

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年9月14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。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、平成28年 3月15日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するため提出するものです。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。また、原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」に「中間財務諸表」の記載事項が追加され、2 ファンドの現況が更新されます。

## 第一部【証券情報】

## (4)【発行(売出)価格】

## &lt;訂正前&gt;

(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。

## &lt;訂正後&gt;

(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

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】

## &lt;訂正前&gt;

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はいいです。
- 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です。

#### <訂正後>

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」といいです。）（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

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です。
- 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です。

## (6) 【申込単位】

## &lt;訂正前&gt;

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/>

## &lt;訂正後&gt;

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

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/>

## (8) 【申込取扱場所】

## &lt;訂正前&gt;

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/>

## &lt;訂正後&gt;

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

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/>

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### b. ファンドの特色

<訂正前>

(略)

### (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ヵ国）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。

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

## (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9月14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9月14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9月14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。

(略)

## (3) 【ファンドの仕組み】

## b. 委託会社の概況

&lt;更新後&gt;

## (イ) 資本金の額(平成28年6月末現在)

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,813,864株

## (ロ) 委託会社の沿革

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

## (ハ) 大株主の状況

(平成28年6月末現在)

株主名	住所	持株数	持株比率
みずほ証券株式会社	東京都千代田区大手町1-5-1	1,396,362株	76.98%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町1-5-5	277,134	15.27
株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング	東京都中央区日本橋1-17-10	137,200	7.56

## 3 【投資リスク】

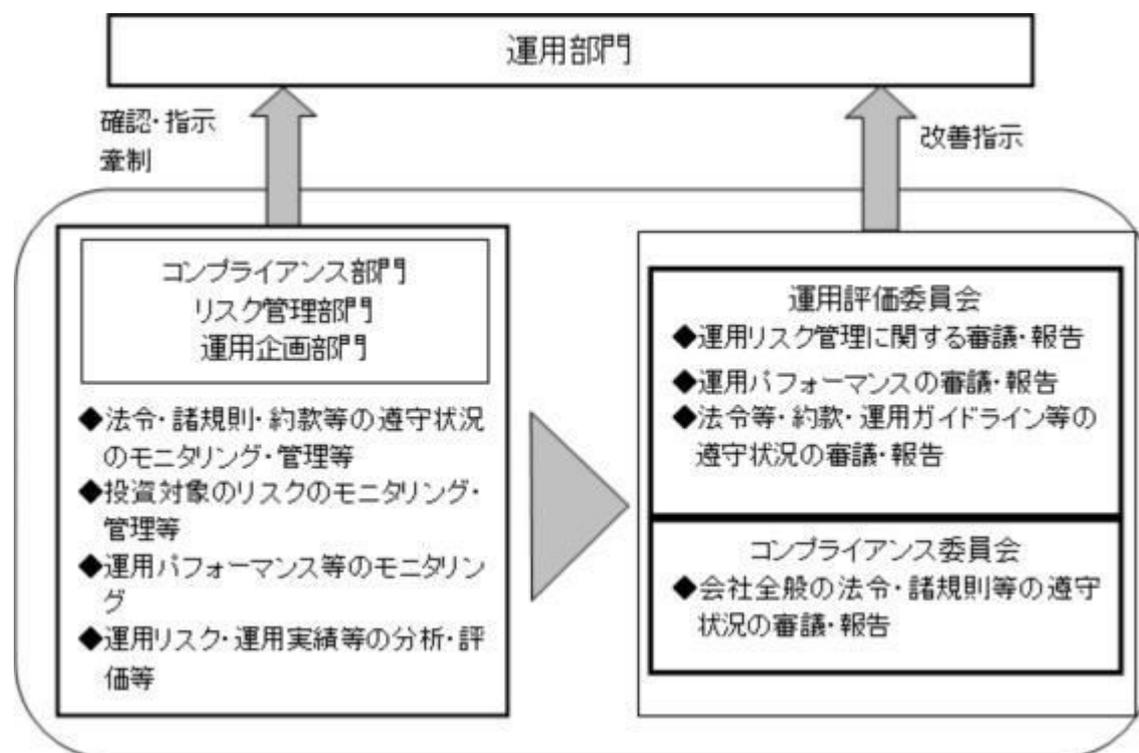
## (2) リスク管理体制

&lt;更新後&gt;

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

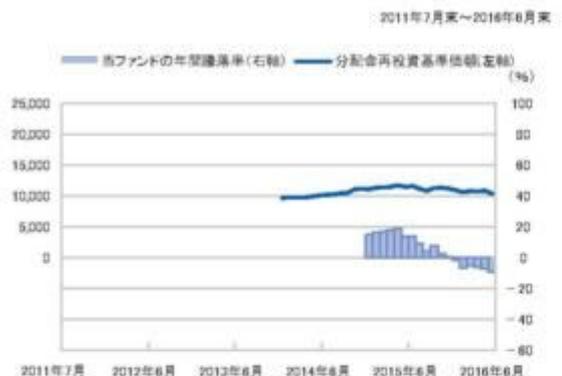
：投資信託財産の運用リスクの管理およびその管理の現状・適正性を把握し、管理方針を協議、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。



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



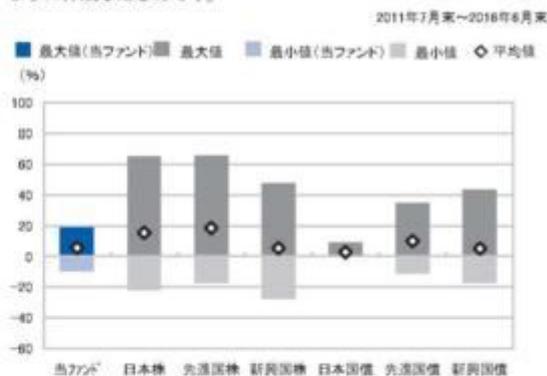
\*分配金再投資基準価額は、設定時を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

\*年間騰落率は、2015年1月から2016年6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。

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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	18.7	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△9.5	△22.0	△17.5	△27.4	0.4	△11.2	△17.4
平均値	5.5	15.5	18.4	5.4	2.7	10.0	5.2

\*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7月から2016年6月の5年間(当ファンドは2015年1月から2016年6月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

\*決算日に対応した数値とは異なります。

\*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

#### 各資産クラスの指数

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

#### 各資産クラスの騰落率について

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

#### 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

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

#### MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

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

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

#### NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

#### シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

## &lt;訂正前&gt;

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です。
- 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です。

## &lt;訂正後&gt;

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

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。

#### （５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

##### a．個人の受益者の場合

（略）

##### （八）損益通算について

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合>

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

（略）

上記は平成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。

<訂正後>

##### a．個人の受益者の場合

（略）

##### （八）損益通算について

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

渡損と損益通算ができます。

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

（略）

上記は平成28年6月末現在のものです。税法が改正された場合等は、上記「（5）課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### （1）【投資状況】

#### グローバル・ナビ

（平成28年 6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	170,952,240	94.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,099,661	5.05
純資産総額		180,051,901	100.00

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

#### （参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

（平成28年 6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	10,781,601,390	96.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		333,801,247	3.00
純資産総額		11,115,402,637	100.00

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

#### （参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	4,629,858,489	50.44
	カナダ	295,523,023	3.21
	モーリシャス	614,336	0.00
	パナマ	4,864,721	0.05
	ドイツ	263,322,478	2.86
	イタリア	54,111,683	0.58
	フランス	271,249,150	2.95
	オランダ	130,430,853	1.42
	スペイン	91,439,670	0.99
	ベルギー	45,598,280	0.49
	オーストリア	5,963,796	0.06
	ルクセンブルグ	8,472,983	0.09
	フィンランド	31,489,114	0.34
	アイルランド	132,914,598	1.44
	ポルトガル	5,023,404	0.05
	イギリス	596,605,525	6.49
	スイス	351,666,417	3.83
	スウェーデン	97,459,195	1.06
	ノルウェー	21,616,257	0.23
	デンマーク	69,039,503	0.75
	ケイマン諸島	19,676,904	0.21
	リベリア	3,448,310	0.03
	オーストラリア	204,605,942	2.22
	バミューダ諸島	29,857,960	0.32
	ニュージーランド	6,858,090	0.07
	パプアニューギニア	1,786,910	0.01
	香港	79,878,570	0.87
	シンガポール	59,305,751	0.64
	イスラエル	24,289,762	0.26
	キュラソー	28,529,787	0.31
	ジャージー	33,721,536	0.36
	英ヴァージン諸島	2,780,459	0.03
マン島	1,131,250	0.01	
	小計	7,603,134,706	82.83
投資信託受益証券	シンガポール	850,551	0.00
投資証券	アメリカ	177,257,386	1.93
	カナダ	2,047,510	0.02
	フランス	12,227,705	0.13
	イギリス	8,962,750	0.09
	オーストラリア	22,069,065	0.24
	香港	5,084,184	0.05

	シンガポール	4,456,490	0.04
	小計	232,105,090	2.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,342,754,705	14.62
純資産総額		9,178,845,052	100.00

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

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

(平成28年 6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	11,542,967,800	79.93
地方債証券	日本	1,079,460,300	7.47
特殊債券	日本	1,133,189,000	7.84
社債券	日本	635,740,000	4.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		48,796,509	0.33
純資産総額		14,440,153,609	100.00

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

(参考) 海外国債マザーファンド

(平成28年 6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	13,415,414,351	43.12
	カナダ	330,270,244	1.06
	ドイツ	2,900,781,692	9.32
	イタリア	5,751,027,028	18.48
	フランス	5,467,720,747	17.57
	イギリス	2,793,654,983	8.98
	小計	30,658,869,045	98.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		450,587,658	1.44
純資産総額		31,109,456,703	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28年 6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	6,114,755,812	42.43
	カナダ	297,689,074	2.06

## 訂正有価証券届出書（内国投資信託受益証券）

メキシコ	129,662,709	0.89
ドイツ	1,064,231,945	7.38
イタリア	1,384,851,666	9.61
フランス	1,423,162,364	9.87
オランダ	351,692,626	2.44
スペイン	774,053,109	5.37
ベルギー	378,027,492	2.62
オーストリア	226,912,011	1.57
フィンランド	85,626,062	0.59
アイルランド	111,298,039	0.77
イギリス	1,127,191,178	7.82
スウェーデン	72,707,619	0.50
ノルウェー	37,280,738	0.25
デンマーク	98,988,494	0.68
ポーランド	81,102,107	0.56
オーストラリア	272,777,318	1.89
シンガポール	54,055,299	0.37
南アフリカ	61,530,720	0.42
小計	14,147,596,382	98.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	261,854,250	1.81
純資産総額	14,409,450,632	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28年 6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	6,961,124,060	96.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		255,169,182	3.53
純資産総額		7,216,293,242	100.00

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

## (参考) 新光J-REITマザーファンド

(平成28年 6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	3,189,192,800	98.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		52,511,411	1.61
純資産総額		3,241,704,211	100.00

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

(参考) 新光米国REITマザーファンド

(平成28年 6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	827,107,061	97.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		21,375,466	2.51
純資産総額		848,482,527	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28年 6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	23,358,083	1.8259	42,650,423	1.5561	36,347,512	20.18
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	27,847,326	1.2228	34,051,711	1.3031	36,287,850	20.15
3	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	16,804,342	2.3278	39,117,148	2.0996	35,282,396	19.59
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	16,208,887	1.8566	30,093,550	1.6327	26,464,249	14.69
5	日本	親投資信託 受益証券	新光J-REITマザーファンド	11,056,359	1.5977	17,664,745	1.6550	18,298,274	10.16
6	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)	13,097,240	1.3354	17,490,055	1.3951	18,271,959	10.14

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

ロ. 種類別投資比率

(平成28年 6月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.94
合計	94.94

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成28年 6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	73,200	6,703.20	490,674,382	5,052.00	369,806,400	3.32
2	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	44,900	4,727.95	212,284,973	4,800.00	215,520,000	1.93
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	465,900	665.29	309,959,612	455.90	212,403,810	1.91
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	32,900	5,500.53	180,967,594	5,789.00	190,458,100	1.71
5	日本	株式	KDDI	情報・通信業	57,400	2,870.99	164,795,238	3,113.00	178,686,200	1.60
6	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	39,000	4,119.02	160,641,968	4,103.00	160,017,000	1.43
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	52,900	3,434.44	181,682,367	2,572.50	136,085,250	1.22
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	46,500	4,106.30	190,943,056	2,926.00	136,059,000	1.22
9	日本	株式	ソニー	電気機器	41,500	2,616.22	108,573,300	2,988.00	124,002,000	1.11
10	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	823,500	219.06	180,403,311	148.30	122,125,050	1.09
11	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	43,400	2,458.51	106,699,680	2,766.50	120,066,100	1.08
12	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	69,000	1,608.93	111,016,715	1,600.00	110,400,000	0.99
13	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	24,500	5,517.34	135,174,868	4,424.00	108,388,000	0.97
14	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	24,300	5,014.68	121,856,868	4,281.00	104,028,300	0.93
15	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	10,800	10,370.07	111,996,848	9,433.00	101,876,400	0.91
16	日本	株式	ファナック	電気機器	6,000	18,509.39	111,056,398	16,535.00	99,210,000	0.89
17	日本	株式	花王	化学	16,600	5,696.97	94,569,840	5,929.00	98,421,400	0.88
18	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	5,300	20,232.87	107,234,240	18,125.00	96,062,500	0.86
19	日本	株式	キヤノン	電気機器	31,700	3,284.53	104,119,795	2,912.50	92,326,250	0.83
20	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	57,316.92	74,512,000	69,140.00	89,882,000	0.80
21	日本	株式	三菱地所	不動産業	43,000	2,297.45	98,790,480	1,873.00	80,539,000	0.72
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	23,500	4,111.64	96,623,756	3,367.00	79,124,500	0.71
23	日本	株式	三菱商事	卸売業	43,600	1,850.26	80,671,760	1,788.00	77,956,800	0.70
24	日本	株式	三菱電機	電気機器	63,000	1,119.20	70,509,730	1,208.00	76,104,000	0.68
25	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	82,100	1,112.94	91,372,488	917.90	75,359,590	0.67
26	日本	株式	ダイキン工業	機械	8,600	7,775.42	66,868,620	8,514.00	73,220,400	0.65
27	日本	株式	三井不動産	不動産業	31,000	2,794.00	86,614,000	2,331.50	72,276,500	0.65
28	日本	株式	村田製作所	電気機器	6,200	14,307.28	88,705,140	11,380.00	70,556,000	0.63
29	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	20,800	3,947.72	82,112,748	3,269.00	67,995,200	0.61
30	日本	株式	信越化学工業	化学	11,100	6,138.64	68,138,954	5,962.00	66,178,200	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28年 6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	0.10

鉱業	0.28
建設業	3.27
食料品	5.25
繊維製品	0.70
パルプ・紙	0.25
化学	6.06
医薬品	5.82
石油・石炭製品	0.49
ゴム製品	0.81
ガラス・土石製品	0.85
鉄鋼	1.13
非鉄金属	0.80
金属製品	0.59
機械	4.54
電気機器	11.47
輸送用機器	8.75
精密機器	1.55
その他製品	1.56
電気・ガス業	1.93
陸運業	4.65
海運業	0.21
空運業	0.62
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	8.52
卸売業	4.02
小売業	4.96
銀行業	6.92
証券、商品先物取引業	0.88
保険業	2.08
その他金融業	1.18
不動産業	2.64
サービス業	3.78
合計	96.99

（参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成28年 6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	14,189	12,407.85	176,055,107	9,714.7039	137,841,935	1.50

2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	10,627	8,433.47	89,622,534	9,515.0586	101,116,528	1.10
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	19,228	5,573.60	107,169,289	5,201.0714	100,006,201	1.08
4	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,061	10,377.44	73,275,135	12,280.2502	86,710,847	0.94
5	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,024	67,456.47	69,075,432	73,642.3964	75,409,814	0.82
6	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO (US)	資本財	23,877	3,061.57	73,101,166	3,143.9004	75,066,912	0.81
7	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	9,156	7,859.23	71,959,165	7,853.9825	71,911,064	0.78
8	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	5,873	10,958.88	64,361,536	11,748.2055	68,997,211	0.75
9	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	15,741	3,379.56	53,197,723	4,377.7913	68,910,814	0.75
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	6,921	7,759.41	53,702,905	8,635.1781	59,764,068	0.65
11	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	12,342	5,708.41	70,453,291	4,833.6827	59,657,312	0.64
12	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	9,392	6,935.10	65,134,505	6,298.0919	59,151,680	0.64
13	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	10,425	4,661.82	48,599,504	5,666.2245	59,070,391	0.64
14	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	15,798	3,462.92	54,707,234	3,602.8790	56,918,284	0.62
15	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	796	74,598.42	59,380,350	70,401.7600	56,039,801	0.61
16	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	6,535	9,319.70	60,904,298	8,379.3325	54,758,938	0.59
17	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	2,018	28,022.16	56,548,737	26,708.7938	53,898,346	0.58
18	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	749	77,673.38	58,177,362	71,542.0026	53,584,960	0.58
19	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	4,819	9,500.65	45,783,638	10,642.9522	51,288,387	0.55
20	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	10,525	4,274.88	44,993,127	4,573.3203	48,134,197	0.52
21	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	3,047	13,789.93	42,017,947	14,625.5690	44,564,109	0.48
22	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	3,245	12,812.29	41,575,898	13,107.6468	42,534,314	0.46
23	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	7,102	5,581.83	39,642,216	5,871.0154	41,695,952	0.45
24	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	6,226	6,315.58	39,320,843	6,580.0653	40,967,487	0.44
25	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	食品・飲料・タバコ	3,965	8,773.07	34,785,252	10,148.9841	40,240,722	0.43
26	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	12,089	3,432.04	41,490,034	3,285.9162	39,723,442	0.43
27	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	3,966	11,980.78	47,515,782	9,980.2118	39,581,520	0.43
28	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	3,699	10,175.74	37,640,065	10,612.0792	39,254,081	0.42

29	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	4,911	8,031.09	39,440,714	7,897.3133	38,783,706	0.42
30	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	12,877	2,900.00	37,343,349	2,908.2366	37,449,363	0.40

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成28年6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28年6月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.38
		素材	4.05
		資本財	6.19
		商業・専門サービス	0.84
		運輸	1.59
		自動車・自動車部品	1.21
		耐久消費財・アパレル	1.54
		消費者サービス	1.57
		メディア	2.40
		小売	3.39
		食品・生活必需品小売り	1.86
		食品・飲料・タバコ	5.90
		家庭用品・パーソナル用品	2.03
		ヘルスケア機器・サービス	3.40
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.28
		銀行	6.71
		各種金融	3.18
		保険	3.43
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	7.26
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.95		
電気通信サービス	2.92		
公益事業	3.22		
半導体・半導体製造装置	1.81		
投資信託受益証券			0.00
投資証券			2.52
合計			85.37

(参考)新光日本債券インデックスマザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成28年 6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313回利付 国債(10年)	170,000,000	106.69	181,379,400	107.64	182,993,100	1.3000	2021.03.20	1.26
2	日本	国債証券	第315回利付 国債(10年)	170,000,000	106.48	181,031,800	107.55	182,841,800	1.2000	2021.06.20	1.26
3	日本	国債証券	第308回利付 国債(10年)	170,000,000	105.83	179,914,500	106.41	180,903,800	1.3000	2020.06.20	1.25
4	日本	国債証券	第323回利付 国債(10年)	160,000,000	105.42	168,672,000	107.41	171,862,400	0.9000	2022.06.20	1.19
5	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	160,000,000	103.25	165,212,500	107.34	171,744,000	0.6000	2024.06.20	1.18
6	日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	160,000,000	105.97	169,556,000	106.41	170,267,200	1.4000	2020.03.20	1.17
7	日本	国債証券	第335回利付 国債(10年)	150,000,000	102.76	154,154,700	106.69	160,038,000	0.5000	2024.09.20	1.10
8	日本	国債証券	第341回利付 国債(10年)	150,000,000	102.52	153,794,400	105.38	158,071,500	0.3000	2025.12.20	1.09
9	日本	国債証券	第342回利付 国債(10年)	150,000,000	101.95	152,928,000	103.43	155,146,500	0.1000	2026.03.20	1.07
10	日本	国債証券	第124回利付 国債(5年)	150,000,000	100.34	150,515,600	101.64	152,466,000	0.1000	2020.06.20	1.05
11	日本	国債証券	第123回利付 国債(5年)	150,000,000	100.34	150,519,800	101.51	152,278,500	0.1000	2020.03.20	1.05
12	日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	140,000,000	105.93	148,306,500	106.83	149,566,200	1.2000	2020.12.20	1.03
13	日本	国債証券	第340回利付 国債(10年)	140,000,000	100.93	141,315,600	106.28	148,792,000	0.4000	2025.09.20	1.03
14	日本	国債証券	第338回利付 国債(10年)	140,000,000	101.18	141,657,500	106.11	148,563,800	0.4000	2025.03.20	1.02
15	日本	国債証券	第107回利付 国債(5年)	140,000,000	100.42	140,595,800	100.74	141,038,800	0.2000	2017.12.20	0.97
16	日本	国債証券	第290回利付 国債(10年)	130,000,000	103.29	134,277,000	102.91	133,785,600	1.4000	2018.03.20	0.92
17	日本	国債証券	第126回利付 国債(5年)	130,000,000	101.19	131,547,600	101.87	132,441,400	0.1000	2020.12.20	0.91
18	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	127.93	127,930,000	2.1000	2029.12.28	0.88
19	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	127.50	127,500,000	2.2200	2029.03.19	0.88
20	日本	国債証券	第310回利付 国債(10年)	120,000,000	104.70	125,640,600	105.57	126,684,000	1.0000	2020.09.20	0.87
21	日本	国債証券	第303回利付 国債(10年)	120,000,000	105.33	126,399,000	105.51	126,619,200	1.4000	2019.09.20	0.87
22	日本	国債証券	第127回利付 国債(5年)	120,000,000	101.55	121,869,500	101.98	122,379,600	0.1000	2021.03.20	0.84
23	日本	国債証券	第125回利付 国債(5年)	120,000,000	100.30	120,362,800	101.77	122,126,400	0.1000	2020.09.20	0.84
24	日本	国債証券	第332回利付 国債(10年)	110,000,000	103.89	114,288,400	106.99	117,692,300	0.6000	2023.12.20	0.81
25	日本	社債券	第36回東日本 旅客鉄道社債	100,000,000	114.96	114,960,000	117.45	117,450,000	2.1100	2024.12.20	0.81
26	日本	国債証券	第301回利付 国債(10年)	110,000,000	105.38	115,923,500	105.39	115,933,400	1.5000	2019.06.20	0.80
27	日本	国債証券	第120回利付 国債(5年)	110,000,000	100.73	110,805,200	101.63	111,801,800	0.2000	2019.09.20	0.77
28	日本	特殊債券	第49回政府保証 地方公共団体 金融機構債券	100,000,000	104.97	104,970,000	106.13	106,130,000	0.8820	2023.06.16	0.73

29	日本	国債証券	第123回利付 国債(20年)	80,000,000	120.06	96,052,000	132.38	105,905,600	2.1000	2030.12.20	0.73
30	日本	社債券	第4回第一三共 社債	100,000,000	103.63	103,630,000	105.33	105,330,000	0.8460	2023.09.15	0.72

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

#### ロ.種類別投資比率

(平成28年 6月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.93
地方債証券	7.47
特殊債券	7.84
社債券	4.40
合計	99.66

(参考) 海外国債マザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成28年 6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	12,000,000	10,459.82	1,255,179,249	11,083.7285	1,330,047,431	2.3750	2024.08.15	4.27
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,396.52	1,247,583,318	10,988.8584	1,318,663,012	2.2500	2025.11.15	4.23
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,336.62	1,240,394,654	10,983.2305	1,317,987,670	2.2500	2024.11.15	4.23
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,700,000	10,574.00	1,237,158,293	11,182.6187	1,308,366,390	2.5000	2024.05.15	4.20
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,206.14	1,224,737,959	10,877.1046	1,305,252,558	2.1250	2025.05.15	4.19
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,109.28	1,213,114,593	10,772.5866	1,292,710,403	2.0000	2025.02.15	4.15
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,092.40	1,211,088,844	10,765.3507	1,291,842,092	2.0000	2025.08.15	4.15
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,400,000	10,131.24	1,154,961,744	10,418.0295	1,187,655,365	1.6250	2026.02.15	3.81
9	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,800,000	14,758.59	1,003,584,652	15,141.8043	1,029,642,693	4.2500	2023.10.25	3.30
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	10,802.27	972,204,662	11,351.4554	1,021,630,987	2.7500	2023.11.15	3.28
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,100,000	10,790.24	874,010,130	11,365.1231	920,574,973	2.7500	2024.02.15	2.95
12	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,000,000	14,800.69	888,041,599	15,157.8189	909,469,134	3.5000	2026.04.25	2.92
13	イギリス	国債証券	TSY	4,900,000	14,010.33	686,506,403	15,129.5971	741,350,258	2.0000	2025.09.07	2.38
14	イギリス	国債証券	TSY	4,700,000	14,398.86	676,746,836	15,321.4333	720,107,368	2.2500	2023.09.07	2.31
15	イギリス	国債証券	TSY	4,500,000	14,906.44	670,789,948	15,944.8320	717,517,440	2.7500	2024.09.07	2.30
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,900,000	14,363.95	703,833,661	14,562.9908	713,586,553	4.7500	2023.08.01	2.29
17	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,000,000	17,095.58	683,823,420	17,715.5793	708,623,172	6.0000	2025.10.25	2.27
18	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000	14,850.10	697,955,161	15,038.8532	706,826,105	5.0000	2025.03.01	2.27
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,300,000	15,918.51	684,496,033	16,342.8993	702,744,670	5.2500	2029.11.01	2.25

20	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,100,000	12,946.03	660,247,641	13,525.4735	689,799,153	2.2500	2024.05.25	2.21
21	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000	14,203.80	653,375,090	14,398.2693	662,320,388	4.5000	2024.03.01	2.12
22	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,000,000	12,429.61	621,480,871	13,087.3599	654,367,995	1.7500	2024.11.25	2.10
23	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,500,000	11,091.25	610,018,992	11,849.6601	651,731,306	0.5000	2025.05.25	2.09
24	イギリス	国債証券	TSY	3,300,000	17,634.19	581,928,512	18,626.6641	614,679,917	5.0000	2025.03.07	1.97
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000	14,903.30	611,035,347	14,721.9930	603,601,713	4.5000	2026.03.01	1.94
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,900,000	13,563.22	528,965,669	13,801.1534	538,244,986	3.7500	2024.09.01	1.73
27	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,300,000	11,741.23	504,873,191	12,334.6736	530,390,969	1.0000	2025.11.25	1.70
28	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000	12,378.14	495,125,678	12,704.1534	508,166,137	2.5000	2024.12.01	1.63
29	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	2,400,000	18,965.19	455,164,674	20,522.1379	492,531,311	5.5000	2031.01.04	1.58
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,828.06	433,122,462	11,882.0851	475,283,405	3.0000	2045.11.15	1.52

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成28年6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28年6月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.55
合計	98.55

(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28年6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	2,900,000	10,759.04	312,012,267	11,020.2138	319,586,202	2.6250	2020.11.15	2.21
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	10,895.52	250,597,106	10,809.5699	248,620,108	4.2500	2017.11.15	1.72
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,227.64	224,552,838	11,321.7080	226,434,160	3.6250	2020.02.15	1.57
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	10,234.37	225,156,339	10,287.7840	226,331,249	0.5000	2017.07.31	1.57
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	10,355.31	207,106,374	11,083.7285	221,674,570	2.3750	2024.08.15	1.53
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,023.02	220,460,554	11,040.3134	220,806,268	3.7500	2018.11.15	1.53
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	10,758.91	215,178,378	10,844.1412	216,882,824	2.7500	2019.02.15	1.50
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	10,838.69	195,096,457	11,351.4554	204,326,198	2.7500	2023.11.15	1.41
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	11,040.93	198,736,896	11,319.2959	203,747,327	3.1250	2021.05.15	1.41
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	10,372.20	197,071,847	10,479.1323	199,103,515	1.5000	2018.08.31	1.38
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	10,225.39	194,282,568	10,313.5115	195,956,720	0.7500	2018.02.28	1.35

12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,091.76	177,468,297	11,200.3063	179,204,901	3.6250	2019.08.15	1.24
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	10,397.11	166,353,886	10,840.9253	173,454,805	2.1250	2021.08.15	1.20
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	10,958.76	164,381,423	10,995.2903	164,929,355	3.1250	2019.05.15	1.14
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	10,699.42	160,491,361	10,993.6823	164,905,235	2.6250	2020.08.15	1.14
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	10,488.78	157,331,702	10,784.6464	161,769,696	2.0000	2023.02.15	1.12
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	9,969.40	149,541,093	10,538.6272	158,079,408	1.6250	2022.11.15	1.09
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	11,016.99	154,237,970	11,185.8345	156,601,683	3.3750	2019.11.15	1.08
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,815.66	151,972,343	14,022.2912	154,245,204	8.0000	2021.11.15	1.07
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	11,003.33	154,046,620	10,932.5794	153,056,112	3.8750	2018.05.15	1.06
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	11,818.53	130,003,887	13,705.5215	150,760,737	3.8750	2040.08.15	1.04
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000	15,618.81	140,569,294	16,718.0984	150,462,886	5.0000	2034.08.01	1.04
23	イギリス	国債証券	TSY	650,000	18,766.87	121,984,677	22,892.3220	148,800,093	4.2500	2049.12.07	1.03
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000	15,591.35	140,322,213	16,342.8993	147,086,094	5.2500	2029.11.01	1.02
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	10,261.25	143,657,536	10,312.7075	144,377,906	0.7500	2017.10.31	1.00
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	11,091.76	133,101,221	11,312.0601	135,744,722	3.5000	2020.05.15	0.94
27	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	650,000	17,350.67	112,779,388	20,824.6993	135,360,546	4.5000	2041.04.25	0.93
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	10,254.82	133,312,669	10,313.5116	134,075,651	0.7500	2018.03.31	0.93
29	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	630,000	18,515.16	116,645,541	20,817.8360	131,152,367	5.7500	2032.10.25	0.91
30	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000	12,432.91	124,329,119	12,277.4787	122,774,787	4.5000	2018.01.31	0.85

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成28年6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28年6月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.18
合計	98.18

(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28年6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	INTL FINANCE CORP	18,505,000	3,126.60	578,578,551	3,168.4479	586,321,302	10.0000	2017.06.12	8.12
2	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	16,200,000	3,594.94	582,381,656	3,611.5117	585,064,911	9.6250	2018.07.13	8.10
3	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	16,830,000	3,128.52	526,530,421	3,163.3375	532,389,718	9.0000	2016.09.30	7.37
4	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	5,655,000	8,646.29	488,948,028	8,599.4844	486,300,843	5.7500	2020.07.28	6.73

5	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2,730,000	16,696.39	455,811,672	16,735.1530	456,869,679	5.3750	2021.06.07	6.33
6	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	59,600,000	678.80	404,569,746	684.7328	408,100,749	7.5000	2019.01.30	5.65
7	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2,555,000	14,466.61	369,621,967	14,556.5796	371,920,611	2.2500	2020.03.07	5.15
8	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	46,390,000	700.83	325,116,661	696.9302	323,305,966	8.7500	2017.03.01	4.48
9	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	4,070,000	7,824.41	318,453,503	7,789.8773	317,048,010	4.5000	2017.03.07	4.39
10	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	52,422,000	555.94	291,435,757	551.2071	288,953,838	4.0000	2018.08.16	4.00
11	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	49,620,000	558.28	277,019,083	554.1036	274,946,207	4.5000	2018.12.18	3.81
12	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	175,000,000	150.61	263,573,100	150.5826	263,519,550	5.1000	2017.02.02	3.65
13	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	6,535,000	3,662.84	239,367,006	3,691.3005	241,226,494	13.6250	2017.05.09	3.34
14	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	126,500,000	156.65	198,167,310	158.0472	199,929,708	6.7500	2017.05.12	2.77
15	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	107,250,000	158.48	169,974,733	158.9544	170,478,594	7.5000	2017.03.02	2.36
16	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	104,300,000	152.05	158,589,611	152.0055	158,541,737	6.0000	2016.12.20	2.19
17	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	20,100,000,000	0.76	153,338,763	0.7729	155,360,136	7.2000	2019.07.09	2.15
18	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	23,025,000	641.85	147,786,375	653.9253	150,566,323		2017.04.04	2.08
19	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	975,000	14,700.52	143,330,130	14,960.7369	145,867,185	2.5000	2022.10.31	2.02
20	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,020,000	14,070.76	143,521,759	14,144.1179	144,270,003	1.5000	2019.02.01	1.99
21	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	17,300,000,000	0.82	142,997,821	0.8265	142,997,821	10.0000	2018.11.16	1.98
22	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	72,600,000	158.79	115,283,282	160.4285	116,471,163	6.5000	2016.09.30	1.61
23	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	16,980,000	611.67	103,862,230	603.0081	102,390,792	7.5000	2020.03.05	1.41
24	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	66,000,000	153.94	101,606,076	153.1530	101,080,980	7.7500	2016.12.03	1.40
25	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	55,000,000	174.61	96,040,890	175.9644	96,780,420	11.0000	2020.01.21	1.34
26	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,660,000	3,363.59	55,835,704	3,514.2692	58,336,869	8.5000	2019.07.25	0.80
27	国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	6,500,000,000	0.77	50,610,560	0.7865	51,124,060	7.2500	2017.07.17	0.70
28	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	20,500,000	151.46	31,051,349	151.0262	30,960,391	5.6250	2017.03.15	0.42

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成28年6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28年6月30日現在)

種類	投資比率（％）
特殊債券	96.46
合計	96.46

（参考）新光J-REITマザーファンド

### イ. 評価額上位銘柄明細

（平成28年 6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	389	598,658.26	232,878,064	633,000	246,237,000	7.59
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	360	590,642.3	212,631,230	634,000	228,240,000	7.04
3	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	702	238,724.43	167,584,553	262,100	183,994,200	5.67
4	日本	投資証券	野村不動産マスタ-ファンド投資法人	1,024	150,979.88	154,603,398	162,700	166,604,800	5.13
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	809	171,342.7	138,616,247	185,100	149,745,900	4.61
6	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	507	225,952.99	114,558,168	251,000	127,257,000	3.92
7	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	666	161,575.59	107,609,346	177,300	118,081,800	3.64
8	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	240	412,140.05	98,913,613	441,000	105,840,000	3.26
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	358	262,053.87	93,815,289	275,300	98,557,400	3.04
10	日本	投資証券	GLP投資法人	714	120,877.82	86,306,767	129,800	92,677,200	2.85
11	日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	165	528,188.72	87,151,139	544,000	89,760,000	2.76
12	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	133	639,746.81	85,086,325	609,000	80,997,000	2.49
13	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	914	86,296.53	78,875,037	86,500	79,061,000	2.43
14	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	482	153,661.46	74,064,828	161,200	77,698,400	2.39
15	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	136	483,225.25	65,718,634	534,000	72,624,000	2.24
16	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	363	204,459.93	74,218,958	194,800	70,712,400	2.18
17	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	111	581,594.17	64,556,952	613,000	68,043,000	2.09
18	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	1,012	74,144.66	75,034,400	64,800	65,577,600	2.02
19	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	133	420,494.2	55,925,728	468,000	62,244,000	1.92
20	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	97	478,240.53	46,389,332	604,000	58,588,000	1.80
21	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	242	225,549.61	54,583,007	239,700	58,007,400	1.78
22	日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	206	241,952	49,842,112	279,100	57,494,600	1.77
23	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	97	533,005.92	51,701,574	573,000	55,581,000	1.71
24	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	263	161,114.57	42,373,134	187,800	49,391,400	1.52
25	日本	投資証券	プレミアム投資法人	362	124,465.13	45,056,380	135,100	48,906,200	1.50
26	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	347	136,577.89	47,392,527	140,600	48,788,200	1.50
27	日本	投資証券	イオンリート投資法人	360	137,940.57	49,658,607	117,500	42,300,000	1.30
28	日本	投資証券	福岡リート投資法人	206	192,776.17	39,711,892	203,400	41,900,400	1.29
29	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	269	149,082.38	40,103,161	146,100	39,300,900	1.21
30	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	451	81,180.66	36,612,482	84,200	37,974,200	1.17

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

## ロ.種類別投資比率

(平成28年 6月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.38
合計	98.38

(参考) 新光米国REITマザーファンド

## イ. 評価額上位銘柄明細

(平成28年 6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	2,630	20,835.15	54,796,467	22,118.4463	58,171,514	6.85
2	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	3,600	9,960.65	35,858,372	11,628.8300	41,863,788	4.93
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	1,200	23,249.42	27,899,313	26,140.1691	31,368,203	3.69
4	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	2,900	8,505.51	24,665,983	10,324.9603	29,942,385	3.52
5	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	600	29,923.47	17,954,084	39,725.3183	23,835,191	2.80
6	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3,000	7,208.84	21,626,537	7,771.7633	23,315,290	2.74
7	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	4,400	4,365.44	19,207,945	5,053.9100	22,237,204	2.62
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,200	19,010.56	22,812,677	18,333.4166	22,000,100	2.59
9	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	3,100	8,199.86	25,419,593	6,998.9090	21,696,618	2.55
10	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	2,800	5,961.57	16,692,413	7,414.6653	20,761,063	2.44
11	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	6,300	2,883.53	18,166,291	3,008.0593	18,950,774	2.23
12	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1,300	12,771.13	16,602,470	13,532.6646	17,592,464	2.07
13	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2,200	5,105.36	11,231,803	7,045.2186	15,499,481	1.82
14	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,300	7,807.78	10,150,117	11,134.8623	14,475,321	1.70
15	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1,400	10,265.27	14,371,382	10,193.2357	14,270,530	1.68
16	アメリカ	投資証券	HCP INC	3,900	4,042.30	15,764,989	3,639.9266	14,195,714	1.67
17	アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	4,300	2,858.83	12,293,011	3,073.9216	13,217,863	1.55
18	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	560	24,383.49	13,654,758	23,105.3535	12,938,998	1.52
19	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	3,600	2,694.18	9,699,062	3,181.9772	11,455,118	1.35
20	アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	1,300	8,604.30	11,185,596	8,637.2361	11,228,407	1.32
21	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	6,300	1,815.33	11,436,594	1,651.7055	10,405,745	1.22
22	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	600	15,103.07	9,061,843	16,875.1816	10,125,109	1.19
23	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,000	8,185.46	8,185,462	9,401.8580	9,401,858	1.10
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	2,300	3,741.80	8,606,157	3,747.9821	8,620,359	1.01
25	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	800	12,246.29	9,797,032	10,601.7887	8,481,431	0.99
26	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	2,000	3,378.53	6,757,071	4,070.0905	8,140,181	0.95
27	アメリカ	投資証券	VEREIT INC	7,700	866.50	6,672,067	1,028.0709	7,916,146	0.93
28	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	2,900	2,165.22	6,279,157	2,698.3003	7,825,071	0.92
29	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORPORATION	800	6,874.38	5,499,510	8,531.2387	6,824,991	0.80
30	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT	600	8,819.38	5,291,632	10,836.4233	6,501,854	0.76

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成28年 6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28年 6月30日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	97.48
合計	97.48

### 【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-REITマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

#### 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28年 6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	26	日本円	323,441,080	323,830,000	2.91

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

## (参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成28年 6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	90	米ドル	9,273,687.5	954,355,181	9,300,600	957,124,746	10.42
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 601X	買建	5	カナダドル	808,224	64,310,384	812,500	64,650,625	0.70
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO ST50	買建	55	ユーロ	1,545,170	176,751,996	1,550,450	177,355,975	1.93
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200	買建	4	オーストラリアドル	515,198	39,536,295	509,300	39,083,682	0.42
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100 IDX	買建	12	英ポンド	718,797	99,488,693	753,900	104,347,299	1.13

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

外貨建先物取引については、平成28年 6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28年 6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	258,937.88	26,647,298	266,125	27,386,924	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	6	米ドル	719,813.64	74,076,021	732,515.64	75,383,184	0.52

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	244,668	33,864,497	256,180	35,457,873	0.24
------	--------------------	--------------	----	--	-------	---------	------------	---------	------------	------

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

外貨建先物取引については、平成28年6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-REITマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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27年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	
平成28年1月末日	191,185,114		1.0915	
2月末日	187,297,421		1.0605	
3月末日	191,228,528		1.0844	
4月末日	188,832,551		1.0766	
5月末日	190,564,749		1.0859	

6月末日	180,051,901		1.0372
------	-------------	--	--------

## 【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
第3中間計算期間	平成27年12月16日～平成28年 6月15日	5.4

(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
第3中間計算期間	平成27年12月16日～平成28年 6月15日	6,162,744	5,297,989

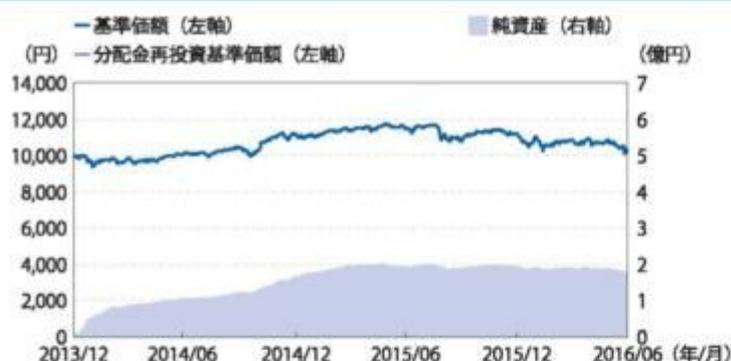
(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

## 運用実績

2016年6月30日現在

## &lt;基準価額・純資産の推移&gt; (2014年1月6日～2016年6月30日)



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

## &lt;分配の推移&gt;

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	20.18%
新光日本債券インデックスマザーファンド	20.15%
海外国債マザーファンド	19.59%
新光外国株式インデックスマザーファンド	14.69%
新光J-REITマザーファンド	10.16%
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)	10.14%
-	-
-	-
-	-
合計	94.94%

## 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	3.32%
日本電信電話	情報・通信業	1.93%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.91%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.71%
KDDI	情報・通信業	1.60%

※東証33業種分類にしたがって記載しています。純資産比率は、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	1.50%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.10%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.08%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.94%
AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	0.82%

※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。

2016年6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	7.59%
ジャンパリアルエステイト投資法人	7.04%
日本リテールファンド投資法人	5.67%
野村不動産マスターファンド投資法人	5.13%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.61%

※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2016年6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313回利付国債(10年)	2021/03/20	1.300%	1.26%
第315回利付国債(10年)	2021/06/20	1.200%	1.26%
第308回利付国債(10年)	2020/06/20	1.300%	1.25%
第323回利付国債(10年)	2022/06/20	0.900%	1.19%
第334回利付国債(10年)	2024/06/20	0.600%	1.18%

※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	4.27%
US TREASURY N/B	2025/11/15	2.250%	米ドル	4.23%
US TREASURY N/B	2024/11/15	2.250%	米ドル	4.23%
US TREASURY N/B	2024/05/15	2.500%	米ドル	4.20%
US TREASURY N/B	2025/05/15	2.125%	米ドル	4.19%

※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	2020/11/15	2.625%	米ドル	2.21%
US TREASURY N/B	2017/11/15	4.250%	米ドル	1.72%
US TREASURY N/B	2020/02/15	3.625%	米ドル	1.57%
US TREASURY N/B	2017/07/31	0.500%	米ドル	1.57%
US TREASURY N/B	2024/08/15	2.375%	米ドル	1.53%

※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2016年6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、将来の成果を予測・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。

## 運用実績

2016年6月30日現在

## &lt;年間収益率の推移&gt;

暦年ベース



※税引前の分配金を単純に合算して計算しています。  
※当ファンドにはベンチマークがありません。  
※2016年については、年初から6月末までの収益率を記載しています。

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

## 2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

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られないものとします。

- ・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（ニ）の規定に準じて計算された価額とします。

<訂正後>

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

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られないものとします。

- ・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（ニ）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】

##### <訂正前>

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。

##### <訂正後>

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

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。

## 第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間（平成27年12月16日から平成28年6月15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る中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【グローバル・ナビ】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

第3期中間計算期間末 平成28年6月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	10,803,326
親投資信託受益証券	174,012,695
流動資産合計	184,816,021
資産合計	184,816,021
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	51,113
未払委託者報酬	1,400,339
未払利息	17
その他未払費用	7,750
流動負債合計	1,459,219
負債合計	1,459,219
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	174,493,368
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,863,434
（分配準備積立金）	12,705,507
元本等合計	183,356,802
純資産合計	183,356,802
負債純資産合計	184,816,021

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第3期中間計算期間 自 平成27年12月16日 至 平成28年6月15日	
<b>営業収益</b>	
受取利息	776
有価証券売買等損益	8,834,031
営業収益合計	8,833,255

第3期中間計算期間  
自 平成27年12月16日  
至 平成28年 6月15日

営業費用	
支払利息	942
受託者報酬	51,113
委託者報酬	1,400,339
その他費用	213,733
営業費用合計	1,666,127
営業利益	10,499,382
経常利益	10,499,382
中間純利益	10,499,382
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	151,594
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	19,226,610
剰余金増加額又は欠損金減少額	552,478
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	552,478
剰余金減少額又は欠損金増加額	567,866
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	567,866
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,863,434

### （ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第3期中間計算期間 自 平成27年12月16日 至 平成28年 6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。

（中間貸借対照表に関する注記）

第3期中間計算期間末 平成28年 6月15日現在	
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	174,493,368口
2. 中間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	1.0508円
(1万口当たり純資産額)	(10,508円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第3期中間計算期間 自 平成27年12月16日 至 平成28年 6月15日
その他費用	主に、海外カストディアンに対するコスト ディフィーであります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期中間計算期間末 平成28年 6月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。
3. 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。

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	第3期中間計算期間末 平成28年 6月15日現在
期首元本額	173,628,613円
期中追加設定元本額	6,162,744円
期中一部解約元本額	5,297,989円

## 2 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。

## （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」- R E I Tマザーファンド」及び「新光米国 R E I Tマザーファンド」各受益証券を主要投資対象

としており、中間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28年6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

(単位：円)

平成28年 6月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	203,983,502
株式	10,666,791,750
未収配当金	83,124,995
前払金	16,148,000
流動資産合計	10,970,048,247
資産合計	10,970,048,247
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,631,760
未払利息	336
その他未払費用	504
流動負債合計	14,632,600
負債合計	14,632,600
純資産の部	
元本等	
元本	6,877,259,677
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	4,078,155,970
元本等合計	10,955,415,647
純資産合計	10,955,415,647
負債純資産合計	10,970,048,247

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年12月16日 至 平成28年 6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28年 6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。	
株式	116,821,800円
2. 計算日における受益権の総数	6,877,259,677口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.5930円
(1万口当たり純資産額)	(15,930円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6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	
株式	
「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して	
おります。	
派生商品評価勘定	
「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して	
おります。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に	
近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま	
す。	
3. 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。	

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成28年 6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	6,660,217,405円
期中追加設定元本額	768,322,762円
期中一部解約元本額	551,280,490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	351,780,388円
新光7資産バランスファンド	491,333,859円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	239,990,028円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	1,853,123,582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)	1,614,902,255円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	50,555,095円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	1,628,910,136円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	589,960,111円
世界アセット・アロケーション・ファンド(適格機関投資家私募)	1,861,301円
グローバル・ナビ	22,186,183円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	6,516,848円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	21,172,983円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	4,966,908円
合計	6,877,259,677円

## 2 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28年 6月15日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	295,131,760	-	280,500,000	14,631,760
東証株価指数先物	295,131,760	-	280,500,000	14,631,760
合計	295,131,760	-	280,500,000	14,631,760

### 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。

## 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28年 6月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	736,744,253
コール・ローン	10,447,006
株式	7,840,289,860
投資信託受益証券	917,407
投資証券	230,625,509
未収入金	592,323
未収配当金	16,637,897
差入委託証拠金	420,344,433
流動資産合計	9,256,598,688
資産合計	9,256,598,688
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,826,886
未払解約金	15,000,000
未払利息	17
その他未払費用	39
流動負債合計	20,826,942
負債合計	20,826,942
純資産の部	
元本等	
元本	5,500,741,458
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	3,735,030,288
元本等合計	9,235,771,746
純資産合計	9,235,771,746
負債純資産合計	9,256,598,688

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年12月16日 至 平成28年 6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。 投資信託受益証券

	<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	<p>受取配当金</p> <p>(1) 株式及び投資証券</p> <p>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</p> <p>原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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28年 6月15日現在	
1. 計算日における受益権の総数	
	5,500,741,458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	1.6790円
(1万口当たり純資産額)	(16,790円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6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	

株式	「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。
投資信託受益証券	「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。
投資証券	「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。
派生商品評価勘定	「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.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。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成28年 6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	5,926,931,068円
期中追加設定元本額	258,628,650円
期中一部解約元本額	684,818,260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	486,152,665円
新光外国株式インデックスVA	2,028,238,139円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	715,283,852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）	518,834,688円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	125,011,574円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,038,305,610円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	570,662,352円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）	2,487,204円
グローバル・ナビ	15,765,374円

合計	5,500,741,458円
----	----------------

## 2 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28年 6月15日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年 超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	1,151,176,618	-	1,145,232,157	5,944,461
S&P500 EMINI	823,660,992	-	822,124,905	1,536,087
S&P/TSE 601X	53,426,705	-	52,972,130	454,575
DJ EURO ST50	154,486,616	-	152,145,910	2,340,706
FTSE 100 IDX	89,306,138	-	87,888,652	1,417,486
SPI 200	30,296,167	-	30,100,560	195,607
合計	1,151,176,618	-	1,145,232,157	5,944,461

### 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28年 6月15日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年 超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	14,849,800	-	14,855,400	5,600
米ドル	14,849,800	-	14,855,400	5,600
合計	14,849,800	-	14,855,400	5,600

## 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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28年 6月15日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	22,864,831
国債証券	11,967,879,900
地方債証券	1,130,409,300
特殊債券	1,135,087,000
社債券	635,980,000
未収利息	53,353,788
前払費用	764,579
流動資産合計	14,946,339,398
<b>資産合計</b>	<b>14,946,339,398</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	4,000,000
未払利息	37
その他未払費用	47
流動負債合計	4,000,084
<b>負債合計</b>	<b>4,000,084</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	11,517,740,414
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	3,424,598,900
元本等合計	14,942,339,314
<b>純資産合計</b>	<b>14,942,339,314</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>14,946,339,398</b>

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成27年12月16日 至 平成28年 6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28年 6月15日現在	
1. 計算日における受益権の総数	11,517,740,414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	1.2973円
(1万口当たり純資産額)	(12,973円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6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	
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。	
3. 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。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成28年 6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	13,221,766,651円
期中追加設定元本額	384,720,107円
期中一部解約元本額	2,088,746,344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）	106,987,223円
新光7資産バランスファンド	667,953,643円
日本債券ファンド	1,272,361,166円
新光日本債券インデックスVA	1,107,852,580円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	1,942,653,521円
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	2,123,027,156円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	135,189,024円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	2,839,593,581円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,292,804,036円
グローバル・ナビ	29,318,484円
合計	11,517,740,414円

2 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。

海外国債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

平成28年 6月15日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	303,431,754
国債証券	31,704,597,545
未収利息	188,358,171

平成28年 6月15日現在	
前払費用	13,221,626
流動資産合計	32,209,609,096
資産合計	32,209,609,096
負債の部	
流動負債	
未払解約金	35,000,000
未払利息	500
その他未払費用	1,070
流動負債合計	35,001,570
負債合計	35,001,570
純資産の部	
元本等	
元本	14,927,530,696
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,247,076,830
元本等合計	32,174,607,526
純資産合計	32,174,607,526
負債純資産合計	32,209,609,096

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年12月16日 至 平成28年 6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。
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28年 6月15日現在	
1. 計算日における受益権の総数	14,927,530,696口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.1554円
(1万口当たり純資産額)	(21,554円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6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</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して</p> <p>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に</p> <p>近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま</p> <p>す。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> <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</p> <p>は、経営者により合理的に算定された価額で評価する場</p> <p>合があります。</p>

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成28年 6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	16,920,799,395円
期中追加設定元本額	57,523,894円
期中一部解約元本額	2,050,792,593円
同期末における元本の内訳	
海外国債ファンド	10,237,132,430円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	1,417,094,422円
新光7資産バランスファンド	408,157,097円
海外国債ファンド（1年決算型）	35,577,113円
海外国債ファンド（変額年金）	2,806,961,125円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適	
格機関投資家私募）	5,587,492円
グローバル・ナビ	17,021,017円
合計	14,927,530,696円

2 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。

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28年 6月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	125,196,294
コール・ローン	45,166,040
国債証券	13,991,364,392
派生商品評価勘定	589,716,512
未収利息	126,060,883
前払費用	6,078,489
差入委託証拠金	23,867,816
流動資産合計	14,907,450,426
資産合計	14,907,450,426
負債の部	
流動負債	
未払利息	74
その他未払費用	291
流動負債合計	365
負債合計	365
純資産の部	
元本等	
元本	10,791,436,153
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,116,013,908
元本等合計	14,907,450,061
純資産合計	14,907,450,061
負債純資産合計	14,907,450,426

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年12月16日 至 平成28年 6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配は使用いたしません。）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）に基づいて評価しております。</p>
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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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28年 6月15日現在

1. 計算日における受益権の総数	10,791,436,153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	1.3814円
(1万口当たり純資産額)	(13,814円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6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>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>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> <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>

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成28年 6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	11,872,377,473円
期中追加設定元本額	63,182,489円
期中一部解約元本額	1,144,123,809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）	6,073,316,441円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家 私募）	127,467,772円

ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	3,359,639,839円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,217,212,369円
グローバル・ナビ	13,799,732円
合計	10,791,436,153円

## 2 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28年 6月15日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超			
市場取引				
債券先物取引				
買建	140,526,164	-	143,051,697	2,525,533
US 10YR NOTE	27,478,488	-	27,969,253	490,765
US 5YR NOTE	76,386,623	-	77,301,787	915,164
LONG GILT FU	36,661,053	-	37,780,657	1,119,604
合計	140,526,164	-	143,051,697	2,525,533

#### 時価の算定方法

##### 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### (通貨関連)

種類	平成28年 6月15日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超			
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	14,652,659,549	-	14,065,476,560	587,182,989

米ドル	6,307,941,528	-	6,044,624,280	263,317,248
カナダドル	300,837,867	-	293,025,660	7,812,207
メキシコペソ	136,229,556	-	127,542,060	8,687,496
ユーロ	5,978,191,432	-	5,779,924,080	198,267,352
英ポンド	1,246,958,658	-	1,156,137,840	90,820,818
スウェーデンク ローナ	70,216,473	-	67,626,000	2,590,473
ノルウェークロー ネ	46,741,648	-	44,649,080	2,092,568
デンマーククロー ネ	98,496,336	-	95,284,410	3,211,926
ポーランドズロチ	86,183,368	-	82,313,760	3,869,608
オーストラリアド ル	265,357,523	-	261,040,320	4,317,203
シンガポールドル	56,264,394	-	54,925,390	1,339,004
南アフリカランド	59,240,766	-	58,383,680	857,086
合計	14,652,659,549	-	14,065,476,560	587,182,989

#### 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。

#### 新光 J - R E I T マザーファンド

##### 貸借対照表

(単位：円)

平成28年 6月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	48,639,787
投資証券	3,226,696,600
未収配当金	17,514,637

平成28年 6月15日現在

流動資産合計	3,292,851,024
資産合計	3,292,851,024
負債の部	
流動負債	
未払金	21,918,116
未払利息	80
その他未払費用	58
流動負債合計	21,918,254
負債合計	21,918,254
純資産の部	
元本等	
元本	1,973,584,740
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,297,348,030
元本等合計	3,270,932,770
純資産合計	3,270,932,770
負債純資産合計	3,292,851,024

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年12月16日 至 平成28年 6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28年 6月15日現在	
1. 計算日における受益権の総数	1,973,584,740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	1.6574円
(1万円当たり純資産額)	(16,574円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6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

## 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。

### 3. 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。

## （その他の注記）

### 1 元本の移動

区分	平成28年 6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	1,510,959,483円
期中追加設定元本額	673,884,033円
期中一部解約元本額	211,258,776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	531,532,406円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）	2,929,699円
グローバル・ナビ	11,110,852円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	1,428,011,783円
合計	1,973,584,740円

## 2 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。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

### グローバル・ナビ

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	180,165,657円
負債総額	113,756円
純資産総額（ - ）	180,051,901円
発行済口数	173,586,068口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0372円
（1万口当たり純資産額）	（10,372円）

（参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	11,495,636,979円
負債総額	380,234,342円
純資産総額（ - ）	11,115,402,637円
発行済口数	7,142,889,352口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5561円
（1万口当たり純資産額）	（15,561円）

（参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	9,192,649,712円
負債総額	13,804,660円
純資産総額（ - ）	9,178,845,052円
発行済口数	5,621,827,416口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6327円
（1万口当たり純資産額）	（16,327円）

（参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	14,795,253,910円
負債総額	355,100,301円
純資産総額（ - ）	14,440,153,609円
発行済口数	11,081,567,685口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3031円
（1万口当たり純資産額）	（13,031円）

（参考）海外国債マザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	31,159,458,590円
負債総額	50,001,887円
純資産総額（ - ）	31,109,456,703円
発行済口数	14,816,507,406口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0996円
（1万口当たり純資産額）	（20,996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28年 6月30日現在）

資産総額	15,915,993,672円
負債総額	1,506,543,040円
純資産総額（ - ）	14,409,450,632円
発行済口数	10,328,695,084口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3951円
（1万口当たり純資産額）	（13,951円）

（参考）グローバル高金利通貨マザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	7,216,293,511円
負債総額	269円
純資産総額（ - ）	7,216,293,242円
発行済口数	7,497,843,906口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9624円
（1万口当たり純資産額）	（9,624円）

（参考）新光J-REITマザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	3,251,922,664円
負債総額	10,218,453円
純資産総額（ - ）	3,241,704,211円
発行済口数	1,958,742,009口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6550円
（1万口当たり純資産額）	（16,550円）

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成28年 6月30日現在）

資産総額	848,482,630円
負債総額	103円
純資産総額（ - ）	848,482,527円
発行済口数	583,750,039口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4535円
（1万口当たり純資産額）	（14,535円）

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<更新後>

##### a．資本金の額（平成28年6月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,813,864株
直近5カ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。	

##### b．委託会社の機構

(イ) 株主総会において、15名以内の取締役が選任されます。

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

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

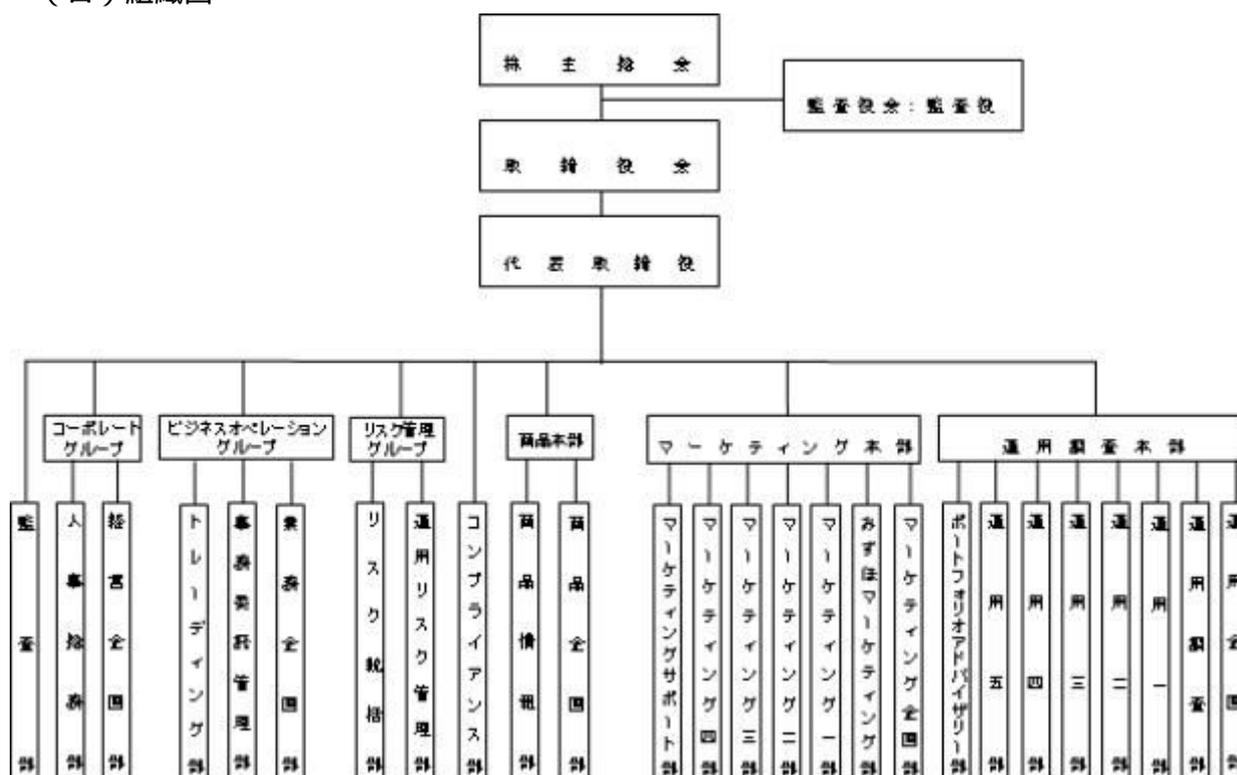
取締役会の決議により、取締役の中から取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

取締役会の決議をもって代表取締役3名以内を決定します。

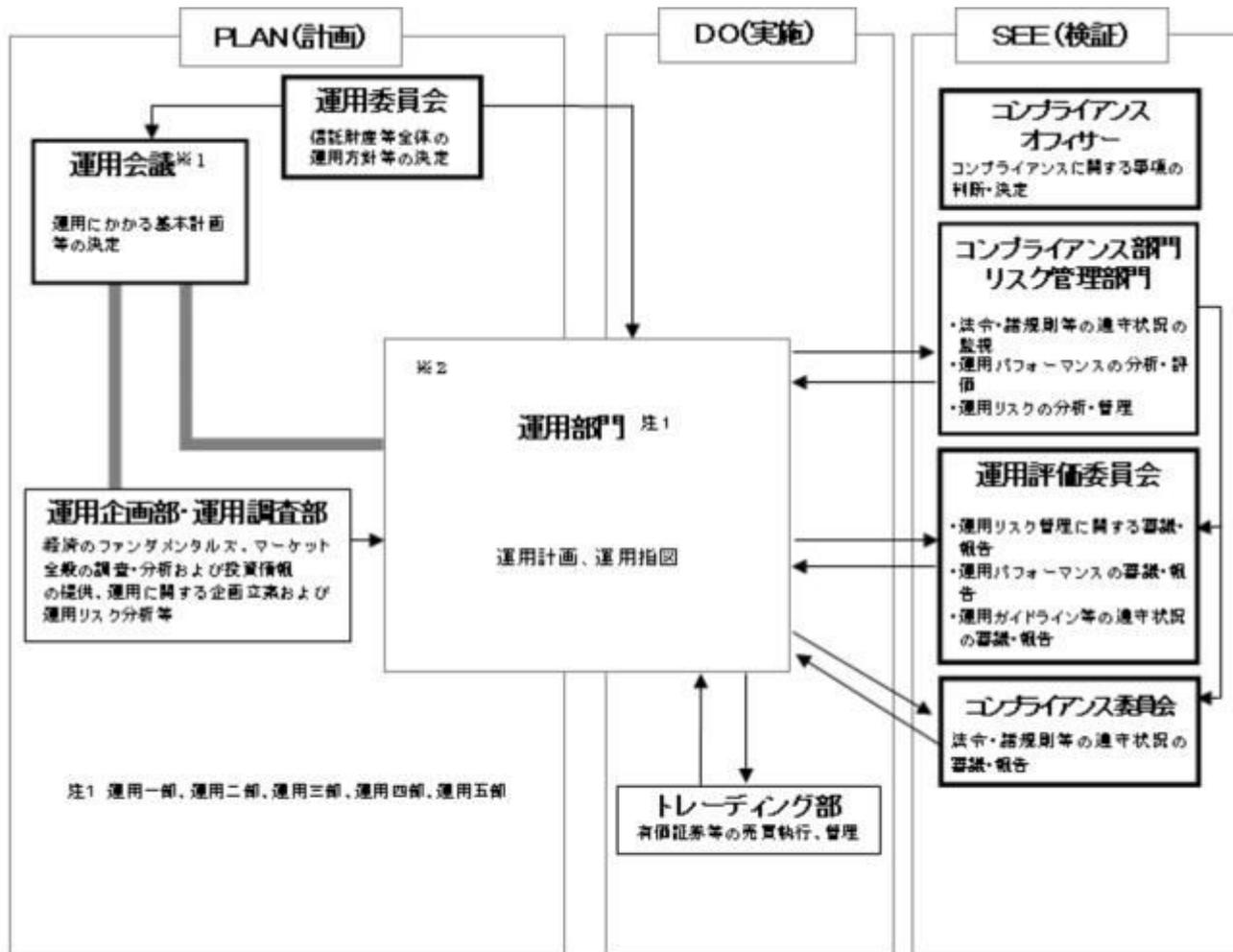
代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

(ロ) 組織図



## (八) 投資運用の意思決定機構



実線の矢印は情報の流れを示します。

※1 運用会議は運用企画部・運用調査部、運用部門(運用一部～五部)で構成されます。

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

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

（平成28年5月31日現在）

基本的性格	本数	純資産総額（円）
追加型公社債投資信託	26	669,428,600,763
追加型株式投資信託	244	3,203,001,207,380
単位型公社債投資信託	4	17,754,535,219
単位型株式投資信託	72	256,599,381,477
合計	346	4,146,783,724,839

## 3 【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

## 1. 財務諸表の作成方法について

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

なお、財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

## 2. 監査証明について

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

### （1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160
有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
<b>流動資産合計</b>	<b>20,404,659</b>	<b>21,767,367</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>		
建物（純額）	2 12,687	2 0
構築物（純額）	2 1,444	2 0
器具・備品（純額）	2 86,688	2 44,868
<b>有形固定資産合計</b>	<b>100,820</b>	<b>44,868</b>
<b>無形固定資産</b>		
電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
<b>無形固定資産合計</b>	<b>86,278</b>	<b>57,152</b>
<b>投資その他の資産</b>		

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	1 1,558,682	1 1,360,372
その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
<b>固定負債</b>		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	4,524,300	4,524,300
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		

利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744
評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

投資有価証券評価損	10,952	62,800
外国税支払損失引当金繰入額	184,111	-
訴訟損失引当金繰入額	30,000	10,000
合併関連費用	2	2
その他特別損失	22,227	-
特別損失合計	305,082	310,625
税引前当期純利益	5,629,593	5,575,383
法人税、住民税及び事業税	2,111,379	1,832,729
法人税等調整額	66,999	19,773
法人税等合計	2,044,380	1,852,503
当期純利益	3,585,212	3,722,880

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

会計方針の変更を反映した 当期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				評価・換算 差額等	純資産合計
	利益剰余金		自己 株式	株主 資本 合計		
	その他利益 剰余金	利益 剰余金 合計				
	繰越 利益 剰余金					
当期首残高	3,981,245	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008
当期変動額						
剰余金の配当	3,446,341	3,446,341		3,446,341		3,446,341
当期純利益	3,722,880	3,722,880		3,722,880		3,722,880

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

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### （1）関連会社株式

総平均法による原価法

#### （2）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### （1）有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

#### （2）無形固定資産

定額法。

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

### 3．引当金の計上基準

#### （1）賞与引当金

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

#### （2）役員賞与引当金

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

#### （3）外国税支払損失引当金

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

#### （4）訴訟損失引当金

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

#### （5）退職給付引当金

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

#### 退職給付見込額の期間帰属方法

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

#### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

#### （6）役員退職慰労引当金

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

#### （7）執行役員退職慰労引当金

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

#### 4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### （1）消費税等の会計処理

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

#### （未適用の会計基準）

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

##### （1）概要

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

##### （2）適用予定日

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

##### （3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

#### （追加情報）

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

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

## （貸借対照表関係）

1．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2．資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

## （損益計算書関係）

1．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2．特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．自己株式に関する事項

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

3．配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

### 1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,823,250	-	9,386	1,813,864

（変動事由の概要）

自己株式の消却

### 2．自己株式に関する事項

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

（変動事由の概要）

自己株式の消却

### 3．配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17日

（金融商品関係）

#### 1．金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

##### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

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

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

得る体制となっております。

#### 市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

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

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

#### 流動性リスクの管理

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金及び預金	14,861,160	14,861,160	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,159,600	6,159,600	-
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	2,884,368	-

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### (1) 現金及び預金

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

#### (2) 有価証券及び投資有価証券

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

#### (3) 未収委託者報酬

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

(注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位: 千円)

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非上場株式	276,151	276,151

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

(注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	14,861,112	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	-	-	-

(有価証券関係)

## 1. 関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3) その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-

原価を超えないもの	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

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

当事業年度(平成28年3月31日)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	1,119,150	869,274	249,875
	小計	1,119,150	869,274	249,875
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,040,450	5,153,936	113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	113,485
合計		6,159,600	6,023,210	136,389

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-
(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	2,209,763	225,965	60,150
合計	2,209,763	225,965	60,150

#### 4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、有価証券について62,800千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

#### （退職給付関係）

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

##### 2. 確定給付制度

###### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,424,739	1,348,083
会計方針の変更による累積的影響額	71,902	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,352,836	1,348,083
勤務費用	90,967	91,804
利息費用	9,476	6,074
数理計算上の差異の発生額	31,927	53,747
退職給付の支払額	73,269	60,817
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	1,348,083	1,438,892

###### (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額（前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円）については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

## (5) 年金資産に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
年金資産の主な内訳		
年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。		
株式	39.4%	33.8%
債券	27.3%	27.3%
共同運用資産	21.0%	24.5%
生命保険一般勘定	10.6%	11.1%

現金及び預金	1.4%	3.2%
合計	100%	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
割引率	0.0720% ~ 1.625%	0.0120% ~ 0.8060%
長期期待運用収益率	2.0%	2.5%
予想昇給率(平均)	2.6%	2.6%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

流動資産 - 繰延税金資産	372,215千円	326,063千円
---------------	-----------	-----------

固定資産 - 長期繰延税金資産	-	29,604
固定負債 - 長期繰延税金負債	89,752	-

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

### （資産除去債務関係）

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

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

### （セグメント情報等）

#### セグメント情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### 関連情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

##### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）営業収益

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

###### （2）有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の

情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

#### 関連当事者情報

##### 1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（千円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	125,167,284	金融商品取引業	(被所有) 直接76.98 間接 7.73	当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任	当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い	8,452,937	未払手数料	570,839

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	116,378
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	92,974	その他未払金	8,479
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,002	その他未払金	1,736

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	みずほ証券プロパティマネジメント株式会社	東京都中央区	4,110,000	不動産賃貸業	直接 4.05	事務所の賃借	事務所の賃借	175,210	長期差入保証金	16,314
同一の親会社を持つ会社	日本証券テクノロジー株式会社	東京都中央区	228,000	情報サービス業	なし	計算業務の委託	計算委託料支払	96,300	その他未払金	8,725
							ハウジングサービス料支払	16,824	その他未払金	1,514
							メールシステムサービス料支払	36,923	その他未払金	3,323
							IT関連業務支援	18,163	その他未払金	1,728

(注) 1. 上記(ア)~(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

(1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。

(2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。

(3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### 親会社情報

みずほ証券株式会社(非上場)

(1株当たり情報)

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

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

(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26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益金額(千円)	3,585,212	3,722,880
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	3,585,212	3,722,880
期中平均株式数(千株)	1,813	1,813

## 5【その他】

### <更新後>

#### a. 定款の変更

委託者の定款につき、下記の変更を行いました。

- ・ 剰余金の配当等の決定機関を法令に別段の定めがある場合を除き、株主総会の定めによらず、取締役会の決議によって定めることとしました。(平成27年6月19日実施)
- ・ 当社株式に関して、株券を発行する定めを廃止し、株券不発行としました。また、単元株(100株単位)について廃止しました。(平成28年1月25日実施)

#### b. 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### <訂正前>

#### (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

<訂正後>

(1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a. 資本金の額

平成28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28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28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

### 3【資本関係】

<訂正前>

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。

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

- 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。

## &lt;訂正後&gt;

みずほ証券株式会社は、委託者の株式の76.9%を所有しています。

（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。

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

- 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。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年7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 公認会計士 湯原 尚  
業務執行社員  
指定有限責任社員 公認会計士 山野 浩  
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、「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27年12月16日から平成28年6月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、グローバル・ナビの平成28年6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中間計算期間（平成27年12月16日から平成28年6月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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、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。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光投信株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の統合基本合意書に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。