

**【表紙】**

|            |                                 |
|------------|---------------------------------|
| 【提出書類】     | 有価証券報告書                         |
| 【提出先】      | 関東財務局長殿                         |
| 【提出日】      | 平成28年3月15日提出                    |
| 【計算期間】     | 第2期(自 平成26年12月16日至 平成27年12月15日) |
| 【ファンド名】    | グローバル・ナビ                        |
| 【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                            |
| 【連絡場所】     | 東京都中央区日本橋一丁目17番10号              |
| 【電話番号】     | 03-3277-1800                    |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。                     |

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

**商品分類表**

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

**商品分類の定義**

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

**属性区分表**

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

### 属性区分の定義

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

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

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

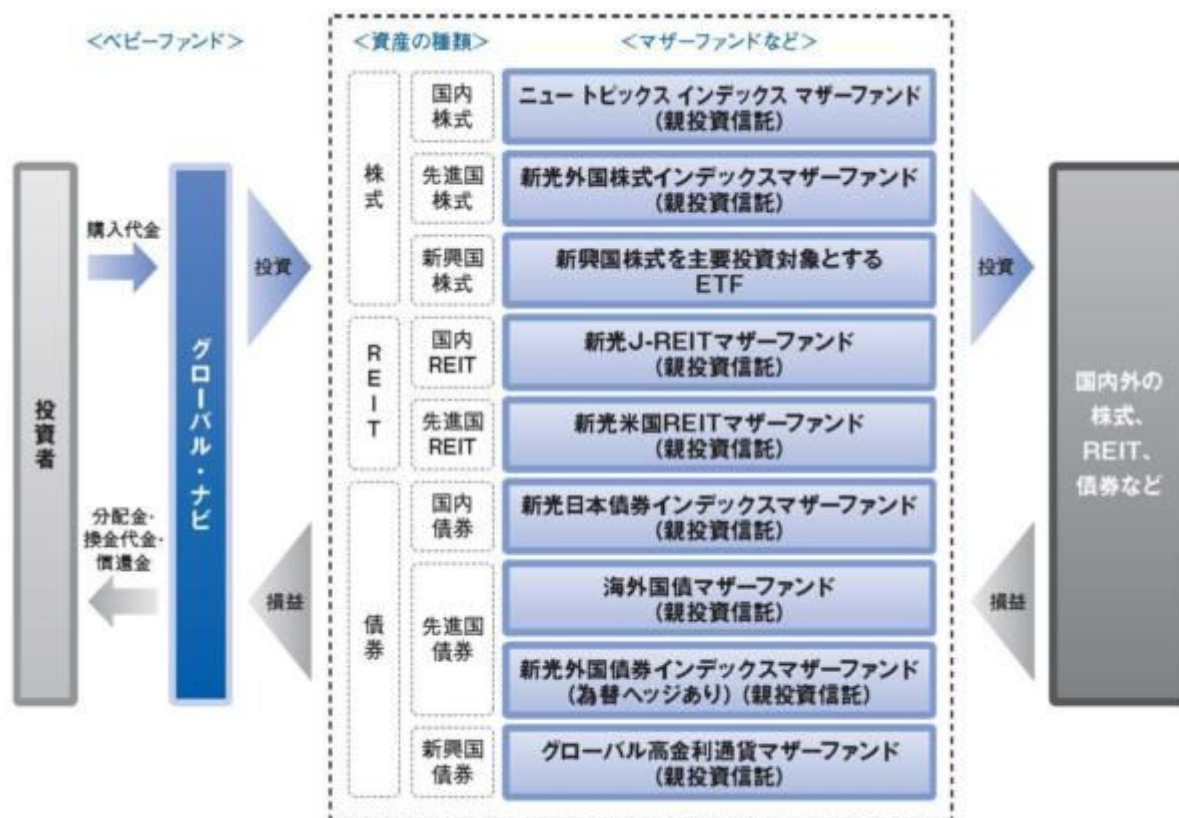
商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

## ファンドの仕組み

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

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

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



### b. ファンドの特色

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

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

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

より、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指します。

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

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

\*1「REIT」とは、不動産投資信託証券を指します。

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

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

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

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

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

### <当ファンドの資産配分について>

#### Step1 株式と債券の配分比率決定・見直し

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

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

#### <配分比率決定・見直しのイメージ>



## Step 2 各資産の配分比率決定

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

株式・債券の配分比率内において、各資産の配分比率に制限はありません。

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

## (参考)当ファンドが投資する各マザーファンドの運用方針

### 国内株式

#### ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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

### 先進国株式

#### 新光外国株式インデックスマザーファンド

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

### 国内債券

#### 新光日本債券インデックスマザーファンド

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

### 先進国債券

#### 海外国債マザーファンド

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

#### 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

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

### 新興国債券

## グローバル高金利通貨マザーファンド

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

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

## 国内REIT

### 新光J-REITマザーファンド

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

## 先進国REIT

### 新光米国REITマザーファンド

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

上記の各マザーファンドの運用方針は、各マザーファンドの内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、記載内容は平成28年3月15日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

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

### 新興国株式

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

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

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

運用会社：ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ

上場取引所：NYSEアーカ取引所

## 主な投資制限

株式などへの投資割合

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

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

## 分配方針

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



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

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

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

運用状況により分配金額は変動します。

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

### c．信託金限度額

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

## （2）【ファンドの沿革】

平成25年12月20日

関東財務局長に対して有価証券届出書提出

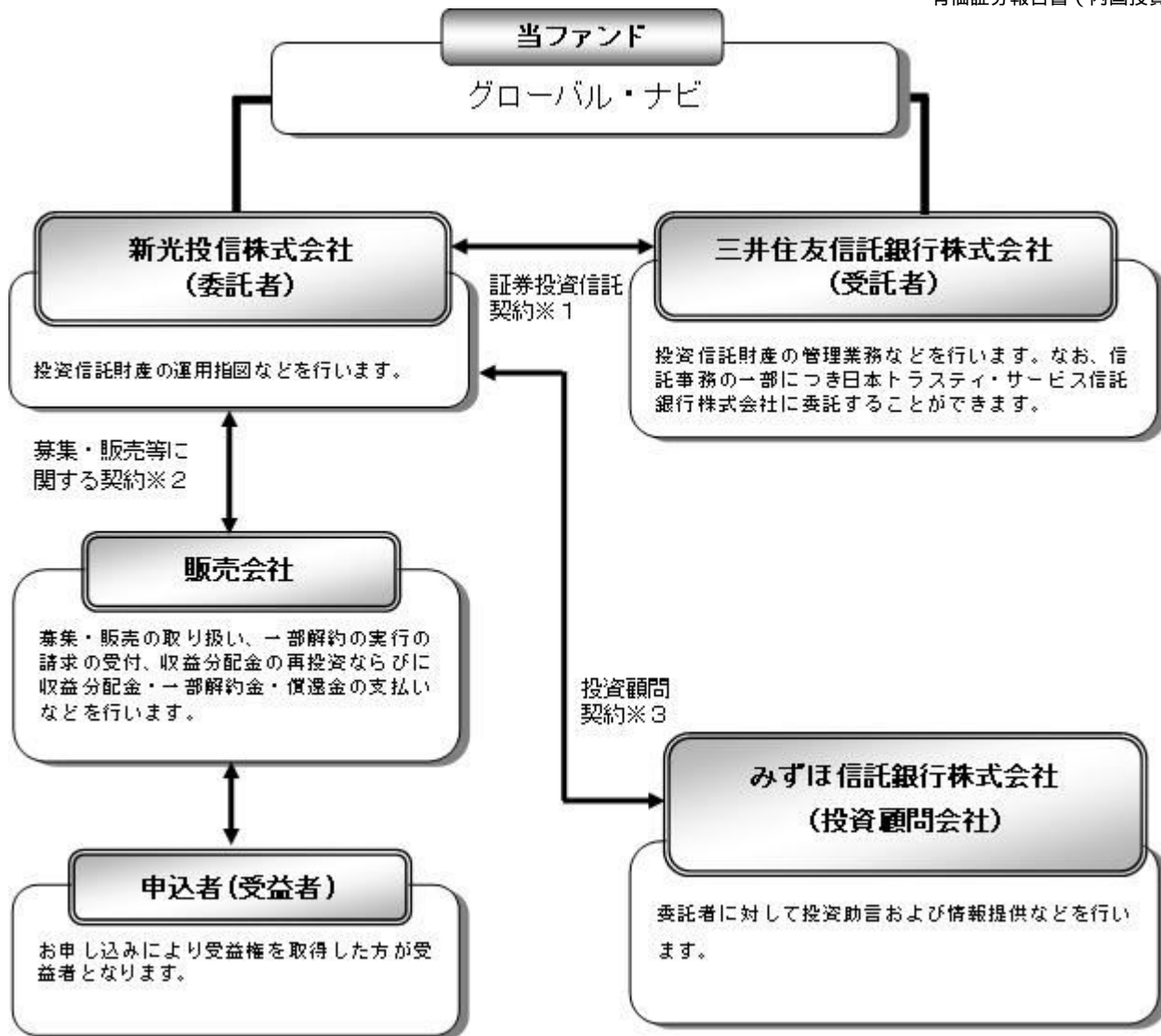
平成26年1月6日

投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

## （3）【ファンドの仕組み】

### a．ファンドの仕組み





### 1 証券投資信託契約

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

### 2 募集・販売等に関する契約

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

### 3 投資顧問契約

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

## b. 委託会社の概況

### (イ) 資本金の額（平成27年12月末現在）

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

### (ロ) 委託会社の沿革

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

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

## (八) 大株主の状況

(平成27年12月末現在)

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## a. 基本方針

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

## b. 運用の方法

## (イ) 主要投資対象

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

## (ロ) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### (八) 主な投資制限

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

#### 各マザーファンドの運用方針

##### ニュー トピックス インデックス マザーファンド

##### 1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数に連動する投資成果をめざした運用を行います。

##### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。

## （２）投資態度

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

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

株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

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

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

## （３）投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

## ３．収益分配方針

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

## 新光外国株式インデックスマザーファンド

### １．基本方針

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

### ２．運用方法

#### （１）投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

#### （２）投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

#### （３）投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

純資産総額の10%以下とします。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### 3. 収益分配方針

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

## 新光日本債券インデックスマザーファンド

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方針

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

#### (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

### 3. 収益分配方針

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

## 海外国債マザーファンド

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

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

運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。

#### (イ) 超過収益獲得の観点から

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

#### (ロ) リスク管理の観点から

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

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

#### (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。

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

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

### 3. 収益分配方針

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

## 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

#### (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### 3. 収益分配方針

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

## グローバル高金利通貨マザーファンド

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

世界各国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

組入公社債の平均残存期間は、1～3年程度とします。

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

### (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### 3. 収益分配方針

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

## 新光J-REITマザーファンド

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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



## （２）投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

## （３）投資制限

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

不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

## ３．収益分配方針

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

## 新光米国ＲＥＩＴマザーファンド

### １．基本方針

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

### ２．運用方法

#### （１）投資対象

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

#### （２）投資態度

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

ＲＥＩＴの組入比率については、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

#### （３）投資制限

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

REITへの投資割合には制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### 3. 収益分配方針

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

## (2) 【投資対象】

### a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### b. 有価証券および金融商品の指図範囲等

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

1. ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券

2. 新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券

3. 新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券

4. 海外国債マザーファンド受益証券

5. 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券

6. グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券

7. 新光J-REITマザーファンド受益証券

8. 新光米国REITマザーファンド受益証券

9. 株券または新株引受権証券

10. 国債証券

11. 地方債証券

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

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

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

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

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

ｃ．先物

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

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

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

ｄ．スワップ

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

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

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

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

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

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

ｅ．金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

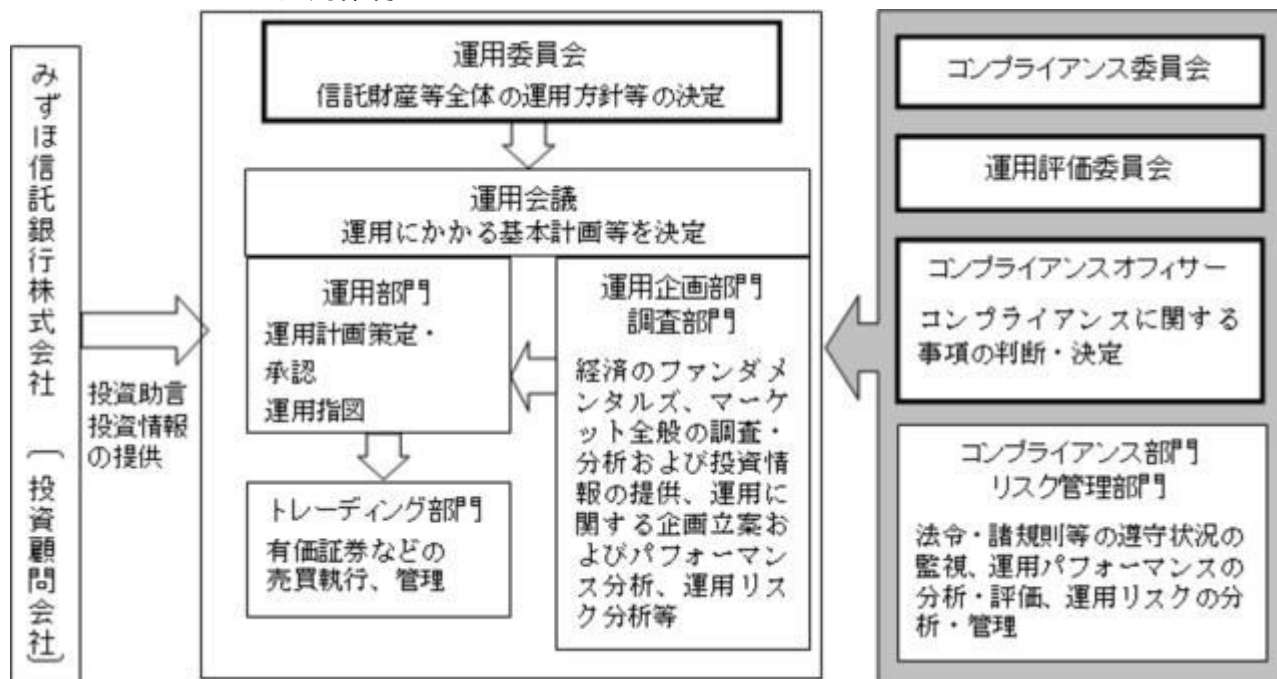
て信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

### (3) 【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



上記運用体制は、今後変更になることがあります。

#### PLAN

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

#### DO

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

#### SEE

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

#### < 受託者に対する管理体制 >

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

b．運用体制に関する社内規則

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

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

(4)【分配方針】

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

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

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

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

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

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

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

(5)【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．株式等への投資割合

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

b．新株引受権証券等への投資割合

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

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

の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じ。

c．投資信託証券への投資割合

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

d．同一銘柄への投資割合

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

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

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

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

e．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

f．投資する株式等の範囲

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

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

g．信用取引の指図範囲

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

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

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



## 4．売出しにより取得する株券

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

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

## h．有価証券の貸し付けの指図および範囲

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

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

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

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

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

## i．公社債の空売りの指図範囲

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

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

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

## j．公社債の借り入れ

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

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

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

（ニ）借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

## k．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

られる場合には、制約されることがあります。

l. 外国為替予約の指図および範囲

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

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

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

m. 資金の借り入れ

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

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

n. 利害関係人等との取引等

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

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

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

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

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

o. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

p. 信用リスク集中回避のための投資制限

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

法令に定める投資制限

a. 同一の法人の発行する株式

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

（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

### 3【投資リスク】

#### （1）ファンドのもつリスク

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

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

a. 資産配分リスク

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

b. 株価変動リスク

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

c. REITの価格変動リスク

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

d. 為替変動リスク

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

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

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

#### e．カントリーリスク

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

#### f．金利変動リスク

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

#### g．信用リスク

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

#### h．流動性リスク

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

#### i．他のベビーファンドの影響

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

#### j．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

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

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

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

- (二) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。
- (ホ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入る有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ヘ) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (ト) 投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

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

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

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

## 東証株価指数について

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

## MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）について

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

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

### **NOMURA - BPI総合について**

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

### **シティ世界国債インデックスについて**

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

### **東証REIT指数（配当込み）について**

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

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

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

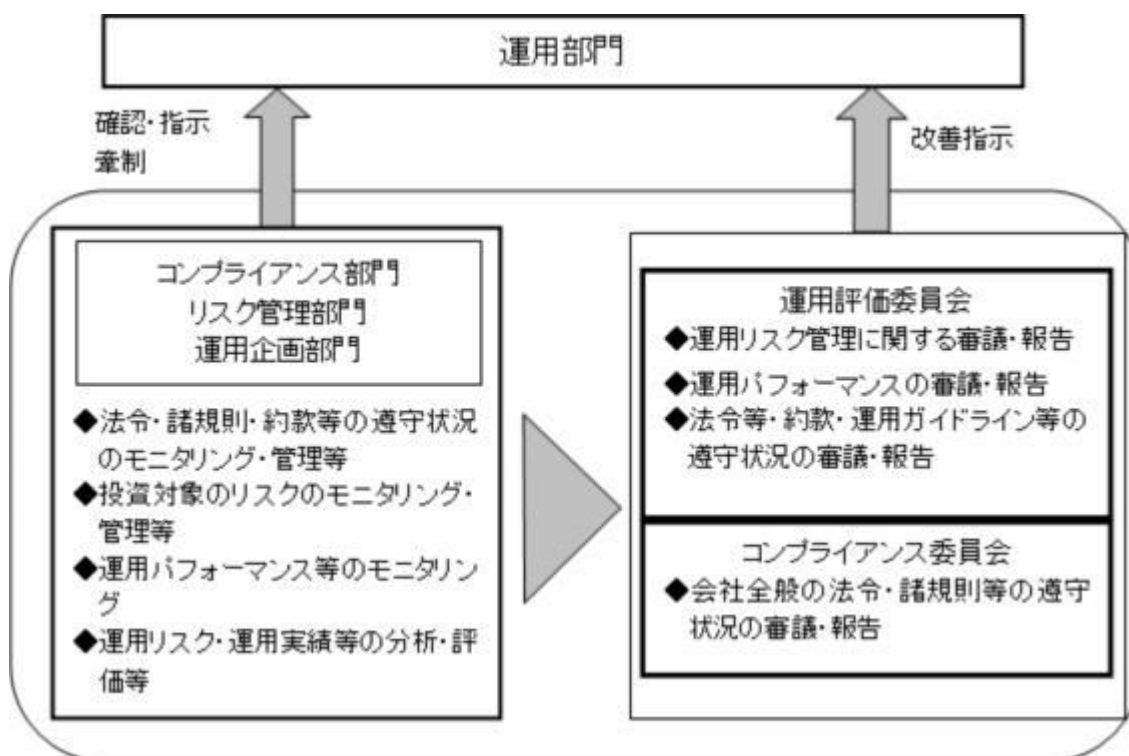
FTSE、London Stock Exchange Plc(以下「ロンドン証券取引所」といいます。)、The Financial Times Limited(以下「FT」といいます。)、National Association of Real Estate Investment Trusts(以下「全米不動産投資信託協会」といいます。 )は、新光米国REITマザーファンドに関して、保証、推奨、販売もしくは奨励を行うものではありません。

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

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

## (2) リスク管理体制

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



上記リスク管理体制は、今後変更になることがあります。

## <参考情報>

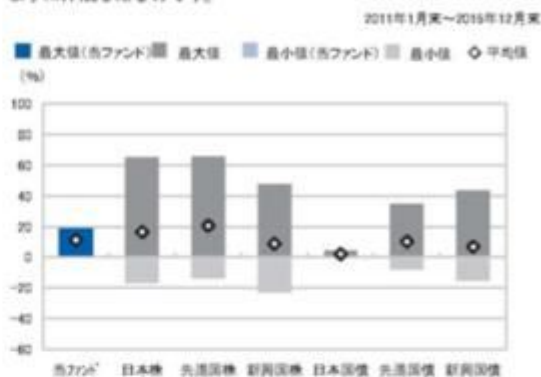
### ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

|     | 当ファンド | 日本株   | 先進国株  | 新興国株  | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債  |
|-----|-------|-------|-------|-------|------|------|-------|
| 最大値 | 18.7  | 65.0  | 65.7  | 47.4  | 4.5  | 34.9 | 43.7  |
| 最小値 | 0.4   | △17.0 | △13.6 | △22.8 | 0.4  | △7.9 | △15.0 |
| 平均値 | 11.3  | 16.6  | 20.7  | 8.8   | 2.3  | 10.2 | 6.9   |

- ※2011年1月から2015年12月の5年間の当ファンドは2015年1月から2015年12月の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- ※決算日に対応した数値とは異なります。
- ※当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

#### 各資産クラスの指数

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

#### 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

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

#### MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

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

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

#### NCMJRA-BPI国債

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

#### シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】



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

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

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

## （2）【換金（解約）手数料】

### a．解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

### b．信託財産留保額

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

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

## （3）【信託報酬等】

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

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬の配分 >

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

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

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

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

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

##### a. 個人の受益者の場合

##### (イ) 収益分配金の取り扱い

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

##### (ロ) 一部解約金・償還金の取り扱い

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

##### (ハ) 損益通算について

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合>

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

b. 法人の受益者の場合

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

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

なお、益金不算入制度は適用されません。

c. 個別元本について

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

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

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

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

d. 収益分配金の課税について

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

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

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

となります。

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

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

## 5【運用状況】

### （１）【投資状況】

#### グローバル・ナビ

（平成27年12月30日現在）

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

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

#### （参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

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

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

#### （参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

（平成27年12月30日現在）

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

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

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

## （参考）新光日本債券インデックスマザーファンド

（平成27年12月30日現在）

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

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

## （参考）海外国債マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券                | アメリカ | 16,519,395,790 | 43.01   |
|                     | カナダ  | 528,254,045    | 1.37    |
|                     | ドイツ  | 3,155,701,752  | 8.21    |
|                     | イタリア | 6,813,994,046  | 17.74   |
|                     | フランス | 6,107,322,080  | 15.90   |
|                     | イギリス | 4,528,580,890  | 11.79   |
|                     | 小計   | 37,653,248,603 | 98.04   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 750,127,714    | 1.95    |
| 純資産総額               |      | 38,403,376,317 | 100.00  |

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

## （参考）新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

（平成27年12月30日現在）

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

|                     |         |                |        |
|---------------------|---------|----------------|--------|
|                     | スペイン    | 828,355,632    | 5.32   |
|                     | ベルギー    | 396,679,090    | 2.54   |
|                     | オーストリア  | 241,853,294    | 1.55   |
|                     | フィンランド  | 92,700,195     | 0.59   |
|                     | アイルランド  | 128,436,220    | 0.82   |
|                     | イギリス    | 1,245,454,457  | 8.00   |
|                     | スウェーデン  | 70,611,960     | 0.45   |
|                     | ノルウェー   | 46,642,322     | 0.29   |
|                     | デンマーク   | 96,265,930     | 0.61   |
|                     | ポーランド   | 87,529,933     | 0.56   |
|                     | オーストラリア | 269,546,894    | 1.73   |
|                     | シンガポール  | 58,402,063     | 0.37   |
|                     | 南アフリカ   | 64,163,708     | 0.41   |
|                     | 小計      | 15,171,417,625 | 97.47  |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |         | 393,625,136    | 2.52   |
| 純資産総額               |         | 15,565,042,761 | 100.00 |

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

(参考) グローバル高金利通貨マザーファンド

(平成27年12月30日現在)

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

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

(参考) 新光J-REITマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

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

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

(参考) 新光米国REITマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計（円）     | 投資比率（％） |
|---------------------|------|-------------|---------|
| 投資証券                | アメリカ | 940,399,088 | 97.75   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |      | 21,596,623  | 2.24    |
| 純資産総額               |      | 961,995,711 | 100.00  |

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

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### グローバル・ナビ

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

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

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

#### ロ. 種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 95.09   |
| 合計        | 95.09   |

#### (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

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



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

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

(平成27年12月30日現在)

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

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

（参考）新光外国株式インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成27年12月30日現在）

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

|    |      |    |                              |                        |        |           |            |             |            |      |
|----|------|----|------------------------------|------------------------|--------|-----------|------------|-------------|------------|------|
| 4  | アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO (US)     | 資本財                    | 26,369 | 3,588.14  | 94,615,861 | 3,772.6807  | 99,481,820 | 0.87 |
| 5  | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7,737  | 12,162.31 | 94,099,811 | 12,547.0582 | 97,076,590 | 0.85 |
| 6  | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC               | 小売                     | 1,112  | 79,058.64 | 87,913,218 | 83,699.7221 | 93,074,091 | 0.82 |
| 7  | アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & COMPANY        | 銀行                     | 13,625 | 6,690.23  | 91,154,475 | 6,668.5268  | 90,858,679 | 0.80 |
| 8  | スイス  | 株式 | NESTLE SA-REGISTERED         | 食品・飲料・タバコ              | 9,737  | 9,089.69  | 88,506,370 | 9,132.2279  | 88,920,504 | 0.78 |
| 9  | アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO          | 銀行                     | 10,332 | 8,127.90  | 83,977,545 | 8,089.3127  | 83,578,779 | 0.73 |
| 10 | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C            | ソフトウェア・サービス            | 866    | 87,428.98 | 75,713,499 | 93,665.7263 | 81,114,519 | 0.71 |
| 11 | アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A               | ソフトウェア・サービス            | 6,003  | 12,843.75 | 77,101,084 | 12,936.6285 | 77,658,581 | 0.68 |
| 12 | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A            | ソフトウェア・サービス            | 810    | 91,032.80 | 73,736,576 | 95,759.5160 | 77,565,208 | 0.68 |
| 13 | スイス  | 株式 | NOVARTIS AG-REG SHS          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 6,949  | 10,778.82 | 74,902,048 | 10,633.0000 | 73,888,717 | 0.65 |
| 14 | アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO          | 家庭用品・パーソナル用品           | 7,622  | 9,093.99  | 69,314,422 | 9,692.2196  | 73,874,098 | 0.65 |
| 15 | アメリカ | 株式 | AT&T INC                     | 電気通信サービス               | 17,272 | 3,960.83  | 68,411,497 | 4,212.9073  | 72,765,335 | 0.64 |
| 16 | スイス  | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2,146  | 32,409.38 | 69,550,538 | 33,843.3201 | 72,627,765 | 0.64 |
| 17 | アメリカ | 株式 | PFIZER INC                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 17,301 | 4,058.52  | 70,216,567 | 3,959.6263  | 68,505,495 | 0.60 |
| 18 | アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 電気通信サービス               | 11,359 | 5,463.63  | 62,061,407 | 5,693.9980  | 64,678,124 | 0.57 |
| 19 | アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE             | 食品・飲料・タバコ              | 11,634 | 5,010.13  | 58,287,961 | 5,271.8630  | 61,332,855 | 0.54 |
| 20 | アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORPORATION  | 銀行                     | 29,164 | 2,132.38  | 62,188,870 | 2,084.1407  | 60,781,882 | 0.53 |
| 21 | アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP                 | エネルギー                  | 5,283  | 11,134.71 | 58,824,700 | 11,005.6625 | 58,142,915 | 0.51 |
| 22 | アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO.          | メディア                   | 4,480  | 14,041.41 | 62,905,544 | 12,914.9187 | 57,858,836 | 0.51 |
| 23 | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC               | 小売                     | 3,588  | 15,015.94 | 53,877,211 | 16,125.5571 | 57,858,499 | 0.51 |
| 24 | アメリカ | 株式 | INTEL CORP                   | 半導体・半導体製造装置            | 13,329 | 4,022.34  | 53,613,817 | 4,274.4184  | 56,973,723 | 0.50 |
| 25 | アメリカ | 株式 | CITIGROUP INC                | 銀行                     | 8,409  | 6,719.18  | 56,501,611 | 6,389.9178  | 53,732,819 | 0.47 |
| 26 | アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 各種金融                   | 3,311  | 16,161.90 | 53,512,071 | 16,178.6254 | 53,567,429 | 0.47 |
| 27 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES      | ソフトウェア・サービス            | 5,500  | 9,412.40  | 51,768,225 | 9,553.5181  | 52,544,350 | 0.46 |
| 28 | アメリカ | 株式 | GILEAD SCIENCES INC          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 4,129  | 13,039.14 | 53,838,639 | 12,466.2496 | 51,473,145 | 0.45 |
| 29 | アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC.             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7,938  | 6,541.88  | 51,929,494 | 6,433.3373  | 51,067,832 | 0.45 |

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

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

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成27年12月30日現在)

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

(参考)新光日本債券インデックスマザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

| 順位 | 国/地域 | 種類    | 銘柄名                  | 数量又は<br>額面総額 | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|-------|----------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 国債証券  | 第103回利付<br>国債(5年)    | 230,000,000  | 100.40            | 230,942,500       | 100.43           | 230,995,900      | 0.3000    | 2017.03.20 | 1.43            |
| 2  | 日本   | 国債証券  | 第308回利付<br>国債(10年)   | 210,000,000  | 105.83            | 222,257,700       | 105.67           | 221,913,300      | 1.3000    | 2020.06.20 | 1.38            |
| 3  | 日本   | 国債証券  | 第334回利付<br>国債(10年)   | 200,000,000  | 103.25            | 206,512,900       | 103.71           | 207,426,000      | 0.6000    | 2024.06.20 | 1.29            |
| 4  | 日本   | 国債証券  | 第105回利付<br>国債(5年)    | 200,000,000  | 100.32            | 200,651,200       | 100.37           | 200,756,000      | 0.2000    | 2017.06.20 | 1.25            |
| 5  | 日本   | 国債証券  | 第313回利付<br>国債(10年)   | 180,000,000  | 106.69            | 192,056,400       | 106.59           | 191,874,600      | 1.3000    | 2021.03.20 | 1.19            |
| 6  | 日本   | 国債証券  | 第123回利付<br>国債(5年)    | 190,000,000  | 100.34            | 190,659,300       | 100.35           | 190,678,300      | 0.1000    | 2020.03.20 | 1.18            |
| 7  | 日本   | 国債証券  | 第306回利付<br>国債(10年)   | 180,000,000  | 105.97            | 190,750,000       | 105.79           | 190,429,200      | 1.4000    | 2020.03.20 | 1.18            |
| 8  | 日本   | 国債証券  | 第323回利付<br>国債(10年)   | 180,000,000  | 105.42            | 189,756,000       | 105.50           | 189,903,600      | 0.9000    | 2022.06.20 | 1.18            |
| 9  | 日本   | 国債証券  | 第315回利付<br>国債(10年)   | 170,000,000  | 106.42            | 180,922,500       | 106.34           | 180,781,400      | 1.2000    | 2021.06.20 | 1.12            |
| 10 | 日本   | 国債証券  | 第124回利付<br>国債(5年)    | 180,000,000  | 100.34            | 180,619,200       | 100.35           | 180,640,800      | 0.1000    | 2020.06.20 | 1.12            |
| 11 | 日本   | 国債証券  | 第303回利付<br>国債(10年)   | 170,000,000  | 105.33            | 179,064,000       | 105.17           | 178,789,000      | 1.4000    | 2019.09.20 | 1.11            |
| 12 | 日本   | 国債証券  | 第335回利付<br>国債(10年)   | 170,000,000  | 102.34            | 173,982,200       | 102.83           | 174,812,700      | 0.5000    | 2024.09.20 | 1.08            |
| 13 | 日本   | 国債証券  | 第285回利付<br>国債(10年)   | 170,000,000  | 102.30            | 173,915,100       | 102.11           | 173,590,400      | 1.7000    | 2017.03.20 | 1.08            |
| 14 | 日本   | 国債証券  | 第338回利付<br>国債(10年)   | 170,000,000  | 101.18            | 172,014,500       | 101.76           | 172,993,700      | 0.4000    | 2025.03.20 | 1.07            |
| 15 | 日本   | 国債証券  | 第106回利付<br>国債(5年)    | 170,000,000  | 100.38            | 170,649,000       | 100.43           | 170,739,500      | 0.2000    | 2017.09.20 | 1.06            |
| 16 | 日本   | 国債証券  | 第340回利付<br>国債(10年)   | 160,000,000  | 100.92            | 161,487,600       | 101.46           | 162,350,400      | 0.4000    | 2025.09.20 | 1.01            |
| 17 | 日本   | 国債証券  | 第107回利付<br>国債(5年)    | 160,000,000  | 100.42            | 160,679,800       | 100.46           | 160,750,400      | 0.2000    | 2017.12.20 | 1.00            |
| 18 | 日本   | 国債証券  | 第125回利付<br>国債(5年)    | 160,000,000  | 100.31            | 160,498,400       | 100.35           | 160,563,200      | 0.1000    | 2020.09.20 | 0.99            |
| 19 | 日本   | 国債証券  | 第312回利付<br>国債(10年)   | 150,000,000  | 105.93            | 158,902,500       | 105.79           | 158,685,000      | 1.2000    | 2020.12.20 | 0.98            |
| 20 | 日本   | 国債証券  | 第310回利付<br>国債(10年)   | 150,000,000  | 104.70            | 157,053,000       | 104.55           | 156,838,500      | 1.0000    | 2020.09.20 | 0.97            |
| 21 | 日本   | 国債証券  | 第118回利付<br>国債(5年)    | 140,000,000  | 100.70            | 140,982,000       | 100.69           | 140,966,000      | 0.2000    | 2019.06.20 | 0.87            |
| 22 | 日本   | 国債証券  | 第116回利付<br>国債(5年)    | 140,000,000  | 100.60            | 140,847,000       | 100.63           | 140,889,000      | 0.2000    | 2018.12.20 | 0.87            |
| 23 | 日本   | 国債証券  | 第122回利付<br>国債(5年)    | 140,000,000  | 100.34            | 140,484,000       | 100.37           | 140,525,000      | 0.1000    | 2019.12.20 | 0.87            |
| 24 | 日本   | 国債証券  | 第293回利付<br>国債(10年)   | 130,000,000  | 104.68            | 136,089,200       | 104.45           | 135,794,100      | 1.8000    | 2018.06.20 | 0.84            |
| 25 | 日本   | 国債証券  | 第290回利付<br>国債(10年)   | 130,000,000  | 103.29            | 134,277,000       | 103.14           | 134,082,000      | 1.4000    | 2018.03.20 | 0.83            |
| 26 | 日本   | 国債証券  | 第117回利付<br>国債(5年)    | 130,000,000  | 100.65            | 130,848,900       | 100.67           | 130,873,600      | 0.2000    | 2019.03.20 | 0.81            |
| 27 | 日本   | 国債証券  | 第109回利付<br>国債(5年)    | 130,000,000  | 100.23            | 130,305,500       | 100.27           | 130,357,500      | 0.1000    | 2018.03.20 | 0.81            |
| 28 | 日本   | 国債証券  | 第332回利付<br>国債(10年)   | 120,000,000  | 103.39            | 124,075,200       | 103.78           | 124,538,400      | 0.6000    | 2023.12.20 | 0.77            |
| 29 | 日本   | 地方債証券 | 第18回東京都<br>公募公債(20年) | 100,000,000  | 119.26            | 119,260,000       | 120.57           | 120,570,000      | 2.2200    | 2029.03.19 | 0.75            |

|    |    |      |                           |             |        |             |        |             |        |            |      |
|----|----|------|---------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|--------|------------|------|
| 30 | 日本 | 特殊債券 | 第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 118.56 | 118,560,000 | 120.06 | 120,060,000 | 2.1000 | 2029.12.28 | 0.74 |
|----|----|------|---------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|--------|------------|------|

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

#### ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

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

#### (参考)海外国債マザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

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

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

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

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

#### ロ. 種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.04   |
| 合計   | 98.04   |

(参考) 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

#### イ. 評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

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

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

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

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

#### ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.47   |
| 合計   | 97.47   |

(参考)グローバル高金利通貨マザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)



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

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

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

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

#### ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 特殊債券 | 95.39   |
| 合計   | 95.39   |

#### (参考)新光J-REITマザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

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

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

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

#### ロ.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.19   |
| 合計   | 98.19   |

#### (参考)新光米国REITマザーファンド

#### イ.評価額上位銘柄明細

(平成27年12月30日現在)

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

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

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

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

#### □.種類別投資比率

(平成27年12月30日現在)

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 97.75   |
| 合計   | 97.75   |

#### 【投資不動産物件】

##### グローバル・ナビ

該当事項はありません。

(参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

(参考)グローバル高金利通貨マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光J-R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光米国R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

## グローバル・ナビ

該当事項はありません。

## (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成27年12月30日現在)

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

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

## (参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

| 資産の種類            | 地域              | 取引所                            | 資産の名称        | 買建/<br>売建 | 数量 | 通貨                | 帳簿価額      | 帳簿価額<br>(円) | 評価額       | 評価額<br>(円)  | 投資比率<br>(%) |
|------------------|-----------------|--------------------------------|--------------|-----------|----|-------------------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------------|
| 株価指<br>数先物<br>取引 | アメリカ            | シカゴ商業<br>取引所                   | S&P500 EMINI | 買建        | 49 | 米ドル               | 4,991,042 | 601,969,575 | 5,078,360 | 612,500,999 | 5.41        |
|                  | カナダ             | モントリ<br>オール取引<br>所             | S&P/TSE 60IX | 買建        | 1  | カナダド<br>ル         | 148,946   | 12,985,112  | 155,300   | 13,539,054  | 0.11        |
|                  | ドイツ             | ユーレック<br>ス・ドイツ<br>金融先物取<br>引所  | DJ EURO ST50 | 買建        | 31 | ユーロ               | 1,004,338 | 132,341,618 | 1,022,690 | 134,759,861 | 1.19        |
|                  | オース<br>トラリ<br>ア | シドニー先<br>物取引所                  | SPI 200      | 買建        | 3  | オースト<br>ラリアド<br>ル | 367,461   | 32,307,171  | 393,675   | 34,611,906  | 0.30        |
|                  | イギリ<br>ス        | ロンドン国<br>際金融先物<br>オプション<br>取引所 | LIFFE FTSE   | 買建        | 14 | 英ポンド              | 837,774   | 149,777,235 | 875,420   | 156,507,587 | 1.38        |

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

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

## (参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

## (参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

（平成27年12月30日現在）

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

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

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

## （参考）グローバル高金利通貨マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新光J - R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新光米国R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## グローバル・ナビ

| 期別                   | 純資産総額（円）    |             | 1口当たり純資産額（円） |        |
|----------------------|-------------|-------------|--------------|--------|
|                      | （分配落）       | （分配付）       | （分配落）        | （分配付）  |
| 第1計算期間末（平成26年12月15日） | 156,197,806 | 156,197,806 | 1.0986       | 1.0986 |
| 第2計算期間末（平成27年12月15日） | 192,855,223 | 192,855,223 | 1.1107       | 1.1107 |
| 平成26年12月末日           | 164,562,493 |             | 1.1187       |        |
| 平成27年1月末日            | 178,267,100 |             | 1.1108       |        |
| 2月末日                 | 185,780,115 |             | 1.1366       |        |

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

## 【分配の推移】

## グローバル・ナビ

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

## 【収益率の推移】

## グローバル・ナビ

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

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

## グローバル・ナビ

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

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## 参考情報

## 運用実績

2015年12月30日現在

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



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。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;

| 年月       | 金額 (円) |
|----------|--------|
| 2015年12月 | 0円     |
| 2014年12月 | 0円     |
| -        | -      |
| -        | -      |
| -        | -      |
| 設定来累計    | 0円     |

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

## &lt;主要な資産の状況&gt;

## 組入状況

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

## ニュー トビックス インデックス マザーファンドの組入上位5銘柄

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

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

## 新光外国株式インデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名                     | 国・地域 | 業種                     | 純資産比率 |
|-------------------------|------|------------------------|-------|
| APPLE INC               | アメリカ | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 1.84% |
| MICROSOFT CORP          | アメリカ | ソフトウェア・サービス            | 1.28% |
| EXXON MOBIL CORP        | アメリカ | エネルギー                  | 0.98% |
| GENERAL ELECTRIC CO(US) | アメリカ | 資本財                    | 0.87% |
| JOHNSON & JOHNSON       | アメリカ | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 0.85% |

※世界産業分類基準(GICS)にしたがって記載しています。純資産比率は、新光外国株式インデックスマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

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



2015年12月30日現在

## 新光J-REITマザーファンドの組入上位5銘柄

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

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

## 新光米国REITマザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名 | 純資産比率 |
|-----|-------|
|     |       |
|     |       |
|     |       |
|     |       |

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

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

## 新光日本債券インデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

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

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

## 海外国債マザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名             | 償還日        | 利率     | 通貨  | 純資産比率 |
|-----------------|------------|--------|-----|-------|
| US TREASURY N/B | 2024/08/15 | 2.375% | 米ドル | 4.24% |
| US TREASURY N/B | 2024/11/15 | 2.250% | 米ドル | 4.19% |
| US TREASURY N/B | 2024/05/15 | 2.500% | 米ドル | 4.19% |
| US TREASURY N/B | 2025/05/15 | 2.125% | 米ドル | 4.17% |
| US TREASURY N/B | 2025/08/15 | 2.000% | 米ドル | 4.09% |

※純資産比率は、海外国債マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

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

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

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

## グローバル高金利通貨マザーファンドの組入上位5銘柄

| 銘柄名 | 償還日 | 利率 | 通貨 | 純資産比率 |
|-----|-----|----|----|-------|
|     |     |    |    |       |
|     |     |    |    |       |
|     |     |    |    |       |
|     |     |    |    |       |

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

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

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

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

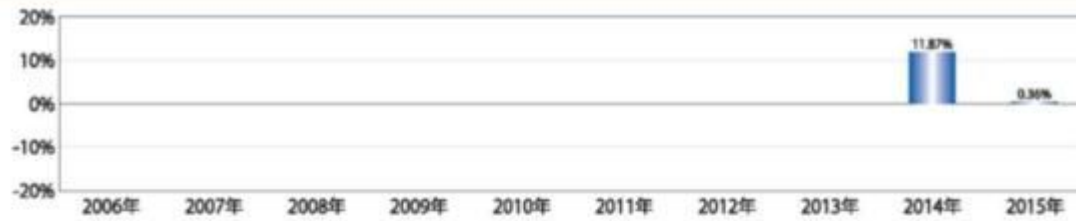
※最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認いただけます。

## 運用実績

2015年12月30日現在

暦年ベース

## &lt;年間収益率の推移&gt;



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

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

12

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

新光投信株式会社 ヘルプデスク

フリーダイヤル 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

当ファンドの主な投資対象の評価方法は以下のとおりです。

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

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

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

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

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

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

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

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

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

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

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

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

#### b. 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

#### c. 書面決議の手続き

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

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

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

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

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

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

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

d．反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

e．運用報告書

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

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

f．公告

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

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

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

g．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

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

h．信託事務処理の再信託

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

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

i．信託業務の委託等

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

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

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

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

るものとしします。

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

j．他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

k．関係法人との契約の更改

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

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

#### 4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

b．一部解約請求権

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

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

c．償還金請求権

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

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成26年12月16日から平成27年12月15日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【グローバル・ナビ】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

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

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

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

## （ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

| 区分              | 第2期  |
|-----------------|--|
|                 | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日   |
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（ 貸借対照表に関する注記 ）

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

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

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

（ 金融商品に関する注記 ）

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 第1期                            | 第2期                            |
|----|--------------------------------|--------------------------------|
|    | 自 平成26年 1月 6日<br>至 平成26年12月15日 | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日 |
|    |                                |                                |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

|   |    |
|---|----|
| 親投資信託受益証券<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して<br>おります。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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<br>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<br>す。 | 同左 |
|---|----|

## （関連当事者との取引に関する注記）

|  | 第1期<br>自 平成26年 1月 6日<br>至 平成26年12月15日 | 第2期<br>自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日 |
|--|---------------------------------------|---------------------------------------|
|  | 該当事項はありません。                           | 同左                                    |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

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

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

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

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

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

（注）券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「新光外国株式インデックスマザーファンド」、「新光日本債券インデックスマザーファンド」、「海外国債マザーファンド」、「新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」、「グローバル高金利通貨マザーファンド」、「新光J-REITマザーファンド」及び「新光米国REITマザーファンド」各受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、これら同ファンドの受益証券であります。

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

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

貸借対照表

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                    | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日   |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式<br>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。<br>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<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。   |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成26年12月15日現在                                      | 平成27年12月15日現在                                      |
|--|--|
| 1. 担保資産<br>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 | 1. 担保資産<br>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 |



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

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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

| 区分                         | 自 平成26年 1月 6日<br>至 平成26年12月15日  | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日 |
|----------------------------|---|--------------------------------|
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制         | <p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左                             |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>  | 同左                             |

## 金融商品の時価等に関する事項

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

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

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

## 2 有価証券関係 売買目的有価証券

| 種類 | 平成26年12月15日現在      | 平成27年12月15日現在      |
|----|--------------------|--------------------|
|    | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式 | 1,094,219,349      | 1,023,953,114      |
| 合計 | 1,094,219,349      | 1,023,953,114      |

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

## 3 デリバティブ取引等関係

### 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

| 種類       | 平成26年12月15日現在 |   |             |            | 平成27年12月15日現在 |   |             |            |
|----------|---------------|---|-------------|------------|---------------|---|-------------|------------|
|          | 契約額等（円）       |   | 時価（円）       | 評価損益（円）    | 契約額等（円）       |   | 時価（円）       | 評価損益（円）    |
|          | うち1年超         |   |             |            | うち1年超         |   |             |            |
| 市場取引     |               |   |             |            |               |   |             |            |
| 株値指数先物取引 |               |   |             |            |               |   |             |            |
| 買建       | 369,384,080   | - | 357,500,000 | 11,884,080 | 562,178,880   | - | 540,540,000 | 21,638,880 |
| 東証株値指数先物 | 369,384,080   | - | 357,500,000 | 11,884,080 | 562,178,880   | - | 540,540,000 | 21,638,880 |
| 合計       | 369,384,080   | - | 357,500,000 | 11,884,080 | 562,178,880   | - | 540,540,000 | 21,638,880 |

### 時価の算定方法

#### 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

### 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

(単位：円)

| 銘柄     | 株式数   | 評価額      |           | 備考 |
|--------|-------|----------|-----------|----|
|        |       | 単価       | 金額        |    |
| 極洋     | 3,000 | 260.00   | 780,000   |    |
| 日本水産   | 6,900 | 449.00   | 3,098,100 |    |
| マルハニチロ | 1,200 | 1,894.00 | 2,272,800 |    |
| サカタのタネ | 1,000 | 2,696.00 | 2,696,000 |    |

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

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

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                    | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日  |
|-----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | <p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>   |
| 3. 収益及び費用の計上基準        | 受取配当金   |

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 平成26年12月15日現在          |                | 平成27年12月15日現在          |                |
|------------------------|----------------|------------------------|----------------|
| 1. 計算日における受益権の総数       | 7,127,974,226口 | 1. 計算日における受益権の総数       | 5,926,931,068口 |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額              | 1.8656円        | 1口当たり純資産額              | 1.8811円        |
| (1万口当たり純資産額)           | (18,656円)      | (1万口当たり純資産額)           | (18,811円)      |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

|  |    |
|--|----|
| 株式<br>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。   | 同左 |
| 投資信託受益証券<br>「（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<br>「（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<br>「（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<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |    |
|  |    |

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

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

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類       | 平成26年12月15日現在      | 平成27年12月15日現在      |
|----------|--------------------|--------------------|
|          | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式       | 220,130,348        | 417,073,500        |
| 投資信託受益証券 | 22,536             | 46,041             |
| 投資証券     | 5,087,879          | 563,335            |
| 合計       | 215,019,933        | 416,556,206        |

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

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

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

## 時価の算定方法

## 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

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



上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

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

時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

#### 有価証券明細表注記

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

| 通貨             | 銘柄数              | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|----------------|------------------|--------------|------------------------|----------------|-------------------------|
| 米ドル            | 株式 605銘柄         | 56.2%        |                        |                | 63.1%                   |
|                | 投資信託受<br>益証券 1銘柄 |              | 0.0%                   |                | 0.0%                    |
|                | 投資証券 35銘柄        |              |                        | 1.7%           | 1.9%                    |
| カナダドル          | 株式 91銘柄          | 3.1%         |                        |                | 3.5%                    |
|                | 投資証券 2銘柄         |              |                        | 0.0%           | 0.0%                    |
| ユーロ            | 株式 233銘柄         | 10.9%        |                        |                | 12.2%                   |
|                | 投資証券 5銘柄         |              |                        | 0.1%           | 0.1%                    |
| 英ポンド           | 株式 108銘柄         | 6.3%         |                        |                | 7.1%                    |
|                | 投資証券 5銘柄         |              |                        | 0.1%           | 0.1%                    |
| スイスフラン         | 株式 39銘柄          | 3.9%         |                        |                | 4.4%                    |
| スウェーデンクロー<br>ナ | 株式 30銘柄          | 1.2%         |                        |                | 1.3%                    |
| ノルウェークローネ      | 株式 9銘柄           | 0.2%         |                        |                | 0.3%                    |
| デンマーククローネ      | 株式 15銘柄          | 0.8%         |                        |                | 0.9%                    |
| オーストラリアドル      | 株式 64銘柄          | 2.1%         |                        |                | 2.4%                    |
|                | 投資証券 8銘柄         |              |                        | 0.2%           | 0.2%                    |
| ニュージーランドド<br>ル | 株式 7銘柄           | 0.1%         |                        |                | 0.1%                    |
| 香港ドル           | 株式 40銘柄          | 1.2%         |                        |                | 1.4%                    |
|                | 投資証券 1銘柄         |              |                        | 0.0%           | 0.1%                    |
| シンガポールドル       | 株式 23銘柄          | 0.5%         |                        |                | 0.5%                    |
|                | 投資証券 4銘柄         |              |                        | 0.0%           | 0.0%                    |
| イスラエルシェケル      | 株式 9銘柄           | 0.3%         |                        |                | 0.3%                    |

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

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

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

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

|   |   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br>14,468,670,820口                                   | 1. 計算日における受益権の総数<br>13,221,766,651口                                   |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.2051円<br>(1万口当たり純資産額) (12,051円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.2214円<br>(1万口当たり純資産額) (12,214円) |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成26年12月15日現在  | 平成27年12月15日現在   |
|--|---|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>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<br/>ん。</p> <p>2.時価の算定方法<br/>国債証券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して<br/>おります。<br/>地方債証券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して<br/>おります。<br/>特殊債券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して<br/>おります。<br/>社債券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載して<br/>おります。<br/>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>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<br/>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<br/>す。</p> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>同左</p> <p>2.時価の算定方法<br/>同左</p> |

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

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

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

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

| 種類    | 平成26年12月15日現在      | 平成27年12月15日現在      |
|-------|--------------------|--------------------|
|       | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券  | 105,480,300        | 35,745,400         |
| 地方債証券 | 3,457,300          | 1,022,200          |
| 特殊債券  | 4,263,800          | 2,099,500          |
| 社債券   | 1,280,000          | 50,000             |
| 合計    | 114,481,400        | 38,817,100         |

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

## 3 デリバティブ取引等関係

### 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

### 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

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

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



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

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

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

|          |                            |                |                |  |
|----------|----------------------------|----------------|----------------|--|
|          | 平成19年度第2回北海道公募公債           | 30,000,000     | 30,759,000     |  |
|          | 第164回神奈川県公募公債              | 100,000,000    | 105,040,000    |  |
|          | 第87回大阪府公募公債(5年)            | 50,000,000     | 50,115,000     |  |
|          | 第110回大阪府公募公債(5年)           | 100,000,000    | 100,170,000    |  |
|          | 第302回大阪府公募公債(10年)          | 40,000,000     | 40,984,000     |  |
|          | 平成20年度第1回愛知県公募公債(10年)      | 48,000,000     | 50,049,600     |  |
|          | 平成24年度第3回広島県公募公債           | 66,000,000     | 68,838,000     |  |
|          | 平成24年度第7回広島県公募公債           | 100,000,000    | 103,240,000    |  |
|          | 第66回共同発行市場公募地方債            | 100,000,000    | 104,050,000    |  |
|          | 第105回共同発行市場公募地方債           | 50,000,000     | 52,780,000     |  |
|          | 第485回名古屋市長公募公債(10年)        | 30,000,000     | 30,942,000     |  |
|          | 平成19年度第2回京都市公募公債           | 30,000,000     | 31,011,000     |  |
|          | 平成19年度第5回福岡市長公募公債          | 13,000,000     | 13,414,700     |  |
|          | 平成24年度第2回広島市長公募公債          | 100,000,000    | 103,510,000    |  |
| 地方債証券 小計 |                            | 1,137,000,000  | 1,192,139,300  |  |
| 特殊債券     | 第33回日本政策投資銀行社債             | 100,000,000    | 100,310,000    |  |
|          | 第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 103,980,000    |  |
|          | 第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 119,510,000    |  |
|          | 第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券     | 100,000,000    | 103,170,000    |  |
|          | 第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000    | 101,520,000    |  |
|          | 第34回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 100,000,000    | 104,790,000    |  |
|          | 第49回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 100,000,000    | 105,200,000    |  |
|          | 第58回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 100,000,000    | 103,370,000    |  |
|          | 第876回政府保証公営企業債券            | 101,000,000    | 103,797,700    |  |
|          | い第759号農林債                  | 20,000,000     | 20,116,000     |  |
|          | い第766号農林債                  | 50,000,000     | 50,175,000     |  |
|          | 第274回信金中金債(5年)             | 100,000,000    | 100,290,000    |  |
|          | 第13回中日本高速道路社債(財投機関債)       | 100,000,000    | 105,280,000    |  |
| 特殊債券 小計  |                            | 1,171,000,000  | 1,221,508,700  |  |
| 社債券      | 第4回第一三共社債                  | 100,000,000    | 103,860,000    |  |
|          | 第30回新日鐵住金社債                | 100,000,000    | 105,300,000    |  |
|          | 第1回日本電産社債                  | 100,000,000    | 100,480,000    |  |
|          | 第8回トヨタ自動車社債                | 100,000,000    | 105,700,000    |  |
|          | 第36回東日本旅客鉄道社債              | 100,000,000    | 115,180,000    |  |
|          | 第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ社債         | 100,000,000    | 104,620,000    |  |
|          | 第524回東京電力社債                | 100,000,000    | 101,460,000    |  |
| 社債券 小計   |                            | 700,000,000    | 736,600,000    |  |
| 合計       |                            | 14,958,000,000 | 16,070,131,400 |  |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 海外国債マザーファンド

#### 貸借対照表

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

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                   | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日   |
|----------------------|--|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法    | 国債証券<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。  |

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 平成26年12月15日現在   | 平成27年12月15日現在   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br>22,791,420,858口                                   | 1. 計算日における受益権の総数<br>16,920,799,395口                                   |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 2.3914円<br>(1万口当たり純資産額) (23,914円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 2.3352円<br>(1万口当たり純資産額) (23,352円) |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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

| 区分                         | 自 平成26年 1月 6日<br>至 平成26年12月15日  | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日 |
|----------------------------|---|--------------------------------|
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制         | <p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク<br/>市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク<br/>組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク<br/>市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p> | 同左                             |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>  | 同左                             |

## 金融商品の時価等に関する事項

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

| 平成26年12月15日現在  | 平成27年12月15日現在  |
|--|--|
| 国債証券<br>「（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。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 国債証券<br>「（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。<br>派生商品評価勘定<br>「（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。<br>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分                                 | 平成26年12月15日現在   | 平成27年12月15日現在   |
|------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 30,467,962,912円 | 22,791,420,858円 |
| 期中追加設定元本額                          | 32,722,403円     | 158,500,408円    |
| 期中一部解約元本額                          | 7,709,264,457円  | 6,029,121,871円  |
| 同期末における元本の内訳                       |                 |                 |
| 海外国債ファンド                           | 14,149,820,427円 | 11,427,326,353円 |
| 海外国債ファンド（3ヵ月決算型）                   | 1,795,786,023円  | 1,514,376,289円  |
| 新光7資産バランスファンド                      | 492,165,560円    | 408,157,097円    |
| 海外国債ファンド（1年決算型）                    | 35,675,420円     | 40,454,372円     |
| 海外国債ファンド（変額年金）                     | 6,304,534,408円  | 3,509,821,876円  |
| 世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）     | 3,477,904円      | 3,735,986円      |
| グローバル・ナビ                           | 9,961,116円      | 16,927,422円     |
| 合計                                 | 22,791,420,858円 | 16,920,799,395円 |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成26年12月15日現在      | 平成27年12月15日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 919,434,249        | 22,463,682         |
| 合計   | 919,434,249        | 22,463,682         |



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

### 3 デリバティブ取引等関係

#### 取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

| 種類        | 平成26年12月15日現在 |   |       |         | 平成27年12月15日現在 |   |             |           |
|-----------|---------------|---|-------|---------|---------------|---|-------------|-----------|
|           | 契約額等(円)       |   | 時価(円) | 評価損益(円) | 契約額等(円)       |   | 時価(円)       | 評価損益(円)   |
|           | うち1年超         |   |       |         | うち1年超         |   |             |           |
| 市場取引以外の取引 |               |   |       |         |               |   |             |           |
| 為替予約取引    |               |   |       |         |               |   |             |           |
| 売建        | -             | - | -     | -       | 255,835,886   | - | 257,168,325 | 1,332,439 |
| カナダドル     | -             | - | -     | -       | 27,900,024    | - | 28,043,274  | 143,250   |
| ユーロ       | -             | - | -     | -       | 227,935,862   | - | 229,125,051 | 1,189,189 |
| 合計        | -             | - | -     | -       | 255,835,886   | - | 257,168,325 | 1,332,439 |

#### 時価の算定方法

##### 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

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

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

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

## 有価証券明細表注記

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

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

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

（単位：円）

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

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                         | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日  |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>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26年12月15日現在   | 平成27年12月15日現在   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br>13,234,688,062口                                   | 1. 計算日における受益権の総数<br>11,872,377,473口                                   |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.3163円<br>(1万口当たり純資産額) (13,163円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.3314円<br>(1万口当たり純資産額) (13,314円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自 平成26年 1月 6日<br>至 平成26年12月15日 | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日 |
|----|--------------------------------|--------------------------------|
|    |                                |                                |

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成26年12月15日現在   | 平成27年12月15日現在   |
|---|---|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>国債証券<br/>「（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<br/>「（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<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 区分   | 平成26年12月15日現在   | 平成27年12月15日現在   |
|--|-----------------|-----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額           | 14,506,931,516円 | 13,234,688,062円 |
| 期中追加設定元本額                                    | 135,155,617円    | 83,164,323円     |
| 期中一部解約元本額                                    | 1,407,399,071円  | 1,445,474,912円  |
| 同期末における元本の内訳<br>新光ワールドバランスファンドV A（適格機関投資家私募） | 7,761,097,997円  | 6,741,407,837円  |

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

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

| 種類   | 平成26年12月15日現在      | 平成27年12月15日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 237,202,039        | 120,152,129        |
| 合計   | 237,202,039        | 120,152,129        |

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

## 3 デリバティブ取引等関係

### 取引の時価等に関する事項

(債券関連)

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

### 時価の算定方法

#### 先物取引



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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

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

時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

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

|          |      |  |               |               |                 |
|----------|------|--|---------------|---------------|-----------------|
|          |      | US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15         | 900,000.00    | 888,820.31    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15        | 1,500,000.00  | 1,462,382.80  |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15          | 500,000.00    | 499,179.69    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15         | 1,300,000.00  | 1,362,867.19  |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15        | 2,000,000.00  | 2,029,218.76  |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15         | 200,000.00    | 200,359.37    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15          | 600,000.00    | 805,734.37    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15         | 300,000.00    | 395,859.37    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15        | 400,000.00    | 546,687.50    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15          | 500,000.00    | 648,828.12    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15          | 500,000.00    | 649,531.25    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15          | 300,000.00    | 335,742.18    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15        | 600,000.00    | 763,031.24    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15        | 600,000.00    | 790,312.50    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15        | 500,000.00    | 635,898.44    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15        | 1,300,000.00  | 1,535,421.87  |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15         | 200,000.00    | 249,828.12    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15         | 300,000.00    | 402,867.18    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15        | 500,000.00    | 638,007.81    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15         | 600,000.00    | 696,656.25    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15        | 400,000.00    | 417,625.00    |                 |
|          |      | US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15          | 500,000.00    | 502,695.31    |                 |
| 米ドル建小計   |      |  | 51,300,000.00 | 54,817,214.70 | (6,641,653,733) |
| カナダドル    | 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01      | 500,000.00    | 525,350.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01     | 300,000.00    | 327,183.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01     | 300,000.00    | 332,235.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01      | 300,000.00    | 336,495.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01     | 200,000.00    | 224,800.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01     | 50,000.00     | 55,157.50     |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01      | 100,000.00    | 101,707.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01      | 300,000.00    | 326,997.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01     | 200,000.00    | 213,700.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01     | 300,000.00    | 438,207.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01      | 350,000.00    | 518,714.00    |                 |
|          |      | CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01      | 100,000.00    | 134,609.00    |                 |
| カナダドル建小計 |      |  | 3,000,000.00  | 3,535,154.50  | (312,154,142)   |
| メキシコペソ   | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15  | 2,300,000.00  | 2,336,524.00  |                 |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14 | 2,800,000.00  | 2,997,484.00  |                 |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11  | 3,000,000.00  | 3,303,630.00  |                 |
|          |      | MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10  | 1,700,000.00  | 1,759,432.00  |                 |

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

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

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

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

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

## 有価証券明細表注記

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



## 3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨         | 銘柄数     | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|---------|--------------|-------------------------|
| 米ドル        | 債券 47銘柄 | 42.0%        | 42.9%                   |
| カナダドル      | 債券 12銘柄 | 2.0%         | 2.0%                    |
| メキシコペソ     | 債券 8銘柄  | 0.9%         | 0.9%                    |
| ユーロ        | 債券 93銘柄 | 40.4%        | 41.3%                   |
| 英ポンド       | 債券 16銘柄 | 8.2%         | 8.4%                    |
| スウェーデンクローナ | 債券 6銘柄  | 0.4%         | 0.5%                    |
| ノルウェークローネ  | 債券 5銘柄  | 0.3%         | 0.3%                    |
| デンマーククローネ  | 債券 4銘柄  | 0.6%         | 0.6%                    |
| ポーランドズロチ   | 債券 6銘柄  | 0.5%         | 0.6%                    |
| オーストラリアドル  | 債券 10銘柄 | 1.7%         | 1.7%                    |
| シンガポールドル   | 債券 5銘柄  | 0.4%         | 0.4%                    |
| 南アフリカランド   | 債券 5銘柄  | 0.4%         | 0.4%                    |

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

## 新光J-REITマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

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

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                 | 自 平成26年12月16日<br>至 平成27年12月15日   |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br>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。<br>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<br>(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<br>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。   |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成26年12月15日現在   | 平成27年12月15日現在   |
|---|---|
| 1. 計算日における受益権の総数<br>773,946,538口                                      | 1. 計算日における受益権の総数<br>1,510,959,483口                                    |
| 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.5896円<br>(1万口当たり純資産額) (15,896円) | 2. 計算日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.4928円<br>(1万口当たり純資産額) (14,928円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 平成26年12月15日現在   | 平成27年12月15日現在   |
|---|---|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>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<br/>投資証券<br/>「（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。<br/>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>同左</p> <p>2.時価の算定方法<br/>同左</p> |

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

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

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成26年12月15日現在      | 平成27年12月15日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 145,747,035        | 16,035,874         |
| 合計   | 145,747,035        | 16,035,874         |

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

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

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

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## グローバル・ナビ

(平成27年12月30日現在)

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

## (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成27年12月30日現在)

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

## (参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

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

## (参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

(平成27年12月30日現在)

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



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

## （参考）海外国債マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

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

## （参考）新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

（平成27年12月30日現在）

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

## （参考）グローバル高金利通貨マザーファンド

（平成27年12月30日現在）

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

## （参考）新光J-REITマザーファンド

（平成27年12月30日現在）

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

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

（参考）新光米国REITマザーファンド

（平成27年12月30日現在）

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

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

##### （1）投資信託受益証券の名義書換等

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

##### （2）受益者等名簿

該当事項はありません。

##### （3）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### （4）受益権の譲渡

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

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

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

断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 償還金

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

(8) 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### a．資本金の額（平成27年12月末現在）

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

直近5ヵ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b．委託会社の機構

（イ）株主総会において、15名以内の取締役が選任されます。

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

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

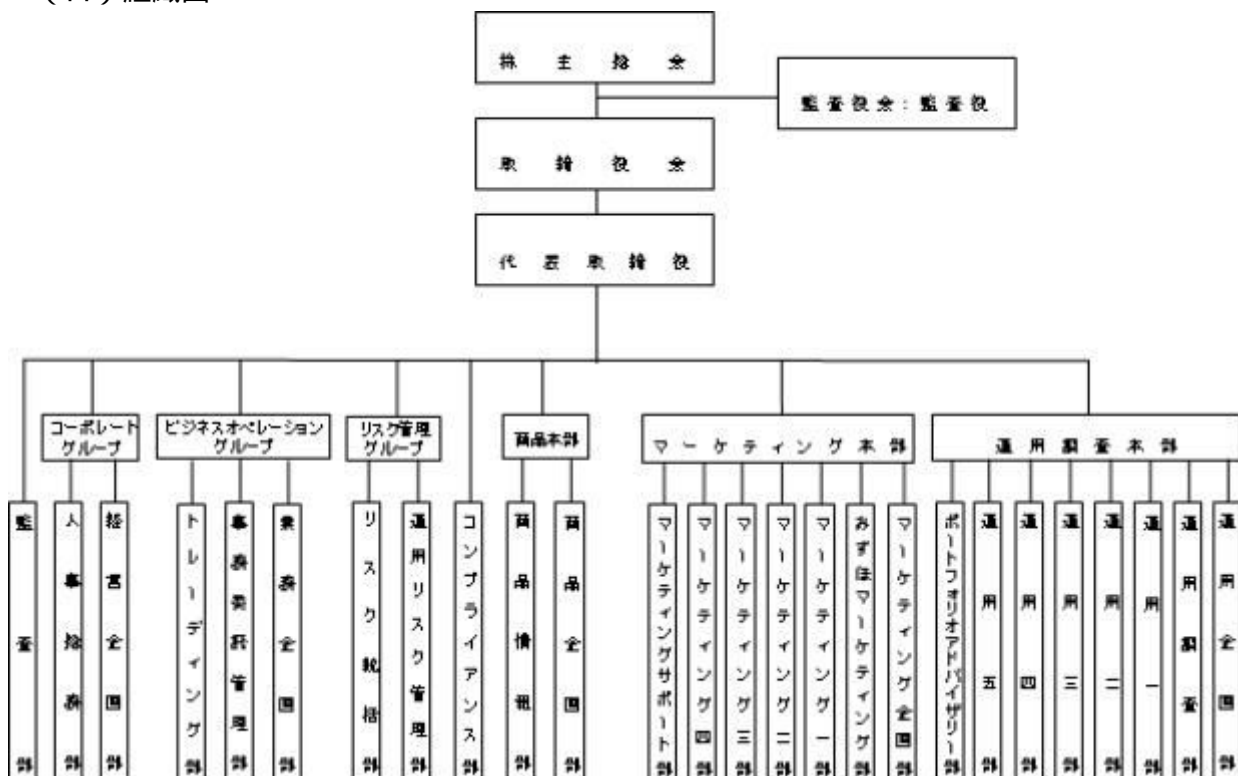
取締役会の決議により、取締役の中から取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長、専務取締役ならびに常務取締役若干名を定めることができます。

取締役会の決議をもって代表取締役3名以内を決定します。

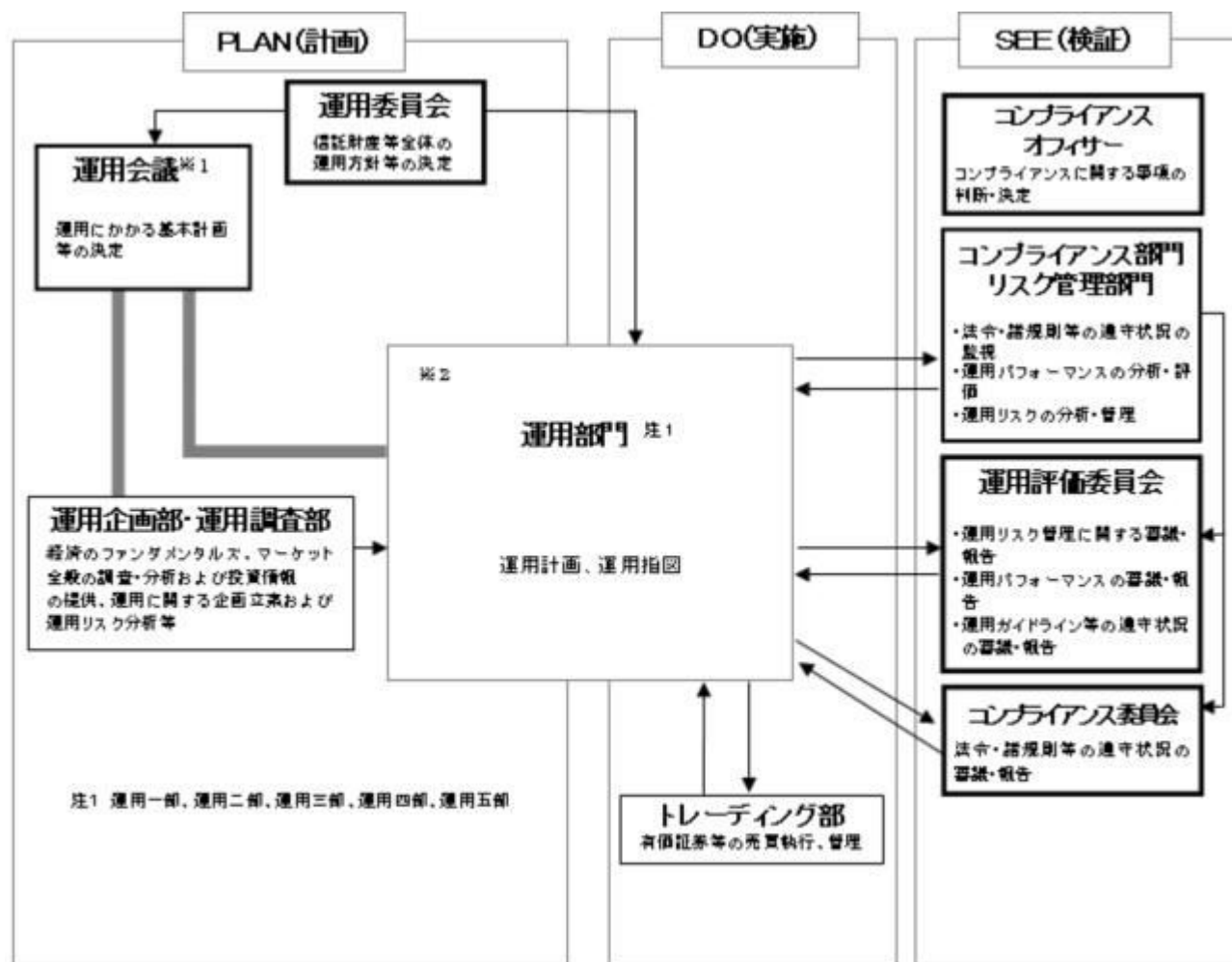
代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

##### （ロ）組織図



##### （ハ）投資運用の意思決定機構



実績の矢印は情報の流れを示します。

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

## 3【委託会社等の経理状況】

### 1．財務諸表の作成方法について

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

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

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

## 2. 監査証明について

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

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

### 1. 財務諸表

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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



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

(単位：千円)

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

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

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

|  | 株主資本  |  |  | 株 主 | 評価・換算差額等 |
|--|-------|--|--|-----|----------|
|  | 利益剰余金 |  |  |     |          |
|  |       |  |  |     |          |
|  |       |  |  |     |          |

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

当事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

|  | 株主資本  |  | 株主 | 評価・換算差額等 |
|--|-------|--|----|----------|
|  | 利益剰余金 |  |    |          |
|  |       |  |    |          |
|  |       |  |    |          |

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

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 関連会社株式

総平均法による原価法

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

#### (2) 無形固定資産

定額法。

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

#### (3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 役員賞与引当金

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

#### (3) 外国税支払損失引当金

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

#### (4) 訴訟損失引当金

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

#### (5) 退職給付引当金

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

##### 退職給付見込額の期間帰属方法

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

##### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

#### (6) 役員退職慰労引当金

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

#### (7) 執行役員退職慰労引当金

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

### 4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### (1) 消費税等の会計処理

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

#### (会計方針の変更)

##### (退職給付に関する会計基準等の適用)

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

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

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

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

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

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

### (損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

|       | 前事業年度<br>(自平成25年4月1日<br>至平成26年3月31日) | 当事業年度<br>(自平成26年4月1日<br>至平成27年3月31日) |
|-------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 支払手数料 | 8,738,779千円                          | 9,189,399千円                          |

### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)

#### 1. 発行済株式に関する事項

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

#### 2. 自己株式に関する事項

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

#### 3. 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

### 1．発行済株式に関する事項

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

### 2．自己株式に関する事項

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

### 3．配当に関する事項

#### (1)配当金支払額

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

#### (リース取引関係)

ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

##### (1)リース資産の内容

有形固定資産

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

##### (2)リース資産の減価償却方法

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

#### (金融商品関係)

##### 1．金融商品の状況に関する事項

###### (1)金融商品に対する取組方針

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

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

###### (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

###### (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

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

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

#### 流動性リスクの管理

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

|                             | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(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<br>その他有価証券 | 8,102,802        | 8,102,802  | -          |
| (3) 未収委託者報酬                 | 3,187,770        | 3,187,770  | -          |

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### (1) 現金及び預金

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

#### (2) 有価証券及び投資有価証券

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



## (3) 未収委託者報酬

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

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

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

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

## (注) 3 . 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 前事業年度（平成26年3月31日）

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

## 当事業年度（平成27年3月31日）

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

## (有価証券関係)

## 1 . 関連会社株式

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

## 2 . その他有価証券

## 前事業年度（平成26年3月31日）

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

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

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

#### 当事業年度（平成27年3月31日）

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

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

#### 3．売却したその他有価証券

##### 前事業年度（平成26年3月31日）

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

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

## 当事業年度（平成27年3月31日）

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

## 4．減損処理を行った有価証券

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

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

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

## （退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

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

## 2．確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額(前事業年度30,333千円、当事業年度28,168千円)については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

## (5)年金資産に関する事項

前事業年度

当事業年度

(平成26年3月31日)

(平成27年3月31日)

## 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|          |       |       |
|----------|-------|-------|
| 株式       | 41.3% | 39.4% |
| 債券       | 25.6% | 27.3% |
| 共同運用資産   | 18.3% | 21.0% |
| 生命保険一般勘定 | 11.2% | 10.6% |
| 現金及び預金   | 3.3%  | 1.4%  |
| 合計       | 100%  | 100%  |

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| 前事業年度        | 当事業年度        |
|--------------|--------------|
| (平成26年3月31日) | (平成27年3月31日) |

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

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳  
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については、繰延税金資産及び繰延税金負債を計算する法定実効税率の変更等を行っております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が19,637千円減少し、その他有価証券評価差額金が14,105千円、法人税等調整額が33,742千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

セグメント情報

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

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）及び

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

### 1．製品及びサービスごとの情報

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

### 2．地域ごとの情報

#### (1) 営業収益

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

#### (2) 有形固定資産

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

### 3．主要な顧客ごとの情報

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

### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

### 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

### 関連当事者情報

#### 1．関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

| 種類 | 会社等の<br>名称又は<br>氏名 | 所在地 | 資本金又は出<br>資金（千円） | 事業の<br>内容又は<br>職業 | 議決権等の<br>所有(被所<br>有)割合<br>(%) | 関連当事<br>者との関<br>係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(千円) | 科目 | 期末残高<br>(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)<br>直接77.05<br>間接 7.74 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売<br>役員の兼任 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い | 8,738,779 | 未払手数料 | 760,018 |
|-----|-----------|---------|-------------|---------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------|-------|---------|

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等  
前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

| 種類          | 会社等の名称又は氏名           | 所在地    | 資本金又は出資金(千円) | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容                       | 取引金額(千円)              | 科目                   | 期末残高(千円)           |
|-------------|----------------------|--------|--------------|-----------|-------------------|-----------|-----------------------------|-----------------------|----------------------|--------------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | みずほ証券プロバティマネジメント株式会社 | 東京都中央区 | 4,110,000    | 不動産賃貸業    | 直接 4.05           | 事務所の賃借    | 事務所の賃借                      | 175,003               | 長期差入保証金              | 116,378            |
| 同一の親会社を持つ会社 | 日本証券テクノロジー株式会社       | 東京都中央区 | 228,000      | 情報サービス業   | なし                | 計算業務の委託   | 計算委託料支払<br><br>ハウジングサービス料支払 | 105,424<br><br>16,824 | その他未払金<br><br>その他未払金 | 8,030<br><br>1,472 |



|  |  |  |  |  |  |  |                |        |        |       |
|--|--|--|--|--|--|--|----------------|--------|--------|-------|
|  |  |  |  |  |  |  | メールシステムサービス料支払 | 36,923 | その他未払金 | 3,230 |
|  |  |  |  |  |  |  | IT関連業務支援       | 4,145  | その他未払金 | 1,648 |

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

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

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

## みずほ証券株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

|              | 前事業年度<br>（自 平成25年4月 1日<br>至 平成26年3月31日） | 当事業年度<br>（自 平成26年4月 1日<br>至 平成27年3月31日） |
|--------------|---|---|
| 1株当たり純資産額    | 10,703円18銭                              | 11,433円05銭                              |
| 1株当たり当期純利益金額 | 1,526円89銭                               | 1,976円56銭                               |

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

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

|                    | 前事業年度<br>（自 平成25年4月 1日<br>至 平成26年3月31日） | 当事業年度<br>（自 平成26年4月 1日<br>至 平成27年3月31日） |
|--------------------|---|---|
| 当期純利益金額（千円）        | 2,769,571                               | 3,585,212                               |
| 普通株主に帰属しない金額（千円）   | -                                       | -                                       |
| 普通株式に係る当期純利益金額（千円） | 2,769,571                               | 3,585,212                               |
| 期中平均株式数（千株）        | 1,813                                   | 1,813                                   |

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 2．中間財務諸表

## （1）中間貸借対照表

（単位：千円）

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

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

(単位：千円)

当中間会計期間

(平成27年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

## 未払金

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

未払法人税等 946,118

未払消費税等 2 221,381

賞与引当金 449,925

役員賞与引当金 22,000

外国税支払損失引当金 139,578

訴訟損失引当金 30,000

その他 758,645

流動負債合計 4,634,840

## 固定負債

退職給付引当金 153,718

役員退職慰労引当金 37,333

執行役員退職慰労引当金 69,916

固定負債合計 260,968

## 負債合計

4,895,808

## 純資産の部

## 株主資本

資本金 4,524,300

資本剰余金

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

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

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

### （３） 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月 1日 至 平成27年9月30日）

（単位：千円）

|                           | 株主資本      |           |         |           |           |
|---------------------------|-----------|-----------|---------|-----------|-----------|
|                           | 資本金       | 資本剰余金     |         | 利益剰余金     |           |
|                           |           | 資本準備金     | 利益準備金   | その他利益剰余金  |           |
|                           |           |           |         | 別途積立金     | 繰越利益剰余金   |
| 当期首残高                     | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 3,981,245 |
| 当中間期変動額                   |           |           |         |           |           |
| 中間純利益                     |           |           |         |           | 2,095,462 |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額（純額） |           |           |         |           |           |
| 当中間期変動額合計                 | -         | -         | -       | -         | 2,095,462 |
| 当中間期末残高                   | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 6,076,707 |

|                           | 株主資本       |        |            | 評価・換算差額等     | 純資産合計      |
|---------------------------|------------|--------|------------|--------------|------------|
|                           | 利益剰余金      | 自己株式   | 株主資本合計     | その他有価証券評価差額金 |            |
|                           | 利益剰余金合計    |        |            |              |            |
| 当期首残高                     | 13,241,738 | 72,415 | 20,455,322 | 282,685      | 20,738,008 |
| 当中間期変動額                   |            |        |            |              |            |
| 中間純利益                     | 2,095,462  |        | 2,095,462  |              | 2,095,462  |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額（純額） |            |        |            | 284,475      | 284,475    |
| 当中間期変動額合計                 | 2,095,462  | -      | 2,095,462  | 284,475      | 1,810,986  |
| 当中間期末残高                   | 15,337,200 | 72,415 | 22,550,784 | 1,790        | 22,548,994 |

#### 注記事項

（重要な会計方針）

#### 1．資産の評価基準及び評価方法

##### （1）有価証券

    関連会社株式

総平均法による原価法

    その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

### （1）有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物            8～18年

構築物          20年

器具備品        2～20年

### （2）無形固定資産

定額法。

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

## 3．引当金の計上基準

### （1）賞与引当金

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

### （2）役員賞与引当金

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

### （3）外国税支払損失引当金

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

### （4）訴訟損失引当金

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

### （5）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日において発生していると認められる額を計上しております。

#### 退職給付見込額の期間帰属方法

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

#### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

### （6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当中間会計期間末日要支給額を計上しております。

す。

(7) 執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当中間会計期間末日要支給額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

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

(追加情報)

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

(中間貸借対照表関係)

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

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

2. 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

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

## 3．配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

## (2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、含まれておりません（（注）2．参照）。

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

|                            | 中間貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|----------------------------|--------------------|------------|------------|
| (1) 現金及び預金                 | 15,954,811         | 15,954,811 | -          |
| (2) 有価証券及び投資有価証券<br>其他有価証券 | 6,127,827          | 6,127,827  | -          |
| (3) 未収委託者報酬                | 3,690,798          | 3,690,798  | -          |
| (4) 未払手数料                  | 1,754,278          | 1,754,278  | -          |

## (注) 1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## (1) 現金及び預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (3) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (4) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注) 2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

| 区分    | 中間貸借対照表計上額（千円） |
|-------|----------------|
| 非上場株式 | 276,151        |

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。



## （有価証券関係）

当中間会計期間（平成27年9月30日）

## 1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 77,100千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2．その他有価証券

|                            | 種類      | 中間貸借対照表<br>計上額(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|----------------------------|---------|--------------------|--------------|------------|
| 中間貸借対照表計上額<br>が取得原価を超えるもの  | (1)株式   | -                  | -            | -          |
|                            | (2)債券   |                    |              |            |
|                            | 国債・地方債等 | -                  | -            | -          |
|                            | 社債      | -                  | -            | -          |
|                            | その他     | -                  | -            | -          |
|                            | (3)その他  | 1,639,419          | 1,392,104    | 247,314    |
|                            | 小計      | 1,639,419          | 1,392,104    | 247,314    |
| 中間貸借対照表計上額<br>が取得原価を超えないもの | (1)株式   | -                  | -            | -          |
|                            | (2)債券   |                    |              |            |
|                            | 国債・地方債等 | -                  | -            | -          |
|                            | 社債      | -                  | -            | -          |
|                            | その他     | -                  | -            | -          |
|                            | (3)その他  | 4,488,408          | 4,739,020    | 250,612    |
|                            | 小計      | 4,488,408          | 4,739,020    | 250,612    |
| 合計                         |         | 6,127,827          | 6,131,125    | 3,297      |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額199,051千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## （デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

## 2．地域ごとの情報

## （1）営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

## （2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

### 3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

#### （1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 項目                                  | 当中間会計期間<br>(平成27年9月30日) |
|-------------------------------------|-------------------------|
| (1) 1株当たり純資産額                       | 12,431円46銭              |
| (算定上の基礎)                            |                         |
| 純資産の部の合計額(千円)                       | 22,548,994              |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)                | 22,548,994              |
| 普通株式の発行済株式数(株)                      | 1,823,250               |
| 普通株式の自己株式数(株)                       | 9,386                   |
| 1株当たり純資産の算定に用いられた<br>中間期末の普通株式の数(株) | 1,813,864               |

| 項目                 | 当中間会計期間<br>(自平成27年4月1日<br>至平成27年9月30日) |
|--------------------|--|
| (2) 1株当たり中間純利益金額   | 1,155円24銭                              |
| (算定上の基礎)           |  |
| 中間純利益金額(千円)        | 2,095,462                              |
| 普通株主に帰属しない金額(千円)   | -                                      |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 2,095,462                              |
| 普通株式の期中平均株式数(株)    | 1,813,864                              |

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載しておりません。

#### (重要な後発事象)

当社は、将来の事業展開や市況変動に備えるために適正な内部留保を維持しつつ、利益配分については株主の皆様へ安定的かつ可能な範囲で高水準の配当を実施していくことを基本的な考え方としており、平成27年11月17日開催の取締役会において、次のとおり剰余金の処分を決議しました。

## 株主配当に関する決議事項

|          |              |
|----------|--------------|
| 株式の種類    | 普通株式         |
| 配当金の総額   | 3,446,341千円  |
| 1株当たり配当額 | 1,900円       |
| 基準日      | 平成27年12月 8日  |
| 効力発生日    | 平成27年12月 17日 |

## 4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等（委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託者の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託者の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### a．定款の変更

委託者の定款につき、下記の変更を行いました。

- ・ 剰余金の配当等の決定機関を法令に別段の定めがある場合を除き、株主総会の定めによらず、取締役会の決議によって定めることとしました。（平成27年6月19日実施）
- ・ 当社株式に関して、株券を発行する定めを廃止し、株券不発行としました。また、単元株（100株単位）について廃止しました。（平成28年1月25日実施）

### b．訴訟事件その他の重要事項

委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

なお、「委託会社等の経理状況 中間財務諸表」の注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、平成27年11月17日開催の取締役会において期中配当を行うことを決議しまし

た。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a．資本金の額

平成27年3月末現在、342,037百万円

b．事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(2) みずほ信託銀行株式会社（「投資顧問会社」）

a．資本金の額

平成27年3月末現在、247,369百万円

b．事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(3) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額及び事業の内容は以下の「販売会社一覧表」のとおりです。

販売会社一覧表

（資本金の額は平成27年3月末現在）

| 名称          | 資本金の額<br>(単位：百万円) | 事業の内容                         |
|-------------|-------------------|-------------------------------|
| 大山日ノ丸証券株式会社 | 215               | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| みずほ証券株式会社   | 125,167           | 同上                            |

### 2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

(1) 委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理

(2) 投資信託財産の計算

(3) その他上記業務に付随する一切の業務

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

「販売会社」は以下の業務を行います。

(1) 募集・販売の取り扱い

(2) 受益者に対する一部解約事務

(3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い

(4) 受益者に対する収益分配金の再投資

(5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付

(6) 受益者に対する運用報告書の交付

(7) 所得税および地方税の源泉徴収

(8) その他上記業務に付随する一切の業務

### 3【資本関係】

みずほ証券株式会社は、委託者の株式の76.5%を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託者の株式または委託者が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が1.0%以上のものを記載しています。

#### <再信託受託会社の概要>

- 名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- 業務の概要 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- 再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託事務の一部（投資信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

| 提出年月日       | 提出書類          |
|-------------|---------------|
| 平成27年 3月13日 | 有価証券届出書       |
| 平成27年 3月13日 | 有価証券報告書       |
| 平成27年 9月15日 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 平成27年 9月15日 | 半期報告書         |

## 独立監査人の監査報告書

平成27年6月12日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第55期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光投信株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

( ) 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年1月26日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

|                    |       |       |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 伊藤 志保 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 福村 寛  |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・ナビの平成26年12月16日から平成27年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・ナビの平成27年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

新光投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- ( ) 1 . 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月1日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、新光投信株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日開催の取締役会において、「統合基本合意書」の締結について決議している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- ( ) 1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。