30年)	30,000,000	35,526,600	
第15回利付国債(30年)	40,000,000	50,635,200	
第17回利付国債(30年)	40,000,000	49,900,800	
第19回利付国債(30年)	20,000,000	24,544,200	
第20回利付国債(30年)	20,000,000	25,241,000	
第21回利付国債(30年)	10,000,000	12,249,000	
第22回利付国債(30年)	20,000,000	25,222,800	
第23回利付国債(30年)	20,000,000	25,233,800	
第24回利付国債(30年)	20,000,000	25,222,000	
第26回利付国債(30年)	40,000,000	49,685,600	
第27回利付国債(30年)	50,000,000	63,120,500	

第28回利付国債(30年)	40,000,000	50,599,600	
第29回利付国債(30年)	40,000,000	49,873,200	
第30回利付国債(30年)	40,000,000	49,115,600	
第31回利付国債(30年)	50,000,000	60,416,500	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	61,487,500	
第33回利付国債(30年)	60,000,000	69,963,000	
第34回利付国債(30年)	60,000,000	72,542,400	
第35回利付国債(30年)	60,000,000	69,925,800	
第36回利付国債(30年)	60,000,000	69,861,600	
第37回利付国債(30年)	60,000,000	68,437,200	
第38回利付国債(30年)	50,000,000	55,817,000	
第39回利付国債(30年)	30,000,000	34,166,100	
第40回利付国債(30年)	40,000,000	44,579,600	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	43,598,400	
第42回利付国債(30年)	40,000,000	43,576,400	
第43回利付国債(30年)	40,000,000	43,554,000	
第44回利付国債(30年)	30,000,000	32,648,400	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	62,330,400	
第46回利付国債(30年)	50,000,000	51,844,500	
第47回利付国債(30年)	30,000,000	31,817,400	
第48回利付国債(30年)	30,000,000	30,318,300	
第45回利付国債(20年)	30,000,000	33,035,100	
第47回利付国債(20年)	60,000,000	66,190,800	
第48回利付国債(20年)	60,000,000	67,414,800	
第50回利付国債(20年)	30,000,000	32,946,300	
第51回利付国債(20年)	10,000,000	11,080,500	
第52回利付国債(20年)	20,000,000	22,361,800	
第53回利付国債(20年)	30,000,000	33,704,100	
第55回利付国債(20年)	30,000,000	33,649,200	
第57回利付国債(20年)	30,000,000	33,588,600	
第58回利付国債(20年)	30,000,000	33,715,800	
第59回利付国債(20年)	30,000,000	33,398,400	
第63回利付国債(20年)	30,000,000	33,799,800	
第64回利付国債(20年)	20,000,000	22,736,600	
第65回利付国債(20年)	70,000,000	79,788,100	
第69回利付国債(20年)	40,000,000	46,359,600	
第70回利付国債(20年)	30,000,000	35,609,700	
第72回利付国債(20年)	30,000,000	34,951,500	
第76回利付国債(20年)	60,000,000	69,174,000	
第78回利付国債(20年)	40,000,000	46,192,800	
第81回利付国債(20年)	50,000,000	58,307,500	
第84回利付国債(20年)	60,000,000	70,114,800	

第 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	70,849,800	
第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	60,185,500	
第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	71,769,000	
第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	59,400,500	
第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	71,407,800	
第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	60,751,000	
第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	72,331,800	
第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	71,727,600	
第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	96,708,800	
第 1 0 3 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	61,133,000	
第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	71,988,600	
第 1 0 8 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	70,561,200	
第 1 1 1 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	72,951,000	
第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	72,218,400	
第 1 1 4 回利付国債（ 2 0 年）	10,000,000	12,047,200	
第 1 1 6 回利付国債（ 2 0 年）	90,000,000	109,701,900	
第 1 1 8 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	83,412,000	
第 1 2 1 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	82,505,500	
第 1 2 3 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	96,521,600	
第 1 2 5 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	73,263,000	
第 1 2 8 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	70,614,600	
第 1 3 0 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	92,951,200	
第 1 3 2 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	91,648,000	
第 1 3 4 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	81,178,300	
第 1 3 7 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	80,061,100	
第 1 4 0 回利付国債（ 2 0 年）	90,000,000	102,805,200	
第 1 4 1 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	79,849,700	
第 1 4 3 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	78,609,300	
第 1 4 5 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	79,613,100	
第 1 4 6 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	79,487,100	
第 1 4 7 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	78,199,100	
第 1 4 8 回利付国債（ 2 0 年）	90,000,000	98,853,300	
第 1 4 9 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	65,763,000	
第 1 5 0 回利付国債（ 2 0 年）	90,000,000	96,832,800	
第 1 5 1 回利付国債（ 2 0 年）	90,000,000	93,471,300	
第 1 5 2 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	103,563,000	
第 1 5 3 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	52,491,000	
第 1 5 4 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	82,368,000	
国債証券 小計	11,950,000,000	12,919,883,400	
地方債証券			
第 1 8 回東京都公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	120,070,000	
第 6 5 4 回東京都公募公債	100,000,000	103,030,000	
第 6 7 8 回東京都公募公債	80,000,000	84,136,000	

	平成19年度第2回北海道公募公債	30,000,000	30,759,000	
	第164回神奈川県公募公債	100,000,000	105,040,000	
	第87回大阪府公募公債(5年)	50,000,000	50,115,000	
	第110回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,170,000	
	第302回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	40,984,000	
	平成20年度第1回愛知県公募公債(10年)	48,000,000	50,049,600	
	平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	68,838,000	
	平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	103,240,000	
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,050,000	
	第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	52,780,000	
	第485回名古屋市長公募公債(10年)	30,000,000	30,942,000	
	平成19年度第2回京都市公募公債	30,000,000	31,011,000	
	平成19年度第5回福岡市公募公債	13,000,000	13,414,700	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	103,510,000	
地方債証券 小計		1,137,000,000	1,192,139,300	
特殊債券	第33回日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,310,000	
	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	103,980,000	
	第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,510,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,170,000	
	第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,520,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,790,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,200,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,370,000	
	第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	103,797,700	
	い第759号農林債	20,000,000	20,116,000	
	い第766号農林債	50,000,000	50,175,000	
	第274回信金中金債(5年)	100,000,000	100,290,000	
	第13回中日本高速道路社債(財投機関債)	100,000,000	105,280,000	
特殊債券 小計		1,171,000,000	1,221,508,700	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	103,860,000	
	第30回新日鐵住金社債	100,000,000	105,300,000	
	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	105,700,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,180,000	
	第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債	100,000,000	104,620,000	
	第524回東京電力社債	100,000,000	101,460,000	
社債券 小計		700,000,000	736,600,000	
合計		14,958,000,000	16,070,131,400	

## 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。

#### 海外国債マザーファンド

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	319,299,469	205,234,173
国債証券	53,794,313,694	38,797,577,151
未収入金	-	255,270,467
未収利息	305,711,737	230,513,534
前払費用	83,037,831	25,650,397
流動資産合計	54,502,362,731	39,514,245,722
資産合計	54,502,362,731	39,514,245,722
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,332,439
流動負債合計	-	1,332,439
負債合計	-	1,332,439
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	22,791,420,858	16,920,799,395
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	31,710,941,873	22,592,113,888
元本等合計	54,502,362,731	39,512,913,283
純資産合計	54,502,362,731	39,512,913,283
負債純資産合計	54,502,362,731	39,514,245,722

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配は使用いたしません。）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）に基づいて評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。



区分	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

## (貸借対照表に関する注記)

平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
1. 計算日における受益権の総数  22,791,420,858口	1. 計算日における受益権の総数  16,920,799,395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 (1万口当たり純資産額)	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 (1万口当たり純資産額)
2.3914円 (23,914円)	2.3352円 (23,352円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引には為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

区分	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15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26年12月15日現在	平成27年12月15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26年12月15日現在	平成27年12月15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。	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。 派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

#### 1 元本の移動

区分	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	30,467,962,912円	22,791,420,858円
期中追加設定元本額	32,722,403円	158,500,408円
期中一部解約元本額	7,709,264,457円	6,029,121,871円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	14,149,820,427円	11,427,326,353円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	1,795,786,023円	1,514,376,289円
新光7資産バランスファンド	492,165,560円	408,157,097円
海外国債ファンド（1年決算型）	35,675,420円	40,454,372円
海外国債ファンド（変額年金）	6,304,534,408円	3,509,821,876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）	3,477,904円	3,735,986円
グローバル・ナビ	9,961,116円	16,927,422円
合計	22,791,420,858円	16,920,799,395円

#### 2 有価証券関係

##### 売買目的有価証券

種類	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	919,434,249	22,463,682
合計	919,434,249	22,463,682

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

### 3 デリバティブ取引等関係

#### 取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

種類	平成26年12月15日現在				平成27年12月15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	-	-	-	-	255,835,886	-	257,168,325	1,332,439
カナダドル	-	-	-	-	27,900,024	-	28,043,274	143,250
ユーロ	-	-	-	-	227,935,862	-	229,125,051	1,189,189
合計	-	-	-	-	255,835,886	-	257,168,325	1,332,439

#### 時価の算定方法

##### 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	10,500,000.00	10,482,773.48	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	10,700,000.00	10,467,609.37	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	1,400,000.00	1,818,250.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	9,100,000.00	9,377,976.60	

		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	11,900,000.00	12,475,476.61	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	10,300,000.00	10,781,203.12	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	13,400,000.00	13,749,656.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	13,700,000.00	13,900,148.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	13,700,000.00	13,748,164.12	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	13,700,000.00	13,443,125.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	13,800,000.00	13,671,703.18	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	13,700,000.00	13,416,367.25	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,000,000.00	5,008,984.40	
米ドル建小計			140,900,000.00	142,341,437.88 (17,246,088,613)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	2,000,000.00	2,034,140.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,900,000.00	2,070,981.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,800,000.00	1,923,300.00	
カナダドル建小計			5,700,000.00	6,028,421.00 (532,309,574)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	2,400,000.00	2,628,960.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	2,400,000.00	2,721,840.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	1,300,000.00	1,914,900.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	2,400,000.00	2,676,240.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	2,400,000.00	2,627,760.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	2,400,000.00	2,520,960.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	3,100,000.00	3,097,520.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,700,000.00	2,807,460.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,900,000.00	3,095,670.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	4,200,000.00	5,174,400.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	5,700,000.00	7,162,050.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,800,000.00	4,412,520.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	5,300,000.00	6,581,010.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	4,600,000.00	5,456,060.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	4,700,000.00	5,097,150.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	5,500,000.00	7,146,700.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	4,500,000.00	4,497,750.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,500,000.00	6,255,900.00	
		FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	2,000,000.00	3,174,000.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	6,000,000.00	6,569,400.00	
		FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	7,500,000.00	9,662,250.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	5,200,000.00	5,888,480.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	5,600,000.00	6,090,560.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	5,800,000.00	5,638,180.00	
		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	4,500,000.00	6,718,050.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,900,000.00	2,929,870.00	
ユーロ建小計			102,300,000.00	122,545,640.00 (16,340,235,637)	
英ポンド	国債証券	TSY-2.25%-23/09/07	6,400,000.00	6,692,352.00	
		TSY-2.75%-24/09/07	6,300,000.00	6,816,411.00	
		TSY-5.0%-25/03/07	4,600,000.00	5,886,022.00	
		TSY-2.0%-25/09/07	6,000,000.00	6,086,880.00	
英ポンド建小計			23,300,000.00	25,481,665.00 (4,678,943,327)	
合計				38,797,577,151 (38,797,577,151)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	債券 13銘柄	43.6%	44.5%
カナダドル	債券 3銘柄	1.3%	1.4%
ユーロ	債券 26銘柄	41.4%	42.1%
英ポンド	債券 4銘柄	11.8%	12.1%

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	183,345,288	153,362,257
コール・ローン	144,667,182	47,394,480
国債証券	16,989,656,145	15,472,360,260
派生商品評価勘定	38,769,784	118,576,542
未収利息	176,002,837	147,882,864
前払費用	9,007,145	5,791,619
差入委託証拠金	14,542,511	24,283,377
流動資産合計	17,555,990,892	15,969,651,399
資産合計	17,555,990,892	15,969,651,399
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	135,552,795	162,788,265
流動負債合計	135,552,795	162,788,265
負債合計	135,552,795	162,788,265
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	13,234,688,062	11,872,377,473
剰余金		

	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
剰余金又は欠損金（ ）	4,185,750,035	3,934,485,661
元本等合計	17,420,438,097	15,806,863,134
純資産合計	17,420,438,097	15,806,863,134
負債純資産合計	17,555,990,892	15,969,651,399

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配は使用いたしません。）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
1. 計算日における受益権の総数 13,234,688,062口	1. 計算日における受益権の総数 11,872,377,473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 1.3163円 (1万口当たり純資産額) (13,163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 1.3314円 (1万口当たり純資産額) (13,314円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15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、国債証券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、債券先物取引及び為替予約取引であります。債券先物取引には市場金利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26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>国債証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	14,506,931,516円	13,234,688,062円
期中追加設定元本額	135,155,617円	83,164,323円
期中一部解約元本額	1,407,399,071円	1,445,474,912円
同期末における元本の内訳 新光ワールドバランスファンドV A（適格機関投資家私募）	7,761,097,997円	6,741,407,837円

新光世界バランス35VAT（適格機関投資家 私募）	182,587,991円	137,890,155円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関 投資家私募）	3,890,982,294円	3,649,841,224円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機 関投資家私募）	1,387,972,641円	1,328,396,540円
グローバル・ナビ	12,047,139円	14,841,717円
合計	13,234,688,062円	11,872,377,473円

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	237,202,039	120,152,129
合計	237,202,039	120,152,129

(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

(債券関連)

種類	平成26年12月15日現在				平成27年12月15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								
債券先物取引								
買建	158,423,158	-	159,599,520	1,176,362	159,922,464	-	160,302,758	380,294
US 10YR NOTE	30,006,522	-	30,256,671	250,149	30,598,626	-	30,634,550	35,924
US 5YR NOTE	84,804,430	-	84,971,093	166,663	86,241,445	-	86,388,974	147,529
LONG GILT FU	43,612,206	-	44,371,756	759,550	43,082,393	-	43,279,234	196,841
合計	158,423,158	-	159,599,520	1,176,362	159,922,464	-	160,302,758	380,294

### 時価の算定方法

#### 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

契約額等及び時価の邦貨換算額は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

種類	平成26年12月15日現在				平成27年12月15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	17,074,301,094	-	17,172,269,550	97,968,456	15,746,924,730	-	15,791,525,970	44,601,240
米ドル	6,763,719,388	-	6,839,860,800	76,141,412	6,840,092,905	-	6,762,700,350	77,392,555
カナダドル	406,792,151	-	400,115,870	6,676,281	327,917,142	-	314,292,230	13,624,912
メキシコペソ	215,183,542	-	202,360,640	12,822,902	160,372,723	-	151,449,600	8,923,123
ユーロ	7,385,671,863	-	7,434,632,250	48,960,387	6,353,717,383	-	6,512,326,810	158,609,427
英ポンド	1,440,217,675	-	1,449,260,000	9,042,325	1,353,599,835	-	1,343,220,900	10,378,935
スウェーデンクローナ	94,107,306	-	93,223,140	884,166	71,804,081	-	73,087,300	1,283,219
ノルウェークローネ	54,285,130	-	50,893,200	3,391,930	48,447,703	-	47,917,100	530,603
デンマーククローネ	126,573,723	-	127,401,900	828,177	97,104,166	-	99,500,160	2,395,994
ポーランドズロチ	123,474,264	-	124,044,800	570,536	86,549,325	-	87,048,950	499,625
オーストラリアドル	296,006,940	-	286,383,330	9,623,610	271,260,519	-	269,436,100	1,824,419
シンガポールドル	69,213,462	-	69,223,420	9,958	59,443,615	-	58,848,350	595,265
南アフリカランド	99,055,650	-	94,870,200	4,185,450	76,615,333	-	71,698,120	4,917,213
合計	17,074,301,094	-	17,172,269,550	97,968,456	15,746,924,730	-	15,791,525,970	44,601,240

時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-0.875%-16/12/31	1,000,000.00	1,000,937.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	1,000,000.00	1,044,062.50	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	1,500,000.00	1,502,226.57	
		US TREASURY N/B-0.875%-17/04/30	1,500,000.00	1,499,238.28	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	2,000,000.00	2,102,187.49	
		US TREASURY N/B-0.5%-17/07/31	2,800,000.00	2,780,093.75	
		US TREASURY N/B-0.75%-17/10/31	1,400,000.00	1,393,875.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	1,200,000.00	1,274,437.50	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	2,600,000.00	2,581,921.88	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	300,000.00	297,750.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	1,400,000.00	1,493,843.74	
		US TREASURY N/B-1.5%-18/08/31	1,900,000.00	1,915,882.81	
		US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	1,000,000.00	1,073,828.11	
		US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	2,000,000.00	2,090,625.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	1,200,000.00	1,271,531.25	
		US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	1,600,000.00	1,726,624.98	
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	1,400,000.00	1,500,953.11	
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	1,000,000.00	1,083,593.75	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	1,200,000.00	1,296,375.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	1,500,000.00	1,565,859.37	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	1,800,000.00	1,878,468.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	1,000,000.00	1,068,359.37	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	1,900,000.00	1,930,281.25	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	1,100,000.00	1,478,382.80	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	1,500,000.00	1,508,320.31			

		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	900,000.00	888,820.31	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,500,000.00	1,462,382.80	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	500,000.00	499,179.69	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	1,300,000.00	1,362,867.19	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	2,000,000.00	2,029,218.76	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	200,000.00	200,359.37	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	600,000.00	805,734.37	
		US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	300,000.00	395,859.37	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	400,000.00	546,687.50	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	500,000.00	648,828.12	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	500,000.00	649,531.25	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	300,000.00	335,742.18	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	600,000.00	763,031.24	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	600,000.00	790,312.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	500,000.00	635,898.44	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,300,000.00	1,535,421.87	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	200,000.00	249,828.12	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	300,000.00	402,867.18	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	500,000.00	638,007.81	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	600,000.00	696,656.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	400,000.00	417,625.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	500,000.00	502,695.31	
米ドル建小計			51,300,000.00	54,817,214.70	(6,641,653,733)
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	500,000.00	525,350.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	300,000.00	327,183.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	300,000.00	332,235.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	300,000.00	336,495.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	200,000.00	224,800.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	50,000.00	55,157.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	100,000.00	101,707.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	300,000.00	326,997.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	200,000.00	213,700.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	300,000.00	438,207.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	350,000.00	518,714.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	100,000.00	134,609.00	
		カナダドル建小計			3,000,000.00
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	2,300,000.00	2,336,524.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	2,800,000.00	2,997,484.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	3,000,000.00	3,303,630.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	1,700,000.00	1,759,432.00	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	1,800,000.00	1,845,792.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	3,700,000.00	3,969,249.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	2,600,000.00	3,453,216.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	1,100,000.00	1,276,869.00	
メキシコペソ建小計			19,000,000.00	20,942,196.00	(146,176,528)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	600,000.00	658,980.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	400,000.00	494,200.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	100,000.00	113,040.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	400,000.00	397,320.00	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	500,000.00	747,850.00	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	400,000.00	623,960.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	700,000.00	729,680.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	700,000.00	764,470.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	400,000.00	460,600.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	500,000.00	574,000.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	200,000.00	229,560.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	400,000.00	499,360.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31	300,000.00	387,540.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	300,000.00	378,090.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	700,000.00	887,600.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	400,000.00	579,760.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	650,000.00	894,335.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	600,000.00	626,136.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	500,000.00	535,710.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	800,000.00	894,120.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	800,000.00	907,120.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-19/10/11	600,000.00	611,460.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-21/01/04	500,000.00	565,700.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-21/09/04	400,000.00	452,000.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	100,000.00	109,425.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	700,000.00	1,031,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	200,000.00	210,080.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	450,000.00	661,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	200,000.00	325,860.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	600,000.00	960,780.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	500,000.00	863,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	100,000.00	128,070.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	300,000.00	313,383.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	700,000.00	758,786.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	900,000.00	983,340.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	300,000.00	333,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	100,000.00	113,390.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	900,000.00	1,048,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	500,000.00	578,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	500,000.00	577,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	300,000.00	347,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	600,000.00	774,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	300,000.00	369,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	500,000.00	593,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	900,000.00	1,169,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	150,000.00	149,925.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	400,000.00	596,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,000,000.00	1,390,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	900,000.00	1,264,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	200,000.00	250,000.00	



FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	100,000.00	103,780.00
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	100,000.00	115,020.00
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	100,000.00	109,180.00
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	260,000.00
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	100,000.00	119,930.00
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-17/02/25	500,000.00	512,250.00
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-17/07/25	400,000.00	408,360.00
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	700,000.00	759,241.00
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	600,000.00	618,180.00
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	800,000.00	919,200.00
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	700,000.00	804,580.00
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	400,000.00	461,680.00
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	500,000.00	559,750.00
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	450,000.00	538,155.00
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	620,000.00	727,198.00
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	500,000.00	564,200.00
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	700,000.00	901,810.00
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	250,000.00	243,025.00
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	100,000.00	149,290.00
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	300,000.00	458,100.00
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	800,000.00	1,311,280.00
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	650,000.00	1,008,930.00
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	300,000.00	463,680.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-4.4%-19/06/18	100,000.00	115,510.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-5.0%-20/10/18	200,000.00	246,640.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-3.4%-24/03/18	400,000.00	479,840.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-5.4%-25/03/13	100,000.00	137,940.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	450,000.00	499,680.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	200,000.00	203,240.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	500,000.00	582,650.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	200,000.00	227,080.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	300,000.00	372,930.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	200,000.00	220,360.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	250,000.00	381,350.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	100,000.00	148,910.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	200,000.00	302,940.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	200,000.00	208,280.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	250,000.00	287,225.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	100,000.00	118,260.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	300,000.00	359,070.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	100,000.00	108,570.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	300,000.00	473,190.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	250,000.00	370,275.00

ユーロ建小計			38,720,000.00	47,876,449.00 (6,383,845,709)
英ポンド	国債証券	TSY-8.75%-17/08/25	400,000.00	456,408.00
		TSY-1.25%-18/07/22	400,000.00	404,808.00
		TSY-4.5%-19/03/07	300,000.00	335,010.30
		TSY-4.75%-20/03/07	400,000.00	461,220.00
		TSY-3.75%-20/09/07	400,000.00	447,996.00
		TSY-3.75%-21/09/07	100,000.00	113,389.00
		TSY-4.0%-22/03/07	400,000.00	463,080.00
		TSY-1.75%-22/09/07	200,000.00	203,452.00
		TSY-5.0%-25/03/07	150,000.00	191,935.50
		TSY-4.25%-27/12/07	100,000.00	124,425.00
		TSY-4.25%-32/06/07	300,000.00	382,107.00
		TSY-4.5%-34/09/07	400,000.00	529,860.00
		TSY-4.75%-38/12/07	650,000.00	910,767.00
		TSY-4.5%-42/12/07	500,000.00	696,400.00
		TSY-4.25%-46/12/07	300,000.00	414,090.00
TSY-4.25%-49/12/07	650,000.00	923,052.00		
英ポンド建小計			5,650,000.00	7,057,999.80 (1,295,989,923)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	900,000.00	963,783.00
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	300,000.00	343,908.00
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	1,600,000.00	1,984,400.00
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	100,000.00	119,412.00
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	800,000.00	917,960.00
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	500,000.00	638,730.00
スウェーデンクローナ建小計			4,200,000.00	4,968,193.00 (71,045,159)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	600,000.00	631,200.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	600,000.00	678,420.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	600,000.00	687,120.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,100,000.00	1,160,500.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	200,000.00	225,660.00
ノルウェークローネ建小計			3,100,000.00	3,382,900.00 (47,326,771)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	1,200,000.00	1,302,900.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,000,000.00	1,159,900.00
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	600,000.00	942,600.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	1,300,000.00	2,121,639.00
デンマーククローネ建小計			4,100,000.00	5,527,039.00 (98,768,186)
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	800,000.00	849,120.00

ポーランドズロチ		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	500,000.00	556,550.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	200,000.00	224,700.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	400,000.00	468,720.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	500,000.00	536,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	150,000.00	152,085.00	
ポーランドズロチ建小計			2,550,000.00	2,787,475.00	(85,129,486)
オーストラリアドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	200,000.00	209,060.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	300,000.00	320,760.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	150,000.00	164,520.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	300,000.00	328,080.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	300,000.00	351,210.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	200,000.00	238,920.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	300,000.00	357,120.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	50,000.00	51,770.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	800,000.00	939,120.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	100,000.00	91,100.00	
オーストラリアドル建小計			2,700,000.00	3,051,660.00	(268,027,297)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	150,000.00	160,761.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	100,000.00	105,804.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	205,182.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	100,000.00	108,325.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	100,000.00	100,529.00	
シンガポールドル建小計			650,000.00	680,601.00	(58,572,522)
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-18/12/21	700,000.00	682,241.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%-21/03/31	1,700,000.00	1,506,302.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	2,800,000.00	2,902,200.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%-36/03/31	3,600,000.00	2,336,148.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%-41/02/28	800,000.00	512,112.00	
南アフリカランド建小計			9,600,000.00	7,939,003.00	(63,670,804)
合計				15,472,360,260	(15,472,360,260)

## 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 47銘柄	42.0%	42.9%
カナダドル	債券 12銘柄	2.0%	2.0%
メキシコペソ	債券 8銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	債券 93銘柄	40.4%	41.3%
英ポンド	債券 16銘柄	8.2%	8.4%
スウェーデンクローナ	債券 6銘柄	0.4%	0.5%
ノルウェークローネ	債券 5銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	債券 4銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	債券 6銘柄	0.5%	0.6%
オーストラリアドル	債券 10銘柄	1.7%	1.7%
シンガポールドル	債券 5銘柄	0.4%	0.4%
南アフリカランド	債券 5銘柄	0.4%	0.4%

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光J-REITマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,459,523	33,249,491
投資証券	1,214,757,600	2,215,199,265
未収入金	5,111,002	1,005,598
未収配当金	7,030,339	9,938,655
未収利息	6	47
流動資産合計	1,232,358,470	2,259,393,056
資産合計	1,232,358,470	2,259,393,056
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	2,087,206	3,761,903
流動負債合計	2,087,206	3,761,903

	平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
負債合計	2,087,206	3,761,903
純資産の部		
元本等		
元本	773,946,538	1,510,959,483
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	456,324,726	744,671,670
元本等合計	1,230,271,264	2,255,631,153
純資産合計	1,230,271,264	2,255,631,153
負債純資産合計	1,232,358,470	2,259,393,056

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場 (最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
1. 計算日における受益権の総数 773,946,538口	1. 計算日における受益権の総数 1,510,959,483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 1.5896円 (1万口当たり純資産額) (15,896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 1.4928円 (1万口当たり純資産額) (14,928円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

平成26年12月15日現在	平成27年12月15日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法 投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 1月 6日 至 平成26年12月15日	自 平成26年12月16日 至 平成27年12月15日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	963,940,401円	773,946,538円
期中追加設定元本額	8,879,105円	892,020,898円
期中一部解約元本額	198,872,968円	155,007,953円
同期末における元本の内訳		
新光7資産バランスファンド	765,275,608円	638,094,455円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）	3,583,455円	2,904,103円
グローバル・ナビ	5,087,475円	6,344,782円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	- 円	863,616,143円
合計	773,946,538円	1,510,959,483円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成26年12月15日現在	平成27年12月15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	145,747,035	16,035,874
合計	145,747,035	16,035,874

（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	106	43,407,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	58	21,199,000	
	森ヒルズリート投資法人	342	51,197,400	
	産業ファンド投資法人	77	42,504,000	
	大和ハウスリート投資法人	76	36,632,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	284	72,931,200	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	76	22,556,800	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	128	66,688,000	
	G L P 投資法人	566	65,542,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	103	23,164,700	
	日本プロロジスリート投資法人	377	79,999,400	
	星野リゾート・リート投資法人	17	20,077,000	
	S I A 不動産投資法人	16	7,272,000	
	イオンリート投資法人	238	32,534,600	
	ヒューリックリート投資法人	170	26,690,000	
	日本リート投資法人	85	24,573,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	118	11,717,400	
	日本ヘルスケア投資法人	16	2,801,600	
	積水ハウス・リート投資法人	173	22,247,800	
	ト・セイ・リート投資法人	34	3,811,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	77	19,280,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	26	2,784,600	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	36	3,078,000	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	18	2,646,000	
	野村不動産マスタ - ファンド投資法人	802.15	116,391,965	
	日本ビルファンド投資法人	308	171,248,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	286	158,444,000		
日本リテールファンド投資法人	557	121,760,200		



オリックス不動産投資法人	506	77,266,200	
日本プライムリアルティ投資法人	190	77,995,000	
プレミア投資法人	287	33,435,500	
東急リアル・エステート投資法人	213	30,970,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	42	17,997,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	600	92,340,000	
森トラスト総合リート投資法人	288	58,723,200	
インヴィンシブル投資法人	697	46,002,000	
フロンティア不動産投資法人	108	50,706,000	
平和不動産リート投資法人	217	17,837,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	192	43,161,600	
福岡リート投資法人	163	32,176,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	88	46,552,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	222	23,643,000	
いちごオフィスリート投資法人	309	25,863,300	
大和証券オフィス投資法人	106	63,176,000	
阪急リート投資法人	130	16,159,000	
スターツプロシード投資法人	38	6,338,400	
トップリート投資法人	38	16,891,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	163	39,331,900	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	686	60,848,200	
日本賃貸住宅投資法人	358	28,890,600	
ジャパンエクセレント投資法人	276	35,714,400	
合計	11,087.15	2,215,199,265	

(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。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## グローバル・ナビ

(平成27年12月30日現在)

資産総額	196,002,647円
負債総額	123,262円
純資産総額( - )	195,879,385円
発行済口数	174,479,430口
1口当たり純資産額( / )	1.1227円
(1万口当たり純資産額)	(11,227円)

## (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産総額	12,707,988,525円
負債総額	51,952,270円
純資産総額( - )	12,656,036,255円
発行済口数	6,622,408,190口
1口当たり純資産額( / )	1.9111円
(1万口当たり純資産額)	(19,111円)

## (参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産総額	11,305,291,884円
負債総額	28,287円
純資産総額( - )	11,305,263,597円
発行済口数	5,828,445,305口
1口当たり純資産額( / )	1.9397円
(1万口当たり純資産額)	(19,397円)

## (参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

資産総額	16,231,871,811円
負債総額	172,927,300円

純資産総額（ - ）	16,058,944,511円
発行済口数	13,101,171,319口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2258円
（1万口当たり純資産額）	（12,258円）

## （参考）海外国債マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産総額	38,548,651,718円
負債総額	145,275,401円
純資産総額（ - ）	38,403,376,317円
発行済口数	16,689,498,726口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3011円
（1万口当たり純資産額）	（23,011円）

## （参考）新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

（平成27年12月30日現在）

資産総額	15,873,388,371円
負債総額	308,345,610円
純資産総額（ - ）	15,565,042,761円
発行済口数	11,749,228,497口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3248円
（1万口当たり純資産額）	（13,248円）

## （参考）グローバル高金利通貨マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産総額	8,534,783,791円
負債総額	36,559円
純資産総額（ - ）	8,534,747,232円
発行済口数	8,115,352,748口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0517円
（1万口当たり純資産額）	（10,517円）

## （参考）新光J-REITマザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産総額	2,420,039,600円
------	----------------

負債総額	33,177,721円
純資産総額（ - ）	2,386,861,879円
発行済口数	1,537,973,032口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5520円
（1万口当たり純資産額）	（15,520円）

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成27年12月30日現在）

資産総額	961,995,711円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	961,995,711円
発行済口数	625,999,930口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5367円
（1万口当たり純資産額）	（15,367円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

##### （1）投資信託受益証券の名義書換等

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

##### （2）受益者等名簿

該当事項はありません。

##### （3）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### （4）受益権の譲渡

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

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

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

断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 償還金

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

(8) 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### a．資本金の額（平成27年12月末現在）

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

直近5ヵ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

###### b．委託会社の機構

（イ）株主総会において、15名以内の取締役が選任されます。

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

取締役の任期は、就任後1年内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。

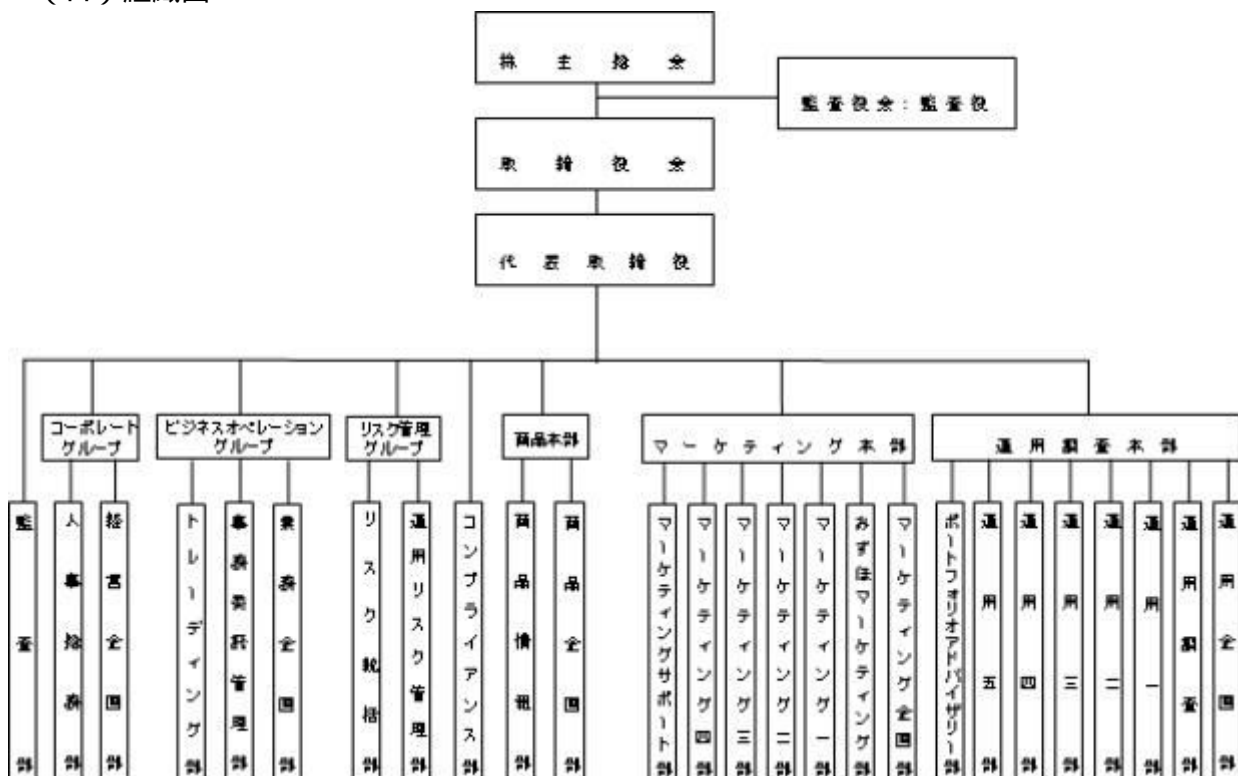
取締役会の決議により、取締役の中から取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

取締役会の決議をもって代表取締役3名以内を決定します。

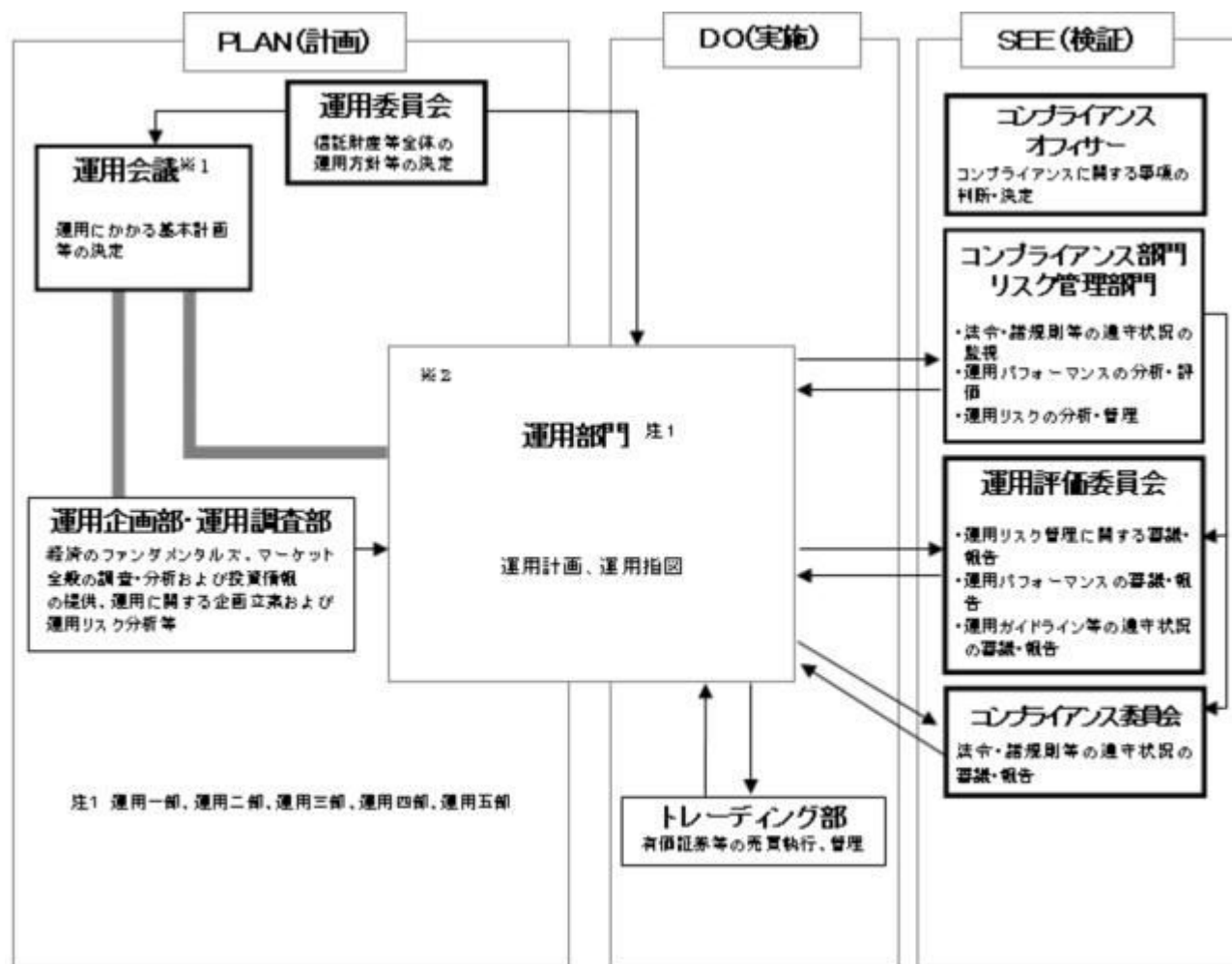
代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

###### （ロ）組織図



###### （ハ）投資運用の意思決定機構



実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図の承認は各々の上位職者が行います。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は以下のとおりです。  
 （平成27年12月30日現在）

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	332	4,334,906
株式投資信託（合計）	304	3,539,661
単位型	62	226,442
追加型	242	3,313,218
公社債投資信託（合計）	28	795,245
単位型	1	2,488
追加型	27	792,756

## 3【委託会社等の経理状況】

### 1．財務諸表の作成方法について



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

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

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

## 2. 監査証明について

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

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

### 1. 財務諸表

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,492,111	13,427,042
有価証券	3,291,156	3,200,000
貯蔵品	5,188	5,117
立替金	15,778	23,184
前払金	38,614	64,821
前払費用	16,530	18,242
未収入金	-	872
未収委託者報酬	2,654,090	3,187,770
未収運用受託報酬	117,049	99,054
未収収益	6,509	6,338
繰延税金資産	283,616	372,215
流動資産合計	19,920,646	20,404,659
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 12,380	2 12,687
構築物（純額）	2 1,650	2 1,444
器具・備品（純額）	2 99,960	2 86,688
リース資産（純額）	2 340	-
有形固定資産合計	114,332	100,820

無形固定資産		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	74,851	85,517
ソフトウェア仮勘定	11,885	669
無形固定資産合計	86,827	86,278
投資その他の資産		
投資有価証券	3,213,218	5,101,854
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,152	124,246
長期繰延税金資産	63,925	-
前払年金費用	374,562	396,211
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	3,859,590	5,706,044
固定資産合計	4,060,749	5,893,143
資産合計	23,981,396	26,297,802

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	21,303	17,893
リース債務	810	345
未払金		
未払収益分配金	177	160
未払償還金	10,100	5,083
未払手数料	1 1,296,830	1 1,558,682
その他未払金	513,148	952,018
未払金合計	1,820,257	2,515,945
未払費用	548,430	722,806
未払法人税等	1,462,380	1,222,883
賞与引当金	362,800	451,000
役員賞与引当金	44,200	66,000
外国税支払損失引当金	-	184,111
訴訟損失引当金	-	30,000
流動負債合計	4,260,181	5,210,985
固定負債		
繰延税金負債	-	89,752
長期リース債務	345	-
退職給付引当金	172,959	155,806
役員退職慰労引当金	31,708	39,333
執行役員退職慰労引当金	102,083	63,916
固定負債合計	307,096	348,809
負債合計	4,567,278	5,559,794

純資産の部		
株主資本		
資本金	4,524,300	4,524,300
資本剰余金		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		
利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	2,889,165	3,981,245
利益剰余金合計	12,149,658	13,241,738
自己株式	72,415	72,415
株主資本合計	19,363,242	20,455,322
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	50,874	282,685
評価・換算差額等合計	50,874	282,685
純資産合計	19,414,117	20,738,008
負債純資産合計	23,981,396	26,297,802

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)		(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		29,107,010		35,876,795
運用受託報酬		261,777		238,412
営業収益合計		29,368,787		36,115,207
営業費用				
支払手数料	1	15,428,327	1	18,252,669
広告宣伝費		336,593		456,430
公告費		2,919		548
調査費				
調査費		339,210		623,792
委託調査費		4,188,805		5,966,340
図書費		4,862		5,254
調査費合計		4,532,878		6,595,388
委託計算費		1,151,067		1,352,318
営業雑経費				
通信費		37,016		32,335
印刷費		160,606		103,093

協会費	14,992	18,150
諸会費	3,153	3,300
その他	27,521	41,594
営業雑経費合計	243,290	198,475
営業費用合計	21,695,077	26,855,830
一般管理費		
給料		
役員報酬	89,886	96,445
給料・手当	1,326,658	1,368,552
賞与	332,688	336,076
給料合計	1,749,233	1,801,073
交際費	9,349	11,426
寄付金	3,066	3,198
旅費交通費	78,321	100,386
租税公課	65,510	68,508
不動産賃借料	205,792	206,753
賞与引当金繰入	362,800	451,000
役員賞与引当金繰入	44,200	66,000
役員退職慰労引当金繰入	39,756	24,930
退職給付費用	182,850	191,900
減価償却費	63,615	70,676
諸経費	585,445	573,824
一般管理費合計	3,389,942	3,569,678
営業利益	4,283,768	5,689,698

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	143,049	163,006
有価証券利息	6,052	3,853
受取利息	14,495	10,741
時効成立分配金・償還金	4,450	5,080
雑益	20,588	487
営業外収益合計	188,635	183,170
営業外費用		
支払利息	59	26
時効成立後支払分配金・償還金	1,557	3,083
雑損	8,673	3,261
営業外費用合計	10,290	6,371
経常利益	4,462,113	5,866,496
特別利益		

投資有価証券売却益	158,386	68,179
特別利益合計	158,386	68,179
特別損失		
固定資産除却損	3,210	3,177
ゴルフ会員権売却損	2,795	-
投資有価証券売却損	42,388	54,613
投資有価証券評価損	10,974	10,952
外国税支払損失引当金繰入額	-	184,111
訴訟損失引当金繰入額	-	30,000
その他特別損失	-	22,227
特別損失合計	59,368	305,082
税引前当期純利益	4,561,131	5,629,593
法人税、住民税及び事業税	1,905,519	2,111,379
法人税等調整額	113,958	66,999
法人税等合計	1,791,560	2,044,380
当期純利益	2,769,571	3,585,212

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本			株 主	評価・換算差額等
	利益剰余金				

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

当事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金	
				別途 積立金	繰越 利益 剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,889,165
会計方針の変更による 累積的影響額					46,276
会計方針の変更を反映した 当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	2,935,441
当期変動額					
別途積立金取崩					
剰余金の配当					2,539,409
当期純利益					3,585,212
自己株式の取得					
自己株式の処分					
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	1,045,803
当期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245

	株主資本		株主	評価・換算差額等
	利益剰余金			

	利益 剰余金 合計	自己 株式	資本 合計	その他有価証 券評価差額金	純資産合計
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117
会計方針の変更による 累積的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した当 期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
別途積立金取崩			-		-
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
自己株式の取得			-		-
自己株式の処分			-		-
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 関連会社株式

総平均法による原価法

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

#### (2) 無形固定資産

定額法。

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

#### (3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

#### (2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

#### (3) 外国税支払損失引当金

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

#### (4) 訴訟損失引当金

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

#### (5) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

##### 退職給付見込額の期間帰属方法

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

##### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

#### (6) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

#### (7) 執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

### 4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### (1) 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

#### (会計方針の変更)

##### (退職給付に関する会計基準等の適用)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の算定方法を退職給付の支払見込期間ごとに設定された複数の割引率を使用する方法に変更しました。



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

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

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

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

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

### (損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,823,250	-	-	1,823,250

2. 自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	9,386	-	-	9,386

3. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年12月19日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成25年11月15日	平成25年12月20日

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

### 1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	-	1,823,250

### 2．自己株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	9,386	-	-	9,386

### 3．配当に関する事項

#### (1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

#### (リース取引関係)

ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

##### (1)リース資産の内容

有形固定資産

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

##### (2)リース資産の減価償却方法

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

#### (金融商品関係)

##### 1．金融商品の状況に関する事項

###### (1)金融商品に対する取組方針

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

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

###### (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

###### (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

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

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

#### 流動性リスクの管理

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	13,492,111	13,492,111	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,305,322	6,305,322	-
(3) 未収委託者報酬	2,654,090	2,654,090	-

当事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	13,427,042	13,427,042	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### (1) 現金及び預金

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

#### (2) 有価証券及び投資有価証券

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

## (3) 未収委託者報酬

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

## (注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品 (単位：千円)

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

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

## (注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 前事業年度（平成26年3月31日）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,491,981	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有 価証券 その他有価証券	3,291,156	380,080	1,261,941	269,692
(3) 未収委託者報酬	2,654,090	-	-	-

## 当事業年度（平成27年3月31日）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有 価証券 その他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

## (有価証券関係)

## 1. 関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

## 前事業年度（平成26年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券 国債・地方債等	-	-	-

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

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

#### 当事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

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

#### 3．売却したその他有価証券

##### 前事業年度（平成26年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
国債・地方債等	-	-	-

社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	1,209,919	158,386	42,388
合計	1,209,919	158,386	42,388

## 当事業年度（平成27年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	503,565	68,179	54,613
合計	503,565	68,179	54,613

## 4．減損処理を行った有価証券

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

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

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

## （退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

## 2．確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額(前事業年度30,333千円、当事業年度28,168千円)については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

## (5)年金資産に関する事項

前事業年度	当事業年度
-------	-------

(平成26年3月31日)

(平成27年3月31日)

## 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

株式	41.3%	39.4%
債券	25.6%	27.3%
共同運用資産	18.3%	21.0%
生命保険一般勘定	11.2%	10.6%
現金及び預金	3.3%	1.4%
合計	100%	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

前事業年度	当事業年度
(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)



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

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

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

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については、繰延税金資産及び繰延税金負債を計算する法定実効税率の変更等を行っております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が19,637千円減少し、その他有価証券評価差額金が14,105千円、法人税等調整額が33,742千円、それぞれ増加しております。

## (セグメント情報等)

### セグメント情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）及び

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）及び

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

### 1．製品及びサービスごとの情報

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

### 2．地域ごとの情報

#### （1）営業収益

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

#### （2）有形固定資産

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

### 3．主要な顧客ごとの情報

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

### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

### 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

### 関連当事者情報

#### 1．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

## 当事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等  
前事業年度(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロバティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,003	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払  ハウジングサービス料支払	105,424  16,824	その他未払金  その他未払金	8,030  1,472

							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,230
							IT関連業務支援	4,145	その他未払金	1,648

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

（注）1．上記（ア）～（イ）の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

（注）2．取引条件及び取引条件の決定方法等

- （1）代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- （2）事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
- （3）計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

## みずほ証券株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

	前事業年度 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	当事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
1株当たり純資産額	10,703円18銭	11,433円05銭
1株当たり当期純利益金額	1,526円89銭	1,976円56銭

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

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

	前事業年度 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	当事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益金額（千円）	2,769,571	3,585,212
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	2,769,571	3,585,212
期中平均株式数（千株）	1,813	1,813

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 2．中間財務諸表

## （1）中間貸借対照表

（単位：千円）

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

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

(単位：千円)

当中間会計期間

(平成27年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

## 未払金

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

未払法人税等 946,118

未払消費税等 2 221,381

賞与引当金 449,925

役員賞与引当金 22,000

外国税支払損失引当金 139,578

訴訟損失引当金 30,000

その他 758,645

流動負債合計 4,634,840

## 固定負債

退職給付引当金 153,718

役員退職慰労引当金 37,333

執行役員退職慰労引当金 69,916

固定負債合計 260,968

## 負債合計

4,895,808

## 純資産の部

## 株主資本

資本金 4,524,300

資本剰余金

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

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	
				別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	3,981,245
当中間期変動額					
中間純利益					2,095,462
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	-	2,095,462
当中間期末残高	4,524,300	2,761,700	360,493	8,900,000	6,076,707

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自己株式	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	
	利益剰余金合計				
当期首残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当中間期変動額					
中間純利益	2,095,462		2,095,462		2,095,462
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）				284,475	284,475
当中間期変動額合計	2,095,462	-	2,095,462	284,475	1,810,986
当中間期末残高	15,337,200	72,415	22,550,784	1,790	22,548,994

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

関連会社株式



総平均法による原価法

    その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物            8～18年

構築物          20年

器具備品        2～20年

### (2) 無形固定資産

定額法。

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

## 3．引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 役員賞与引当金

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

### (3) 外国税支払損失引当金

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

### (4) 訴訟損失引当金

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

### (5) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

### (6) 役員退職慰労引当金

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

す。

#### (7) 執行役員退職慰労引当金

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

#### 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

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

#### (追加情報)

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

#### (中間貸借対照表関係)

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

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

##### 2. 消費税等の取扱い

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

#### (中間損益計算書関係)

##### 1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

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

#### (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

##### 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

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

## 3．配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

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

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

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 有価証券及び投資有価証券

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

## (3) 未収委託者報酬

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

## (4) 未払手数料

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

## (注) 2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

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

## （有価証券関係）

当中間会計期間（平成27年9月30日）

## 1．関連会社株式

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

## 2．その他有価証券

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

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

## （デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## （1）営業収益

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

## （2）有形固定資産

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

### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

#### （1株当たり情報）

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

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

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

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

#### (重要な後発事象)

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

#### 株主配当に関する決議事項

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### a．定款の変更

委託者の定款につき、下記の変更を行いました。

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

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

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

た。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a．資本金の額

平成27年3月末現在、342,037百万円

b．事業の内容

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

(2) みずほ信託銀行株式会社（「投資顧問会社」）

a．資本金の額

平成27年3月末現在、247,369百万円

b．事業の内容

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

(3) 販売会社

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

販売会社一覧表

（資本金の額は平成27年3月末現在）

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
大山日ノ丸証券株式会社	215	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
みずほ証券株式会社	125,167	同上

### 2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

(1) 委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理

(2) 投資信託財産の計算

(3) その他上記業務に付随する一切の業務

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

「販売会社」は以下の業務を行います。

(1) 募集・販売の取り扱い

(2) 受益者に対する一部解約事務

(3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い

(4) 受益者に対する収益分配金の再投資

(5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付

(6) 受益者に対する運用報告書の交付

(7) 所得税および地方税の源泉徴収

(8) その他上記業務に付随する一切の業務

### 3【資本関係】

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。

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

#### <再信託受託会社の概要>

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

### 第3【その他】

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



## 独立監査人の監査報告書

平成27年6月12日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第55期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光投信株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年1月26日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・ナビの平成26年12月16日から平成27年12月15日までの計算期間の財務諸表、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、グローバル・ナビの平成27年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月1日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

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

## 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。