

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------------|--|------------------------|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／債券／インデックス型 | |
| 信託期間 | 約15年間（2013年11月18日～2028年11月30日） | |
| 運用方針 | 投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。 | |
| 主要投資対象 | ベビーファンド | 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券 |
| | 外国債券インデックスマザーファンド | 外国の公社債 |
| マザーファンドの運用方法 | ①投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 | |
| 組入制限 | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 | 無制限 |
| | マザーファンドの株式組入上限比率 | 純資産総額の30%以下 |
| 分配方針 | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。 | |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ・インデックス セレクト 外国債券

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2015年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ・インデックスセレクト 外国債券」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) | | 公社債 組入比率 | 債券 先物比率 | 純資産 総額 |
|--------------------|--------|------------|-----------|------------------------------------|-----------|-------------|------------|-----------|
| | | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (ベンチマーク) | 期中 騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 1 期末 (2014年12月1日) | 12,189 | 0 | 21.9 | 12,309 | 23.1 | 97.8 | — | 115 |
| 2 期末 (2015年11月30日) | 11,797 | 0 | △ 3.2 | 11,995 | △ 2.5 | 98.3 | — | 202 |

(注1) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・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投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。

(注2) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の原データに基づき、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

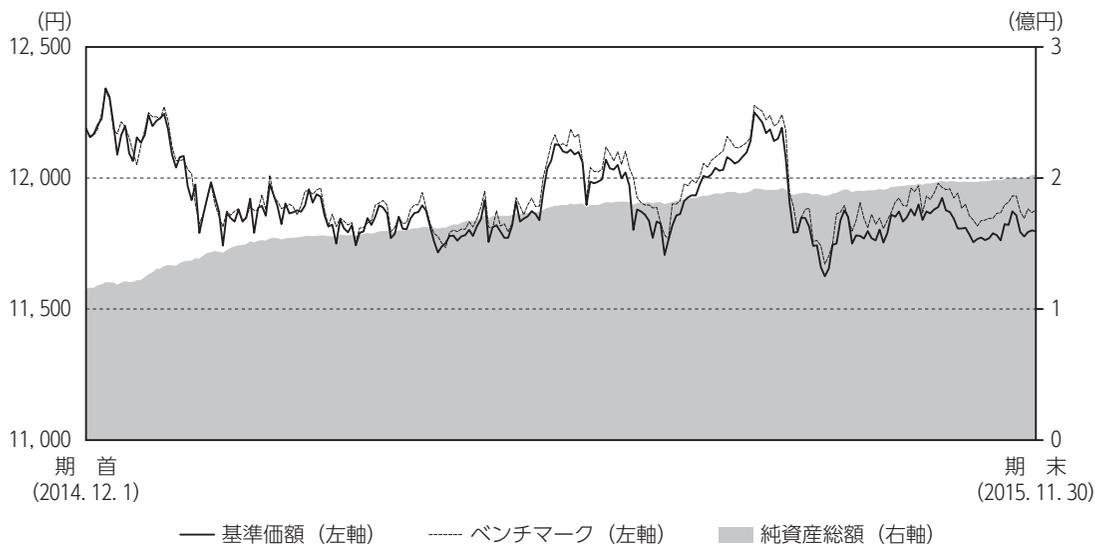
(注4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

《運用経過》

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークは、シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) です。

■基準価額・騰落率

期首：12,189円

期末：11,797円

騰落率：△3.2%

■基準価額の変動要因

当期の基準価額は、米国の国債金利がやや上昇 (債券価格は下落) したことやユーロが対円で下落したことを受けて下がりました。

ダイワ・インデックスセレクト 外国債券

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) | | 公 社 債 組入比率 | 債 券 先物比率 |
|-----------------|---------|-------|------------------------------------|-------|---------------|-------------|
| | | 騰 落 率 | (ベンチマーク) | 騰 落 率 | | |
| (期首)2014年12月1日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 12,189 | — | 12,309 | — | 97.8 | — |
| 12月末 | 12,245 | 0.5 | 12,392 | 0.7 | 98.1 | — |
| 2015年1月末 | 11,880 | △ 2.5 | 11,999 | △ 2.5 | 97.6 | — |
| 2月末 | 11,906 | △ 2.3 | 12,055 | △ 2.1 | 98.4 | — |
| 3月末 | 11,852 | △ 2.8 | 11,966 | △ 2.8 | 98.1 | — |
| 4月末 | 11,842 | △ 2.8 | 12,004 | △ 2.5 | 97.8 | — |
| 5月末 | 12,067 | △ 1.0 | 12,250 | △ 0.5 | 98.3 | — |
| 6月末 | 11,880 | △ 2.5 | 12,042 | △ 2.2 | 97.1 | — |
| 7月末 | 12,031 | △ 1.3 | 12,222 | △ 0.7 | 98.3 | — |
| 8月末 | 11,847 | △ 2.8 | 11,997 | △ 2.5 | 98.5 | — |
| 9月末 | 11,803 | △ 3.2 | 11,964 | △ 2.8 | 97.9 | — |
| 10月末 | 11,807 | △ 3.1 | 12,001 | △ 2.5 | 98.0 | — |
| (期末)2015年11月30日 | 11,797 | △ 3.2 | 11,995 | △ 2.5 | 98.3 | — |

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

○債券市況

・米国

米国の国債金利はやや上昇しました。2015年1月のECB（欧州中央銀行）の国債購入策決定などを背景に、世界的に金利は低下しました。2月以降は、原油価格が底打ち傾向となる中でディスインフレ圧力の後退から金利は下げ止まり、4月から6月にかけては欧州の金利の上昇に連れた動きとなりました。7月以降は、欧州でのギリシャ支援問題の混迷や中国株の急落、原油価格の下落、新興国経済の減速懸念によるリスク回避的な市場環境、またFRB（米国連邦準備制度理事会）による利上げ観測の後退を背景に、金利は低下傾向となりました。10月半ば以降は、米国の経済指標の改善により年内の利上げ期待が高まったことから、金利は上昇に転じました。

・ユーロ圏

ユーロ圏では主要各国で国債金利が低下しました。2015年1月のECBの国債購入策決定を背景に、4月半ばまで金利低下が続きました。4月末からは、欧米の金融政策当局者が市場変動の高まりに容認姿勢を示したこともあり、大きく金利の上昇に転じました。6月以降は、ギリシャ支援問題の混迷や新興国経済への懸念、原油価格の下落などを受けてリスク回避的な市場環境となったこと、ECBによる追加金融緩和期待の高まりを受けて、金利の低下が続きました。ドイツ以外のユーロ圏周辺国国債については、ECBによる金融緩和を背景に、ドイツ国債とのスプレッド（金利格差）は縮小しました。

○為替相場

・米ドル

米ドル円為替相場は、期首から2015年4月中旬にかけてレンジ圏での推移が続きましたが、4月末からは、米国の金利が上昇して日本との金利差が拡大するとの観測から、対円で上昇しました。7月以降は、原油価格が下落に転じたほか、新興国経済の減速が懸念されて市場のリスク回避姿勢も強まり、円高傾向が強まりました。10月後半以降は、米国の経済指標が改善したことから年内の利上げ期待が高まり、米ドル円は上昇に転じました。

・ユーロ

ユーロ円為替相場は、期首から2015年4月前半にかけて、ユーロ圏の物価低迷からECBが量的金融緩和の導入決定に至り、対円で下落しました。4月後半から6月半ばにかけては、欧州の金利の上昇を受けてユーロは対円で上昇しましたが、リスク回避姿勢が強まったことやECBの追加金融緩和期待の高まりから、ユーロは対円で下落傾向が続きました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」の受益証券組入比率は高位を維持します。

○外国債券インデックスマザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

ポートフォリオについて

○当ファンド

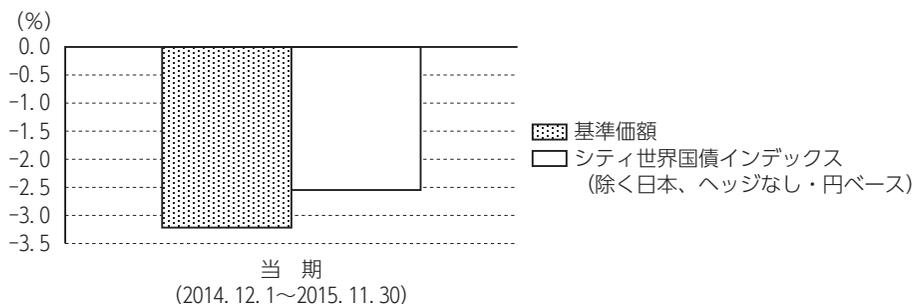
「外国債券インデックスマザーファンド」の受益証券組入比率を、期を通じておおむね100%程度に維持しました。

○外国債券インデックスマザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ベンチマークとの差異について

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。また、当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したものは）0.07%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。



分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目 | 当 期 | |
|-----------------|------------|-------------|
| | 2014年12月2日 | 2015年11月30日 |
| 当期分配金 (税込み) (円) | | — |
| 対基準価額比率 (%) | | — |
| 当期の収益 (円) | | — |
| 当期の収益以外 (円) | | — |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | | 1,796 |

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

《今後の運用方針》

○当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

○外国債券インデックスマザーファンド

当ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------|----------------------------|---------|--|
| | (2014. 12. 2~2015. 11. 30) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 71円 | 0.592% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,911円です。 |
| (投信会社) | (33) | (0.280) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価 |
| (販売会社) | (33) | (0.280) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託銀行) | (4) | (0.032) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| 売買委託手数料 | — | — | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| 有価証券取引税 | — | — | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| その他費用 | 4 | 0.033 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (3) | (0.026) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.008) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| 合 計 | 75 | 0.626 | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2014年12月2日から2015年11月30日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|---------------------------|--------|--------|-------|-------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国債券 インデックス マザーファンド | 34,069 | 98,188 | 2,359 | 6,807 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | | 当 期 末 | |
|-----------------------|--------|---------|--------|---------|
| | □ 数 | 評 価 額 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 39,180 | 202,448 | 70,890 | 202,448 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年11月30日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 202,448 | 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 584 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 203,033 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=122.82円、1カナダ・ドル=91.79円、1オーストラリア・ドル=88.12円、1シンガポール・ドル=86.86円、1イギリス・ポンド=184.60円、1スイス・フラン=119.17円、1デンマーク・クローネ=17.41円、1ノルウェー・クローネ=14.11円、1スウェーデン・クローネ=14.03円、1メキシコ・ペソ=7.39円、1マレーシア・リンギット=28.70円、1南アフリカ・ランド=8.54円、1ポーランド・ズロチ=30.43円、1ユーロ=129.88円です。

(注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(162,313,350千円)の投資信託財産総額(163,748,638千円)に対する比率は、99.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年11月30日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------|--------------|
| (A) 資産 | 203,033,124円 |
| コール・ローン等 | 584,166 |
| 外国債券インデックス マザーファンド(評価額) | 202,448,958 |
| (B) 負債 | 568,890 |
| 未払信託報酬 | 561,326 |
| その他未払費用 | 7,564 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 202,464,234 |
| 元本 | 171,624,247 |
| 次期繰越損益金 | 30,839,987 |
| (D) 受益権総口数 | 171,624,247口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 11,797円 |

*期首における元本額は94,760,893円、当期中における追加設定元本額は98,986,606円、同解約元本額は22,123,252円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,797円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月2日 至2015年11月30日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| (A) 配当等収益 | 91円 |
| 受取利息 | 91 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 3,475,264 |
| 売買益 | 346,383 |
| 売買損 | △ 3,821,647 |
| (C) 信託報酬等 | △ 1,023,501 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 4,498,674 |
| (E) 前期繰越損益金 | 12,235,744 |
| (F) 追加信託差損益金 | 23,102,917 |
| (配当等相当額) | (13,907,819) |
| (売買損益相当額) | (9,195,098) |
| (G) 合計(D+E+F) | 30,839,987 |
| 次期繰越損益金(G) | 30,839,987 |
| 追加信託差損益金 | 23,102,917 |
| (配当等相当額) | (13,907,819) |
| (売買損益相当額) | (9,195,098) |
| 分配準備積立金 | 12,235,744 |
| 繰越損益金 | △ 4,498,674 |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は10ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|--------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 18,604,243 |
| (d) 分配準備積立金 | 12,235,744 |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 30,839,987 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 30,839,987 |
| (h) 受益権総口数 | 171,624,247口 |

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2014年12月1日の交付運用報告書および運用報告書（全体版）につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えくださいますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額（月末値の平均値）」は10,699円です。」

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第16期 (決算日 2015年11月30日)

(計算期間 2014年12月2日～2015年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの第16期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 |
| 主要投資対象 | 外国の公社債 |
| 運用方法 | ①主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の30%以下 |

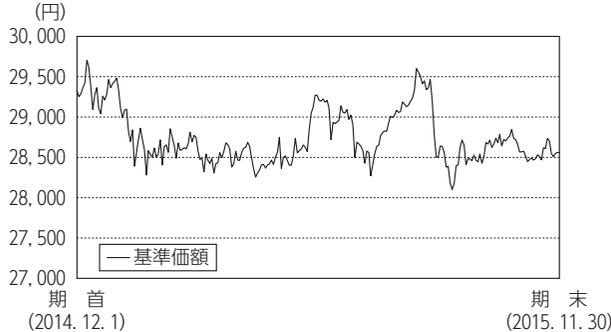
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額と市況の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：29,332円 期末：28,558円 騰落率：△2.6%

【基準価額の主な変動要因】

米国債金利がやや上昇したことやユーロが対円で下落したことを受けて、当ファンドの基準価額は下がりました。

◆投資環境について

○債券市況

・米国

米国の国債金利はやや上昇しました。2015年1月のECB（欧州中央銀行）の国債購入策決定などを背景に、世界的に金利は低下しました。2月以降は、原油価格が底打ち傾向となる中でディスインフレーションの後退から金利は下げ止まり、4月から6月にかけては欧州の金利の上昇に連れた動きとなりました。7月以降は、欧州でのギリシャ支援問題の混迷や中国株の急落、原油価格の下落や新興国経済の減速懸念によるリスク回避的な市場環境、またFRB（米国連邦準備制度理事会）による利上げ観測の後退を背景に、金利は低下傾向となりました。10月半ば以降は、米国の経済指標の改善により年内の利上げ期待が高まったことから、金利は上昇に転じました。

・ユーロ圏

ユーロ圏では主要各国で国債金利が低下しました。2015年1月のECBの国債購入策決定を背景に、4月半ばまで金利低下が続きました。4月末からは、欧米の金融政策当局者が市場変動の高まりに容認姿勢を示したこともあり、大きく金利の上昇に転じました。6月以降は、ギリシャ支援問題の混迷や新興国経済への懸念、原油価格の下落などをを受けてリスク回避的な市場環境となったこと、ECBによる追加金融緩和期待の高まりを受けて、金利の低下が続きました。ドイツ以外のユーロ圏周辺国債については、ECBによる金融緩和を背景に、ドイツ国債とのスプレッド（金利格差）は縮小しました。

○為替相場

・米ドル

米ドル円為替相場は、期首から2015年4月中旬にかけてレンジ圏での推移が続きましたが、4月末からは、米国の金利が上昇して日本との金利差が拡大するとの観測から、米ドルは対円で上昇しました。7月以降は、原油価格が下落に転じたほか、新興国経済の減速が懸念されて市場のリスク回避姿勢も強まり、円高傾向が強まりました。10月後半以降は、米国の経済指標が改善したことから年内の利上げ期待が高まり、米ドル円は上昇に転じました。

・ユーロ

ユーロ円為替相場は、期首から2015年4月前半にかけて、ユーロ圏の物価低迷からECBが量的金融緩和の導入決定に至り、対円で下落しました。4月後半から6月半ばにかけては、欧州の金利の上昇を受けてユーロは対円で上昇しましたが、リスク回避姿勢が強まったことやECBの追加金融緩和期待の高まりから、ユーロは対円での下落傾向が続きました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後もファンドの通貨の比率をベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

| 年 月 日 | 基準価額 | | シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) | | 公社債 組入比率 | 債券 先物比率 |
|------------------|--------|-----------------|------------------------------------|------------|-------------|------------|
| | 円 | 騰落率 (ベンチマーク) | 円 | 騰落率 (%) | | |
| (期首) 2014年12月1日 | 29,332 | — | 29,578 | — | 98.3 | — |
| 12月末 | 29,482 | 0.5 | 29,777 | 0.7 | 98.1 | — |
| 2015年1月末 | 28,616 | △ 2.4 | 28,834 | △ 2.5 | 97.7 | — |
| 2月末 | 28,692 | △ 2.2 | 28,968 | △ 2.1 | 98.4 | — |
| 3月末 | 28,576 | △ 2.6 | 28,754 | △ 2.8 | 98.1 | — |
| 4月末 | 28,566 | △ 2.6 | 28,847 | △ 2.5 | 97.8 | — |
| 5月末 | 29,123 | △ 0.7 | 29,436 | △ 0.5 | 98.3 | — |
| 6月末 | 28,687 | △ 2.2 | 28,937 | △ 2.2 | 97.1 | — |
| 7月末 | 29,067 | △ 0.9 | 29,371 | △ 0.7 | 98.3 | — |
| 8月末 | 28,636 | △ 2.4 | 28,829 | △ 2.5 | 98.5 | — |
| 9月末 | 28,543 | △ 2.7 | 28,749 | △ 2.8 | 97.9 | — |
| 10月末 | 28,568 | △ 2.6 | 28,838 | △ 2.5 | 98.0 | — |
| (期末) 2015年11月30日 | 28,558 | △ 2.6 | 28,825 | △ 2.5 | 98.3 | — |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・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投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。

(注3) シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の原データに基づき、当ファンドの設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。

(注4) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

外国債券インデックスマザーファンド

◆ポートフォリオについて

当期におきましては、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

◆ベンチマークとの差異について

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.06%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

当期の当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

今後もファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

■1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------|-----------|
| 売買委託手数料 | —円 |
| 有価証券取引税 | — |
| その他費用 (保管費用) | 7 (7) |
| 合 計 | 7 |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出方法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2014年12月2日から2015年11月30日まで)

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|-----------------|-----------------------|--------------------------------|
| 外 | アメリカ | 千アメリカ・ドル 141,828 | 千アメリカ・ドル 131,234 (—) |
| | カナダ | 千カナダ・ドル 7,415 | 千カナダ・ドル 9,498 (—) |
| | オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 6,297 | 千オーストラリア・ドル 2,948 (—) |
| | シンガポール | 千シンガポール・ドル 1,286 | 千シンガポール・ドル 1,637 (—) |
| | イギリス | 千イギリス・ポンド 6,667 | 千イギリス・ポンド 9,319 (—) |
| | スイス | 千スイス・フラン 4,055 | 千スイス・フラン 4,763 (—) |
| | デンマーク | 千デンマーク・クローネ — | 千デンマーク・クローネ 4,027 (—) |
| | ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 2,975 | 千ノルウェー・クローネ 457 (—) |
| | スウェーデン | 千スウェーデン・クローネ 4,701 | 千スウェーデン・クローネ 6,302 (—) |
| | メキシコ | 千メキシコ・ペソ 33,638 | 千メキシコ・ペソ 25,710 (—) |
| 国 | マレーシア | 千マレーシア・リンギット 3,812 | 千マレーシア・リンギット 3,667 (—) |
| | 南アフリカ | 千南アフリカ・ランド 19,001 | 千南アフリカ・ランド 11,492 (—) |
| | ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 5,695 | 千ポーランド・ズロチ 9,153 (—) |
| | ユーロ (アイルランド) | 千ユーロ 1,550 | 千ユーロ 2,064 (—) |
| | ユーロ (オランダ) | 千ユーロ 4,770 | 千ユーロ 5,334 (—) |
| | ユーロ (ベルギー) | 千ユーロ 3,574 | 千ユーロ 4,911 (—) |

| | | 買付額 | 売付額 |
|----------------------------|-----------------|----------------|-------------------------|
| 外 国 | ユーロ (フランス) | 千ユーロ 16,551 | 千ユーロ 14,322 (—) |
| | ユーロ (ドイツ) | 千ユーロ 13,028 | 千ユーロ 16,439 (—) |
| | ユーロ (スペイン) | 千ユーロ 10,909 | 千ユーロ 6,769 (—) |
| | ユーロ (イタリア) | 千ユーロ 17,383 | 千ユーロ 17,532 (—) |
| | ユーロ (フィンランド) | 千ユーロ 802 | 千ユーロ 1,782 (—) |
| | ユーロ (オーストリア) | 千ユーロ 1,964 | 千ユーロ 2,901 (—) |
| | ユーロ (ユーロ通貨計) | 千ユーロ 70,535 | 千ユーロ 72,059 (—) |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。
(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2014年12月2日から2015年11月30日まで)

| 当 | | 期 | |
|--|---------|--|---------|
| 買 | 付 | 売 | 付 |
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 |
| | 千円 | | 千円 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2025/2/15 | 760,033 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.375% 2016/3/31 | 609,423 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2025/5/15 | 752,658 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2016/8/31 | 548,835 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2025/8/15 | 736,161 | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.25% 2016/4/25 | 493,360 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2024/11/15 | 590,373 | United Kingdom Gilt (イギリス) 4% 2016/9/7 | 477,670 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/11/30 | 506,676 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2016/5/31 | 476,042 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2045/5/15 | 499,593 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2016/6/30 | 426,737 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2020/1/31 | 470,680 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 3.75% 2016/8/1 | 422,924 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2045/2/15 | 442,942 | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 5% 2016/10/25 | 399,418 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2045/8/15 | 430,088 | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.5% 2016/7/25 | 396,266 |
| United Kingdom Gilt (イギリス) 2% 2020/7/22 | 406,208 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.5% 2016/6/15 | 394,785 |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。
(注2) 単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

| 区 分 | 額 面 金 額 | 当 期 | | | 末 | | | | |
|-----------------------|------------------------|------------------------|------------------|------------|--------------------|-----------|------|------|-----|
| | | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格 以下組入 比 | 残存期間別組入比率 | | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 | |
| | | | | % | % | % | % | % | |
| アメリカ | 千アメリカ・ドル 552,013 | 千アメリカ・ドル 567,249 | 千円 69,669,622 | 42.6 | — | 16.7 | 16.1 | 9.7 | |
| カナダ | 千カナダ・ドル 32,341 | 千カナダ・ドル 36,282 | 3,330,391 | 2.0 | — | 1.0 | 0.6 | 0.4 | |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 29,120 | 千オーストラリア・ドル 31,721 | 2,795,335 | 1.7 | — | 1.0 | 0.5 | 0.2 | |
| シンガポール | 千シンガポール・ドル 6,609 | 千シンガポール・ドル 6,837 | 593,906 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.0 | |
| イギリス | 千イギリス・ポンド 61,592 | 千イギリス・ポンド 73,782 | 13,620,299 | 8.3 | — | 6.0 | 1.9 | 0.5 | |
| スイス | 千スイス・フラン 3,343 | 千スイス・フラン 4,041 | 481,635 | 0.3 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 | |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 48,572 | 千デンマーク・クローネ 62,187 | 1,082,676 | 0.7 | — | 0.4 | 0.1 | 0.1 | |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 28,682 | 千ノルウェー・クローネ 31,539 | 445,017 | 0.3 | — | 0.2 | 0.0 | 0.1 | |
| スウェーデン | 千スウェーデン・クローネ 44,250 | 千スウェーデン・クローネ 51,786 | 726,564 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 203,967 | 千メキシコ・ペソ 226,176 | 1,671,446 | 1.0 | — | 0.6 | 0.3 | 0.1 | |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット 24,905 | 千マレーシア・リンギット 24,924 | 715,334 | 0.4 | — | 0.2 | 0.2 | 0.1 | |
| 南アフリカ | 千南アフリカ・ランド 95,336 | 千南アフリカ・ランド 88,944 | 759,584 | 0.5 | — | 0.4 | 0.1 | 0.0 | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 24,821 | 千ポーランド・ズロチ 27,369 | 832,868 | 0.5 | — | 0.2 | 0.2 | 0.1 | |
| ユ ー ロ 区 域 | アイルランド | 千ユーロ 7,988 | 千ユーロ 9,576 | 1,243,799 | 0.8 | — | 0.4 | 0.4 | 0.0 |
| | オランダ | 千ユーロ 25,606 | 千ユーロ 30,210 | 3,923,765 | 2.4 | — | 1.4 | 0.8 | 0.3 |
| | ベルギー | 千ユーロ 24,569 | 千ユーロ 30,604 | 3,974,911 | 2.4 | — | 1.7 | 0.5 | 0.2 |
| | フランス | 千ユーロ 97,396 | 千ユーロ 117,550 | 15,267,493 | 9.3 | — | 5.7 | 2.6 | 1.0 |
| | ドイツ | 千ユーロ 77,160 | 千ユーロ 91,742 | 11,915,494 | 7.3 | — | 4.2 | 2.1 | 1.0 |
| | スペイン | 千ユーロ 56,527 | 千ユーロ 67,542 | 8,772,406 | 5.4 | — | 3.1 | 1.6 | 0.7 |
| | イタリア | 千ユーロ 99,157 | 千ユーロ 120,989 | 15,714,095 | 9.6 | — | 6.0 | 2.6 | 1.0 |
| | フィンランド | 千ユーロ 6,284 | 千ユーロ 7,155 | 929,311 | 0.6 | — | 0.4 | 0.1 | 0.1 |
| | オーストリア | 千ユーロ 15,300 | 千ユーロ 18,722 | 2,431,655 | 1.5 | — | 0.9 | 0.4 | 0.1 |
| | 小計 | 409,987 | 494,094 | 64,172,933 | 39.2 | — | 23.7 | 11.2 | 4.3 |
| 合 計 | — | — | 160,897,617 | 98.3 | — | 51.1 | 31.5 | 15.7 | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|----------------------------------|----------------------------------|--------|--------|---------|-----------|------------|------------|
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | | |
| | | | | | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| アメリカ | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.6250 | 2,336 | 2,423 | 297,686 | 2016/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.6250 | 2,039 | 2,134 | 262,197 | 2017/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 1,795 | 1,891 | 232,318 | 2017/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.7500 | 2,401 | 2,561 | 314,574 | 2017/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,686 | 1,794 | 220,428 | 2017/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 3,839 | 4,047 | 497,085 | 2018/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.8750 | 2,960 | 3,162 | 388,410 | 2018/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.0000 | 3,173 | 3,420 | 420,046 | 2018/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 2,488 | 2,672 | 328,194 | 2018/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,161 | 3,308 | 406,310 | 2019/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 3,096 | 3,282 | 403,183 | 2019/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 2,621 | 2,831 | 347,738 | 2019/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 85 | 86 | 10,678 | 2016/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.3750 | 4,020 | 4,315 | 530,030 | 2019/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 4,149 | 4,234 | 520,046 | 2016/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.2500 | 3,154 | 3,240 | 397,980 | 2016/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 2,884 | 2,963 | 364,006 | 2017/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 5,630 | 6,110 | 750,521 | 2020/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,687 | 2,761 | 339,181 | 2017/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.2500 | 4,635 | 4,790 | 588,369 | 2017/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,653 | 1,707 | 209,737 | 2017/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 3,073 | 3,323 | 408,178 | 2020/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 2,835 | 2,918 | 358,407 | 2017/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,468 | 3,559 | 437,133 | 2017/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,773 | 1,818 | 223,347 | 2017/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,854 | 2,979 | 366,000 | 2020/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,903 | 2,954 | 362,825 | 2017/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,831 | 2,882 | 354,045 | 2017/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,372 | 2,415 | 296,686 | 2017/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 4,509 | 4,708 | 578,278 | 2020/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 883 | 905 | 111,257 | 2017/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 924 | 958 | 117,674 | 2017/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 255 | 263 | 32,409 | 2018/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 4,076 | 4,457 | 547,506 | 2021/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 1,234 | 1,281 | 157,355 | 2018/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 1,300 | 1,355 | 166,456 | 2018/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 260 | 269 | 33,134 | 2018/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 3,417 | 3,653 | 448,755 | 2021/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,322 | 1,364 | 167,562 | 2018/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,065 | 1,099 | 134,998 | 2018/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 1,341 | 1,380 | 169,609 | 2018/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,534 | 2,577 | 316,572 | 2021/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,444 | 3,476 | 426,989 | 2018/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,835 | 2,851 | 350,207 | 2018/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 142 | 142 | 17,496 | 2016/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 1,320 | 1,340 | 164,698 | 2018/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,353 | 1,364 | 167,576 | 2021/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 3,027 | 3,032 | 372,411 | 2016/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,165 | 2,174 | 267,128 | 2018/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 3,410 | 3,415 | 419,486 | 2016/12/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,861 | 1,867 | 229,333 | 2018/12/31 | |
| United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,970 | 2,974 | 365,359 | 2017/01/31 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 当 期 | | 未 評 価 額 | | | 償還年月日 |
|-----|----------------------------------|------|--------|---------|-----------|---------|------------|-------|
| | | | 年利率 | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額 | | | |
| | | | | | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,426 | 1,424 | 174,990 | 2019/01/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 3,224 | 3,246 | 398,707 | 2022/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,408 | 2,412 | 296,291 | 2017/02/28 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,843 | 1,846 | 226,798 | 2019/02/28 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 3,856 | 3,868 | 475,090 | 2017/03/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 300 | 301 | 37,067 | 2019/03/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,375 | 2,377 | 292,050 | 2017/04/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 559 | 557 | 68,430 | 2019/04/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,459 | 2,430 | 298,568 | 2022/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 3,485 | 3,475 | 426,803 | 2017/05/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,385 | 2,366 | 290,705 | 2019/05/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 3,906 | 3,901 | 479,168 | 2017/06/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,368 | 1,350 | 165,917 | 2019/06/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 5,660 | 5,629 | 691,358 | 2017/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,784 | 1,750 | 215,017 | 2019/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,543 | 2,490 | 305,937 | 2022/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 6,410 | 6,381 | 783,796 | 2017/08/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,872 | 1,842 | 226,343 | 2019/08/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 4,974 | 4,950 | 608,065 | 2017/09/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,215 | 2,178 | 267,538 | 2019/09/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,648 | 2,640 | 324,248 | 2017/10/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 884 | 877 | 107,770 | 2019/10/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,168 | 3,094 | 380,094 | 2022/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 2,336 | 2,321 | 285,122 | 2017/11/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,353 | 1,327 | 163,059 | 2019/11/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 1,913 | 1,904 | 233,916 | 2017/12/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 894 | 880 | 108,154 | 2019/12/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,153 | 2,147 | 263,717 | 2018/01/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,366 | 1,357 | 166,696 | 2020/01/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 3,850 | 3,850 | 472,927 | 2023/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 3,447 | 3,425 | 420,727 | 2018/02/28 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,968 | 1,943 | 238,705 | 2020/02/29 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,315 | 2,299 | 282,428 | 2018/03/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,160 | 1,138 | 139,844 | 2020/03/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 4,685 | 4,590 | 563,765 | 2023/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 4,218 | 4,174 | 512,666 | 2018/04/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,451 | 1,423 | 174,799 | 2020/04/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 3,407 | 3,398 | 417,368 | 2018/05/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,461 | 2,435 | 299,116 | 2020/05/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,693 | 1,704 | 209,387 | 2018/06/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,131 | 2,154 | 264,631 | 2020/06/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,827 | 2,874 | 352,989 | 2020/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,697 | 1,707 | 209,776 | 2018/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 4,468 | 4,611 | 566,418 | 2023/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 1,993 | 2,036 | 250,133 | 2020/08/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,885 | 1,916 | 235,331 | 2020/09/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,611 | 3,616 | 444,194 | 2018/10/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,345 | 2,352 | 288,957 | 2020/10/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,821 | 4,012 | 492,759 | 2023/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 719 | 718 | 88,282 | 2016/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,638 | 2,639 | 324,225 | 2018/11/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,501 | 2,537 | 311,682 | 2020/11/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 144 | 143 | 17,675 | 2016/12/15 | |

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|-----|----------------------------------|------|--------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | | |
| | | | | | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,026 | 2,040 | 250,659 | 2018/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 2,006 | 2,072 | 254,517 | 2020/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,168 | 2,168 | 266,324 | 2017/01/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 5,229 | 5,479 | 673,026 | 2024/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,185 | 2,200 | 270,205 | 2019/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 1,647 | 1,679 | 206,297 | 2021/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 2,190 | 2,186 | 268,596 | 2017/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,373 | 2,388 | 293,317 | 2019/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,734 | 1,756 | 215,747 | 2021/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 1,182 | 1,182 | 145,177 | 2017/03/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,383 | 2,405 | 295,469 | 2019/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,821 | 2,892 | 355,244 | 2021/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,485 | 1,486 | 182,608 | 2017/04/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 5,412 | 5,559 | 682,768 | 2024/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,975 | 3,002 | 368,783 | 2019/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,237 | 2,239 | 275,080 | 2017/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,407 | 2,468 | 303,201 | 2021/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,241 | 2,251 | 276,527 | 2019/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,732 | 2,763 | 339,369 | 2021/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 753 | 753 | 92,587 | 2017/06/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,885 | 2,910 | 357,460 | 2019/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,485 | 3,548 | 435,783 | 2021/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 7.5000 | 1,552 | 1,652 | 202,953 | 2016/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.7500 | 1,527 | 1,703 | 209,164 | 2017/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.8750 | 904 | 1,121 | 137,779 | 2019/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.1250 | 724 | 900 | 110,540 | 2019/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.7500 | 642 | 848 | 104,267 | 2020/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.0000 | 2,106 | 2,837 | 348,460 | 2021/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.2500 | 654 | 851 | 104,521 | 2023/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.0000 | 855 | 1,149 | 141,223 | 2026/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.5000 | 630 | 887 | 109,022 | 2026/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.1250 | 709 | 987 | 121,325 | 2027/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.5000 | 700 | 936 | 115,009 | 2028/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.2500 | 438 | 574 | 70,606 | 2028/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.2500 | 473 | 622 | 76,506 | 2029/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.2500 | 964 | 1,404 | 172,463 | 2030/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.3750 | 1,241 | 1,690 | 207,671 | 2031/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 1,926 | 2,479 | 304,576 | 2036/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.0000 | 547 | 752 | 92,449 | 2037/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 548 | 693 | 85,162 | 2038/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 1,019 | 1,312 | 161,184 | 2038/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 255 | 282 | 34,729 | 2039/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.2500 | 694 | 859 | 105,580 | 2039/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 760 | 974 | 119,741 | 2039/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 810 | 1,021 | 125,419 | 2039/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.6250 | 1,307 | 1,706 | 209,611 | 2040/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 1,478 | 1,861 | 228,667 | 2040/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.8750 | 1,591 | 1,860 | 228,563 | 2040/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,677 | 2,077 | 255,111 | 2040/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.7500 | 1,754 | 2,334 | 286,717 | 2041/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 1,365 | 1,724 | 211,826 | 2041/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 1,367 | 1,572 | 193,079 | 2041/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,450 | 1,499 | 184,224 | 2041/11/15 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|-----|----------------------------------|------|--------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | | |
| | | | | | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 2,377 | 2,455 | 301,612 | 2042/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,353 | 2,370 | 291,116 | 2042/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 1,731 | 1,654 | 203,232 | 2042/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,984 | 3,801 | 466,948 | 2042/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 2,026 | 2,080 | 255,519 | 2043/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,998 | 3,904 | 479,563 | 2043/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 3,314 | 3,740 | 459,364 | 2043/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 3,581 | 4,132 | 507,612 | 2043/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 3,617 | 4,078 | 500,880 | 2044/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.3750 | 2,993 | 3,217 | 395,196 | 2044/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,583 | 2,584 | 317,402 | 2017/07/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,326 | 3,353 | 411,849 | 2019/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,834 | 2,902 | 356,446 | 2021/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 5,662 | 5,749 | 706,213 | 2024/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 3,729 | 3,820 | 469,193 | 2044/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,818 | 1,818 | 223,329 | 2017/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 1,189 | 1,198 | 147,161 | 2019/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,301 | 1,313 | 161,335 | 2021/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,187 | 2,191 | 269,120 | 2017/09/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,404 | 3,444 | 423,008 | 2019/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,625 | 3,683 | 452,350 | 2021/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,466 | 1,465 | 179,976 | 2017/10/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,190 | 3,194 | 392,375 | 2019/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,163 | 2,181 | 267,877 | 2021/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,921 | 5,947 | 730,511 | 2024/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,227 | 3,222 | 395,813 | 2044/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,593 | 1,591 | 195,476 | 2017/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.3750 | 145 | 144 | 17,769 | 2016/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,886 | 2,888 | 354,734 | 2021/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 4,325 | 4,327 | 531,483 | 2019/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 444 | 443 | 54,431 | 2016/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 717 | 717 | 88,134 | 2017/12/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,169 | 3,214 | 394,809 | 2021/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,204 | 2,214 | 271,962 | 2019/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 1,544 | 1,542 | 189,448 | 2016/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,547 | 1,543 | 189,533 | 2018/01/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,963 | 3,917 | 481,143 | 2020/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 2,386 | 2,379 | 292,245 | 2017/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,427 | 2,371 | 291,237 | 2022/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 6,275 | 6,163 | 757,023 | 2025/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,763 | 3,384 | 415,663 | 2045/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,961 | 1,960 | 240,763 | 2018/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,788 | 2,767 | 339,932 | 2020/02/29 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 970 | 966 | 118,757 | 2017/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 1,809 | 1,792 | 220,115 | 2022/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,081 | 2,079 | 255,376 | 2018/03/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,792 | 2,769 | 340,098 | 2020/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 2,159 | 2,151 | 264,245 | 2017/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,083 | 2,068 | 254,004 | 2018/04/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,891 | 2,861 | 351,493 | 2022/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,180 | 2,175 | 267,233 | 2018/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 6,188 | 6,134 | 753,474 | 2025/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 4,035 | 4,027 | 494,686 | 2045/05/15 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | | 当 期 | | | 末 | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------------------|-------|--------|----------------|----------------|------------|-------------|-------|
| | | 銘 柄 | 種 類 | 年利率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,607 | 2,583 | 317,338 | 2020/04/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,612 | 2,583 | 317,296 | 2022/04/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 2,323 | 2,313 | 284,161 | 2017/04/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,826 | 2,813 | 345,569 | 2022/05/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,013 | 3,001 | 368,639 | 2020/05/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,196 | 2,197 | 269,869 | 2018/06/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,001 | 3,001 | 368,697 | 2020/06/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 2,313 | 2,305 | 283,204 | 2017/06/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,021 | 2,042 | 250,855 | 2022/06/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,189 | 2,174 | 267,118 | 2018/07/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,135 | 3,135 | 385,040 | 2020/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 1,374 | 1,368 | 168,140 | 2017/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,179 | 2,184 | 268,355 | 2022/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 6,143 | 6,019 | 739,333 | 2025/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,573 | 3,482 | 427,724 | 2045/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 14 | 13 | 1,712 | 2018/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,445 | 2,431 | 298,628 | 2022/08/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,868 | 2,835 | 348,200 | 2020/08/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,179 | 2,168 | 266,358 | 2018/09/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,472 | 2,436 | 299,269 | 2022/09/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,876 | 2,839 | 348,701 | 2020/09/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,057 | 2,038 | 250,359 | 2018/10/15 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 233銘柄 | | 552,013 | 567,249 | 69,669,622 | | |
| カナダ | Canada Government International Bond | 国債証券 | 2.7500 | 千カナダ・ドル 285 | 千カナダ・ドル 325 | 29,872 | 2064/12/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 8.0000 | 386 | 635 | 58,296 | 2027/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 983 | 1,425 | 130,882 | 2029/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 1,017 | 1,548 | 142,158 | 2033/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.0000 | 1,386 | 2,027 | 186,136 | 2037/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,747 | 1,835 | 168,453 | 2017/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 969 | 1,055 | 96,857 | 2018/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 2,199 | 2,427 | 222,838 | 2019/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,413 | 1,873 | 171,983 | 2041/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 1,476 | 1,649 | 151,405 | 2020/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 956 | 1,068 | 98,091 | 2021/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,461 | 1,601 | 146,957 | 2022/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 1,491 | 1,881 | 172,715 | 2045/12/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,327 | 1,342 | 123,186 | 2017/03/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 780 | 791 | 72,685 | 2017/09/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,625 | 1,642 | 150,723 | 2023/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 1,265 | 1,282 | 117,693 | 2018/03/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 1,021 | 1,036 | 95,181 | 2018/09/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,105 | 1,196 | 109,855 | 2024/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,463 | 1,478 | 135,728 | 2017/02/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 853 | 881 | 80,893 | 2019/03/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 827 | 857 | 78,695 | 2019/09/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 341 | 344 | 31,625 | 2017/08/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 406 | 446 | 41,023 | 2048/12/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,047 | 1,109 | 101,865 | 2025/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,014 | 1,018 | 93,453 | 2016/11/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 829 | 853 | 78,311 | 2020/03/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 98 | 99 | 9,112 | 2018/02/01 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|------|-----------------------|---------------------|--------|-----------------|--------------------|--------------------|---------------|------------|
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| イギリス | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.0000 | 千イギリス・ポンド 2,380 | 千イギリス・ポンド 2,465 | 千円 455,164 | 2020/07/22 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.0000 | 1,124 | 1,142 | 210,976 | 2025/09/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.5000 | 554 | 559 | 103,209 | 2021/01/22 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.5000 | 412 | 423 | 78,184 | 2065/07/22 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 8.7500 | 595 | 680 | 125,686 | 2017/08/25 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 8.0000 | 1,213 | 1,646 | 304,015 | 2021/06/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 6.0000 | 949 | 1,389 | 256,453 | 2028/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,840 | 2,340 | 432,120 | 2032/06/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 5.0000 | 1,662 | 2,132 | 393,569 | 2025/03/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,843 | 2,374 | 438,404 | 2036/03/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.7500 | 1,457 | 2,036 | 375,874 | 2038/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.7500 | 1,724 | 1,990 | 367,356 | 2020/03/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,708 | 2,523 | 465,914 | 2055/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,666 | 2,299 | 424,502 | 2046/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,232 | 1,535 | 283,442 | 2027/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 5.0000 | 1,604 | 1,763 | 325,589 | 2018/03/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.5000 | 1,666 | 2,318 | 427,977 | 2042/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.7500 | 1,800 | 2,397 | 442,596 | 2030/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,773 | 2,510 | 463,483 | 2049/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.5000 | 1,820 | 2,036 | 375,919 | 2019/03/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,178 | 1,546 | 285,479 | 2039/09/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.0000 | 1,391 | 1,611 | 297,555 | 2022/03/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.5000 | 1,870 | 2,468 | 455,770 | 2034/09/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,428 | 1,574 | 290,681 | 2019/09/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.0000 | 1,144 | 1,644 | 303,553 | 2060/01/22 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,795 | 2,010 | 371,152 | 2020/09/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,657 | 2,194 | 405,049 | 2040/12/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,843 | 2,091 | 386,079 | 2021/09/07 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 1,010 | 1,025 | 189,224 | 2017/01/22 |
| | | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,182 | 1,558 | 287,736 | 2052/07/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.0000 | 2,392 | 2,409 | 444,742 | 2017/09/07 | |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 2,242 | 2,279 | 420,784 | 2022/09/07 | |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.2500 | 2,012 | 2,305 | 425,678 | 2044/01/22 | |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.2500 | 2,854 | 2,889 | 533,434 | 2018/07/22 | |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.2500 | 2,167 | 2,267 | 418,589 | 2023/09/07 | |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.5000 | 1,506 | 2,000 | 369,249 | 2068/07/22 | |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 1,781 | 1,828 | 337,485 | 2019/07/22 | |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.7500 | 2,012 | 2,180 | 402,465 | 2024/09/07 | |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.5000 | 1,106 | 1,327 | 245,144 | 2045/01/22 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 39銘柄 | | | | | | |
| | 金額 | | | 61,592 | 73,782 | 13,620,299 | | |
| スイス | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 千スイス・フラン 420 | 千スイス・フラン 563 | 67,137 | 2023/02/11 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 506 | 766 | 91,348 | 2028/04/08 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 495 | 535 | 63,856 | 2017/06/05 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 568 | 618 | 73,670 | 2018/01/08 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 527 | 603 | 71,861 | 2019/05/12 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 457 | 525 | 62,680 | 2020/07/06 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 370 | 428 | 51,078 | 2021/04/28 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 7銘柄 | | | | | | |
| | 金額 | | | 3,343 | 4,041 | 481,635 | | |

外国債券インデックスマザーファンド

| | | 当 期 | | | 未 | | |
|---------------|---------------------------|--------|---------|-----------------------|-----------------------|--------------|------------|
| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| デンマーク | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.0000 | 千デンマーク・クローネ 3,055 | 千デンマーク・クローネ 4,823 | 千円 83,972 | 2024/11/10 |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 8,385 | 9,134 | 159,023 | 2017/11/15 |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 11,932 | 19,750 | 343,855 | 2039/11/15 |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 8,601 | 10,045 | 174,885 | 2019/11/15 |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 6,150 | 7,212 | 125,572 | 2021/11/15 |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,921 | 3,009 | 52,399 | 2016/11/15 |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 5,846 | 6,358 | 110,700 | 2023/11/15 |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,682 | 1,853 | 32,267 | 2025/11/15 |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 8銘柄 | | 48,572 | 62,187 | 1,082,676 | |
| ノルウェー | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 千ノルウェー・クローネ 5,755 | 千ノルウェー・クローネ 6,066 | 85,591 | 2017/05/19 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 5,075 | 5,750 | 81,142 | 2019/05/22 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 6,698 | 7,694 | 108,568 | 2021/05/25 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 5,149 | 5,430 | 76,618 | 2023/05/24 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 4,095 | 4,633 | 65,372 | 2024/03/14 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,910 | 1,964 | 27,724 | 2025/03/13 |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 6銘柄 | | 28,682 | 31,539 | 445,017 | |
| スウェーデン | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.0000 | 千スウェーデン・クローネ 5,775 | 千スウェーデン・クローネ 7,196 | 100,970 | 2020/12/01 |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 5,175 | 5,550 | 77,876 | 2017/08/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 10,220 | 11,758 | 164,964 | 2019/03/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 4,475 | 5,879 | 82,484 | 2039/03/30 |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 7,555 | 9,093 | 127,586 | 2022/06/01 |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 6,290 | 6,775 | 95,057 | 2023/11/13 |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 4,760 | 5,532 | 77,624 | 2025/05/12 |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 7銘柄 | | 44,250 | 51,786 | 726,564 | |
| メキシコ | Mexican Bonos | 国債証券 | 5.0000 | 千メキシコ・ペソ 8,802 | 千メキシコ・ペソ 8,756 | 64,707 | 2019/12/11 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 5.7500 | 2,298 | 2,226 | 16,450 | 2026/03/05 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.0000 | 8,233 | 9,306 | 68,774 | 2023/12/07 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 10.0000 | 20,222 | 25,786 | 190,560 | 2024/12/05 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.5000 | 8,568 | 9,355 | 69,137 | 2027/06/03 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.2500 | 12,639 | 13,120 | 96,958 | 2016/12/15 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 13,756 | 14,759 | 109,069 | 2017/12/14 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 10.0000 | 6,874 | 9,370 | 69,244 | 2036/11/20 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.5000 | 8,844 | 10,448 | 77,212 | 2029/05/31 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.5000 | 12,376 | 13,669 | 101,020 | 2018/12/13 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.5000 | 9,694 | 11,592 | 85,667 | 2038/11/18 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.0000 | 12,728 | 14,188 | 104,850 | 2020/06/11 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 6.5000 | 13,441 | 14,113 | 104,301 | 2021/06/10 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 17,015 | 18,912 | 139,764 | 2031/05/29 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 6.5000 | 14,299 | 14,863 | 109,838 | 2022/06/09 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 9,654 | 10,715 | 79,185 | 2042/11/13 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 5.0000 | 9,290 | 9,454 | 69,871 | 2017/06/15 |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 4.7500 | 13,133 | 13,204 | 97,584 | 2018/06/14 |
| Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 2,101 | 2,333 | 17,247 | 2034/11/23 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 19銘柄 | | 203,967 | 226,176 | 1,671,446 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| | | 当 期 | | | 末 | | |
|----------------------|--------------------------|--------|---------|-----------------------|-----------------------|--------------|------------|
| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| マレーシア | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.2400 | 千マレーシア・リンギット 1,210 | 千マレーシア・リンギット 1,237 | 千円 35,505 | 2018/02/07 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 5.7340 | 1,417 | 1,518 | 43,571 | 2019/07/30 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8140 | 1,015 | 1,028 | 29,524 | 2017/02/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5020 | 573 | 519 | 14,907 | 2027/05/31 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 5.2480 | 738 | 793 | 22,768 | 2028/09/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.3780 | 1,603 | 1,645 | 47,228 | 2019/11/29 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0120 | 1,427 | 1,457 | 41,844 | 2017/09/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.4980 | 578 | 579 | 16,645 | 2030/04/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1600 | 1,916 | 1,931 | 55,429 | 2021/07/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.3920 | 1,514 | 1,513 | 43,441 | 2026/04/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5800 | 1,595 | 1,608 | 46,152 | 2018/09/28 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4180 | 875 | 834 | 23,944 | 2022/08/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8920 | 731 | 694 | 19,930 | 2027/03/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1270 | 618 | 584 | 16,784 | 2032/04/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.3140 | 399 | 403 | 11,576 | 2017/10/31 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4920 | 444 | 439 | 12,620 | 2020/03/31 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.2600 | 533 | 533 | 15,319 | 2018/03/01 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4800 | 401 | 382 | 10,975 | 2023/03/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8440 | 477 | 435 | 12,492 | 2033/04/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7330 | 586 | 543 | 15,584 | 2028/06/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8890 | 656 | 658 | 18,891 | 2020/07/31 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.9350 | 233 | 239 | 6,871 | 2043/09/30 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1810 | 488 | 485 | 13,920 | 2024/07/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.3940 | 340 | 343 | 9,854 | 2017/03/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0480 | 857 | 857 | 24,595 | 2021/09/30 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.6540 | 648 | 648 | 18,597 | 2019/10/31 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.9550 | 404 | 395 | 11,363 | 2025/09/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.6590 | 700 | 698 | 20,057 | 2020/10/15 |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7950 | 1,161 | 1,138 | 32,670 | 2022/09/30 | |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7590 | 768 | 775 | 22,264 | 2019/03/15 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 30銘柄 | | | | | |
| | 金 額 | | | 24,905 | 24,924 | 715,334 | |
| 南アフリカ | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.2500 | 千南アフリカ・ランド 5,462 | 千南アフリカ・ランド 5,543 | 47,337 | 2017/09/15 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.0000 | 4,178 | 4,207 | 35,935 | 2018/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.2500 | 5,768 | 5,622 | 48,014 | 2020/01/15 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 10.5000 | 13,703 | 15,596 | 133,196 | 2026/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.2500 | 7,612 | 5,611 | 47,918 | 2036/03/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.7500 | 7,086 | 6,674 | 56,998 | 2021/03/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.5000 | 9,804 | 7,240 | 61,835 | 2041/02/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.0000 | 8,999 | 7,507 | 64,117 | 2031/02/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.7500 | 2,839 | 2,748 | 23,468 | 2023/02/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.7500 | 8,752 | 8,311 | 70,982 | 2048/02/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.5000 | 6,321 | 5,920 | 50,560 | 2037/01/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.0000 | 3,801 | 3,508 | 29,961 | 2030/01/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.7500 | 2,902 | 2,754 | 23,525 | 2044/01/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.2500 | 4,943 | 4,613 | 39,399 | 2032/03/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.8750 | 3,166 | 3,083 | 26,333 | 2035/02/28 |
| | 通貨小計 | 銘柄数 | 15銘柄 | | | | |
| | 金 額 | | | 95,336 | 88,944 | 759,584 | |
| ポーランド | Poland Government Bond | 国債証券 | 5.7500 | 千ポーランド・ズロチ 2,309 | 千ポーランド・ズロチ 2,802 | 85,278 | 2022/09/23 |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 5.2500 | 2,029 | 2,167 | 65,971 | 2017/10/25 |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 5.5000 | 1,912 | 2,175 | 66,199 | 2019/10/25 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | | 当 期 | | | 未 | | | 償還年月日 |
|------------|-------------------------|------|--------|--------|---------|-----------|-------------|-------|
| | | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| ユーロ (ベルギー) | | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.8000 | 1,163 | 1,168 | 151,721 | 2025/06/22 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.0000 | 349 | 330 | 42,972 | 2031/06/22 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.9000 | 358 | 371 | 48,207 | 2038/06/22 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 5.5000 | 1,706 | 2,582 | 335,476 | 2028/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 5.5000 | 810 | 896 | 116,480 | 2017/09/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 5.0000 | 1,704 | 2,697 | 350,415 | 2035/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 1,377 | 1,710 | 222,214 | 2022/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 209 | 221 | 28,713 | 2017/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 966 | 1,063 | 138,168 | 2018/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 1,121 | 1,280 | 166,283 | 2019/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.7500 | 1,636 | 1,938 | 251,725 | 2020/09/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,396 | 2,130 | 276,695 | 2041/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,656 | 2,059 | 267,423 | 2021/09/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.5000 | 1,202 | 1,275 | 165,598 | 2017/06/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.5000 | 801 | 1,094 | 142,146 | 2026/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,070 | 1,361 | 176,838 | 2022/09/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 777 | 1,075 | 139,724 | 2032/03/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.0000 | 1,123 | 1,260 | 163,738 | 2019/09/28 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.2500 | 1,338 | 1,524 | 198,000 | 2023/06/22 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,052 | 1,094 | 142,175 | 2018/06/22 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.7500 | 753 | 1,087 | 141,197 | 2045/06/22 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.6000 | 1,505 | 1,761 | 228,777 | 2024/06/22 | |
| | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.0000 | 497 | 617 | 80,217 | 2034/06/22 | |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 23銘柄 | | | | | | |
| | 金額 | | | 24,569 | 30,604 | 3,974,911 | | |
| ユーロ (フランス) | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 8.5000 | 653 | 875 | 113,723 | 2019/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 8.5000 | 1,285 | 2,058 | 267,405 | 2023/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 2,225 | 3,364 | 436,971 | 2025/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 2,623 | 4,059 | 527,303 | 2029/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 2,507 | 4,186 | 543,786 | 2032/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 2,113 | 3,280 | 426,062 | 2035/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 3,075 | 3,546 | 460,610 | 2019/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,721 | 2,702 | 350,954 | 2055/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 3,230 | 3,883 | 504,421 | 2021/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,222 | 3,233 | 419,992 | 2038/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 3,288 | 3,477 | 451,660 | 2017/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 3,397 | 4,420 | 574,145 | 2023/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 3,148 | 3,424 | 444,711 | 2017/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,261 | 2,496 | 324,216 | 2018/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 2,467 | 2,792 | 362,734 | 2018/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 2,365 | 3,742 | 486,075 | 2041/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 3,263 | 3,765 | 489,004 | 2019/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 3,590 | 4,162 | 540,690 | 2020/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,017 | 1,621 | 210,634 | 2060/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 3,146 | 3,995 | 518,884 | 2026/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 3,113 | 3,501 | 454,714 | 2020/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 3,760 | 4,461 | 579,450 | 2021/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 3,480 | 4,111 | 534,021 | 2022/04/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 3,099 | 3,710 | 481,874 | 2027/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,940 | 2,207 | 286,678 | 2022/10/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 2,114 | 2,182 | 283,503 | 2018/05/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 788 | 1,050 | 136,379 | 2045/05/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,747 | 3,031 | 393,717 | 2023/05/25 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|-----------|------------------------|------|---------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | | | 千ユーロ | 千円 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000% | 2,659 | 2,760 | 358,519 | 2018/11/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 2,486 | 2,848 | 369,980 | 2024/05/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,764 | 1,839 | 238,861 | 2019/05/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,401 | 1,409 | 183,039 | 2016/11/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,680 | 3,132 | 406,907 | 2030/05/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,799 | 3,085 | 400,705 | 2024/11/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,322 | 2,383 | 309,579 | 2019/11/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,792 | 2,745 | 356,525 | 2025/05/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 1,870 | 1,877 | 243,856 | 2020/05/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 113 | 113 | 14,780 | 2018/02/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 481 | 491 | 63,896 | 2025/11/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 729 | 738 | 95,969 | 2020/11/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 480 | 492 | 63,971 | 2031/05/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,315 | 2,375 | 308,507 | 2017/02/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,868 | 1,909 | 248,064 | 2017/07/25 |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 43銘柄 | | | | | |
| | 金 額 | | | 97,396 | 117,550 | 15,267,493 | |
| ユーロ (ドイツ) | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 774 | 1,151 | 149,589 | 2024/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000 | 1,067 | 1,780 | 231,222 | 2027/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.6250 | 1,362 | 2,159 | 280,448 | 2028/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,113 | 1,664 | 216,207 | 2028/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 951 | 1,652 | 214,652 | 2030/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,304 | 2,162 | 280,845 | 2031/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,721 | 2,806 | 364,569 | 2034/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,071 | 3,179 | 412,902 | 2037/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 2,185 | 2,285 | 296,788 | 2017/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,225 | 1,996 | 259,336 | 2039/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 2,099 | 2,255 | 292,955 | 2017/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,798 | 1,966 | 255,347 | 2018/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 2,211 | 2,479 | 322,052 | 2018/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,399 | 2,458 | 319,326 | 2040/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 2,682 | 3,026 | 393,127 | 2019/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 2,481 | 2,824 | 366,906 | 2019/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 2,075 | 2,378 | 308,885 | 2020/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 2,247 | 2,584 | 335,610 | 2020/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,374 | 2,005 | 260,482 | 2042/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,444 | 1,616 | 209,945 | 2020/09/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,333 | 2,654 | 344,804 | 2021/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,465 | 1,744 | 226,525 | 2021/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,415 | 1,610 | 209,121 | 2021/09/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,707 | 1,924 | 250,008 | 2022/01/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,222 | 2,484 | 322,679 | 2022/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,376 | 1,793 | 232,897 | 2044/07/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,644 | 1,812 | 235,438 | 2022/09/04 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,410 | 1,556 | 202,207 | 2023/02/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,817 | 2,006 | 260,643 | 2023/05/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,707 | 1,952 | 253,590 | 2023/08/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,291 | 1,453 | 188,835 | 2024/02/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,204 | 1,573 | 204,334 | 2046/08/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,705 | 1,885 | 244,927 | 2024/05/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 2,142 | 2,274 | 295,404 | 2024/08/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,379 | 1,394 | 181,178 | 2025/02/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,549 | 1,629 | 211,693 | 2025/08/15 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 485 | 486 | 63,250 | 2016/12/16 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|------------|-------------------------|------------------------|--------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 492 | 494 | 64,221 | 2017/03/10 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 795 | 800 | 103,906 | 2017/06/16 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 307 | 309 | 40,170 | 2017/09/15 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,717 | 1,741 | 226,175 | 2017/02/24 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,848 | 1,870 | 242,951 | 2017/04/07 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,811 | 1,842 | 239,274 | 2017/10/13 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 890 | 908 | 117,959 | 2018/02/23 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,392 | 1,414 | 183,663 | 2018/04/13 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,209 | 1,257 | 163,338 | 2018/10/12 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,674 | 1,748 | 227,044 | 2019/02/22 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,113 | 1,145 | 148,760 | 2019/04/12 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,151 | 1,176 | 152,822 | 2019/10/11 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 1,731 | 1,750 | 227,344 | 2020/04/17 |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 596 | 609 | 79,119 | 2020/10/16 |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 51銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 77,160 | 91,742 | 11,915,494 | |
| | | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| ユーロ (スペイン) | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 2,108 | 3,101 | 402,866 | 2029/01/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,735 | 1,752 | 227,588 | 2017/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6000 | 1,497 | 1,517 | 197,125 | 2025/04/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 527 | 520 | 67,547 | 2030/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 12 | 12 | 1,565 | 2018/04/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.1500 | 1,642 | 1,737 | 225,640 | 2025/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.1500 | 609 | 627 | 81,521 | 2020/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 1,679 | 2,515 | 326,725 | 2032/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,654 | 1,806 | 234,615 | 2017/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2000 | 1,494 | 1,907 | 247,718 | 2037/01/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.8000 | 2,135 | 2,231 | 289,808 | 2017/01/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.9000 | 1,139 | 1,606 | 208,659 | 2040/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.1000 | 2,206 | 2,441 | 317,143 | 2018/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8000 | 1,777 | 2,262 | 293,792 | 2024/01/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6000 | 2,382 | 2,759 | 358,447 | 2019/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.3000 | 1,775 | 2,052 | 266,516 | 2019/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7000 | 1,173 | 1,619 | 210,310 | 2041/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,101 | 2,428 | 315,351 | 2020/04/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6500 | 1,789 | 2,297 | 298,346 | 2025/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8500 | 1,681 | 2,033 | 264,046 | 2020/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 2,515 | 3,166 | 411,210 | 2021/04/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.9000 | 1,265 | 1,791 | 232,703 | 2026/07/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,456 | 1,513 | 196,625 | 2016/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.8500 | 1,978 | 2,576 | 334,607 | 2022/01/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 2,000 | 2,193 | 284,902 | 2018/01/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.4000 | 1,758 | 2,283 | 296,533 | 2023/01/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.4000 | 1,350 | 1,673 | 217,366 | 2023/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.1500 | 1,270 | 1,736 | 225,486 | 2028/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 1,564 | 1,730 | 224,769 | 2018/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.1500 | 964 | 1,433 | 186,157 | 2044/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.1000 | 1,488 | 1,532 | 199,094 | 2017/04/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,836 | 1,994 | 259,057 | 2019/04/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.8000 | 2,219 | 2,650 | 344,267 | 2024/04/30 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,849 | 2,055 | 266,951 | 2024/10/31 | |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4000 | 1,900 | 1,981 | 257,333 | 2020/01/31 | |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 35銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 56,527 | 67,542 | 8,772,406 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区分 | 銘柄 | 種類 | 当 期 年 利 率 | 未 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
|-----------------------------------|-----------------------------------|--------|--------------|--------------|-----------|------------|------------|
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | | |
| | | | | | 千ユーロ | 千円 | |
| ユーロ (イタリア) | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 9.0000 | 1,106 | 1,769 | 229,851 | 2023/11/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.2500 | 1,110 | 1,750 | 227,392 | 2026/11/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000 | 2,722 | 4,131 | 536,660 | 2027/11/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,814 | 2,002 | 260,036 | 2024/12/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,743 | 1,771 | 230,021 | 2018/01/15 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0500 | 1,445 | 1,489 | 193,485 | 2019/12/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,129 | 1,299 | 168,789 | 2046/09/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.3500 | 1,229 | 1,271 | 165,119 | 2022/04/15 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 945 | 962 | 125,072 | 2025/06/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6500 | 577 | 558 | 72,591 | 2032/03/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 128 | 128 | 16,714 | 2018/05/15 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7000 | 1,211 | 1,230 | 159,790 | 2020/05/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 357 | 377 | 49,028 | 2025/12/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4500 | 601 | 623 | 80,999 | 2022/09/15 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.3000 | 371 | 373 | 48,522 | 2018/10/15 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.2500 | 2,654 | 3,765 | 489,007 | 2029/11/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 6.0000 | 3,118 | 4,792 | 622,432 | 2031/05/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.7500 | 1,455 | 2,228 | 289,463 | 2033/02/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.2500 | 2,528 | 2,751 | 357,318 | 2017/08/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,074 | 2,345 | 304,583 | 2019/02/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 1,921 | 2,256 | 293,121 | 2020/02/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 1,908 | 2,737 | 355,499 | 2034/08/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 2,390 | 3,057 | 397,130 | 2037/02/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 2,734 | 3,206 | 416,409 | 2021/08/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 2,280 | 2,388 | 310,251 | 2017/02/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,480 | 2,722 | 353,565 | 2018/02/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 1,674 | 2,456 | 319,023 | 2039/08/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,953 | 2,488 | 323,215 | 2023/08/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,187 | 2,446 | 317,755 | 2018/08/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,708 | 3,092 | 401,637 | 2019/03/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,531 | 2,912 | 378,308 | 2019/09/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,118 | 2,802 | 363,990 | 2025/03/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 1,893 | 2,776 | 360,607 | 2040/09/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,560 | 2,989 | 388,301 | 2020/03/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 2,000 | 2,339 | 303,872 | 2020/09/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,070 | 2,678 | 347,904 | 2026/03/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 2,144 | 2,501 | 324,854 | 2021/03/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 2,281 | 2,806 | 364,561 | 2021/09/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,012 | 2,530 | 328,681 | 2022/03/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 2,315 | 2,472 | 321,072 | 2017/05/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.5000 | 1,657 | 2,159 | 280,441 | 2022/09/01 |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,490 | 1,596 | 207,377 | 2017/06/01 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.5000 | 1,910 | 2,494 | 323,975 | 2022/11/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 1,295 | 1,382 | 179,576 | 2017/11/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,810 | 2,430 | 315,692 | 2028/09/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 1,594 | 1,991 | 258,636 | 2023/05/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 2,341 | 2,545 | 330,616 | 2018/06/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,434 | 2,087 | 271,063 | 2044/09/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,194 | 2,769 | 359,643 | 2024/03/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 2.7500 | 421 | 432 | 56,151 | 2016/11/15 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 2,111 | 2,327 | 302,274 | 2018/12/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 1,095 | 1,280 | 166,320 | 2021/05/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 1.5000 | 318 | 323 | 41,978 | 2016/12/15 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 2.5000 | 1,100 | 1,187 | 154,288 | 2019/05/01 | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 1,901 | 2,294 | 298,052 | 2024/09/01 | |

| 区 分 | | 当 期 | | | 末 | | | 償還年月日 |
|--------------|-----|-----------------------------------|------|--------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| | | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 1,066 | 1,284 | 166,884 | 2030/03/01 |
| | | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 1.1500 | 905 | 920 | 119,591 | 2017/05/15 |
| | | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 2.1500 | 1,593 | 1,726 | 224,210 | 2021/12/15 |
| | | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 1.5000 | 446 | 467 | 60,674 | 2019/08/01 |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 59銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 99,157 | 120,989 | 15,714,095 | |
| ユーロ (フィンランド) | | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.3750 | 232 | 237 | 30,807 | 2020/09/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.7500 | 248 | 234 | 30,508 | 2031/04/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.8750 | 279 | 283 | 36,857 | 2025/09/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 3.8750 | 474 | 510 | 66,269 | 2017/09/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 4.3750 | 447 | 521 | 67,714 | 2019/07/04 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 4.0000 | 667 | 877 | 113,996 | 2025/07/04 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 3.3750 | 527 | 608 | 79,021 | 2020/04/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 3.5000 | 459 | 546 | 70,944 | 2021/04/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.8750 | 163 | 168 | 21,831 | 2017/04/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 2.7500 | 389 | 474 | 61,591 | 2028/07/04 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.6250 | 612 | 672 | 87,339 | 2022/09/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.5000 | 446 | 485 | 63,056 | 2023/04/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 2.6250 | 387 | 496 | 64,450 | 2042/07/04 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.1250 | 425 | 442 | 57,422 | 2018/09/15 |
| | | Finland Government Bond | 国債証券 | 2.0000 | 529 | 596 | 77,500 | 2024/04/15 |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 15銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 6,284 | 7,155 | 929,311 | |
| ユーロ (オーストリア) | | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.2500 | 347 | 353 | 45,908 | 2019/10/18 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.2000 | 462 | 484 | 62,902 | 2025/10/20 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 6.2500 | 985 | 1,574 | 204,547 | 2027/07/15 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.6500 | 1,286 | 1,423 | 184,827 | 2018/01/15 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.9000 | 1,248 | 1,482 | 192,581 | 2020/07/15 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.5000 | 1,212 | 1,457 | 189,313 | 2021/09/15 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.1500 | 1,218 | 1,836 | 238,562 | 2037/03/15 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.3000 | 711 | 770 | 100,060 | 2017/09/15 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.3500 | 989 | 1,140 | 148,100 | 2019/03/15 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.8500 | 675 | 951 | 123,642 | 2026/03/15 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.2000 | 907 | 946 | 122,919 | 2017/02/20 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.6500 | 554 | 678 | 88,120 | 2022/04/20 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.4000 | 872 | 1,064 | 138,274 | 2022/11/22 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.8000 | 318 | 538 | 69,945 | 2062/01/26 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.9500 | 738 | 796 | 103,451 | 2019/06/18 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.1500 | 563 | 773 | 100,495 | 2044/06/20 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.7500 | 675 | 749 | 97,294 | 2023/10/20 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 2.4000 | 301 | 355 | 46,189 | 2034/05/23 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.1500 | 307 | 320 | 41,578 | 2018/10/19 |
| | | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.6500 | 932 | 1,023 | 132,941 | 2024/10/21 |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 20銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 15,300 | 18,722 | 2,431,655 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 280銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 409,987 | 494,094 | 64,172,933 | |
| 合 計 | 銘柄数 | 729銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | | | 160,897,617 | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

2015年11月30日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 160,897,617 | 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 2,851,021 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 163,748,638 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=122.82円、1カナダ・ドル=91.79円、1オーストラリア・ドル=88.12円、1シンガポール・ドル=86.86円、1イギリス・ポンド=184.60円、1スウェーデン・クローネ=119.17円、1デンマーク・クローネ=17.41円、1ノルウェー・クローネ=14.11円、1スウェーデン・クローネ=14.03円、1メキシコ・ペソ=7.39円、1マレーシア・リンギット=28.70円、1南アフリカ・ランド=8.54円、1ポーランド・ズロチ=30.43円、1ユーロ=129.88円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(162,313,350千円)の投資信託財産総額(163,748,638千円)に対する比率は、99.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年11月30日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------|-------------------------|
| (A) 資産 | 165,050,287,123円 |
| コール・ローン等 | 1,447,267,326 |
| 公社債(評価額) | 160,897,617,318 |
| 未収入金 | 1,311,969,573 |
| 未収利息 | 1,365,306,752 |
| 前払費用 | 28,126,154 |
| (B) 負債 | 1,397,976,773 |
| 未払金 | 1,316,101,673 |
| 未払解約金 | 81,875,100 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 163,652,310,350 |
| 元本 | 57,305,049,313 |
| 次期繰越損益金 | 106,347,261,037 |
| (D) 受益権総口数 | 57,305,049,313口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 28,558円 |

*期首における元本額は58,642,095,234円、当期中における追加設定元本額は4,738,151,583円、同解約元本額は6,075,197,504円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A1,705,324,690円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)64,835,690円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)424,599,533円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)94,962,008円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)1,383,635,321円、D-1's 外国債券インデックス458,057円、DCダイワ外国債券インデックス35,721,581,475円、ダイワ・ライフ・バランス30 453,561,180円、ダイワ・ライフ・バランス50 223,580,955円、ダイワ・ライフ・バランス70 140,934,888円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)208,558,781円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)170,466,025円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)51,355,053円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 11,127,145円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 11,074,521円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 617,784円、ダイワ世界バランスファンド40VA1,816,582,601円、ダイワ世界バランスファンド60VA190,939,449円、ダイワ・バランスファンド35VA7,736,607,136円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA546,037,516円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA350,468,264円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)412,662,256円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券70,890,454円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,422,306,182円、ダイワライフスタイル25 30,209,709円、ダイワライフスタイル50 48,765,591円、ダイワライフスタイル75 12,907,049円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は28,558円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月2日 至2015年11月30日

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------|-------------------------|
| (A) 配当等収益 | 4,306,200,486円 |
| 受取利息 | 4,307,009,948 |
| 支払利息 | △ 809,462 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 8,734,391,023 |
| 売買益 | 3,875,458,517 |
| 売買損 | △ 12,609,849,540 |
| (C) その他費用 | △ 42,581,695 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 4,470,772,232 |
| (E) 前期繰越損益金 | 113,365,834,168 |
| (F) 解約差損益金 | △ 11,404,721,716 |
| (G) 追加信託差損益金 | 8,856,920,817 |
| (H) 合計(D+E+F+G) | 106,347,261,037 |
| 次期繰越損益金(H) | 106,347,261,037 |

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。