

★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／内外／資産複合 | |
| 信託期間 | 無期限 | |
| 運用方針 | 安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。 | |
| 主要投資対象 | ベビーフンド | 下記の各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 |
| | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 内外の公社債等(各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。) |
| | ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 海外の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)および店頭登録(登録予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券 |
| | ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券 |
| | ダイワ北米好配当株マザーファンド | 北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券(上場予定および店頭登録予定を含みます。) |
| | ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。) |
| | ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。) |
| | ダイワ好配当日本株マザーファンド | わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。) |
| ベビーフンドの運用方法 | 主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。 | |
| 組入制限 | 株式組入上限比率 | |
| | 外国債券インデックスマザーファンド | 純資産総額の30%以下 |
| | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 純資産総額の10%以下 |
| | ダイワ北米好配当株マザーファンド | 無制限 |
| | ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| | ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| | ダイワ好配当日本株マザーファンド | |
| 投資信託証券組入上限比率 | | |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 無制限 | |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | | |
| 分配方針 | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とし、原則として、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、分配対象額が少額の場合には、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ないます。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。

DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽/安定コース)

DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽/6分散コース)

DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽/成長コース)

(以下、上記のファンドを総称して「DCダイワ・ワールドアセット」といいます。)

運用報告書 (全体版)

第10期

(決算日 2016年1月12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、「DCダイワ・ワールドアセット」は、このたび、第10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/>

<3719>

<3720>

<3721>

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)

★DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 合成指数 | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 | 公社債 組入比率 | 投資信託 組入比率 | 純資産 総額 |
|------------------|------------|-----------|------------|-----------|------------|------------|------------|-------------|--------------|------------|
| | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (参考指数) | 期中 騰落率 | | | | | | |
| 6期末(2012年1月10日) | 円 8,535 | 円 0 | % △ 6.7 | 8,673 | % △ 6.4 | % 17.6 | % - | % 50.0 | % 29.2 | 百万円 884 |
| 7期末(2013年1月10日) | 10,521 | 0 | 23.3 | 10,823 | 24.8 | 18.3 | - | 49.7 | 29.4 | 1,295 |
| 8期末(2014年1月10日) | 13,008 | 0 | 23.6 | 13,415 | 24.0 | 17.6 | 0.2 | 49.9 | 29.3 | 1,780 |
| 9期末(2015年1月13日) | 15,471 | 0 | 18.9 | 16,024 | 19.4 | 16.4 | 0.2 | 49.7 | 30.9 | 2,254 |
| 10期末(2016年1月12日) | 14,830 | 0 | △ 4.1 | 15,393 | △ 3.9 | 15.8 | - | 51.9 | 29.1 | 2,390 |

(注1) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。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。

| 投資対象資産 | 指数 | 配分比率 |
|--------|---------------------------------|------|
| 海外債券 | 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) | 25% |
| 国内債券 | NOMURA-BPI総合指数 | 25% |
| 海外リート | S&P先進国REIT指数 (除く日本) | 15% |
| 国内リート | 東証REIT指数 (配当込み) | 15% |
| 海外株式 | MSCIコクサイ指数 (グロス配当込み) | 10% |
| 国内株式 | TOPIX (配当込み) | 10% |

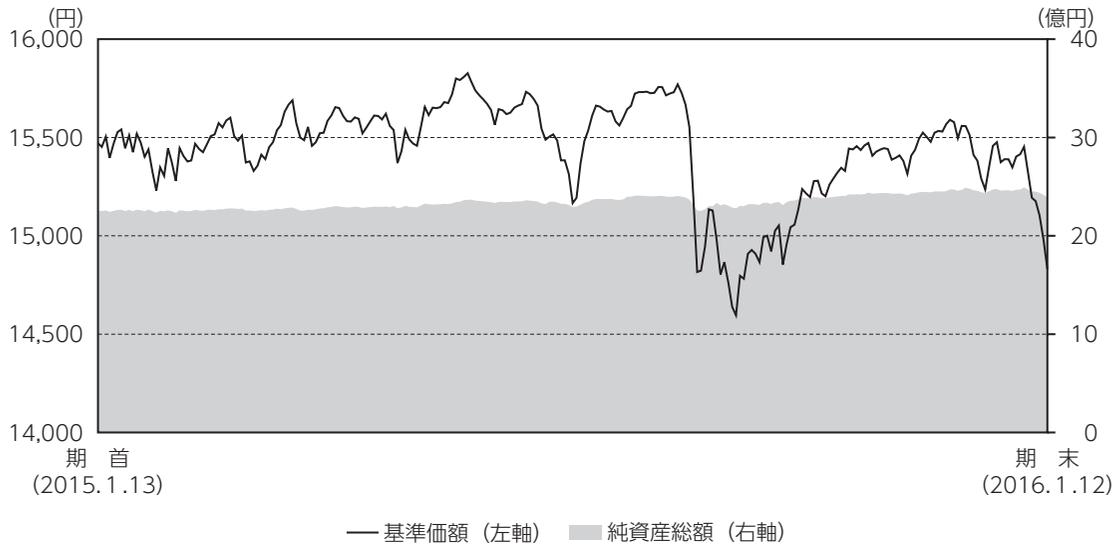
(注2) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注4) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

《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：15,471円
 期末：14,830円
 騰落率：△4.1%

■ 組入ファンドの当期中の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|----------------------------|--------|
| 外国債券インデックスマザーファンド | △4.6% |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) | 0.9% |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | △2.2% |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | △10.9% |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | △2.4% |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | △7.6% |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | △12.7% |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | △1.1% |

■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、国内債券以外のマザーファンドの下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 合 成 指 数 | | 株 式 組 入 率 株 比 | 株 式 先 物 率 株 比 | 公 社 債 率 公 組 入 比 | 投 信 託 証 比 組 入 証 比 | 資 券 率 証 比 |
|------------------|---------|--------|---------|--------|------------------|------------------|--------------------|----------------------|--------------|
| | 円 | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | | | | |
| (期首)2015年 1 月13日 | 15,471 | % - | 16,024 | % - | % 16.4 | % 0.2 | % 49.7 | % 30.9 | |
| 1 月末 | 15,439 | △0.2 | 16,006 | △0.1 | 16.9 | 0.1 | 49.6 | 30.5 | |
| 2 月末 | 15,551 | 0.5 | 16,174 | 0.9 | 17.4 | 0.2 | 49.9 | 29.7 | |
| 3 月末 | 15,554 | 0.5 | 16,192 | 1.0 | 16.7 | 0.5 | 50.4 | 29.5 | |
| 4 月末 | 15,559 | 0.6 | 16,219 | 1.2 | 17.0 | 0.1 | 50.4 | 29.6 | |
| 5 月末 | 15,792 | 2.1 | 16,487 | 2.9 | 17.1 | 0.1 | 50.1 | 29.5 | |
| 6 月末 | 15,489 | 0.1 | 16,090 | 0.4 | 17.1 | 0.0 | 50.6 | 29.4 | |
| 7 月末 | 15,661 | 1.2 | 16,318 | 1.8 | 17.3 | - | 50.2 | 29.7 | |
| 8 月末 | 15,128 | △2.2 | 15,687 | △2.1 | 16.5 | 0.1 | 51.4 | 28.9 | |
| 9 月末 | 14,959 | △3.3 | 15,490 | △3.3 | 16.1 | 0.2 | 50.6 | 30.0 | |
| 10月末 | 15,472 | 0.0 | 16,121 | 0.6 | 17.1 | - | 49.5 | 30.4 | |
| 11月末 | 15,530 | 0.4 | 16,200 | 1.1 | 17.1 | - | 49.2 | 30.3 | |
| 12月末 | 15,453 | △0.1 | 16,093 | 0.4 | 16.6 | - | 50.2 | 29.8 | |
| (期末)2016年 1 月12日 | 14,830 | △4.1 | 15,393 | △3.9 | 15.8 | - | 51.9 | 29.1 | |

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について**○海外債券市況**

米国およびユーロ圏の主要各国では国債金利が上昇しました。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。4月末からはユーロ圏の金利が上昇に転じる中、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、米国でも金利は上昇に転じました。6月以降は、欧州でのギリシャ支援問題の混迷や中国株式市況の急落、原油価格の下落や新興国経済の減速懸念、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世界的に金利は低下傾向となりました。10月中旬以降は、米国では年内の利上げ期待が金利上昇圧力となりましたが、2016年1月は原油価格が一段安となった影響から世界的にリスク回避的な市場環境となり、金利は低下して期末を迎えました。

○国内債券市況

国内債券市況は、期首から、株価の上昇や低調な国債入札などを受けて金利は上昇しました。2015年3月半ば以降は、ECBによる国債買い入れの開始や、FOMC（米国連邦公開市場委員会）での低水準の政策金利見通しなどから欧米の長期金利が低下したことを受けて、金利は低下しました。4月下旬からは、欧米の早期金融引き締め観測や国内景況感の改善などにより、金利は上昇しました。6月半ば以降は、ギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念や中国経済の先行き不透明感、新興国通貨安の進行、国内景況感の悪化、米国の利上げ先送り観測、株価の下落などを背景に、金利は低下基調となりました。10月以降は、株価が上昇に転じたほか、12月には米国が約9年半ぶりに利上げに踏み切りましたが、良好な国債需給や日銀による量的・質的金融緩和を補完するための諸措置の決定もあり、金利は低下基調が続きました。

○海外リート市況

海外リート市況は、小幅な下落となりました。2015年前半は、景気回復を受けた米国の利上げに対する警戒を背景に市況は下落しました。6月にはFRBが年内の利上げとその後の慎重なペースでの利上げを示唆したことで金融政策に対する安心感が広がり、市況はいったんは上昇に転じました。しかし8月に入り、中国経済の減速に歯止めがかからないことに対する不安が強まり世界的に株式市況が急落すると、リート市況も連れ安する展開になりました。9月のFOMCで利上げが見送られたことや中国の追加金融緩和を好感して、10月中旬にかけて市況は再び上昇しました。その後は、12月のFOMCでFRBが利上げに踏み切るとの警戒が市況の上値抑制要因になり、期末にかけて市況は一進一退の展開になりました。

市場別では、利上げに対する警戒から米国が下落したほか、米国の利上げにより不動産市場への資金流入が細るとの見方が広まったシンガポールが下落しました。一方、ECBが量的金融緩和策を打ち出したことが2015年前半の力強い上昇につながったフランスやイタリアが上昇したほか、ロンドンの好調な不動産市場が下支え要因となった英国も上昇しました。

○国内リート市況

国内リート市況は、日銀が追加金融緩和に関して慎重な姿勢を示したことなどをきっかけに長期金利が反転上昇したことや、2015年に入ってから相次いだ国内リート各社によるエクイティ・ファイナンス（新株発行などを伴う資金調達）が需給面での重しとなり、軟調に始まりました。その後は、オフィス・ビル空室率の低下や実物不動産取引の活発化など国内リートを取り巻くファンダメンタルズの改善傾向などを背景に、徐々に落ち着きを取り戻しました。7月に入ると、ギリシャのデフォルトリスクや中国株式市況の調整などを受けて先行き不透明感が強まり、国内リート市況も一時大きく下落しました。その後は、米国の利上げ時期に関する思惑の変化などにより値動きが荒くなる局面もありましたが、国内株式市況が反発したことや長期金利が低下傾向となったことなどを背景に、戻り基調となりました。2016年に入ると、原油安に加えて、中国株式市況が大幅に下落したことを受けて、国内リート市況は再び調整する展開となりました。

○海外株式市況

・北米

北米株式市況は下落しました。2015年前半は、良好な景気と好調な企業業績を背景に市況は底堅い展開になりました。しかし、景気対策を打ち出してはいるものの景気減速に歯止めがかからない中国経済の先行きに対する不安や中国本土の株式市況の大幅下落を背景に市場のリスク回避姿勢が急速に強まったため、8月下旬に市況は大きく下落しました。9月に入り、F R Bが中国経済の鈍化の影響に対する不透明感などを理由に利上げを見送ったことが、市場に安心感をもたらして市況は反発に転じ、一時は下落分をほぼ取り戻すまで値を戻しましたが、12月のF O M Cを前に利上げに対する警戒から再び上値が重くなりました。2016年に入ると、中国経済の減速に対する不安が再燃し、市況は急落して期末を迎えました。

業種別では、原油価格の大幅下落や金や銅など金属価格の下落を背景に、エネルギーセクターや素材セクターの下落率が大きくなりました。一方、堅調な業績が好感されたインターネット小売関連銘柄を中心に小売セクターが上昇しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は上昇しました。期首から2015年4月中旬にかけては、米国の早期利上げ観測の後退が支援材料となり市況は上昇しました。その後は9月下旬まで一進一退の展開になりました。10月以降は、12月のF O M Cでの利上げを前に市況が下落する場面もありましたが、F R Bが慎重なペースでの利上げを示唆したことや、長期国債利回りが落ち着いた推移となったことが下支え要因となり、市況は期末にかけて上昇しました。

・欧州

欧州株式市況は小幅な下落となりました。期首から、E C Bが国債の買い入れを含む量的金融緩和策を発表したことや、ドイツのマクロ経済指標の改善などを受けて、堅調に推移しました。しかし2015年5月以降は、ギリシャに対する金融支援に進展が見られないことや米国の景気減速への警戒感などを受けて、軟調に推移しました。さらに8月以降は、中国をはじめとする新興国の景気への懸念や中国株式市況の急落から、欧州株式市況も大幅下落となり、さらにドイツ大手自動車会社が米国の排ガス検査で不正行為を行っていたことなどが嫌気されて下値を試す展開となりました。10月以降は、米国企業の業績が総じて市場予想を上回ったことを受けて一時的に反発しましたが、その後は、中国の景気減速懸念の高まりや原油価格の下落を反映しながら、下落基調で期末を迎えました。

・アジア・オセアニア

アジア・オセアニア株式市況は下落しました。期首から2015年4月下旬にかけては、中国の金融緩和や国有企業改革推進観測、米国の早期利上げ観測の後退などを背景に上昇しました。5月上旬から8月下旬にかけては、中国の株式信用取引規制強化に対する懸念、ギリシャのユーロ離脱懸念、中国人民元の実質的な切下げを受けた中国および新興国の株式市場でのリスクオフの動きなどから、軟調な値動きとなりました。9月上旬から期末にかけては、中国財政部が経済成長の目標達成へ向けて積極的な財政措置を実施する旨を示したことや、欧州での追加金融緩和期待などが支援材料となったものの、米国の利上げをめぐる不透明感や原油価格の下落、中国人民元の先安観などから上値が重い展開となりました。

○国内株式市況

国内株式市況は、期首から、ECBによる量的金融緩和の決定や国内景気の持ち直し、春闘でのベア高め妥結、日銀・GPIF（年金積立金管理運用独立行政法人）を背景とする良好な株式需給関係の継続、さらなる円安の進行などを受けて、大きく上昇しました。2015年6月から8月上旬は、ギリシャ支援協議の難航や中国株式市況が急落したことなどから、上値の重い展開となりました。8月中旬以降は、中国をはじめとした世界経済の先行き不透明感の広がりや円高の進行などから、株価は下落に転じました。10月からは、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやECBが追加金融緩和を示唆したこと、中国での追加金融緩和の実施、国内企業の良好な決算などを受けて、株価は上昇しました。しかし12月に入ると、ECBの追加金融緩和が予想を下回る内容だったことや原油価格の下落、高利回り債に投資していた一部の投資ファンドの解約停止などを受け、市場参加者のリスク回避姿勢が強まり、株価は下落しました。

○為替相場

・米ドル

米ドルの対円為替相場は、期首から2015年4月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、米国の金利上昇による日本との金利差の拡大観測から、上昇しました。7月以降は、原油価格の下落や新興国経済の減速懸念から下落に転じましたが、10月後半以降は、米国経済指標の改善による利上げ期待の高まりや、12月のFOMCにおける利上げの決定などを材料に、米ドルは上昇しました。しかし2016年1月は、原油価格が一段安となりリスク回避的な市場環境となる中で下落が加速し、期末を迎えました。

・ユーロ

ユーロの対円為替相場は、期首から2015年4月にかけて、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、下落しました。4月後半から6月半ばにかけては、欧州の金利上昇を受けてユーロは上昇しましたが、その後はECBの追加金融緩和への期待の高まりやリスク環境の悪化から下落傾向が続き、期末を迎えました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行ないます。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の25%
- ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) …純資産総額の25%
- ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド …純資産総額の15%
- ・ダイワ J - R E I T アクティブ ・マザーファンド …純資産総額の15%
- ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の10%

…3ファンド合計で純資産総額の10% (*)

*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

○外国債券インデックスマザーファンド

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。

○ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

今後もベンチマーク (NOMURA-BPI総合指数) との高い連動性を維持するように運用を行ないます。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド (国債以外の債券における国債との利回り格差) への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

○ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク (以下、C & S) に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。

銘柄選択に際しては、良好な財務体質を有し、低コストでの資金調達により物件取得や事業拡大を図ることが可能であり、かつ保有不動産の価値と比較して価格が割安なリートを選好します。用途別では、米国では、住宅施設や個人用倉庫などを保有するリート、欧州では、ロンドンのオフィスや商業施設、ユーロ圏の商業施設、パリなどのオフィスを保有するリートに注目しています。

○ダイワ J - R E I T アクティブ ・マザーファンド

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつ国内リートに幅広く分散投資を行ない、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。ポートフォリオ戦略については、個別銘柄ごとのバリュエーション格差が徐々に縮小していることに鑑み、各種バリュエーション指標での割安度よりも、経営戦略や業績の変化等を重視した銘柄選別を行なっていく方針です。また、相対的に景気敏感なオフィス・セクターや、訪日観光客の増加などテーマ性のあるホテル・セクターにも注目します。

○**ダイワ北米好配当株マザーファンド**

外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。普通株式については、今後もキャッシュフローおよび配当の成長が期待できるセクターや銘柄に重点を置いたポートフォリオを継続します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築してまいります。

○**ダイワ欧州好配当株マザーファンド**

外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド（以下、パイオニア社）に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。銘柄選定では、収益基盤が安定しており、安定した配当を継続できる銘柄や、景気回復局面で収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

○**ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド**

オーストラリアや香港、韓国、台湾を中心に市場分散に配慮したポートフォリオとする方針です。革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景として、市場予想を上回る業績が期待できる企業を選別して投資を行ないます。また、世界的な低金利が継続していることから、配当利回りの高い銘柄に注目しています。

○**ダイワ好配当日本株マザーファンド**

バリュエーション面から割安感があり、業績改善が期待される銘柄を中心としたポートフォリオを継続する方針です。特に円安・原油安がメリットになる銘柄や自動車の電装化・安全対策、ウエアラブル端末、マイナンバー、電力自由化、軍事・航空に関連する銘柄などに注目してまいります。また、株価が割安となり企業買収の対象となり得る銘柄や中長期での成長が期待される銘柄などにも注目してまいります。

ポートフォリオについて

○**当ファンド**

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行ないました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行ないました。

- | | |
|------------------------------|---------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の10%（*） |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | |

*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

○**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。

○**ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)**

当ファンドの収益率が、ベンチマークの収益率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

○**ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド**

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & S に運用の指図にかかる権限を委託しております。当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし保有不動産の価値などと比べて魅力的であると考えられる銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。国・地域別配分では大きなリスクを取らず各地域にバランス良く投資を行ないましたが、ECBの追加金融緩和に対する期待などを背景に底堅い推移となったフランスの商業施設リートなどの組み入れを引き下げ、ユーロ圏のオーバーウエート幅を縮小しました。また、リート価格が堅調に推移し割安感が後退したオフィスリートや大手商業施設リートなどを一部売却し、英国を小幅のアンダーウエートに引き下げました。一方、リート価格の下落により割安感が高まったショッピングモールやショッピングセンターを保有するリートを買増したほか、高い成長が見込めるデータセンターを保有するリートなどを新たに組み入れ、米国をオーバーウエートに引き上げました。

○**ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド**

リーートの組入比率につきましては、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本としており、期を通じておおむね96~98%台程度で推移させました。銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄ではインベスコ・オフィス・ジェイリート、ジャパン・ホテル・リート、インヴィンシブルなどを東証REIT指数と比較してオーバーウエートとし、日本リテールファンド、日本ビルファンド、アドバンス・レジデンス等をアンダーウエートとしました。

○**ダイワ北米好配当株マザーファンド**

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & S に運用の指図にかかる権限を委託しております。有価証券の組入比率は、株式を68~74%程度、ハイブリッド優先証券等を22~28%程度としました。

銘柄選択にあたって、C & S では、長期的なビジネスモデルが確立した銘柄に絞って調査しております。当ファンドでは、その中から魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できるキャッシュフローを生み出せると考える銘柄を中心にポートフォリオを構築しました。その結果、業種別では、IT (情報技術) セクターや金融セクターを高位で組み入れました。また個別銘柄では、MICROSOFTやAPPLE (ともに情報技術)、EXXON MOBIL (エネルギー) などを高位で組み入れました。

○**ダイワ欧州好配当株マザーファンド**

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、パイオニア社に運用の指図にかかる権限を委託しております。

株式組入比率は、高位に維持しました。銘柄選定にあたって、パイオニア社では、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、景気回復局面で収益改善が見込まれる銘柄に選別投資しました。セクター別では金融セクターや生活必需品セクター、個別銘柄ではNESTLE (スイス、生活必需品)、NOVARTIS (スイス、ヘルスケア)、BRITISH AMERICAN TOBACCO (英国、生活必需品) などを高位で組み入れました。

○ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

オーストラリアや香港、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。国別では、雇用や住宅市場の底堅い推移から堅調な株価動向が見込まれたオーストラリアや、革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景にIT企業の好業績が見込まれた台湾を組入高位としました。個別銘柄では、製品の内製化による採算改善や高い配当利回りが見込まれたオーストラリアの包装資材銘柄や、ウェアラブル機器等の売上高増加が見込まれた台湾のIT銘柄を組入高位としました。

○ダイワ好配当日本株マザーファンド

企業の収益性・安定性などのファンダメンタルズやP E R（株価収益率）、P B R（株価純資産倍率）などの株価指標、株式需給やテクニカル要因等にも留意して投資しました。

株式組入比率（株式先物、Jリートを含む。）は、おおむね91～100%程度としました。

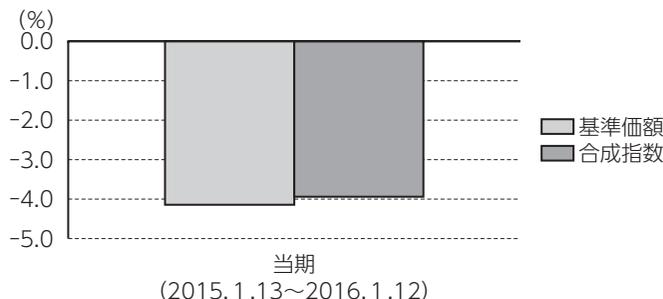
業種構成は、業績好調な銘柄やバリュエーション面から魅力的な銘柄などを買い付け、輸送用機器、情報・通信業、銀行業、サービス業などの組入比率を引き上げました。一方、大幅に上昇した銘柄や上値の重い銘柄などを売却し、化学、ゴム製品、機械、電気機器などの組入比率を引き下げました。期末では、卸売業、輸送用機器、情報・通信業、サービス業などを中心としたポートフォリオとしました。

個別銘柄では、業績面の懸念や上値の重さから東洋ゴム、加藤製作所などを売却しました。一方、業績見通しやバリュエーション指標、株主還元に対する経営姿勢などから日本電信電話や日産自動車などを買い付けました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）との騰落率の対比です。



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 | |
|---------------|---------------------------|--|
| | 2015年1月14日 ～2016年1月12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） | — | |
| 翌期繰越分配可能額（円） | 6,026 | |

（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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。

《今後の運用方針》

○当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行ないます。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の25%
 - ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） …純資産総額の25%
 - ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の15%
 - ・ダイワJーREITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の15%
 - ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の10%
- } …3ファンド合計で純資産総額の10%（*）
- *外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

○外国債券インデックスマザーファンド

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。

○ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

今後もベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ないます。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッドへの感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

○ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。

銘柄選択に際しては、良好な財務体質を有し、低コストでの資金調達により物件取得や事業拡大を図ることが可能であり、かつ保有不動産の価値と比較して価格が割安なリートを選択します。用途別では、米国では賃貸住宅への需要が旺盛なことにより住宅セクターや堅調な個人消費が見込めることから商業施設セクターに注目しています。英国では、貸倉庫の普及拡大が期待されることから貸倉庫を保有するリートに注目しています。ユーロ圏では、競争力の高い大型商業施設を保有するリートや事業環境の改善が期待される域内主要都市のオフィスを保有するリートに注目しています。

○ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

現状の個別銘柄間のバリュエーション格差は過去と比較して大きくないと判断していることから、ポートフォリオ戦略については、各種バリュエーション指標での割安度よりも、経営戦略や業績の変化等を重視した銘柄選別を継続していく方針です。また、賃料の上昇ペースが緩慢ではあるものの、相対的に景気に敏感なオフィス・セクターや、訪日観光客の増加などにより変動賃料の増加が期待できるホテル・セクターにも引き続き注目しています。

○ダイワ北米好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。普通株式については、今後もキャッシュフローおよび配当の成長が期待できる業種や銘柄に重点を置いたポートフォリオを継続します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

○ダイワ欧州好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア社に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、景気回復局面で収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

○ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

オーストラリアや香港、台湾、韓国を中心に市場分散に配慮したポートフォリオとする方針です。革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景として、市場予想を上回る業績が期待できる企業を選別して投資を行ないます。また、高い成長性を背景に今後株式市場での認知度の高まりが見込まれる中小型株に注目しています。

○ダイワ好配当日本株マザーファンド

世界経済の先行き不透明感などから、金融市場全般にリスク回避姿勢が強まっています。しかし、国内株式については、堅調な企業業績や企業の株主還元に対する意識の高まりなどから、中期的な上昇基調は継続すると考えています。株式組入比率（株式先物、Jリートを含む。）は90%程度以上の高位を維持する方針です。個別銘柄については、予想配当利回りが高い銘柄の中から、PERやPBRなどのバリュエーション指標や業績動向のほか、株主還元や資本効率の向上に対する経営姿勢などにも注目して選定してまいります。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------|-----------------------|---------|---|
| | (2015.1.14~2016.1.12) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 150円 | 0.969% | 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15,438円です。 |
| (投信会社) | (75) | (0.485) | 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) | (67) | (0.431) | 販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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) | (8) | (0.054) | 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 | 10 | 0.064 | 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 |
| (株式) | (5) | (0.030) | |
| (先物) | (0) | (0.001) | |
| (ハイブリッド 優先証券) | (0) | (0.002) | |
| (投資信託証券) | (5) | (0.031) | |
| 有価証券取引税 | 1 | 0.006 | 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 |
| (株式) | (0) | (0.003) | |
| (ハイブリッド 優先証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (1) | (0.004) | |
| その他費用 | 5 | 0.035 | 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) | (4) | (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 |
| (その他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 166 | 1.075 | |

(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

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------------|--------|---------|--------|--------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 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 | 35,404 | 101,271 | 7,024 | 20,206 |
| ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI) | 71,575 | 87,012 | 25,275 | 30,743 |
| ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド | 28,113 | 55,923 | 22,825 | 46,882 |
| ダイワ好配当日本株 マザーファンド | 15,539 | 38,050 | 10,215 | 25,865 |
| ダイワ北米好配当株 マザーファンド | 13,513 | 27,908 | 6,666 | 14,101 |
| ダイワ欧州好配当株 マザーファンド | 8,677 | 13,629 | 3,796 | 6,202 |
| ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド | 963 | 1,908 | 891 | 1,842 |
| ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド | 25,888 | 55,820 | 9,591 | 21,558 |

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|--------------------------|
| | ダイワ好配当日本株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 240,802,277千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 60,960,195千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 3.95 |
| | ダイワ北米好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 1,737,448千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,580,393千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.09 |
| | ダイワ欧州好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 536,436千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,575,752千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.34 |
| | ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 6,313,400千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,222,320千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 5.16 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の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。

(2) 外国債券インデックスマザーファンドにおける期中の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。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | | | |
|---------|-----------|------------------------|------|-----------|------------------------|------|
| 区 分 | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| | | | | | | |
| 公社債 | 5,191 | 625 | 12.0 | 5,319 | 653 | 12.3 |
| コール・ローン | 25,436 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合4.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(4) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおける期中の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。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | | | |
|---------|-----------|------------------------|------|-----------|------------------------|------|
| 区 分 | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| | | | | | | |
| 株式 | 98,469 | 46,798 | 47.5 | 142,333 | 61,706 | 43.4 |
| 株式先物取引 | 16,976 | 8,249 | 48.6 | 18,375 | 8,253 | 44.9 |
| 投資信託証券 | 2,297 | 976 | 42.5 | 3,824 | 1,677 | 43.9 |
| コール・ローン | 509,813 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合0.3%

(6) ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(7) ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(9) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 区 分 | 当 期 | | | 期 | | |
|---------|---------------|------------------------|-----------|---------------|------------------------|-----------|
| | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| 投資信託証券 | 百万円 37,831 | 百万円 13,223 | % 35.0 | 百万円 13,896 | 百万円 4,944 | % 35.6 |
| コール・ローン | 363,335 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合0.5%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 種 類 | 当 期 | | |
|--------|------------|----------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 期末保有額 |
| 投資信託証券 | 百万円 632 | 百万円 - | 百万円 2,000 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 種 類 | 当 期 | |
|--------|--------------------------------------|-----|
| | 買 付 額 | 付 額 |
| 株式 | ダイワ好配当日本株マザーファンド 百万円 1,263 | |
| 投資信託証券 | ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド 百万円 212 | |
| 投資信託証券 | 百万円 3,312 | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 1,509千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 571千円 |
| (B) / (A) | 37.9% |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み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。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、日の出証券、大和証券、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|-------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千口 188,911 | 千口 217,291 | 千円 597,486 | |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 454,082 | 500,383 | 618,524 | |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 173,366 | 178,655 | 346,769 | |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | 94,005 | 99,330 | 228,379 | |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | 72,477 | 79,324 | 156,474 | |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 38,694 | 43,575 | 60,600 | |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 5,771 | 5,842 | 10,109 | |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 150,269 | 166,566 | 350,738 | |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年1月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千円 597,486 | % 24.8 |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 618,524 | 25.7 |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 346,769 | 14.4 |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | 228,379 | 9.5 |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | 156,474 | 6.5 |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 60,600 | 2.5 |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 10,109 | 0.4 |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 350,738 | 14.6 |
| コール・ローン等、その他 | 35,921 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | 2,405,004 | 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、1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=117.80円、1カナダ・ドル=82.91円、1オーストラリア・ドル=82.46円、1香港ドル=15.18円、1シンガポール・ドル=82.10円、1ニュージーランド・ドル=77.29円、1台湾ドル=3.53円、1イギリス・ポンド=171.43円、1スイス・フラン=117.55円、1デンマーク・クローネ=17.14円、1ノルウェー・クローネ=13.20円、1スウェーデン・クローネ=13.79円、1メキシコ・ペソ=6.59円、100韓国ウォン=9.79円、1マレーシア・リンギット=26.83円、1南アフリカ・ランド=7.01円、1ポーランド・ズロチ=29.36円、1ユーロ=127.86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(156,338,501千円)の投資信託財産総額(157,914,698千円)に対する比率は、99.0%です。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(142,826,219千円)の投資信託財産総額(145,033,280千円)に対する比率は、98.5%です。

ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,913,260千円)の投資信託財産総額(1,936,508千円)に対する比率は、98.8%です。

ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,293,823千円)の投資信託財産総額(1,322,109千円)に対する比率は、97.9%です。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(978,964千円)の投資信託財産総額(1,024,300千円)に対する比率は、95.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年1月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--|-----------------------|
| (A) 資産 | 2,405,004,578円 |
| コール・ローン等 | 33,541,625 |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 597,486,674 |
| ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額) | 618,524,046 |
| ダイワ・グローバル R E I T ・ マザーファンド(評価額) | 346,769,488 |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額) | 228,379,627 |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額) | 156,474,836 |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額) | 60,600,240 |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド(評価額) | 10,109,444 |
| ダイワ J - R E I T アクティブ・ マザーファンド(評価額) | 350,738,598 |
| 未収入金 | 2,380,000 |
| (B) 負債 | 14,260,028 |
| 未払解約金 | 2,474,073 |
| 未払信託報酬 | 11,688,632 |
| その他未払費用 | 97,323 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 2,390,744,550 |
| 元本 | 1,612,119,584 |
| 次期繰越損益金 | 778,624,966 |
| (D) 受益権総口数 | 1,612,119,584口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 14,830円 |

*期首における元本額は1,457,399,074円、当期中における追加設定元本額は345,342,005円、同解約元本額は190,621,495円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は14,830円です。

■損益の状況

当期 自2015年1月14日 至2016年1月12日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|----------------------|
| (A) 配当等収益 | 16,921円 |
| 受取利息 | 16,921 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 78,985,094 |
| 売買益 | 13,094,900 |
| 売買損 | △ 92,079,994 |
| (C) 信託報酬等 | △ 22,932,067 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | △ 101,900,240 |
| (E) 前期繰越損益金 | 582,297,086 |
| (F) 追加信託差損益金 | 298,228,120 |
| (配当等相当額) | (389,325,640) |
| (売買損益相当額) | (△ 91,097,520) |
| (G) 合計(D + E + F) | 778,624,966 |
| 次期繰越損益金(G) | 778,624,966 |
| 追加信託差損益金 | 298,228,120 |
| (配当等相当額) | (389,325,640) |
| (売買損益相当額) | (△ 91,097,520) |
| 分配準備積立金 | 582,297,086 |
| 繰越損益金 | △ 101,900,240 |

(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17ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表を参照。

(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用: 2,668,650円(未監査)

■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 | 389,325,640 |
| (d) 分配準備積立金 | 582,297,086 |
| (e) 当期分配可能額(a + b + c + d) | 971,622,726 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配可能額(e - f) | 971,622,726 |
| (h) 受益権総口数 | 1,612,119,584口 |

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年1月13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13,744円です。」

★DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース)

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 合成指数 | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 | 公社債 組入比率 | 投資 信託証券 組入比率 | 純資 産額 |
|------------------|------------|-----------|------------|-----------|------------|------------|------------|-------------|--------------------|------------|
| | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (参考指数) | 期中 騰落率 | | | | | | |
| 6期末(2012年1月10日) | 円 8,062 | 円 0 | % △ 8.6 | 7,992 | % △ 8.8 | % 29.7 | % - | % 34.4 | % 32.3 | 百万円 860 |
| 7期末(2013年1月10日) | 10,192 | 0 | 26.4 | 10,263 | 28.4 | 29.9 | - | 34.4 | 32.7 | 1,272 |
| 8期末(2014年1月10日) | 13,193 | 0 | 29.4 | 13,280 | 29.4 | 29.1 | 0.3 | 34.6 | 32.8 | 1,919 |
| 9期末(2015年1月13日) | 15,976 | 0 | 21.1 | 16,057 | 20.9 | 27.5 | 0.3 | 35.0 | 34.1 | 2,724 |
| 10期末(2016年1月12日) | 15,254 | 0 | △ 4.5 | 15,416 | △ 4.0 | 26.6 | - | 36.5 | 32.9 | 2,855 |

(注1) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。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。

| 投資対象資産 | 指数 | 配分比率 |
|--------|---------------------------------|-------|
| 海外債券 | 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) | 16.7% |
| 国内債券 | NOMURA-BPI総合指数 | 16.7% |
| 海外リート | S&P先進国REIT指数 (除く日本) | 16.7% |
| 国内リート | 東証REIT指数 (配当込み) | 16.7% |
| 海外株式 | MSCIコクサイ指数 (グロス配当込み) | 16.7% |
| 国内株式 | TOPIX (配当込み) | 16.7% |

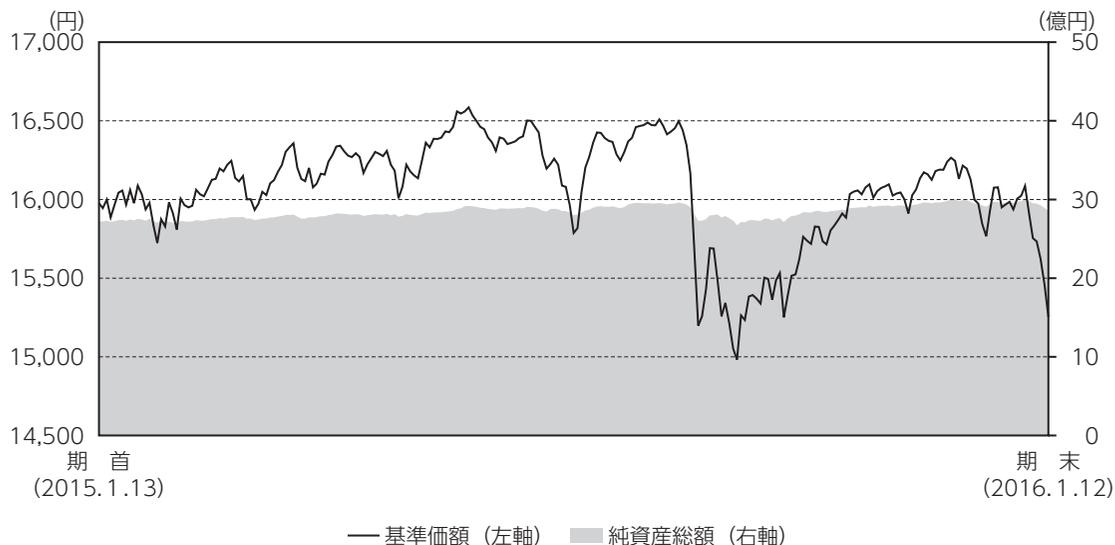
(注2) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注4) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

《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：15,976円
 期末：15,254円
 騰落率：△4.5%

■組入ファンドの当期中の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|----------------------------|--------|
| 外国債券インデックスマザーファンド | △4.6% |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) | 0.9% |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | △2.2% |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | △10.9% |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | △2.4% |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | △7.6% |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | △12.7% |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | △1.1% |

■基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、国内債券以外のマザーファンドの下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 合 成 指 数 | | 株 式 組 入 率 株 比 | 株 式 先 物 率 株 比 | 公 社 債 率 公 組 入 比 | 投 信 託 証 比 組 入 証 比 | 資 券 率 証 比 |
|------------------|-------------|--------|---------|--------|------------------|------------------|--------------------|----------------------|--------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | | | | |
| (期首)2015年 1 月13日 | 円 15,976 | % - | 16,057 | % - | % 27.5 | % 0.3 | % 35.0 | % 34.1 | |
| 1 月末 | 15,979 | 0.0 | 16,105 | 0.3 | 28.3 | 0.1 | 34.8 | 33.6 | |
| 2 月末 | 16,179 | 1.3 | 16,415 | 2.2 | 29.1 | 0.4 | 34.7 | 32.9 | |
| 3 月末 | 16,201 | 1.4 | 16,464 | 2.5 | 27.9 | 0.8 | 35.1 | 33.1 | |
| 4 月末 | 16,221 | 1.5 | 16,522 | 2.9 | 28.3 | 0.2 | 35.1 | 33.2 | |
| 5 月末 | 16,546 | 3.6 | 16,884 | 5.1 | 28.6 | 0.2 | 34.8 | 32.9 | |
| 6 月末 | 16,196 | 1.4 | 16,405 | 2.2 | 28.5 | 0.1 | 35.3 | 33.1 | |
| 7 月末 | 16,392 | 2.6 | 16,673 | 3.8 | 28.9 | - | 34.9 | 33.2 | |
| 8 月末 | 15,688 | △1.8 | 15,846 | △1.3 | 27.9 | 0.2 | 35.7 | 32.7 | |
| 9 月末 | 15,389 | △3.7 | 15,498 | △3.5 | 26.9 | 0.4 | 35.2 | 34.1 | |
| 10月末 | 16,096 | 0.8 | 16,372 | 2.0 | 28.3 | - | 34.7 | 33.7 | |
| 11月末 | 16,189 | 1.3 | 16,487 | 2.7 | 28.1 | - | 34.7 | 33.6 | |
| 12月末 | 16,086 | 0.7 | 16,345 | 1.8 | 27.7 | - | 34.9 | 33.4 | |
| (期末)2016年 1 月12日 | 15,254 | △4.5 | 15,416 | △4.0 | 26.6 | - | 36.5 | 32.9 | |

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

4～6ページをご参照ください。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行ないます。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の16.7%

} … 3ファンド合計で純資産総額の16.7%（*）

*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

- 外国債券インデックスマザーファンド
- ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）
- ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
- ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
- ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ダイワ好配当日本株マザーファンド

} 7～8ページをご参照ください。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行いました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行いました。

- | | |
|---------------------------------|------------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ ・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の16.7% (*) |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の16.7% |

* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

○外国債券インデックスマザーファンド

○ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

○ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

○ダイワ J - R E I T アクティブ ・マザーファンド

○ダイワ北米好配当株マザーファンド

○ダイワ欧州好配当株マザーファンド

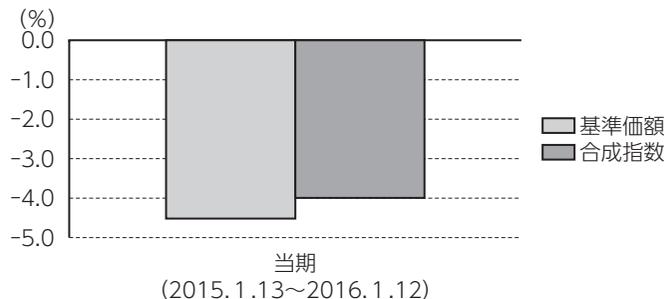
○ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

○ダイワ好配当日本株マザーファンド

8~10ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）との騰落率の対比です。



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 | |
|------------|---------------------------|-------|
| | 2015年1月14日 ～2016年1月12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) | — |
| 翌期繰越分配可能額 | (円) | 6,793 |

(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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。

《今後の運用方針》

○当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行ないます。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワJーR E I Tアクティブ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の16.7%
- … 3ファンド合計で純資産総額の16.7%（*）

*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

- 外国債券インデックスマザーファンド
- ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）
- ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド
- ダイワJーR E I Tアクティブ・マザーファンド
- ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ダイワ好配当日本株マザーファンド

11～12ページをご参照ください。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------|-----------------------|---------|---|
| | (2015.1.14~2016.1.12) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 182円 | 1.131% | 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16,063円です。 |
| (投信会社) | (92) | (0.571) | 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) | (81) | (0.506) | 販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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) | (9) | (0.054) | 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 | 15 | 0.090 | 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 |
| (株式) | (8) | (0.050) | |
| (先物) | (0) | (0.002) | |
| (ハイブリッド 優先証券) | (1) | (0.004) | |
| (投資信託証券) | (6) | (0.035) | |
| 有価証券取引税 | 1 | 0.009 | 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 |
| (株式) | (1) | (0.005) | |
| (ハイブリッド 優先証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (1) | (0.004) | |
| その他費用 | 7 | 0.043 | 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) | (6) | (0.034) | 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 |
| (その他) | (0) | (0.001) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 205 | 1.273 | |

(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

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------------|--------|---------|--------|--------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 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 | 38,057 | 108,846 | 16,376 | 46,630 |
| ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI) | 82,141 | 99,877 | 52,383 | 63,683 |
| ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド | 45,597 | 91,865 | 35,526 | 71,899 |
| ダイワ好配当日本株 マザーファンド | 31,297 | 77,208 | 21,486 | 54,171 |
| ダイワ北米好配当株 マザーファンド | 30,423 | 63,024 | 15,857 | 33,041 |
| ダイワ欧州好配当株 マザーファンド | 20,727 | 32,578 | 11,572 | 18,602 |
| ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド | 2,877 | 5,737 | 2,654 | 5,377 |
| ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド | 35,167 | 77,565 | 11,258 | 25,123 |

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------|--------------------------|
| | ダイワ好配当日本株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 240,802,277千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 60,960,195千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 3.95 |
| | ダイワ北米好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 1,737,448千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,580,393千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 1.09 |
| | ダイワ欧州好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 536,436千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,575,752千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.34 |
| | ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 6,313,400千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,222,320千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 5.16 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の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。

(2) 外国債券インデックスマザーファンドにおける期中の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。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | | | |
|---------|-----------|------------------------|-----|-----------|------------------------|-----|
| 区 分 | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| | | | | | | |
| コール・ローン | 25,436 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合3.2%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(4) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおける期中の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。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | | | |
|---------|-----------|------------------------|------|-----------|------------------------|------|
| 区 分 | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| | | | | | | |
| 株式先物取引 | 16,976 | 8,249 | 48.6 | 18,375 | 8,253 | 44.9 |
| 投資信託証券 | 2,297 | 976 | 42.5 | 3,824 | 1,677 | 43.9 |
| コール・ローン | 509,813 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合0.7%

(6) ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(7) ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(9) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 区 分 | 当 期 | | | | | |
|---------|---------------|------------------------|-----------|---------------|------------------------|-----------|
| | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| 投資信託証券 | 百万円 37,831 | 百万円 13,223 | % 35.0 | 百万円 13,896 | 百万円 4,944 | % 35.6 |
| コール・ローン | 363,335 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合0.7%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 種 類 | 当 期 | | |
|--------|------------|----------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 期末保有額 |
| 投資信託証券 | 百万円 632 | 百万円 - | 百万円 2,000 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 種 類 | 当 期 | |
|--------|--|-----|
| | 買 付 額 | 付 額 |
| 株式 | ダイワ好配当日本株マザーファンド 百万円 1,263 | |
| 投資信託証券 | 百万円 212 | |
| 投資信託証券 | ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド 百万円 3,312 | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 2,578千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 1,076千円 |
| (B) / (A) | 41.7% |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み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。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、日の出証券、大和証券、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|-------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千口 153,389 | 千口 175,070 | 千円 481,391 | |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 370,744 | 400,503 | 495,061 | |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 229,395 | 239,467 | 464,805 | |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | 190,610 | 200,420 | 460,807 | |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | 145,429 | 159,994 | 315,605 | |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 78,827 | 87,982 | 122,357 | |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 11,536 | 11,759 | 20,346 | |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 198,996 | 222,905 | 469,372 | |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年1月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千円 481,391 | % 16.8 |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 495,061 | 17.2 |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 464,805 | 16.2 |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | 460,807 | 16.0 |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | 315,605 | 11.0 |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 122,357 | 4.3 |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 20,346 | 0.7 |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 469,372 | 16.3 |
| コール・ローン等、その他 | 43,570 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 2,873,319 | 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、1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=117.80円、1カナダ・ドル=82.91円、1オーストラリア・ドル=82.46円、1香港ドル=15.18円、1シンガポール・ドル=82.10円、1ニュージーランド・ドル=77.29円、1台湾ドル=3.53円、1イギリス・ポンド=171.43円、1スイス・フラン=117.55円、1デンマーク・クローネ=17.14円、1ノルウェー・クローネ=13.20円、1スウェーデン・クローネ=13.79円、1メキシコ・ペソ=6.59円、100韓国ウォン=9.79円、1マレーシア・リンギット=26.83円、1南アフリカ・ランド=7.01円、1ポーランド・ズロチ=29.36円、1ユーロ=127.86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 (156,338,501千円) の投資信託財産総額 (157,914,698千円) に対する比率は、99.0%です。
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (142,826,219千円) の投資信託財産総額 (145,033,280千円) に対する比率は、98.5%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (1,913,260千円) の投資信託財産総額 (1,936,508千円) に対する比率は、98.8%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (1,293,823千円) の投資信託財産総額 (1,322,109千円) に対する比率は、97.9%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (978,964千円) の投資信託財産総額 (1,024,300千円) に対する比率は、95.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年1月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------------|-----------------------|
| (A) 資産 | 2,873,319,089円 |
| コール・ローン等 | 42,841,555 |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 481,391,824 |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)(評価額) | 495,061,815 |
| ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド(評価額) | 464,805,827 |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額) | 460,807,834 |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額) | 315,605,395 |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額) | 122,357,375 |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額) | 20,346,183 |
| ダイワ J-R E I T アクティブ・マザーファンド(評価額) | 469,372,281 |
| 未収入金 | 729,000 |
| (B) 負債 | 17,564,888 |
| 未払解約金 | 1,027,390 |
| 未払信託報酬 | 16,420,291 |
| その他未払費用 | 117,207 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 2,855,754,201 |
| 元本 | 1,872,177,277 |
| 次期繰越損益金 | 983,576,924 |
| (D) 受益権総口数 | 1,872,177,277口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 15,254円 |

*期首における元本額は1,705,347,049円、当期中における追加設定元本額は501,645,807円、同解約元本額は334,815,579円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は15,254円です。

■損益の状況

当期 自2015年1月14日 至2016年1月12日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------------------|
| (A) 配当等収益 | 21,549円 |
| 受取利息 | 21,549 |
| (B) 有価証券売買損益 | △106,600,971 |
| 売買益 | 20,398,876 |
| 売買損 | △126,999,847 |
| (C) 信託報酬等 | △ 32,398,641 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | △138,978,063 |
| (E) 前期繰越損益金 | 677,096,543 |
| (F) 追加信託差損益金 | 445,458,444 |
| (配当等相当額) | (594,772,126) |
| (売買損益相当額) | (△149,313,682) |
| (G) 合計(D + E + F) | 983,576,924 |
| 次期繰越損益金(G) | 983,576,924 |
| 追加信託差損益金 | 445,458,444 |
| (配当等相当額) | (594,772,126) |
| (売買損益相当額) | (△149,313,682) |
| 分配準備積立金 | 677,096,543 |
| 繰越損益金 | △138,978,063 |

(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せん。

(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28ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表を参照。

(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用:4,328,467円(未監査)

■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 | 594,772,126 |
| (d) 分配準備積立金 | 677,096,543 |
| (e) 当期分配可能額(a + b + c + d) | 1,271,868,669 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配可能額(e - f) | 1,271,868,669 |
| (h) 受益権総口数 | 1,872,177,277口 |

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年1月13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14,015円です。」

★DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 合成指数 | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 | 公社債 組入比率 | 投資 信託証券 組入比率 | 純資 産額 |
|------------------|--------|---|-------|--------|-------|------------|------------|-------------|--------------------|------------|
| | 円 | 円 | % | (参考指数) | % | | | | | |
| 6期末(2012年1月10日) | 7,304 | 0 | △11.3 | 7,088 | △12.1 | 44.6 | — | 13.0 | 38.7 | 百万円 636 |
| 7期末(2013年1月10日) | 9,581 | 0 | 31.2 | 9,484 | 33.8 | 44.9 | — | 13.0 | 39.0 | 997 |
| 8期末(2014年1月10日) | 13,144 | 0 | 37.2 | 12,990 | 37.0 | 43.6 | 0.5 | 13.0 | 39.6 | 1,528 |
| 9期末(2015年1月13日) | 16,365 | 0 | 24.5 | 16,043 | 23.5 | 41.3 | 0.4 | 13.5 | 41.2 | 2,263 |
| 10期末(2016年1月12日) | 15,507 | 0 | △5.2 | 15,343 | △4.4 | 40.4 | — | 14.5 | 40.3 | 2,808 |

(注1) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。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。

| 投資対象資産 | 指数 | 配分比率 |
|--------|---------------------------------|------|
| 海外債券 | 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) | 5% |
| 国内債券 | NOMURA-BPI総合指数 | 5% |
| 海外リート | S&P先進国REIT指数 (除く日本) | 20% |
| 国内リート | 東証REIT指数 (配当込み) | 20% |
| 海外株式 | MSCIコクサイ指数 (グロス配当込み) | 25% |
| 国内株式 | TOPIX (配当込み) | 25% |

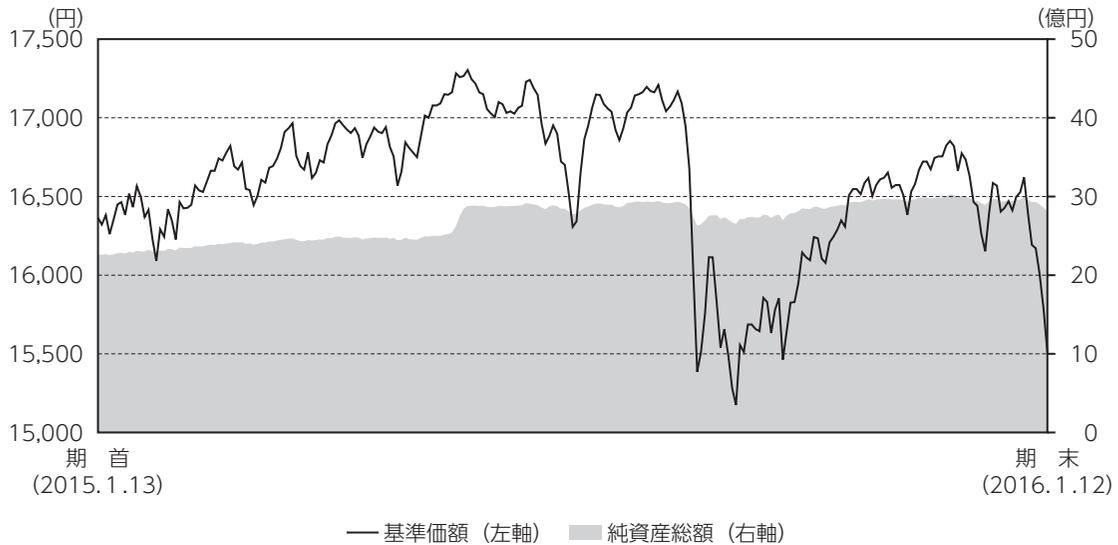
(注2) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注4) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

《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：16,365円
 期末：15,507円
 騰落率：△5.2%

■ 組入ファンドの当期中の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|----------------------------|--------|
| 外国債券インデックスマザーファンド | △4.6% |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) | 0.9% |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | △2.2% |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | △10.9% |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | △2.4% |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | △7.6% |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | △12.7% |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | △1.1% |

■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、国内債券以外のマザーファンドの下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース)

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 合 成 指 数 | | 株 式 組 入 率 株 比 | 株 式 先 物 率 株 比 | 公 社 債 率 公 組 入 比 | 投 信 託 証 比 組 入 証 比 | 資 券 率 証 比 |
|------------------|-------------|--------|---------|--------|------------------|------------------|--------------------|----------------------|--------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | | | | |
| (期首)2015年 1 月13日 | 円 16,365 | % - | 16,043 | % - | % 41.3 | % 0.4 | % 13.5 | % - | % 41.2 |
| 1 月末 | 16,415 | 0.3 | 16,176 | 0.8 | 42.7 | 0.2 | 13.5 | - | 40.1 |
| 2 月末 | 16,729 | 2.2 | 16,661 | 3.8 | 43.3 | 0.5 | 13.4 | - | 39.6 |
| 3 月末 | 16,780 | 2.5 | 16,753 | 4.4 | 41.7 | 1.1 | 13.5 | - | 40.1 |
| 4 月末 | 16,816 | 2.8 | 16,844 | 5.0 | 42.4 | 0.2 | 13.5 | - | 40.3 |
| 5 月末 | 17,259 | 5.5 | 17,326 | 8.0 | 42.6 | 0.2 | 13.4 | - | 39.9 |
| 6 月末 | 16,836 | 2.9 | 16,728 | 4.3 | 43.0 | 0.1 | 13.5 | - | 40.2 |
| 7 月末 | 17,065 | 4.3 | 17,049 | 6.3 | 43.0 | - | 13.4 | - | 40.1 |
| 8 月末 | 16,113 | △1.5 | 15,947 | △0.6 | 42.1 | 0.2 | 14.0 | - | 39.8 |
| 9 月末 | 15,643 | △4.4 | 15,413 | △3.9 | 40.4 | 0.6 | 14.0 | - | 41.1 |
| 10月末 | 16,617 | 1.5 | 16,603 | 3.5 | 42.2 | - | 13.4 | - | 40.7 |
| 11月末 | 16,755 | 2.4 | 16,767 | 4.5 | 42.1 | - | 13.6 | - | 40.4 |
| 12月末 | 16,621 | 1.6 | 16,584 | 3.4 | 41.4 | - | 13.6 | - | 40.3 |
| (期末)2016年 1 月12日 | 15,507 | △5.2 | 15,343 | △4.4 | 40.4 | - | 14.5 | - | 40.3 |

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

4～6ページをご参照ください。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめぐりに投資を行ないます。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の5%
- ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） …純資産総額の5%
- ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の20%
- ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の20%
- ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の25%

} …3ファンド合計で純資産総額の25%（*）

*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

- 外国債券インデックスマザーファンド
- ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）
- ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
- ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
- ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ダイワ好配当日本株マザーファンド

} 7～8ページをご参照ください。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行ないました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行ないました。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の5%
 - ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) …純資産総額の5%
 - ・ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド …純資産総額の20%
 - ・ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド …純資産総額の20%
 - ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の25%
- * 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

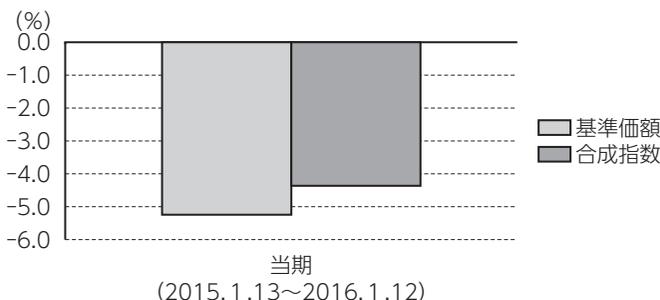
… 3 ファンド合計で純資産総額の25% (*)

- 外国債券インデックスマザーファンド
- ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)
- ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド
- ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド
- ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ダイワ好配当日本株マザーファンド

8~10ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数 (合成指数) との騰落率の対比です。



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（1万口当たり）

| 項 目 | 当 期 | |
|------------|---------------------------|-------|
| | 2015年1月14日 ～2016年1月12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) | — |
| 翌期繰越分配可能額 | (円) | 7,723 |

(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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。

《今後の運用方針》

○当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行ないます。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の5%
 - ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） …純資産総額の5%
 - ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の20%
 - ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の20%
 - ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の25%
- … 3ファンド合計で純資産総額の25%（*）

*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

- 外国債券インデックスマザーファンド
- ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）
- ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
- ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
- ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ダイワ好配当日本株マザーファンド

11～12ページをご参照ください。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------|-----------------------|---------|--|
| | (2015.1.14~2016.1.12) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 214円 | 1.292% | 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16,595円です。 |
| (投信会社) | (109) | (0.657) | 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) | (97) | (0.582) | 販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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) | (9) | (0.054) | 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 | 21 | 0.125 | 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 |
| (株式) | (12) | (0.074) | |
| (先物) | (1) | (0.003) | |
| (ハイブリッド 優先証券) | (1) | (0.006) | |
| (投資信託証券) | (7) | (0.042) | |
| 有価証券取引税 | 2 | 0.012 | 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 |
| (株式) | (1) | (0.007) | |
| (ハイブリッド 優先証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (1) | (0.005) | |
| その他費用 | 9 | 0.054 | 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) | (7) | (0.045) | 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 |
| (その他) | (0) | (0.001) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 246 | 1.483 | |

(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

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------------|--------|---------|--------|--------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 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 | 18,470 | 52,999 | 4,143 | 11,848 |
| ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI) | 39,405 | 47,784 | 11,393 | 13,843 |
| ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド | 80,621 | 164,233 | 22,725 | 46,559 |
| ダイワ好配当日本株 マザーファンド | 80,451 | 202,669 | 20,220 | 51,436 |
| ダイワ北米好配当株 マザーファンド | 76,402 | 160,787 | 17,858 | 37,753 |
| ダイワ欧州好配当株 マザーファンド | 40,635 | 65,997 | 7,991 | 13,056 |
| ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド | 5,340 | 11,238 | 2,075 | 4,370 |
| ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド | 78,863 | 177,467 | 10,971 | 24,574 |

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------|--------------------------|
| | ダイワ好配当日本株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 240,802,277千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 60,960,195千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 3.95 |
| | ダイワ北米好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 1,737,448千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,580,393千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 1.09 |
| | ダイワ欧州好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 536,436千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,575,752千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.34 |
| | ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 6,313,400千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,222,320千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 5.16 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の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。

(2) 外国債券インデックスマザーファンドにおける期中の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。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | | | |
|---------|-----------|------------------------|-----|-----------|------------------------|-----|
| 区 分 | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| | | | | | | |
| コール・ローン | 25,436 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合0.9%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(4) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおける期中の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。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | | | |
|---------|-----------|------------------------|------|-----------|------------------------|------|
| 区 分 | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| | | | | | | |
| 株式先物取引 | 16,976 | 8,249 | 48.6 | 18,375 | 8,253 | 44.9 |
| 投資信託証券 | 2,297 | 976 | 42.5 | 3,824 | 1,677 | 43.9 |
| コール・ローン | 509,813 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合1.0%

(6) ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(7) ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける期中の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。

(9) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 区 分 | 当 期 | | | 期 | | |
|---------|---------------|------------------------|-----------|---------------|------------------------|-----------|
| | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| 投資信託証券 | 百万円 37,831 | 百万円 13,223 | % 35.0 | 百万円 13,896 | 百万円 4,944 | % 35.6 |
| コール・ローン | 363,335 | - | - | - | - | - |

(注) 平均保有割合0.8%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 種 類 | 当 期 | | |
|--------|------------|----------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 期末保有額 |
| 投資信託証券 | 百万円 632 | 百万円 - | 百万円 2,000 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 種 類 | 当 期 | |
|--------|--------------|-----|
| | 買 付 額 | 付 額 |
| 株式 | 百万円 1,263 | |
| 投資信託証券 | 百万円 212 | |
| 投資信託証券 | 百万円 3,312 | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 3,401千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 1,484千円 |
| (B) / (A) | 43.7% |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み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。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、日の出証券、大和証券、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | | 当 期 末 | |
|---------------------------|--------------|--------------|---------------|-------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千口 38,305 | 千口 52,631 | 千円 144,721 | |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 92,470 | 120,482 | 148,928 | |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 228,531 | 286,427 | 555,956 | |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | 238,480 | 298,710 | 686,794 | |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | 180,873 | 239,416 | 472,272 | |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 98,845 | 131,489 | 182,862 | |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 14,421 | 17,687 | 30,602 | |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 198,375 | 266,266 | 560,677 | |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年1月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------------|----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千円 144,721 | % 5.1 |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 148,928 | 5.3 |
| ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | 555,956 | 19.7 |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド | 686,794 | 24.3 |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド | 472,272 | 16.7 |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド | 182,862 | 6.5 |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | 30,602 | 1.1 |
| ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | 560,677 | 19.8 |
| コール・ローン等、その他 | 46,007 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 2,828,824 | 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、1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=117.80円、1カナダ・ドル=82.91円、1オーストラリア・ドル=82.46円、1香港ドル=15.18円、1シンガポール・ドル=82.10円、1ニュージーランド・ドル=77.29円、1台湾ドル=3.53円、1イギリス・ポンド=171.43円、1スイス・フラン=117.55円、1デンマーク・クローネ=17.14円、1ノルウェー・クローネ=13.20円、1スウェーデン・クローネ=13.79円、1メキシコ・ペソ=6.59円、100韓国ウォン=9.79円、1マレーシア・リンギット=26.83円、1南アフリカ・ランド=7.01円、1ポーランド・ズロチ=29.36円、1ユーロ=127.86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(156,338,501千円)の投資信託財産総額(157,914,698千円)に対する比率は、99.0%です。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(142,826,219千円)の投資信託財産総額(145,033,280千円)に対する比率は、98.5%です。

ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,913,260千円)の投資信託財産総額(1,936,508千円)に対する比率は、98.8%です。

ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,293,823千円)の投資信託財産総額(1,322,109千円)に対する比率は、97.9%です。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(978,964千円)の投資信託財産総額(1,024,300千円)に対する比率は、95.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年1月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------------|-----------------------|
| (A) 資産 | 2,828,824,563円 |
| コール・ローン等 | 45,415,383 |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 144,721,630 |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)(評価額) | 148,928,397 |
| ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド(評価額) | 555,956,577 |
| ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額) | 686,794,829 |
| ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額) | 472,272,634 |
| ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額) | 182,862,899 |
| ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額) | 30,602,471 |
| ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド(評価額) | 560,677,743 |
| 未収入金 | 592,000 |
| (B) 負債 | 20,220,479 |
| 未払解約金 | 1,352,405 |
| 未払信託報酬 | 18,750,970 |
| その他未払費用 | 117,104 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 2,808,604,084 |
| 元本 | 1,811,193,142 |
| 次期繰越損益金 | 997,410,942 |
| (D) 受益権総口数 | 1,811,193,142口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 15,507円 |

* 期首における元本額は1,382,926,899円、当期中における追加設定元本額は698,613,794円、同解約元本額は270,347,551円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,507円です。

■損益の状況

当期 自2015年1月14日 至2016年1月12日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------------------|
| (A) 配当等収益 | 21,283円 |
| 受取利息 | 21,283 |
| (B) 有価証券売買損益 | △145,761,989 |
| 売買益 | 12,632,335 |
| 売買損 | △158,394,324 |
| (C) 信託報酬等 | △ 35,187,390 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | △180,928,096 |
| (E) 前期繰越損益金 | 641,229,216 |
| (F) 追加信託差損益金 | 537,109,822 |
| (配当等相当額) | (757,663,807) |
| (売買損益相当額) | (△220,553,985) |
| (G) 合計(D + E + F) | 997,410,942 |
| 次期繰越損益金(G) | 997,410,942 |
| 追加信託差損益金 | 537,109,822 |
| (配当等相当額) | (757,663,807) |
| (売買損益相当額) | (△220,553,985) |
| 分次準備積立金 | 641,229,216 |
| 繰越損益金 | △180,928,096 |

(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せん。

(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39ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表を参照。

(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用:5,580,376円(未監査)

■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 | 757,663,807 |
| (d) 分配準備積立金 | 641,229,216 |
| (e) 当期分配可能額(a + b + c + d) | 1,398,893,023 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配可能額(e - f) | 1,398,893,023 |
| (h) 受益権総口数 | 1,811,193,142口 |

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年1月13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14,084円です。」

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2015年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年1月12日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を40～55ページに併せて掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | | 付 | | | 売 | | | 付 | | |
|---|-------------------|---------|--|------------------|---------|---|-------------------|---------|---|-------------------|---------|
| 銘 | 柄 | 金額 | 銘 | 柄 | 金額 | 銘 | 柄 | 金額 | 銘 | 柄 | 金額 |
| | | 千円 | | | 千円 | | | 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) | 1% 2016/8/31 | 548,835 | 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) | 2% 2025/8/15 | 736,161 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.75% 2016/11/30 | 506,810 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.25% 2025/11/15 | 477,733 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.5% 2045/2/15 | 442,942 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 3% 2045/5/15 | 499,593 | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) | 3.25% 2016/4/25 | 493,360 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 1.25% 2020/1/31 | 470,680 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.875% 2045/8/15 | 430,088 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.25% 2025/11/15 | 477,733 | United Kingdom Gilt (イギリス) | 4% 2016/9/7 | 477,670 | 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) | 2.5% 2045/2/15 | 442,942 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 1.25% 2020/1/31 | 470,680 | 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) | 2.5% 2045/2/15 | 442,942 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.875% 2045/8/15 | 430,088 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.5% 2045/2/15 | 442,942 | 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) | 2.875% 2045/8/15 | 430,088 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.125% 2021/12/31 | 391,933 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.875% 2045/8/15 | 430,088 | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) | 5% 2016/10/25 | 399,418 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.125% 2021/12/31 | 391,933 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.125% 2021/12/31 | 391,933 |
| United Kingdom Gilt (イギリス) | 2% 2020/7/22 | 406,208 | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) | 2.5% 2016/7/25 | 396,266 | | | | | | |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) | 2.125% 2021/12/31 | 391,933 | | | | | | | | | |

(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。

■組入資産明細表

下記は、2016年1月12日現在における外国債券インデックスマザーファンド（57,391,929千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | | |
|--------------|------------------------|------------------------|------------------|-----------|---------------------|-------------------|-----------|----------|--|
| 区 分 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 | う ち B B 格 以下組入比率 | 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 554,843 | 千アメリカ・ドル 571,358 | 千円 67,306,046 | % 42.7 | % - | % 17.3 | % 16.5 | % 8.8 | |
| カナダ | 千カナダ・ドル 32,515 | 千カナダ・ドル 36,950 | 3,063,555 | 1.9 | - | 1.0 | 0.5 | 0.5 | |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 30,126 | 千オーストラリア・ドル 32,985 | 2,719,976 | 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 6,795 | 557,885 | 0.4 | - | 0.2 | 0.1 | 0.0 | |
| イギリス | 千イギリス・ポンド 62,375 | 千イギリス・ポンド 74,430 | 12,759,608 | 8.1 | - | 5.8 | 1.8 | 0.4 | |
| スイス | 千スイス・フラン 3,248 | 千スイス・フラン 3,876 | 455,722 | 0.3 | - | 0.1 | 0.1 | 0.1 | |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 44,617 | 千デンマーク・クローネ 56,502 | 968,453 | 0.6 | - | 0.4 | 0.1 | 0.1 | |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 29,462 | 千ノルウェー・クローネ 32,347 | 426,984 | 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 47,155 | 千スウェーデン・クローネ 53,966 | 744,204 | 0.5 | - | 0.3 | 0.2 | 0.0 | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 202,715 | 千メキシコ・ペソ 225,791 | 1,487,963 | 0.9 | - | 0.6 | 0.3 | 0.1 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | | |
|-----------------|------------------------|------------------------|---------------|----------|---------------------|-------------------|----------|----------|--|
| 区 分 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 | う ち B B 格 以下組入比率 | 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 | |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット 25,641 | 千マレーシア・リンギット 25,688 | 千円 689,230 | % 0.4 | % - | % 0.2 | % 0.2 | % 0.1 | |
| 南アフリカ | 千南アフリカ・ランド 96,678 | 千南アフリカ・ランド 83,529 | 585,541 | 0.4 | - | 0.3 | 0.0 | 0.0 | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 27,343 | 千ポーランド・ズロチ 29,576 | 868,376 | 0.6 | - | 0.2 | 0.2 | 0.1 | |
| ユーロ (アイルランド) | 千ユーロ 7,988 | 千ユーロ 9,507 | 1,215,642 | 0.8 | - | 0.4 | 0.4 | 0.0 | |
| ユーロ (オランダ) | 千ユーロ 26,057 | 千ユーロ 30,396 | 3,886,448 | 2.5 | - | 1.4 | 0.8 | 0.3 | |
| ユーロ (ベルギー) | 千ユーロ 24,841 | 千ユーロ 30,460 | 3,894,707 | 2.5 | - | 1.7 | 0.5 | 0.2 | |
| ユーロ (フランス) | 千ユーロ 97,445 | 千ユーロ 116,229 | 14,861,089 | 9.4 | - | 5.8 | 2.8 | 0.8 | |
| ユーロ (ドイツ) | 千ユーロ 77,054 | 千ユーロ 90,708 | 11,597,930 | 7.3 | - | 4.0 | 2.2 | 1.1 | |
| ユーロ (スペイン) | 千ユーロ 55,658 | 千ユーロ 65,446 | 8,367,960 | 5.3 | - | 3.1 | 1.6 | 0.6 | |
| ユーロ (イタリア) | 千ユーロ 98,230 | 千ユーロ 118,362 | 15,133,850 | 9.6 | - | 6.2 | 2.7 | 0.7 | |
| ユーロ (フィンランド) | 千ユーロ 6,389 | 千ユーロ 7,194 | 919,825 | 0.6 | - | 0.4 | 0.2 | 0.1 | |
| ユーロ (オーストリア) | 千ユーロ 15,457 | 千ユーロ 18,677 | 2,388,061 | 1.5 | - | 1.0 | 0.4 | 0.1 | |
| ユーロ (小計) | 409,119 | 486,981 | 62,265,516 | 39.5 | - | 24.0 | 11.7 | 3.9 | |
| 合 計 | - | - | 154,899,065 | 98.2 | - | 51.6 | 32.2 | 14.3 | |

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在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)

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|----------------------------------|------|-------------|-------------------|-------------------|---------------|------------|--|
| 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 | | |
| アメリカ | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | % 4.6250 | 千アメリカ・ドル 2,039 | 千アメリカ・ドル 2,123 | 千円 250,157 | 2017/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 1,795 | 1,882 | 221,765 | 2017/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.7500 | 2,401 | 2,547 | 300,105 | 2017/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,686 | 1,787 | 210,519 | 2017/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 3,839 | 4,035 | 475,424 | 2018/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.8750 | 2,960 | 3,156 | 371,826 | 2018/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.0000 | 3,173 | 3,412 | 401,958 | 2018/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 2,488 | 2,669 | 314,481 | 2018/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,161 | 3,308 | 389,788 | 2019/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 3,096 | 3,281 | 386,562 | 2019/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 2,621 | 2,830 | 333,429 | 2019/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.3750 | 4,020 | 4,318 | 508,698 | 2019/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.2500 | 189 | 193 | 22,797 | 2016/12/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 2,884 | 2,954 | 348,041 | 2017/01/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 4,280 | 4,648 | 547,649 | 2020/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,687 | 2,752 | 324,280 | 2017/02/28 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.2500 | 4,635 | 4,770 | 561,929 | 2017/03/31 | |

2016年1月12日現在

| 区 分 | 銘 | 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 | |
| | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,653 | 1,701 | 200,473 | 2017/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 3,073 | 3,328 | 392,074 | 2020/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 2,835 | 2,908 | 342,585 | 2017/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,468 | 3,549 | 418,118 | 2017/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,773 | 1,813 | 213,573 | 2017/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,854 | 2,989 | 352,194 | 2020/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,903 | 2,947 | 347,273 | 2017/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,831 | 2,875 | 338,777 | 2017/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,372 | 2,410 | 283,928 | 2017/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 4,509 | 4,724 | 556,554 | 2020/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 883 | 903 | 106,487 | 2017/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 924 | 955 | 112,592 | 2017/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 255 | 263 | 31,035 | 2018/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 4,076 | 4,470 | 526,665 | 2021/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 1,234 | 1,278 | 150,650 | 2018/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 1,300 | 1,351 | 159,234 | 2018/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 260 | 269 | 31,715 | 2018/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 3,417 | 3,669 | 432,236 | 2021/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,322 | 1,362 | 160,451 | 2018/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,065 | 1,098 | 129,416 | 2018/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 1,341 | 1,379 | 162,528 | 2018/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,534 | 2,590 | 305,102 | 2021/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,444 | 3,477 | 409,630 | 2018/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,835 | 2,852 | 335,996 | 2018/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 1,320 | 1,341 | 158,010 | 2018/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,353 | 1,370 | 161,474 | 2021/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,165 | 2,177 | 256,511 | 2018/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 207 | 207 | 24,414 | 2016/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,861 | 1,870 | 220,363 | 2018/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,970 | 2,973 | 350,261 | 2017/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,426 | 1,426 | 168,100 | 2019/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 3,224 | 3,263 | 384,397 | 2022/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,408 | 2,410 | 283,937 | 2017/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,843 | 1,850 | 217,995 | 2019/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 3,856 | 3,864 | 455,227 | 2017/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 300 | 302 | 35,596 | 2019/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,375 | 2,376 | 279,914 | 2017/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 559 | 558 | 65,762 | 2019/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,459 | 2,445 | 288,105 | 2022/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 3,485 | 3,473 | 409,165 | 2017/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,385 | 2,371 | 279,306 | 2019/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 3,906 | 3,898 | 459,280 | 2017/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,368 | 1,353 | 159,393 | 2019/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 5,660 | 5,626 | 662,814 | 2017/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,784 | 1,755 | 206,740 | 2019/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,543 | 2,505 | 295,116 | 2022/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 6,410 | 6,379 | 751,526 | 2017/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,872 | 1,847 | 217,643 | 2019/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 4,974 | 4,947 | 582,843 | 2017/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,215 | 2,183 | 257,206 | 2019/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,648 | 2,638 | 310,823 | 2017/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 884 | 879 | 103,606 | 2019/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,168 | 3,114 | 366,920 | 2022/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 2,336 | 2,321 | 273,469 | 2017/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,353 | 1,331 | 156,855 | 2019/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 1,913 | 1,904 | 224,382 | 2017/12/31 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|----------------------------------|---|------|--------|----------|-----------|-------------|------------|
| 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 | 1.1250 | 894 | 883 | 104,090 | 2019/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.8750 | 2,153 | 2,148 | 253,057 | 2018/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 1,366 | 1,362 | 160,448 | 2020/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 3,850 | 3,871 | 456,042 | 2023/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.7500 | 3,447 | 3,427 | 403,705 | 2018/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.2500 | 1,968 | 1,950 | 229,818 | 2020/02/29 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.7500 | 2,315 | 2,300 | 271,032 | 2018/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.1250 | 1,160 | 1,143 | 134,672 | 2020/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.7500 | 4,685 | 4,619 | 544,127 | 2023/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.6250 | 4,218 | 4,176 | 492,025 | 2018/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.1250 | 1,451 | 1,429 | 168,375 | 2020/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.0000 | 3,407 | 3,399 | 400,497 | 2018/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 2,461 | 2,445 | 288,137 | 2020/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 1,693 | 1,704 | 200,829 | 2018/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.8750 | 2,131 | 2,163 | 254,895 | 2020/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 2,827 | 2,883 | 339,681 | 2020/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 1,697 | 1,708 | 201,233 | 2018/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.5000 | 4,468 | 4,636 | 546,230 | 2023/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.1250 | 1,993 | 2,042 | 240,626 | 2020/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 1,885 | 1,922 | 226,458 | 2020/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.2500 | 3,611 | 3,618 | 426,269 | 2018/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.7500 | 2,345 | 2,363 | 278,376 | 2020/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.7500 | 3,821 | 4,031 | 474,870 | 2023/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.2500 | 2,638 | 2,643 | 311,362 | 2018/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 2,501 | 2,548 | 300,256 | 2020/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.5000 | 2,026 | 2,043 | 240,732 | 2018/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.3750 | 2,006 | 2,081 | 245,203 | 2020/12/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.7500 | 2,168 | 2,167 | 255,359 | 2017/01/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.7500 | 5,229 | 5,503 | 648,358 | 2024/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.5000 | 2,185 | 2,202 | 259,483 | 2019/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.1250 | 1,647 | 1,687 | 198,760 | 2021/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.6250 | 2,190 | 2,186 | 257,566 | 2017/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.5000 | 2,373 | 2,391 | 281,700 | 2019/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 1,734 | 1,765 | 207,966 | 2021/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.7500 | 1,182 | 1,181 | 139,157 | 2017/03/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.6250 | 2,383 | 2,409 | 283,808 | 2019/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.2500 | 2,821 | 2,905 | 342,256 | 2021/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.8750 | 1,485 | 1,485 | 175,048 | 2017/04/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.5000 | 5,412 | 5,586 | 658,100 | 2024/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.6250 | 2,975 | 3,006 | 354,204 | 2019/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.8750 | 2,237 | 2,237 | 263,610 | 2017/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.2500 | 2,407 | 2,478 | 291,960 | 2021/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.5000 | 2,241 | 2,254 | 265,629 | 2019/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 2,732 | 2,777 | 327,207 | 2021/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.8750 | 753 | 753 | 88,706 | 2017/06/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.6250 | 2,885 | 2,914 | 343,302 | 2019/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.1250 | 3,485 | 3,563 | 419,737 | 2021/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 8.7500 | 1,527 | 1,689 | 198,971 | 2017/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 8.8750 | 904 | 1,115 | 131,383 | 2019/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 8.1250 | 724 | 896 | 105,548 | 2019/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 8.7500 | 642 | 846 | 99,751 | 2020/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 8.0000 | 2,106 | 2,837 | 334,296 | 2021/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 6.2500 | 654 | 852 | 100,393 | 2023/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 6.0000 | 855 | 1,151 | 135,632 | 2026/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 6.5000 | 630 | 889 | 104,809 | 2026/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 6.1250 | 709 | 991 | 116,777 | 2027/11/15 |

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|-------------|------------|--|
| 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 | | |
| | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.5000 | 700 | 940 | 110,843 | 2028/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.2500 | 438 | 578 | 68,107 | 2028/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.2500 | 473 | 626 | 73,771 | 2029/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.2500 | 964 | 1,412 | 166,434 | 2030/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.3750 | 1,241 | 1,702 | 200,565 | 2031/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 1,926 | 2,500 | 294,539 | 2036/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.0000 | 547 | 757 | 89,244 | 2037/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 548 | 699 | 82,397 | 2038/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 1,019 | 1,322 | 155,786 | 2038/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 255 | 285 | 33,624 | 2039/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,121 | 1,401 | 165,118 | 2039/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.5000 | 760 | 984 | 115,931 | 2039/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 810 | 1,030 | 121,426 | 2039/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.6250 | 1,307 | 1,721 | 202,848 | 2040/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 1,478 | 1,881 | 221,599 | 2040/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.8750 | 1,591 | 1,881 | 221,623 | 2040/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.2500 | 1,677 | 2,097 | 247,121 | 2040/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.7500 | 1,754 | 2,357 | 277,719 | 2041/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4.3750 | 1,365 | 1,742 | 205,217 | 2041/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 1,367 | 1,588 | 187,148 | 2041/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,450 | 1,516 | 178,629 | 2041/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,870 | 1,953 | 230,146 | 2042/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,353 | 2,397 | 282,444 | 2042/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 1,731 | 1,675 | 197,364 | 2042/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,984 | 3,850 | 453,546 | 2042/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 2,026 | 2,102 | 247,712 | 2043/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,998 | 3,949 | 465,261 | 2043/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 3,314 | 3,779 | 445,195 | 2043/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 3,581 | 4,177 | 492,167 | 2043/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 3,617 | 4,119 | 485,231 | 2044/02/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.3750 | 2,993 | 3,251 | 382,985 | 2044/05/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,583 | 2,582 | 304,216 | 2017/07/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,326 | 3,358 | 395,595 | 2019/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,834 | 2,915 | 343,416 | 2021/07/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 5,662 | 5,784 | 681,363 | 2024/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 3,729 | 3,858 | 454,475 | 2044/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,818 | 1,816 | 214,034 | 2017/08/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 1,189 | 1,199 | 141,333 | 2019/08/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,301 | 1,319 | 155,460 | 2021/08/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,187 | 2,189 | 257,958 | 2017/09/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,404 | 3,449 | 406,408 | 2019/09/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,625 | 3,700 | 435,928 | 2021/09/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,466 | 1,464 | 172,472 | 2017/10/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,190 | 3,201 | 377,191 | 2019/10/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,163 | 2,191 | 258,124 | 2021/10/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,921 | 5,983 | 704,845 | 2024/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,227 | 3,254 | 383,436 | 2044/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,593 | 1,590 | 187,398 | 2017/11/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,886 | 2,904 | 342,095 | 2021/11/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 4,325 | 4,339 | 511,176 | 2019/11/30 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 717 | 717 | 84,525 | 2017/12/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,169 | 3,229 | 380,479 | 2021/12/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,204 | 2,221 | 261,638 | 2019/12/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 405 | 404 | 47,654 | 2016/12/31 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,547 | 1,543 | 181,830 | 2018/01/15 | |
| | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,963 | 3,932 | 463,190 | 2020/01/31 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|--------------------------------------|-------|------|--------|----------|-----------|-------------|------------|
| 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 | |
| | | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.5000 | 2,386 | 2,379 | 280,289 | 2017/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.5000 | 2,427 | 2,384 | 280,917 | 2022/01/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 6,275 | 6,202 | 730,701 | 2025/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.5000 | 3,763 | 3,417 | 402,623 | 2045/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.0000 | 1,961 | 1,960 | 230,941 | 2018/02/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 2,788 | 2,778 | 327,296 | 2020/02/29 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.5000 | 970 | 966 | 113,890 | 2017/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.7500 | 1,809 | 1,801 | 212,232 | 2022/02/28 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.0000 | 2,081 | 2,079 | 245,016 | 2018/03/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 2,792 | 2,779 | 327,483 | 2020/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.5000 | 2,159 | 2,150 | 253,356 | 2017/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.7500 | 2,083 | 2,068 | 243,718 | 2018/04/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.7500 | 2,891 | 2,876 | 338,908 | 2022/03/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.0000 | 2,180 | 2,176 | 256,390 | 2018/03/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.1250 | 5,788 | 5,777 | 680,544 | 2025/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 3.0000 | 4,035 | 4,064 | 478,811 | 2045/05/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 2,607 | 2,593 | 305,569 | 2020/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.7500 | 2,612 | 2,596 | 305,890 | 2022/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.5000 | 2,323 | 2,313 | 272,505 | 2017/04/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.8750 | 2,826 | 2,829 | 333,318 | 2022/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.5000 | 3,013 | 3,013 | 354,984 | 2020/05/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.1250 | 2,196 | 2,197 | 258,919 | 2018/06/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.6250 | 3,001 | 3,014 | 355,090 | 2020/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.6250 | 2,313 | 2,304 | 271,523 | 2017/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.1250 | 2,021 | 2,053 | 241,923 | 2022/06/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.8750 | 2,189 | 2,176 | 256,342 | 2018/07/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.6250 | 3,135 | 3,147 | 370,802 | 2020/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.6250 | 1,374 | 1,368 | 161,204 | 2017/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 2,179 | 2,196 | 258,749 | 2022/07/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 6,143 | 6,056 | 713,463 | 2025/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.8750 | 3,573 | 3,509 | 413,466 | 2045/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.0000 | 14 | 13 | 1,643 | 2018/08/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.8750 | 2,445 | 2,443 | 287,793 | 2022/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 2,868 | 2,847 | 335,471 | 2020/08/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.0000 | 2,179 | 2,171 | 255,751 | 2018/09/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.7500 | 2,472 | 2,449 | 288,493 | 2022/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 2,876 | 2,852 | 336,011 | 2020/09/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.8750 | 2,057 | 2,041 | 240,487 | 2018/10/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.2500 | 4,005 | 4,037 | 475,582 | 2025/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.3750 | 3,116 | 3,088 | 363,823 | 2020/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 3.0000 | 2,682 | 2,705 | 318,678 | 2045/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.8750 | 2,558 | 2,552 | 300,717 | 2022/10/31 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.2500 | 2,138 | 2,142 | 252,415 | 2018/11/15 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 0.8750 | 2,277 | 2,274 | 267,903 | 2017/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.6250 | 3,096 | 3,104 | 365,762 | 2020/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 2.0000 | 2,687 | 2,701 | 318,282 | 2022/11/30 |
| | United States Treasury Note/Bond | | 国債証券 | 1.2500 | 2,151 | 2,155 | 253,912 | 2018/12/15 |
| 通貨小計 | 銘 柄 数 額 | 232銘柄 | | | 554,843 | 571,358 | 67,306,046 | |
| カナダ | | | | | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | | |
| | Canada Government International Bond | | 国債証券 | 2.7500 | 285 | 345 | 28,630 | 2064/12/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 8.0000 | 386 | 646 | 53,636 | 2027/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.7500 | 983 | 1,458 | 120,885 | 2029/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.7500 | 1,017 | 1,589 | 131,765 | 2033/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.0000 | 1,386 | 2,090 | 173,363 | 2037/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.0000 | 1,747 | 1,833 | 152,038 | 2017/06/01 |

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|----------------------------|---|------|--------|-------------|-------------|-------------|------------|
| 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 | |
| | | | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.2500 | 969 | 1,057 | 87,657 | 2018/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.7500 | 1,524 | 1,691 | 140,238 | 2019/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.0000 | 1,413 | 1,943 | 161,121 | 2041/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.5000 | 1,476 | 1,662 | 137,799 | 2020/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.2500 | 956 | 1,080 | 89,618 | 2021/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.7500 | 1,351 | 1,501 | 124,516 | 2022/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.5000 | 1,491 | 1,959 | 162,435 | 2045/12/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.5000 | 1,327 | 1,343 | 111,393 | 2017/03/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.5000 | 780 | 793 | 65,829 | 2017/09/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.5000 | 1,625 | 1,672 | 138,648 | 2023/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.2500 | 1,265 | 1,287 | 106,777 | 2018/03/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.2500 | 1,021 | 1,043 | 86,521 | 2018/09/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.5000 | 1,105 | 1,219 | 101,089 | 2024/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.5000 | 1,463 | 1,479 | 122,697 | 2017/02/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.7500 | 853 | 887 | 73,583 | 2019/03/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.7500 | 827 | 863 | 71,596 | 2019/09/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.2500 | 975 | 987 | 81,902 | 2017/08/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.7500 | 653 | 751 | 62,331 | 2048/12/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.2500 | 1,047 | 1,133 | 93,998 | 2025/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.5000 | 829 | 860 | 71,372 | 2020/03/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.2500 | 98 | 99 | 8,267 | 2018/02/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 0.2500 | 1,018 | 1,016 | 84,243 | 2017/05/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 0.7500 | 649 | 652 | 54,085 | 2020/09/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.5000 | 505 | 508 | 42,120 | 2026/06/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 0.2500 | 1,128 | 1,125 | 93,280 | 2017/11/01 |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 0.7500 | 363 | 363 | 30,108 | 2021/03/01 |
| 通貨小計 | 銘 柄 数 金 額 | | 32銘柄 | | 32,515 | 36,950 | 3,063,555 | |
| オーストラリア | | | | | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 6.0000 | 1,737 | 1,811 | 149,384 | 2017/02/15 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.2500 | 2,506 | 2,756 | 227,298 | 2019/03/15 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.7500 | 2,050 | 2,412 | 198,899 | 2021/05/15 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.5000 | 2,459 | 2,701 | 222,760 | 2020/04/15 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.7500 | 1,882 | 2,262 | 186,528 | 2022/07/15 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.5000 | 2,063 | 2,206 | 181,907 | 2018/01/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.5000 | 1,918 | 2,298 | 189,563 | 2023/04/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.2500 | 1,385 | 1,431 | 118,043 | 2017/07/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.7500 | 1,882 | 2,229 | 183,811 | 2027/04/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.7500 | 2,173 | 2,192 | 180,798 | 2024/04/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.2500 | 964 | 992 | 81,801 | 2029/04/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.2500 | 2,148 | 2,244 | 185,103 | 2025/04/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.5000 | 958 | 1,130 | 93,242 | 2033/04/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.2500 | 671 | 694 | 57,231 | 2018/10/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.2500 | 1,956 | 2,215 | 182,724 | 2026/04/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.7500 | 1,029 | 1,055 | 87,040 | 2019/10/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.7500 | 763 | 816 | 67,347 | 2037/04/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.7500 | 354 | 327 | 27,012 | 2035/06/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.7500 | 826 | 810 | 66,798 | 2020/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.2500 | 402 | 396 | 32,679 | 2039/06/21 |
| 通貨小計 | 銘 柄 数 金 額 | | 20銘柄 | | 30,126 | 32,985 | 2,719,976 | |
| シンガポール | | | | | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 国債証券 | 4.0000 | 391 | 417 | 34,274 | 2018/09/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 国債証券 | 3.2500 | 696 | 733 | 60,227 | 2020/09/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 国債証券 | 3.5000 | 442 | 478 | 39,263 | 2027/03/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 国債証券 | 3.1250 | 438 | 458 | 37,649 | 2022/09/01 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|----------------------|------|--------|---------|------------|-------------|------------|------------|
| 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 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.5000 | 599 | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | 千円 | 2019/06/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 3.0000 | 768 | | 615 | 50,540 | 2024/09/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.3750 | 580 | | 797 | 65,480 | 2017/04/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.8750 | 279 | | 590 | 48,451 | 2030/09/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.2500 | 307 | | 281 | 23,142 | 2021/06/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 370 | | 307 | 25,242 | 2021/06/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 0.5000 | 272 | | 359 | 29,553 | 2042/04/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 151 | | 267 | 21,969 | 2018/04/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 3.3750 | 173 | | 154 | 12,645 | 2023/07/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.8750 | 435 | | 186 | 15,279 | 2033/09/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 1.6250 | 70 | | 440 | 36,142 | 2029/07/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.3750 | 224 | | 69 | 5,726 | 2019/10/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.0000 | 224 | | 221 | 18,214 | 2025/06/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 1.3750 | 190 | | 224 | 18,409 | 2020/07/01 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | | | | 190 | 15,672 | 2017/10/01 |
| 通貨小計 | 銘柄数額 | 18銘柄 | | | 6,609 | 6,795 | 557,885 | |
| イギリス | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.0000 | 2,380 | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 423,589 | 2020/07/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.0000 | 1,821 | | 2,470 | 318,573 | 2025/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.5000 | 875 | | 1,858 | 151,861 | 2021/01/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.5000 | 412 | | 885 | 72,324 | 2065/07/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 8.7500 | 595 | | 421 | 115,923 | 2017/08/25 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 8.0000 | 1,102 | | 676 | 256,169 | 2021/06/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 6.0000 | 949 | | 1,494 | 238,287 | 2028/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,840 | | 1,390 | 402,080 | 2032/06/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 5.0000 | 1,472 | | 2,345 | 324,111 | 2025/03/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,912 | | 1,890 | 422,959 | 2036/03/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.7500 | 1,457 | | 2,467 | 348,533 | 2038/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.7500 | 1,724 | | 2,033 | 340,970 | 2020/03/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,708 | | 1,988 | 430,741 | 2055/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,666 | | 2,512 | 392,103 | 2046/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,232 | | 2,287 | 263,622 | 2027/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 5.0000 | 1,604 | | 1,537 | 301,563 | 2018/03/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.5000 | 1,666 | | 1,759 | 395,502 | 2042/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.7500 | 1,650 | | 2,307 | 377,164 | 2030/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,773 | | 2,200 | 427,985 | 2049/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.5000 | 1,820 | | 2,496 | 348,413 | 2019/03/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,246 | | 2,032 | 279,497 | 2039/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.0000 | 1,391 | | 1,630 | 276,707 | 2022/03/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.5000 | 1,870 | | 2,473 | 424,087 | 2034/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,428 | | 1,574 | 269,943 | 2019/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.0000 | 1,144 | | 1,636 | 280,602 | 2060/01/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,795 | | 2,013 | 345,104 | 2020/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 4.2500 | 1,657 | | 2,185 | 374,674 | 2040/12/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,843 | | 2,095 | 359,198 | 2021/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 1,010 | | 1,024 | 175,585 | 2017/01/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.7500 | 1,182 | | 1,551 | 266,053 | 2052/07/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.0000 | 2,392 | | 2,411 | 413,382 | 2017/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 2,242 | | 2,287 | 392,109 | 2022/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.2500 | 2,091 | | 2,380 | 408,071 | 2044/01/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.2500 | 2,854 | | 2,893 | 496,110 | 2018/07/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.2500 | 2,167 | | 2,274 | 389,840 | 2023/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.5000 | 1,506 | | 1,990 | 341,305 | 2068/07/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 1.7500 | 1,781 | | 1,831 | 313,896 | 2019/07/22 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.7500 | 2,012 | | 2,185 | 374,683 | 2024/09/07 |
| | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 3.5000 | 1,106 | | 1,319 | 226,270 | 2045/01/22 |
| 通貨小計 | 銘柄数額 | 39銘柄 | | | 62,375 | 74,430 | 12,759,608 | |

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|---------------|---------------------------|--------|---------|--------|--------|------------|------------|--|
| 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 | | |
| スイス | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 420 | 552 | 64,943 | 2023/02/11 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 506 | 750 | 88,218 | 2028/04/08 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 968 | 1,038 | 122,077 | 2017/06/05 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 527 | 595 | 70,026 | 2019/05/12 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 457 | 517 | 60,880 | 2020/07/06 | |
| | SWISS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 370 | 421 | 49,576 | 2021/04/28 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 6銘柄 | | 3,248 | 3,876 | 455,722 | | |
| デンマーク | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.0000 | 1,864 | 2,893 | 49,587 | 2024/11/10 | |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 6,576 | 7,108 | 121,844 | 2017/11/15 | |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 11,932 | 19,186 | 328,859 | 2039/11/15 | |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 8,601 | 9,952 | 170,583 | 2019/11/15 | |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 6,150 | 7,135 | 122,297 | 2021/11/15 | |
| | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 5,846 | 6,276 | 107,584 | 2023/11/15 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 7銘柄 | | 44,617 | 56,502 | 968,453 | | |
| ノルウェー | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 5,755 | 6,035 | 79,662 | 2017/05/19 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 5,075 | 5,724 | 75,564 | 2019/05/22 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 6,698 | 7,689 | 101,495 | 2021/05/25 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 5,149 | 5,457 | 72,042 | 2023/05/24 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 4,095 | 4,656 | 61,459 | 2024/03/14 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,690 | 2,784 | 36,760 | 2025/03/13 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 6銘柄 | | 29,462 | 32,347 | 426,984 | | |
| スウェーデン | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.0000 | 6,055 | 7,484 | 103,210 | 2020/12/01 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 5,175 | 5,526 | 76,208 | 2017/08/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 9,460 | 10,812 | 149,104 | 2019/03/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 4,005 | 5,164 | 71,214 | 2039/03/30 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 7,555 | 9,002 | 124,144 | 2022/06/01 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 6,725 | 7,135 | 98,396 | 2023/11/13 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 4,760 | 5,465 | 75,364 | 2025/05/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 3,420 | 3,376 | 46,560 | 2026/11/12 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 8銘柄 | | 47,155 | 53,966 | 744,204 | | |
| メキシコ | Mexican Bonos | 国債証券 | 5.0000 | 8,802 | 8,769 | 57,788 | 2019/12/11 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 5.7500 | 2,298 | 2,224 | 14,662 | 2026/03/05 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.0000 | 8,233 | 9,299 | 61,284 | 2023/12/07 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 10.0000 | 21,119 | 26,957 | 177,648 | 2024/12/05 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.5000 | 8,568 | 9,385 | 61,852 | 2027/06/03 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 13,756 | 14,738 | 97,129 | 2017/12/14 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 10.0000 | 6,874 | 9,333 | 61,509 | 2036/11/20 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.5000 | 8,844 | 10,438 | 68,787 | 2029/05/31 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.5000 | 22,092 | 24,384 | 160,693 | 2018/12/13 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.5000 | 9,694 | 11,600 | 76,444 | 2038/11/18 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.0000 | 12,728 | 14,122 | 93,064 | 2020/06/11 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 6.5000 | 13,441 | 14,128 | 93,104 | 2021/06/10 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 17,015 | 18,919 | 124,681 | 2031/05/29 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 6.5000 | 14,299 | 14,924 | 98,352 | 2022/06/09 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 9,654 | 10,687 | 70,427 | 2042/11/13 | |
| Mexican Bonos | 国債証券 | 5.0000 | 9,290 | 9,453 | 62,299 | 2017/06/15 | | |
| Mexican Bonos | 国債証券 | 4.7500 | 13,133 | 13,244 | 87,278 | 2018/06/14 | | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|--------------------------|------|---------|--------------|--------------|-----------|------------|--|
| 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 | | |
| | | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 2,875 | 3,179 | 20,952 | 2034/11/23 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 18銘柄 | | 202,715 | 225,791 | 1,487,963 | | |
| マレーシア | | | | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | | | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.2400 | 1,210 | 1,235 | 33,136 | 2018/02/07 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 5.7340 | 1,417 | 1,521 | 40,834 | 2019/07/30 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8140 | 1,015 | 1,027 | 27,565 | 2017/02/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5020 | 573 | 520 | 13,955 | 2027/05/31 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 5.2480 | 738 | 783 | 21,011 | 2028/09/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.3780 | 1,603 | 1,650 | 44,277 | 2019/11/29 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0120 | 1,427 | 1,457 | 39,109 | 2017/09/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.4980 | 578 | 571 | 15,326 | 2030/04/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1600 | 1,916 | 1,944 | 52,177 | 2021/07/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.3920 | 1,514 | 1,510 | 40,537 | 2026/04/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5800 | 1,595 | 1,610 | 43,206 | 2018/09/28 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4180 | 875 | 842 | 22,595 | 2022/08/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8920 | 731 | 693 | 18,611 | 2027/03/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1270 | 618 | 579 | 15,561 | 2032/04/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.3140 | 399 | 403 | 10,822 | 2017/10/31 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4920 | 444 | 442 | 11,858 | 2020/03/31 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.2600 | 533 | 534 | 14,328 | 2018/03/01 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4800 | 401 | 385 | 10,339 | 2023/03/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8440 | 477 | 428 | 11,508 | 2033/04/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7330 | 586 | 541 | 14,524 | 2028/06/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8890 | 656 | 667 | 17,895 | 2020/07/31 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.9350 | 400 | 407 | 10,925 | 2043/09/30 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1810 | 1,057 | 1,051 | 28,203 | 2024/07/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.3940 | 340 | 342 | 9,193 | 2017/03/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0480 | 857 | 864 | 23,188 | 2021/09/30 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.6540 | 648 | 651 | 17,488 | 2019/10/31 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.9550 | 404 | 395 | 10,599 | 2025/09/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.6590 | 700 | 704 | 18,901 | 2020/10/15 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7950 | 1,161 | 1,143 | 30,675 | 2022/09/30 | |
| | MALYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7590 | 768 | 777 | 20,868 | 2019/03/15 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 30銘柄 | | 25,641 | 25,688 | 689,230 | | |
| 南アフリカ | | | | 千南アフリカ・ランド | 千南アフリカ・ランド | | | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.2500 | 5,462 | 5,450 | 38,210 | 2017/09/15 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.0000 | 4,178 | 4,086 | 28,646 | 2018/12/21 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.2500 | 5,768 | 5,406 | 37,899 | 2020/01/15 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 10.5000 | 13,703 | 14,453 | 101,321 | 2026/12/21 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.2500 | 7,612 | 5,087 | 35,663 | 2036/03/31 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.7500 | 7,086 | 6,344 | 44,475 | 2021/03/31 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.5000 | 9,804 | 6,511 | 45,646 | 2041/02/28 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.0000 | 8,999 | 6,884 | 48,257 | 2031/02/28 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.7500 | 2,839 | 2,580 | 18,087 | 2023/02/28 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.7500 | 8,752 | 7,492 | 52,519 | 2048/02/28 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.5000 | 6,321 | 5,374 | 37,674 | 2037/01/31 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.0000 | 3,801 | 3,222 | 22,588 | 2030/01/31 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.7500 | 4,244 | 3,623 | 25,398 | 2044/01/31 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.2500 | 4,943 | 4,201 | 29,454 | 2032/03/31 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.8750 | 3,166 | 2,809 | 19,697 | 2035/02/28 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 15銘柄 | | 96,678 | 83,529 | 585,541 | | |
| ポーランド | | | | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | | | |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 5.7500 | 2,309 | 2,760 | 81,045 | 2022/09/23 | |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 5.2500 | 2,029 | 2,163 | 63,529 | 2017/10/25 | |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 5.5000 | 1,912 | 2,164 | 63,551 | 2019/10/25 | |

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|-----------------------------|------|---------|--------|------------|------------|-------------|------------|
| 区 分 | 銘 | 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | % | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | 2017/07/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | — | 812 | 794 | 23,328 | 2020/04/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,476 | 1,441 | 42,310 | 2026/07/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 2.5000 | 601 | 569 | 16,706 | 2021/04/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,227 | 1,208 | 35,482 | 2029/04/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 5.7500 | 627 | 792 | 23,259 | 2020/10/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 5.2500 | 2,256 | 2,573 | 75,555 | 2021/10/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 5.7500 | 2,284 | 2,701 | 79,329 | 2017/04/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,177 | 1,228 | 36,059 | 2023/10/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.0000 | 3,083 | 3,351 | 98,405 | 2018/04/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,720 | 1,807 | 53,059 | 2019/07/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,099 | 2,150 | 63,137 | 2018/07/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,840 | 1,928 | 56,621 | 2025/07/25 |
| | Poland Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,891 | 1,941 | 56,992 | |
| 通貨小計 | 銘 柄 数 | 16銘柄 | | | 27,343 | 29,576 | 868,376 | |
| | 金 額 | | | | | | | |
| ユーロ (アイルランド) | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 4.5000 | 千ユーロ | 千ユーロ | 109,595 | 2018/10/18 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 4.4000 | 759 | 857 | 100,848 | 2019/10/18 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 5.9000 | 684 | 788 | 89,101 | 2025/03/13 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 5.4000 | 570 | 696 | 120,449 | 2017/10/18 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 5.0000 | 1,131 | 1,562 | 199,821 | 2024/03/18 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 5.5000 | 765 | 942 | 23,821 | 2023/03/20 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 3.9000 | 169 | 186 | 79,494 | 2020/04/18 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 3.4000 | 504 | 621 | 130,322 | 2030/05/15 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 2.4000 | 847 | 1,019 | 48,883 | 2022/03/15 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 0.8000 | 761 | 839 | 107,385 | 2045/02/18 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 2.0000 | 372 | 382 | 48,539 | 2020/04/18 |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 2.0000 | 391 | 379 | 157,376 | |
| | IRISH TREASURY | | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,035 | 1,230 | | |
| 国小計 | 銘 柄 数 | 12銘柄 | | | 7,988 | 9,507 | 1,215,642 | |
| | 金 額 | | | | | | | |
| ユーロ (オランダ) | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 7.5000 | 千ユーロ | 千ユーロ | 41,064 | 2023/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 5.5000 | 214 | 321 | 240,480 | 2037/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,239 | 1,880 | 157,070 | 2017/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,195 | 1,771 | 226,492 | 2018/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 3.7500 | 991 | 1,228 | 192,902 | 2021/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,405 | 1,508 | 296,665 | 2019/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 4.0000 | 2,093 | 2,320 | 197,674 | 2020/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,347 | 1,546 | 260,011 | 2021/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,146 | 1,330 | 219,757 | 2022/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,349 | 2,033 | 147,123 | 2017/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,463 | 1,718 | 194,930 | 2023/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 2.5000 | 1,465 | 1,508 | 170,122 | 2019/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,438 | 1,626 | 202,972 | 2020/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 2.5000 | 968 | 1,150 | 199,821 | 2022/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 1.2500 | 1,477 | 1,524 | 194,911 | 2017/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 1.7500 | 1,385 | 1,524 | 147,123 | 2018/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 1.2500 | 924 | 966 | 194,911 | 2023/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 0.5000 | 317 | 320 | 123,542 | 2019/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 2.7500 | 955 | 1,245 | 40,994 | 2017/04/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,620 | 1,817 | 159,294 | 2047/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,374 | 1,395 | 232,353 | 2024/07/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | — | 749 | 754 | 178,421 | 2020/01/15 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | | 国 債 証 券 | 0.2500 | 943 | 902 | 96,452 | 2018/04/15 |
| 国小計 | 銘 柄 数 | 22銘柄 | | | 26,057 | 30,396 | 3,886,448 | |
| | 金 額 | | | | | | | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|------------------------|-------------------------|------|--------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| 区 分 | 銘 | 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| ユーロ (ベルギー) | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 0.8000 | 1,399 | 千ユーロ | 千円 | 2025/06/22 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 1.0000 | 349 | 1,387 | 177,466 | 2031/06/22 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 1.9000 | 358 | 322 | 41,254 | 2038/06/22 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 5.5000 | 1,706 | 360 | 46,045 | 2028/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 5.5000 | 810 | 2,537 | 324,488 | 2017/09/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 5.0000 | 1,704 | 891 | 113,996 | 2035/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.0000 | 1,377 | 2,631 | 336,501 | 2022/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.0000 | 209 | 1,696 | 216,851 | 2017/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.0000 | 966 | 220 | 28,147 | 2018/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.0000 | 1,121 | 1,058 | 135,360 | 2019/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 3.7500 | 1,636 | 1,273 | 162,836 | 2020/09/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.2500 | 1,396 | 1,925 | 246,228 | 2041/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.2500 | 1,446 | 2,069 | 264,661 | 2021/09/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 3.5000 | 1,202 | 1,782 | 227,965 | 2017/06/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.5000 | 801 | 1,269 | 162,371 | 2026/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.2500 | 1,316 | 1,076 | 137,630 | 2022/09/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 4.0000 | 777 | 1,657 | 211,987 | 2032/03/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 3.0000 | 1,123 | 1,048 | 134,121 | 2019/09/28 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 2.2500 | 1,338 | 1,254 | 160,376 | 2023/06/22 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 1.2500 | 1,052 | 1,508 | 192,900 | 2018/06/22 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 3.7500 | 753 | 1,092 | 139,706 | 2045/06/22 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 2.6000 | 1,505 | 1,052 | 134,517 | 2024/06/22 |
| | Belgium Government Bond | | 国債証券 | 3.0000 | 497 | 1,739 | 222,454 | 2034/06/22 |
| 国小計 | 銘 柄 数 額 | 23銘柄 | | | 24,841 | 30,460 | 3,894,707 | |
| ユーロ (フランス) | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 8.5000 | 653 | 千ユーロ | 千円 | 2019/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 8.5000 | 1,285 | 866 | 110,790 | 2023/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 6.0000 | 2,225 | 2,033 | 260,022 | 2025/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.5000 | 2,623 | 3,312 | 423,563 | 2029/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.7500 | 2,507 | 3,978 | 508,676 | 2032/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.7500 | 2,209 | 4,080 | 521,715 | 2035/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.2500 | 3,075 | 3,337 | 426,745 | 2019/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.0000 | 1,721 | 3,523 | 450,477 | 2019/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.7500 | 3,230 | 2,609 | 333,593 | 2055/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.0000 | 2,222 | 3,853 | 492,706 | 2021/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.7500 | 3,288 | 3,141 | 401,732 | 2038/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.2500 | 3,397 | 3,462 | 442,735 | 2017/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.2500 | 3,148 | 4,366 | 558,275 | 2023/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.0000 | 2,931 | 3,407 | 435,661 | 2017/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.2500 | 2,467 | 3,220 | 411,738 | 2018/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.5000 | 2,484 | 2,777 | 355,083 | 2018/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.7500 | 3,263 | 3,815 | 487,840 | 2041/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.5000 | 3,590 | 3,740 | 478,286 | 2019/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.0000 | 1,017 | 4,134 | 528,613 | 2020/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.5000 | 3,146 | 1,559 | 199,446 | 2060/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.5000 | 3,113 | 3,932 | 502,833 | 2026/04/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.2500 | 3,550 | 3,479 | 444,895 | 2020/10/25 |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.0000 | 3,480 | 4,178 | 534,239 | 2021/10/25 |
| FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.7500 | 3,099 | 4,073 | 520,888 | 2022/04/25 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.2500 | 1,940 | 3,643 | 465,920 | 2027/10/25 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.0000 | 2,114 | 2,186 | 279,580 | 2022/10/25 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 3.2500 | 788 | 2,178 | 278,542 | 2018/05/25 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.7500 | 2,747 | 1,013 | 129,629 | 2045/05/25 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 1.0000 | 2,659 | 3,001 | 383,765 | 2023/05/25 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.2500 | 2,486 | 2,753 | 352,052 | 2018/11/25 | |
| FRENCH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 2.2500 | 2,486 | 2,811 | 359,464 | 2024/05/25 | |

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|--|
| 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 | | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,764 | 1,832 | 234,354 | 2019/05/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,787 | 3,184 | 407,178 | 2030/05/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,799 | 3,043 | 389,140 | 2024/11/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,322 | 2,374 | 303,663 | 2019/11/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,792 | 2,709 | 346,396 | 2025/05/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | - | 1,870 | 1,871 | 239,251 | 2020/05/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | - | 1,335 | 1,343 | 171,787 | 2018/02/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,099 | 1,107 | 141,622 | 2025/11/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 973 | 982 | 125,618 | 2020/11/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 602 | 602 | 77,031 | 2031/05/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 777 | 795 | 101,715 | 2017/02/25 | |
| | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,868 | 1,906 | 243,808 | 2017/07/25 | |
| 国小計 | 銘柄数 金 額 | 42銘柄 | | 97,445 | 116,229 | 14,861,089 | | |
| ユーロ (ドイツ) | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 774 | 1,139 | 145,650 | 2024/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000 | 1,067 | 1,753 | 224,249 | 2027/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.6250 | 1,362 | 2,122 | 271,426 | 2028/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,113 | 1,637 | 209,385 | 2028/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 951 | 1,623 | 207,619 | 2030/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,304 | 2,123 | 271,553 | 2031/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,775 | 2,835 | 362,591 | 2034/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,071 | 3,113 | 398,065 | 2037/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 1,242 | 1,294 | 165,516 | 2017/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,225 | 1,956 | 250,215 | 2039/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 2,099 | 2,243 | 286,813 | 2017/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,798 | 1,954 | 249,920 | 2018/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 2,211 | 2,465 | 315,180 | 2018/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,399 | 2,408 | 307,928 | 2040/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 2,682 | 3,009 | 384,856 | 2019/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 2,481 | 2,809 | 359,214 | 2019/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 2,075 | 2,362 | 302,123 | 2020/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 1,928 | 2,201 | 281,504 | 2020/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,374 | 1,964 | 251,227 | 2042/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,444 | 1,605 | 205,293 | 2020/09/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,333 | 2,634 | 336,906 | 2021/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,674 | 1,975 | 252,622 | 2021/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,415 | 1,597 | 204,268 | 2021/09/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,707 | 1,907 | 243,941 | 2022/01/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,222 | 2,459 | 314,475 | 2022/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,376 | 1,747 | 223,390 | 2044/07/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,644 | 1,795 | 229,532 | 2022/09/04 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,410 | 1,541 | 197,120 | 2023/02/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,817 | 1,988 | 254,199 | 2023/05/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,707 | 1,933 | 247,195 | 2023/08/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,291 | 1,440 | 184,190 | 2024/02/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,204 | 1,534 | 196,254 | 2046/08/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,705 | 1,867 | 238,807 | 2024/05/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,542 | 1,622 | 207,392 | 2024/08/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,994 | 1,998 | 255,569 | 2025/02/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,809 | 1,886 | 241,216 | 2025/08/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | - | 492 | 494 | 63,192 | 2017/03/10 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | - | 795 | 799 | 102,223 | 2017/06/16 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | - | 307 | 309 | 39,512 | 2017/09/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.0000 | 733 | 738 | 94,425 | 2017/12/15 | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,717 | 1,739 | 222,354 | 2017/02/24 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|-------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|------------|
| 区 分 | 銘 | 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 | | |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,848 | 千ユーロ | 千円 | 238,908 | 2017/04/07 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,811 | | | 235,178 | 2017/10/13 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 890 | | | 115,919 | 2018/02/23 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,392 | | | 180,513 | 2018/04/13 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,209 | | | 160,357 | 2018/10/12 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 1,674 | | | 222,920 | 2019/02/22 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,113 | | | 146,107 | 2019/04/12 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,151 | | | 150,011 | 2019/10/11 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | - | 1,731 | | | 223,220 | 2020/04/17 |
| | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 966 | | | 125,665 | 2020/10/16 |
| 国小計 | 銘数 金額 | 51銘柄 | | 77,054 | 千ユーロ | 千ユーロ | 11,597,930 | |
| ユーロ (スペイン) | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 2,108 | 千ユーロ | 千ユーロ | 385,032 | 2029/01/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,735 | | | 223,740 | 2017/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6000 | 1,745 | | | 221,252 | 2025/04/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 693 | | | 84,421 | 2030/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 12 | | | 1,538 | 2018/04/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.1500 | 1,642 | | | 216,456 | 2025/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.1500 | 609 | | | 79,531 | 2020/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 1,679 | | | 310,493 | 2032/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,654 | | | 229,416 | 2017/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2000 | 1,494 | | | 234,140 | 2037/01/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.8000 | 2,135 | | | 283,998 | 2017/01/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.9000 | 1,228 | | | 211,941 | 2040/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.1000 | 2,206 | | | 310,335 | 2018/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8000 | 1,777 | | | 283,895 | 2024/01/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6000 | 2,382 | | | 349,814 | 2019/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.3000 | 1,775 | | | 259,770 | 2019/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7000 | 1,173 | | | 197,338 | 2041/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,101 | | | 307,067 | 2020/04/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6500 | 1,789 | | | 286,800 | 2025/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8500 | 1,681 | | | 256,530 | 2020/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 2,515 | | | 399,133 | 2021/04/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.9000 | 1,265 | | | 223,096 | 2026/07/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.8500 | 1,978 | | | 324,403 | 2022/01/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 2,000 | | | 278,819 | 2018/01/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.4000 | 1,758 | | | 286,839 | 2023/01/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.4000 | 1,350 | | | 210,243 | 2023/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.1500 | 1,270 | | | 215,648 | 2028/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 1,564 | | | 219,860 | 2018/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.1500 | 1,049 | | | 189,455 | 2044/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.1000 | 1,488 | | | 195,442 | 2017/04/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,836 | | | 253,387 | 2019/04/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.8000 | 1,970 | | | 294,911 | 2024/04/30 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,097 | | | 291,808 | 2024/10/31 |
| | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4000 | 1,900 | | | 251,392 | 2020/01/31 |
| 国小計 | 銘数 金額 | 34銘柄 | | 55,658 | 千ユーロ | 千ユーロ | 8,367,960 | |
| ユーロ (イタリア) | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 9.0000 | 1,106 | 千ユーロ | 千ユーロ | 222,638 | 2023/11/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.2500 | 1,110 | | | 219,551 | 2026/11/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000 | 2,392 | | | 456,391 | 2027/11/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,814 | | | 252,179 | 2024/12/01 |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,743 | | | 226,303 | 2018/01/15 |

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|-----------------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|--|
| 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 | | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0500 | 1,445 | 1,483 | 189,642 | 2019/12/01 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,129 | 1,260 | 161,166 | 2046/09/01 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.3500 | 1,229 | 1,259 | 161,077 | 2022/04/15 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,687 | 1,691 | 216,217 | 2025/06/01 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6500 | 577 | 546 | 69,876 | 2032/03/01 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 128 | 128 | 16,452 | 2018/05/15 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7000 | 1,211 | 1,223 | 156,422 | 2020/05/01 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 357 | 370 | 47,414 | 2025/12/01 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4500 | 964 | 989 | 126,575 | 2022/09/15 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.3000 | 371 | 373 | 47,724 | 2018/10/15 | |
| | ITALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.6500 | 374 | 375 | 47,980 | 2020/11/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.2500 | 2,654 | 3,685 | 471,221 | 2029/11/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 6.0000 | 3,118 | 4,696 | 600,472 | 2031/05/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.7500 | 1,455 | 2,182 | 279,093 | 2033/02/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.2500 | 2,528 | 2,735 | 349,793 | 2017/08/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,074 | 2,333 | 298,316 | 2019/02/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 1,921 | 2,239 | 286,305 | 2020/02/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 1,908 | 2,675 | 342,066 | 2034/08/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 2,390 | 2,985 | 381,731 | 2037/02/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 2,734 | 3,178 | 406,346 | 2021/08/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 1,413 | 1,473 | 188,396 | 2017/02/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,480 | 2,708 | 346,303 | 2018/02/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 1,674 | 2,395 | 306,257 | 2039/08/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,953 | 2,453 | 313,706 | 2023/08/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,187 | 2,434 | 311,253 | 2018/08/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,708 | 3,073 | 392,953 | 2019/03/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,531 | 2,891 | 369,757 | 2019/09/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,118 | 2,755 | 352,282 | 2025/03/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 1,893 | 2,700 | 345,329 | 2040/09/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,560 | 2,964 | 379,038 | 2020/03/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 2,214 | 2,566 | 328,179 | 2020/09/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,070 | 2,633 | 336,684 | 2026/03/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 2,144 | 2,479 | 316,970 | 2021/03/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 2,281 | 2,778 | 355,260 | 2021/09/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,012 | 2,501 | 319,803 | 2022/03/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 928 | 985 | 126,040 | 2017/05/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.5000 | 1,657 | 2,132 | 272,603 | 2022/09/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,490 | 1,588 | 203,123 | 2017/06/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.5000 | 1,910 | 2,463 | 314,939 | 2022/11/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 1,295 | 1,377 | 176,092 | 2017/11/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,810 | 2,386 | 305,126 | 2028/09/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 1,594 | 1,967 | 251,508 | 2023/05/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 2,341 | 2,534 | 324,089 | 2018/06/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,348 | 1,905 | 243,646 | 2044/09/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,194 | 2,727 | 348,745 | 2024/03/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 2,111 | 2,317 | 296,299 | 2018/12/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 1,729 | 2,003 | 256,213 | 2021/05/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 2.5000 | 1,100 | 1,182 | 151,163 | 2019/05/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 1,901 | 2,258 | 288,798 | 2024/09/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 1,221 | 1,442 | 184,469 | 2030/03/01 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 1.1500 | 905 | 919 | 117,601 | 2017/05/15 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 2.1500 | 1,593 | 1,710 | 218,767 | 2021/12/15 | |
| | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 1.5000 | 446 | 465 | 59,482 | 2019/08/01 | |
| 国 小 計 | 銘 柄 数 額 | 58銘柄 | | | 98,230 | 118,362 | 15,133,850 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|-------------------------|-------------------------|---------|---------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| 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 | |
| ユーロ (フィンランド) | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 0.3750 | 232 | 236 | 30,202 | 2020/09/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 0.7500 | 248 | 228 | 29,210 | 2031/04/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 0.8750 | 279 | 279 | 35,785 | 2025/09/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.8750 | 474 | 507 | 64,943 | 2017/09/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.3750 | 447 | 518 | 66,243 | 2019/07/04 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.0000 | 667 | 863 | 110,439 | 2025/07/04 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.3750 | 632 | 725 | 92,702 | 2020/04/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.5000 | 459 | 541 | 69,286 | 2021/04/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.8750 | 163 | 167 | 21,445 | 2017/04/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 2.7500 | 389 | 464 | 59,426 | 2028/07/04 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.6250 | 612 | 666 | 85,217 | 2022/09/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.5000 | 446 | 480 | 61,449 | 2023/04/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 2.6250 | 387 | 482 | 61,751 | 2042/07/04 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.1250 | 425 | 441 | 56,413 | 2018/09/15 |
| | Finland Government Bond | | 国 債 証 券 | 2.0000 | 529 | 588 | 75,308 | 2024/04/15 |
| 国 小 計 | 銘 柄 数 額 | 15銘柄 | | | 6,389 | 7,194 | 919,825 | |
| ユーロ (オーストリア) | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 0.2500 | 347 | 352 | 45,046 | 2019/10/18 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.2000 | 462 | 477 | 61,067 | 2025/10/20 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 6.2500 | 985 | 1,548 | 198,021 | 2027/07/15 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.6500 | 1,066 | 1,173 | 150,009 | 2018/01/15 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.9000 | 1,248 | 1,471 | 188,092 | 2020/07/15 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,212 | 1,445 | 184,791 | 2021/09/15 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.1500 | 1,218 | 1,786 | 228,434 | 2037/03/15 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.3000 | 711 | 766 | 98,038 | 2017/09/15 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.3500 | 989 | 1,132 | 144,836 | 2019/03/15 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 4.8500 | 675 | 937 | 119,819 | 2026/03/15 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.2000 | 907 | 942 | 120,542 | 2017/02/20 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.6500 | 797 | 967 | 123,759 | 2022/04/20 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.4000 | 872 | 1,054 | 134,856 | 2022/11/22 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.8000 | 318 | 515 | 65,875 | 2062/01/26 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.9500 | 738 | 792 | 101,382 | 2019/06/18 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 3.1500 | 563 | 749 | 95,776 | 2044/06/20 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.7500 | 809 | 888 | 113,559 | 2023/10/20 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 2.4000 | 301 | 344 | 44,092 | 2034/05/23 |
| | Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.1500 | 307 | 319 | 40,827 | 2018/10/19 |
| Austria Government Bond | | 国 債 証 券 | 1.6500 | 932 | 1,010 | 129,232 | 2024/10/21 | |
| 国 小 計 | 銘 柄 数 額 | 20銘柄 | | | 15,457 | 18,677 | 2,388,061 | |
| 通貨小計 | 銘 柄 数 額 | 277銘柄 | | | 409,119 | 486,981 | 62,265,516 | |
| 合 計 | 銘 柄 数 額 | 724銘柄 | | | | | 154,899,065 | |

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在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。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の決算日（2015年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年1月12日）現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の組入資産の内容等を56～58ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の主要な売買銘柄
公 社 債

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | 付 | 売 | | 付 |
|-----|-----------------------|---------|------|------------------------|---------|
| 銘 | 柄 | 金 額 | 銘 | 柄 | 金 額 |
| | | 千円 | | | 千円 |
| 125 | 5年国債 0.1% 2020/9/20 | 290,854 | 349 | 2年国債 0.1% 2017/2/15 | 170,286 |
| 340 | 10年国債 0.4% 2025/9/20 | 277,676 | 122 | 5年国債 0.1% 2019/12/20 | 135,202 |
| 124 | 5年国債 0.1% 2020/6/20 | 205,221 | 344 | 2年国債 0.1% 2016/9/15 | 135,178 |
| 123 | 5年国債 0.1% 2020/3/20 | 195,042 | 117 | 5年国債 0.2% 2019/3/20 | 112,728 |
| 338 | 10年国債 0.4% 2025/3/20 | 175,597 | 307 | 10年国債 1.3% 2020/3/20 | 108,676 |
| 339 | 10年国債 0.4% 2025/6/20 | 174,164 | 123 | 5年国債 0.1% 2020/3/20 | 105,076 |
| 349 | 2年国債 0.1% 2017/2/15 | 170,261 | 378 | 東北電力 3.85% 2016/4/25 | 104,021 |
| 154 | 20年国債 1.2% 2035/9/20 | 148,495 | 293 | 大阪府公債 2.1% 2016/8/30 | 102,156 |
| 122 | 5年国債 0.1% 2019/12/20 | 126,155 | 18-2 | 北九州市債 1.79% 2016/12/20 | 101,816 |
| 337 | 10年国債 0.3% 2024/12/20 | 117,724 | 18-4 | 札幌市公債 1.8% 2016/9/20 | 101,803 |

(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。

■組入資産明細表

下記は、2016年1月12日現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）（11,936,951千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別、新株予約権付社債券（転換社債券）を除く）

| 2016年1月12日現在 | | | | | | | | |
|--------------|------------|------------|---------|-----------------|-------------------|---------|---------|---|
| 区 分 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちＢＢ格 以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | | |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 | |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 9,095,000 | 10,084,735 | 68.3 | — | 55.3 | 12.8 | 0.2 | |
| 地方債証券 | 1,710,800 | 1,768,440 | 12.0 | — | 2.1 | 5.6 | 4.2 | |
| 特殊債券(除く金融債券) | 1,250,000 | 1,289,433 | 8.7 | — | 0.7 | 4.9 | 3.1 | |
| 金融債券 | 100,000 | 100,270 | 0.7 | — | — | — | 0.7 | |
| 普通社債券 | 1,403,000 | 1,426,393 | 9.7 | — | 0.7 | 5.5 | 3.4 | |
| 合 計 | 13,558,800 | 14,669,272 | 99.4 | — | 58.8 | 28.9 | 11.7 | |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

(2) 国内 (邦貨建) 公社債 (銘柄別、新株予約権付社債券 (転換社債券) を除く)

| 2016年1月12日現在 | | | | | | |
|--------------|-----|-------|--------|---------|---------|------------|
| 区 分 | 銘 柄 | 年利率 | 額面金額 | 評 価 額 | 償還年月日 | |
| | | % | 千円 | 千円 | | |
| 国債証券 | 357 | 2年国債 | 0.1000 | 10,028 | 10,028 | 2017/10/15 |
| | 359 | 2年国債 | 0.1000 | 20,000 | 20,061 | 2017/12/15 |
| | 114 | 5年国債 | 0.3000 | 62,000 | 62,531 | 2018/09/20 |
| | 115 | 5年国債 | 0.2000 | 55,000 | 55,324 | 2018/09/20 |
| | 296 | 10年国債 | 1.5000 | 35,000 | 36,422 | 2018/09/20 |
| | 40 | 20年国債 | 2.3000 | 51,000 | 54,167 | 2018/09/20 |
| | 116 | 5年国債 | 0.2000 | 133,000 | 133,857 | 2018/12/20 |
| | 297 | 10年国債 | 1.4000 | 20,000 | 20,829 | 2018/12/20 |
| | 298 | 10年国債 | 1.3000 | 61,000 | 63,352 | 2018/12/20 |
| | 299 | 10年国債 | 1.3000 | 10,000 | 10,416 | 2019/03/20 |
| | 300 | 10年国債 | 1.5000 | 8,000 | 8,384 | 2019/03/20 |
| | 41 | 20年国債 | 1.5000 | 40,000 | 41,933 | 2019/03/20 |
| | 42 | 20年国債 | 2.6000 | 22,000 | 23,832 | 2019/03/20 |
| | 119 | 5年国債 | 0.1000 | 31,000 | 31,116 | 2019/06/20 |
| | 301 | 10年国債 | 1.5000 | 35,000 | 36,813 | 2019/06/20 |
| | 302 | 10年国債 | 1.4000 | 54,000 | 56,612 | 2019/06/20 |
| | 120 | 5年国債 | 0.2000 | 10,000 | 10,077 | 2019/09/20 |
| | 121 | 5年国債 | 0.1000 | 25,000 | 25,101 | 2019/09/20 |
| | 43 | 20年国債 | 2.9000 | 14,000 | 15,500 | 2019/09/20 |
| | 122 | 5年国債 | 0.1000 | 50,000 | 50,206 | 2019/12/20 |
| | 305 | 10年国債 | 1.3000 | 100,000 | 105,110 | 2019/12/20 |
| | 123 | 5年国債 | 0.1000 | 90,000 | 90,375 | 2020/03/20 |
| | 306 | 10年国債 | 1.4000 | 10,000 | 10,582 | 2020/03/20 |
| | 307 | 10年国債 | 1.3000 | 5,000 | 5,270 | 2020/03/20 |
| | 44 | 20年国債 | 2.5000 | 32,000 | 35,342 | 2020/03/20 |
| | 45 | 20年国債 | 2.4000 | 20,000 | 22,005 | 2020/03/20 |
| | 124 | 5年国債 | 0.1000 | 178,000 | 178,747 | 2020/06/20 |
| | 308 | 10年国債 | 1.3000 | 100,000 | 105,712 | 2020/06/20 |
| | 309 | 10年国債 | 1.1000 | 103,000 | 107,970 | 2020/06/20 |
| | 46 | 20年国債 | 2.2000 | 19,000 | 20,844 | 2020/06/22 |
| | 125 | 5年国債 | 0.1000 | 244,000 | 245,027 | 2020/09/20 |
| | 310 | 10年国債 | 1.0000 | 30,000 | 31,382 | 2020/09/20 |
| | 311 | 10年国債 | 0.8000 | 42,000 | 43,542 | 2020/09/20 |
| | 47 | 20年国債 | 2.2000 | 23,000 | 25,358 | 2020/09/21 |
| | 126 | 5年国債 | 0.1000 | 21,000 | 21,087 | 2020/12/20 |
| | 312 | 10年国債 | 1.2000 | 94,000 | 99,488 | 2020/12/20 |
| | 48 | 20年国債 | 2.5000 | 9,000 | 10,105 | 2020/12/21 |
| | 313 | 10年国債 | 1.3000 | 75,000 | 79,986 | 2021/03/20 |
| | 314 | 10年国債 | 1.1000 | 77,000 | 81,322 | 2021/03/20 |
| | 49 | 20年国債 | 2.1000 | 4,000 | 4,434 | 2021/03/22 |
| | 50 | 20年国債 | 1.9000 | 30,000 | 32,946 | 2021/03/22 |
| | 315 | 10年国債 | 1.2000 | 90,000 | 95,786 | 2021/06/20 |
| | 316 | 10年国債 | 1.1000 | 59,000 | 62,472 | 2021/06/20 |
| | 51 | 20年国債 | 2.0000 | 25,000 | 27,701 | 2021/06/21 |
| | 317 | 10年国債 | 1.1000 | 35,000 | 37,155 | 2021/09/20 |
| | 318 | 10年国債 | 1.0000 | 10,000 | 10,559 | 2021/09/20 |
| | 52 | 20年国債 | 2.1000 | 19,000 | 21,256 | 2021/09/21 |
| | 319 | 10年国債 | 1.1000 | 129,000 | 137,293 | 2021/12/20 |
| | 320 | 10年国債 | 1.0000 | 35,000 | 37,042 | 2021/12/20 |
| | 53 | 20年国債 | 2.1000 | 13,000 | 14,610 | 2021/12/20 |
| | 54 | 20年国債 | 2.2000 | 14,000 | 15,817 | 2021/12/20 |
| | 321 | 10年国債 | 1.0000 | 65,000 | 68,951 | 2022/03/20 |
| | 322 | 10年国債 | 0.9000 | 75,000 | 79,072 | 2022/03/20 |
| | 55 | 20年国債 | 2.0000 | 41,000 | 46,025 | 2022/03/21 |
| | 323 | 10年国債 | 0.9000 | 60,000 | 63,390 | 2022/06/20 |
| | 324 | 10年国債 | 0.8000 | 96,000 | 100,808 | 2022/06/20 |
| | 56 | 20年国債 | 2.0000 | 12,000 | 13,530 | 2022/06/20 |
| | 57 | 20年国債 | 1.9000 | 24,000 | 26,906 | 2022/06/20 |
| | 325 | 10年国債 | 0.8000 | 102,000 | 107,273 | 2022/09/20 |
| | 58 | 20年国債 | 1.9000 | 35,000 | 39,377 | 2022/09/20 |
| | 59 | 20年国債 | 1.7000 | 3,000 | 3,345 | 2022/12/20 |
| | 60 | 20年国債 | 1.4000 | 16,000 | 17,510 | 2022/12/20 |
| | 328 | 10年国債 | 0.6000 | 30,000 | 31,191 | 2023/03/20 |
| | 61 | 20年国債 | 1.0000 | 40,000 | 42,748 | 2023/03/20 |
| | 329 | 10年国債 | 0.8000 | 56,000 | 59,064 | 2023/06/20 |
| | 62 | 20年国債 | 0.8000 | 16,000 | 16,875 | 2023/06/20 |
| | 63 | 20年国債 | 1.8000 | 30,000 | 33,873 | 2023/06/20 |
| | 330 | 10年国債 | 0.8000 | 81,000 | 85,484 | 2023/09/20 |
| | 331 | 10年国債 | 0.6000 | 75,000 | 78,007 | 2023/09/20 |
| | 64 | 20年国債 | 1.9000 | 35,000 | 39,894 | 2023/09/20 |
| | 332 | 10年国債 | 0.6000 | 135,000 | 140,421 | 2023/12/20 |

| 2016年1月12日現在 | | | | | | |
|--------------|-----|-------|--------|---------|---------|------------|
| 区 分 | 銘 柄 | 年利率 | 額面金額 | 評 価 額 | 償還年月日 | |
| | | % | 千円 | 千円 | | |
| | 65 | 20年国債 | 1.9000 | 42,000 | 48,005 | 2023/12/20 |
| | 66 | 20年国債 | 1.8000 | 30,000 | 34,053 | 2023/12/20 |
| | 333 | 10年国債 | 0.6000 | 155,000 | 161,220 | 2024/03/20 |
| | 67 | 20年国債 | 1.9000 | 19,000 | 21,774 | 2024/03/20 |
| | 68 | 20年国債 | 2.2000 | 25,000 | 29,258 | 2024/03/20 |
| | 69 | 20年国債 | 2.1000 | 12,000 | 13,946 | 2024/03/20 |
| | 334 | 10年国債 | 0.6000 | 166,000 | 172,648 | 2024/06/20 |
| | 70 | 20年国債 | 2.4000 | 18,000 | 21,442 | 2024/06/20 |
| | 71 | 20年国債 | 2.2000 | 17,000 | 19,967 | 2024/06/20 |
| | 335 | 10年国債 | 0.5000 | 130,000 | 134,071 | 2024/09/20 |
| | 72 | 20年国債 | 2.1000 | 53,000 | 61,990 | 2024/09/20 |
| | 336 | 10年国債 | 0.5000 | 48,000 | 49,480 | 2024/12/20 |
| | 337 | 10年国債 | 0.3000 | 96,000 | 97,269 | 2024/12/20 |
| | 73 | 20年国債 | 2.0000 | 30,000 | 34,937 | 2024/12/20 |
| | 74 | 20年国債 | 2.1000 | 22,000 | 25,815 | 2024/12/20 |
| | 338 | 10年国債 | 0.4000 | 145,000 | 148,079 | 2025/03/20 |
| | 75 | 20年国債 | 2.1000 | 14,000 | 16,464 | 2025/03/20 |
| | 76 | 20年国債 | 1.9000 | 25,000 | 28,947 | 2025/03/20 |
| | 339 | 10年国債 | 0.4000 | 154,000 | 157,141 | 2025/06/20 |
| | 78 | 20年国債 | 1.9000 | 17,000 | 19,720 | 2025/06/20 |
| | 79 | 20年国債 | 2.0000 | 14,000 | 16,370 | 2025/06/20 |
| | 80 | 20年国債 | 2.1000 | 20,000 | 23,571 | 2025/06/20 |
| | 340 | 10年国債 | 0.4000 | 207,000 | 211,032 | 2025/09/20 |
| | 81 | 20年国債 | 2.0000 | 18,000 | 21,087 | 2025/09/20 |
| | 82 | 20年国債 | 2.1000 | 28,000 | 33,084 | 2025/09/20 |
| | 341 | 10年国債 | 0.3000 | 30,000 | 30,247 | 2025/12/20 |
| | 83 | 20年国債 | 2.1000 | 25,000 | 29,611 | 2025/12/20 |
| | 84 | 20年国債 | 2.0000 | 27,000 | 31,717 | 2025/12/20 |
| | 85 | 20年国債 | 2.1000 | 31,000 | 36,801 | 2026/03/20 |
| | 86 | 20年国債 | 2.3000 | 6,000 | 7,245 | 2026/03/20 |
| | 87 | 20年国債 | 2.2000 | 20,000 | 23,942 | 2026/03/20 |
| | 88 | 20年国債 | 2.3000 | 33,000 | 39,957 | 2026/06/20 |
| | 89 | 20年国債 | 2.2000 | 15,000 | 18,009 | 2026/06/20 |
| | 90 | 20年国債 | 2.2000 | 37,000 | 44,529 | 2026/09/20 |
| | 91 | 20年国債 | 2.3000 | 18,000 | 21,850 | 2026/09/20 |
| | 92 | 20年国債 | 2.1000 | 45,000 | 53,801 | 2026/12/20 |
| | 93 | 20年国債 | 2.0000 | 18,000 | 21,355 | 2027/03/20 |
| | 94 | 20年国債 | 2.1000 | 36,000 | 43,124 | 2027/03/20 |
| | 95 | 20年国債 | 2.3000 | 30,000 | 36,691 | 2027/06/20 |
| | 96 | 20年国債 | 2.1000 | 23,000 | 27,605 | 2027/06/20 |
| | 97 | 20年国債 | 2.2000 | 25,000 | 30,344 | 2027/09/20 |
| | 98 | 20年国債 | 2.1000 | 29,000 | 34,871 | 2027/09/20 |
| | 99 | 20年国債 | 2.1000 | 43,000 | 51,796 | 2027/12/20 |
| | 100 | 20年国債 | 2.2000 | 35,000 | 42,637 | 2028/03/20 |
| | 101 | 20年国債 | 2.4000 | 20,000 | 24,846 | 2028/03/20 |
| | 102 | 20年国債 | 2.4000 | 10,000 | 12,449 | 2028/06/20 |
| | 103 | 20年国債 | 2.3000 | 21,000 | 25,893 | 2028/06/20 |
| | 104 | 20年国債 | 2.1000 | 24,000 | 29,002 | 2028/06/20 |
| | 105 | 20年国債 | 2.1000 | 38,000 | 45,991 | 2028/09/20 |
| | 106 | 20年国債 | 2.2000 | 21,000 | 25,670 | 2028/09/20 |
| | 107 | 20年国債 | 2.1000 | 45,000 | 54,540 | 2028/12/20 |
| | 108 | 20年国債 | 1.9000 | 18,000 | 21,359 | 2028/12/20 |
| | 109 | 20年国債 | 1.9000 | 35,000 | 41,597 | 2029/03/20 |
| | 110 | 20年国債 | 2.1000 | 26,000 | 31,572 | 2029/03/20 |
| | 111 | 20年国債 | 2.2000 | 35,000 | 43,002 | 2029/06/20 |
| | 112 | 20年国債 | 2.1000 | 34,000 | 41,340 | 2029/06/20 |
| | 113 | 20年国債 | 2.1000 | 66,000 | 80,397 | 2029/09/20 |
| | 114 | 20年国債 | 2.1000 | 45,000 | 54,841 | 2029/12/20 |
| | 115 | 20年国債 | 2.2000 | 22,000 | 27,100 | 2029/12/20 |
| | 2 | 30年国債 | 2.4000 | 9,000 | 11,342 | 2030/02/20 |
| | 116 | 20年国債 | 2.2000 | 27,000 | 33,319 | 2030/03/20 |
| | 117 | 20年国債 | 2.1000 | 37,000 | 45,136 | 2030/03/20 |
| | 3 | 30年国債 | 2.3000 | 4,000 | 4,990 | 2030/05/20 |
| | 118 | 20年国債 | 2.0000 | 33,000 | 39,822 | 2030/06/20 |
| | 119 | 20年国債 | 1.8000 | 13,000 | 15,326 | 2030/06/20 |
| | 120 | 20年国債 | 1.6000 | 37,000 | 42,592 | 2030/06/20 |
| | 121 | 20年国債 | 1.9000 | 56,000 | 66,814 | 2030/09/20 |
| | 122 | 20年国債 | 1.8000 | 14,000 | 16,511 | 2030/09/20 |
| | 4 | 30年国債 | 2.9000 | 8,000 | 10,690 | 2030/11/20 |
| | 123 | 20年国債 | 2.1000 | 42,000 | 51,372 | 2030/12/20 |
| | 124 | 20年国債 | 2.0000 | 30,000 | 36,252 | 2030/12/20 |

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

| 2016年1月12日現在 | | | | | | |
|--------------|-----------|--------|--------|--------|------------|--|
| 区 分 | 銘 柄 | 年利率 | 額面金額 | 評 価 額 | 償還年月日 | |
| | | % | 千円 | 千円 | | |
| | 125 20年国債 | 2.2000 | 25,000 | 30,952 | 2031/03/20 | |
| | 126 20年国債 | 2.0000 | 21,000 | 25,390 | 2031/03/20 | |
| | 127 20年国債 | 1.9000 | 24,000 | 28,659 | 2031/03/20 | |
| | 5 30年国債 | 2.2000 | 8,000 | 9,909 | 2031/05/20 | |
| | 128 20年国債 | 1.9000 | 27,000 | 32,253 | 2031/06/20 | |
| | 129 20年国債 | 1.8000 | 28,000 | 33,024 | 2031/06/20 | |
| | 130 20年国債 | 1.8000 | 28,000 | 33,029 | 2031/09/20 | |
| | 131 20年国債 | 1.7000 | 40,000 | 46,573 | 2031/09/20 | |
| | 6 30年国債 | 2.4000 | 9,000 | 11,427 | 2031/11/20 | |
| | 132 20年国債 | 1.7000 | 25,000 | 29,083 | 2031/12/20 | |
| | 133 20年国債 | 1.8000 | 40,000 | 47,151 | 2031/12/20 | |
| | 134 20年国債 | 1.8000 | 25,000 | 29,467 | 2032/03/20 | |
| | 135 20年国債 | 1.7000 | 24,000 | 27,913 | 2032/03/20 | |
| | 136 20年国債 | 1.6000 | 20,000 | 22,949 | 2032/03/20 | |
| | 7 30年国債 | 2.3000 | 12,000 | 15,070 | 2032/05/20 | |
| | 137 20年国債 | 1.7000 | 18,000 | 20,914 | 2032/06/20 | |
| | 138 20年国債 | 1.5000 | 24,000 | 27,149 | 2032/06/20 | |
| | 139 20年国債 | 1.6000 | 30,000 | 34,409 | 2032/06/20 | |
| | 140 20年国債 | 1.7000 | 67,000 | 77,821 | 2032/09/20 | |
| | 8 30年国債 | 1.8000 | 5,000 | 5,886 | 2032/11/22 | |
| | 9 30年国債 | 1.4000 | 11,000 | 12,239 | 2032/12/20 | |
| | 141 20年国債 | 1.7000 | 48,000 | 55,729 | 2032/12/20 | |
| | 142 20年国債 | 1.8000 | 27,000 | 31,784 | 2032/12/20 | |
| | 10 30年国債 | 1.1000 | 15,000 | 15,932 | 2033/03/20 | |
| | 143 20年国債 | 1.6000 | 48,000 | 54,918 | 2033/03/20 | |
| | 144 20年国債 | 1.5000 | 14,000 | 15,790 | 2033/03/20 | |
| | 11 30年国債 | 1.7000 | 9,000 | 10,430 | 2033/06/20 | |
| | 145 20年国債 | 1.7000 | 72,000 | 83,443 | 2033/06/20 | |
| | 12 30年国債 | 2.1000 | 11,000 | 13,465 | 2033/09/20 | |
| | 146 20年国債 | 1.7000 | 67,000 | 77,541 | 2033/09/20 | |
| | 13 30年国債 | 2.0000 | 11,000 | 13,267 | 2033/12/20 | |
| | 147 20年国債 | 1.6000 | 73,000 | 83,135 | 2033/12/20 | |
| | 14 30年国債 | 2.4000 | 22,000 | 28,008 | 2034/03/20 | |
| | 148 20年国債 | 1.5000 | 64,000 | 71,678 | 2034/03/20 | |
| | 15 30年国債 | 2.5000 | 21,000 | 27,082 | 2034/06/20 | |
| | 149 20年国債 | 1.5000 | 60,000 | 67,068 | 2034/06/20 | |
| | 16 30年国債 | 2.5000 | 17,000 | 21,910 | 2034/09/20 | |
| | 150 20年国債 | 1.4000 | 73,000 | 80,183 | 2034/09/20 | |
| | 17 30年国債 | 2.4000 | 17,000 | 21,614 | 2034/12/20 | |
| | 151 20年国債 | 1.2000 | 65,000 | 68,991 | 2034/12/20 | |
| | 18 30年国債 | 2.3000 | 20,000 | 25,050 | 2035/03/20 | |
| | 152 20年国債 | 1.2000 | 61,000 | 64,573 | 2035/03/20 | |
| | 19 30年国債 | 2.3000 | 15,000 | 18,767 | 2035/06/20 | |
| | 153 20年国債 | 1.3000 | 69,000 | 74,054 | 2035/06/20 | |
| | 20 30年国債 | 2.5000 | 16,000 | 20,590 | 2035/09/20 | |
| | 154 20年国債 | 1.2000 | 91,000 | 95,804 | 2035/09/20 | |
| | 21 30年国債 | 2.3000 | 16,000 | 20,005 | 2035/12/20 | |
| | 155 20年国債 | 1.0000 | 13,000 | 13,175 | 2035/12/20 | |
| | 22 30年国債 | 2.5000 | 17,000 | 21,868 | 2036/03/20 | |
| | 23 30年国債 | 2.5000 | 20,000 | 25,744 | 2036/06/20 | |
| | 24 30年国債 | 2.5000 | 15,000 | 19,319 | 2036/09/20 | |
| | 25 30年国債 | 2.3000 | 17,000 | 21,266 | 2036/12/20 | |
| | 26 30年国債 | 2.4000 | 32,000 | 40,682 | 2037/03/20 | |
| | 27 30年国債 | 2.5000 | 31,000 | 40,070 | 2037/09/20 | |
| | 28 30年国債 | 2.5000 | 35,000 | 45,311 | 2038/03/20 | |
| | 29 30年国債 | 2.4000 | 34,000 | 43,442 | 2038/09/20 | |
| | 30 30年国債 | 2.3000 | 40,000 | 50,400 | 2039/03/20 | |
| | 31 30年国債 | 2.2000 | 38,000 | 47,137 | 2039/09/20 | |
| | 32 30年国債 | 2.3000 | 47,000 | 59,358 | 2040/03/20 | |
| | 33 30年国債 | 2.0000 | 57,000 | 68,350 | 2040/09/20 | |
| | 34 30年国債 | 2.2000 | 50,000 | 62,193 | 2041/03/20 | |
| | 35 30年国債 | 2.0000 | 53,000 | 63,570 | 2041/09/20 | |
| | 36 30年国債 | 2.0000 | 53,000 | 63,600 | 2042/03/20 | |
| | 37 30年国債 | 1.9000 | 59,000 | 69,379 | 2042/09/20 | |
| | 38 30年国債 | 1.8000 | 35,000 | 40,294 | 2043/03/20 | |
| | 39 30年国債 | 1.9000 | 36,000 | 42,291 | 2043/06/20 | |
| | 40 30年国債 | 1.8000 | 31,000 | 35,680 | 2043/09/20 | |
| | 41 30年国債 | 1.7000 | 27,000 | 30,428 | 2043/12/20 | |
| | 42 30年国債 | 1.7000 | 33,000 | 37,179 | 2044/03/20 | |
| | 43 30年国債 | 1.7000 | 37,000 | 41,672 | 2044/06/20 | |
| | 44 30年国債 | 1.7000 | 35,000 | 39,406 | 2044/09/20 | |
| | 45 30年国債 | 1.5000 | 38,000 | 40,887 | 2044/12/20 | |
| | 46 30年国債 | 1.5000 | 40,000 | 43,011 | 2045/03/20 | |

| 2016年1月12日現在 | | | | | | |
|-----------------|---------------|--------|------------|------------|------------|--|
| 区 分 | 銘 柄 | 年利率 | 額面金額 | 評 価 額 | 償還年月日 | |
| | | % | 千円 | 千円 | | |
| | 47 30年国債 | 1.6000 | 44,000 | 48,406 | 2045/06/20 | |
| | 48 30年国債 | 1.4000 | 65,000 | 68,218 | 2045/09/20 | |
| | 49 30年国債 | 1.4000 | 10,000 | 10,486 | 2045/12/20 | |
| | 1 40年国債 | 2.4000 | 24,000 | 31,414 | 2048/03/20 | |
| | 2 40年国債 | 2.2000 | 23,000 | 28,938 | 2049/03/20 | |
| | 3 40年国債 | 2.2000 | 19,000 | 23,923 | 2050/03/20 | |
| | 4 40年国債 | 2.2000 | 30,000 | 37,842 | 2051/03/20 | |
| | 5 40年国債 | 2.0000 | 35,000 | 42,169 | 2052/03/20 | |
| | 6 40年国債 | 1.9000 | 19,000 | 22,332 | 2053/03/20 | |
| | 7 40年国債 | 1.7000 | 31,000 | 34,560 | 2054/03/20 | |
| | 8 40年国債 | 1.4000 | 30,000 | 30,659 | 2055/03/20 | |
| 種別 | 銘柄数 | | 226銘柄 | | | |
| 小計 | 金額 | | 9,095,000 | 10,084,735 | | |
| 地方債証券 | | | | | | |
| | 47 共同発行地方 | 1.8000 | 100,000 | 101,927 | 2017/02/24 | |
| | 19-1 広島県公債 | 1.7800 | 110,800 | 113,364 | 2017/05/25 | |
| | 648 東京都公債 | 1.8400 | 100,000 | 102,531 | 2017/06/20 | |
| | 19-2 静岡県公債 | 1.9300 | 100,000 | 102,690 | 2017/06/28 | |
| | 24-7 福岡県5年 | 0.1900 | 100,000 | 100,209 | 2017/11/27 | |
| | 653 東京都公債 | 1.5400 | 100,000 | 102,845 | 2017/12/20 | |
| | 24-6 京都市5年 | 0.1370 | 100,000 | 100,121 | 2018/03/28 | |
| | 20-1 千葉県公債 | 1.5500 | 100,000 | 103,355 | 2018/04/25 | |
| | 660 東京都公債 | 1.5800 | 100,000 | 103,666 | 2018/06/20 | |
| | 20-6 北海道公債 | 1.7200 | 100,000 | 104,237 | 2018/08/29 | |
| | 21-2 埼玉県公債 | 1.5700 | 100,000 | 105,003 | 2019/05/27 | |
| | 76 共同発行地方 | 1.4000 | 100,000 | 104,655 | 2019/07/25 | |
| | 21-6 大阪府公債 | 1.5700 | 100,000 | 105,731 | 2019/11/25 | |
| | 21-35 兵庫県公債 | 1.4600 | 100,000 | 105,447 | 2020/01/22 | |
| | 116 共同発行地方 | 0.8000 | 100,000 | 104,484 | 2022/11/25 | |
| | 117 共同発行地方 | 0.7200 | 100,000 | 103,964 | 2022/12/22 | |
| | 24-16 愛知県公債 | 0.7570 | 100,000 | 104,203 | 2023/01/31 | |
| 種別 | 銘柄数 | | 17銘柄 | | | |
| 小計 | 金額 | | 1,710,800 | 1,768,440 | | |
| 特殊債券 (除く金融債) | | | | | | |
| | 16 政保政策投資B | 1.8000 | 100,000 | 101,956 | 2017/02/28 | |
| | 27 政保道路機構 | 1.8000 | 50,000 | 50,978 | 2017/02/28 | |
| | 27 国際協力銀行 | 1.7700 | 100,000 | 101,958 | 2017/03/17 | |
| | 26 公営企業 | 1.7800 | 100,000 | 102,007 | 2017/03/24 | |
| | 28 公営企業 | 1.8900 | 100,000 | 103,190 | 2017/10/25 | |
| | 3 政保地方公共6年 | 0.4000 | 100,000 | 100,677 | 2018/01/30 | |
| | 30 国際協力銀行 | 1.8700 | 100,000 | 103,822 | 2018/03/20 | |
| | 56 政保道路機構 | 1.4000 | 100,000 | 103,019 | 2018/04/20 | |
| | 2 政保地方公営機 | 1.6000 | 100,000 | 104,360 | 2018/11/16 | |
| | 5 日本政策投資CO | 1.7450 | 100,000 | 105,121 | 2019/03/20 | |
| | 98 政保道路機構 | 1.3000 | 100,000 | 104,947 | 2020/01/31 | |
| | 122 政保道路機構 | 0.9000 | 100,000 | 103,937 | 2020/11/30 | |
| | 190 政保道路機構 | 0.6050 | 100,000 | 103,456 | 2023/05/31 | |
| 種別 | 銘柄数 | | 13銘柄 | | | |
| 小計 | 金額 | | 1,250,000 | 1,289,433 | | |
| 金融債券 | | | | | | |
| 種別 | 銘柄数 | | 1銘柄 | | | |
| 小計 | 金額 | | 100,000 | 100,270 | | |
| 普通社債券 | | | | | | |
| | 1 三菱UFJ信託BK | 0.3450 | 100,000 | 100,259 | 2017/06/07 | |
| | 137 三菱東京UFJJK | 0.2750 | 100,000 | 100,172 | 2017/07/20 | |
| | 10 首都高速道路 | 0.3360 | 100,000 | 100,357 | 2017/09/20 | |
| | 31 みずほコーポレート | 0.3300 | 100,000 | 100,248 | 2017/10/25 | |
| | 261 北海道電力 | 2.7750 | 3,000 | 3,141 | 2017/11/24 | |
| | 4 成田国際空港 | 1.7000 | 100,000 | 103,043 | 2017/12/20 | |
| | 15 NTTドコモ | 1.9600 | 100,000 | 104,514 | 2018/06/20 | |
| | 35 みずほBK | 0.2850 | 100,000 | 100,258 | 2019/01/25 | |
| | 25 東日本高速道 | 0.2990 | 100,000 | 100,457 | 2019/03/20 | |
| | 27 東日本高速道 | 0.2480 | 100,000 | 100,321 | 2019/06/20 | |
| | 1 明治安田2014基 | 0.5100 | 100,000 | 100,558 | 2019/08/07 | |
| | 164 オリックス | 1.1460 | 100,000 | 103,060 | 2019/08/07 | |
| | 62 トヨタファイナンス | 0.2030 | 100,000 | 100,230 | 2019/12/20 | |
| | 70 東日本旅客鉄道 | 1.1930 | 100,000 | 104,787 | 2020/09/29 | |
| | 33 中日本高速道 | 1.0840 | 100,000 | 104,981 | 2021/09/17 | |
| 種別 | 銘柄数 | | 15銘柄 | | | |
| 小計 | 金額 | | 1,403,000 | 1,426,393 | | |
| 合計 | 銘柄数 | | 272銘柄 | | | |
| 合計 | 金額 | | 13,558,800 | 14,669,272 | | |

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド」の決算日（2015年9月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年1月12日）現在におけるダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンドの組入資産の内容等を59～60ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | | | 付 | | | | 売 | | | | 付 | | | |
|-----------------------------------|-----------|-----------|--------|-------------------------------------|-----------|-----------|--------|-----------------------------------|-----------|-----------|-------|----------------------------------|-----------|-----------|--------|
| 銘柄 | 口数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 口数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 口数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 口数 | 金額 | 平均単価 |
| | 千口 | 千円 | 円 | | 千口 | 千円 | 円 | | 千口 | 千円 | 円 | | 千口 | 千円 | 円 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ) | 407.52 | 9,295,340 | 22,809 | UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス) | 188.391 | 6,098,112 | 32,369 | LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス) | 2,558.713 | 6,006,256 | 2,347 | GOODMAN GROUP (オーストラリア) | 9,257.25 | 5,235,056 | 565 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC (アメリカ) | 1,945.971 | 4,912,967 | 2,524 | WELLTOWER INC (アメリカ) | 590.174 | 4,763,715 | 8,071 | EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ) | 511.413 | 4,751,051 | 9,290 | WESTFIELD CORP (オーストラリア) | 4,957.726 | 4,274,323 | 862 |
| EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ) | 404.607 | 3,717,892 | 9,188 | PROLOGIS INC (アメリカ) | 618.589 | 3,301,399 | 5,336 | SCENTRE GROUP (オーストラリア) | 7,770.001 | 2,774,184 | 357 | SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ) | 138.14 | 3,182,468 | 23,037 |
| KLEPIERRE (フランス) | 624.795 | 3,349,694 | 5,361 | GECINA SA (フランス) | 202.547 | 3,178,591 | 15,693 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS (アメリカ) | 583.15 | 2,630,159 | 4,510 | GENERAL GROWTH PROPERTIES (アメリカ) | 681.959 | 2,163,985 | 3,173 |
| DEXUS PROPERTY GROUP (オーストラリア) | 4,496.62 | 3,035,792 | 675 | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC (アメリカ) | 1,613.465 | 3,145,687 | 1,949 | LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス) | 1,239.344 | 2,858,786 | 2,306 | | | | |
| WELLTOWER INC (アメリカ) | 312.683 | 2,904,752 | 9,289 | | | | | SCENTRE GROUP (オーストラリア) | 7,770.001 | 2,774,184 | 357 | | | | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス) | 1,239.344 | 2,858,786 | 2,306 | | | | | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS (アメリカ) | 583.15 | 2,630,159 | 4,510 | | | | |
| SCENTRE GROUP (オーストラリア) | 7,770.001 | 2,774,184 | 357 | | | | | GENERAL GROWTH PROPERTIES (アメリカ) | 681.959 | 2,163,985 | 3,173 | | | | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS (アメリカ) | 583.15 | 2,630,159 | 4,510 | | | | | | | | | | | | |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES (アメリカ) | 681.959 | 2,163,985 | 3,173 | | | | | | | | | | | | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2016年1月12日現在におけるダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド（73,981,368千口）の内容です。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 2016年1月12日現在 | | | |
|----------------------------|--------------|----------|-----------|-----|
| | 口数 | 評価額 | | 比率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| 不動産ファンド (アメリカ) | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 433.677 | 80,971 | 9,538,481 | 6.6 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 954.954 | 37,682 | 4,438,996 | 3.1 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES | 681.959 | 17,642 | 2,078,260 | 1.4 |
| VORNADO REALTY TRUST | 396.841 | 37,969 | 4,472,836 | 3.1 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | 219.654 | 9,737 | 1,147,049 | 0.8 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 760.02 | 60,634 | 7,142,731 | 5.0 |
| EQUINIX INC | 42.066 | 13,161 | 1,550,437 | 1.1 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 1,327.005 | 19,573 | 2,305,737 | 1.6 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 615.023 | 10,197 | 1,201,216 | 0.8 |
| CYRUSONE INC | 253.889 | 9,442 | 1,112,283 | 0.8 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 1.196 | 20 | 2,464 | 0.0 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 953.161 | 9,055 | 1,066,682 | 0.7 |
| SUN COMMUNITIES INC | 230.551 | 15,668 | 1,845,719 | 1.3 |
| DDR CORP | 1,692.407 | 27,484 | 3,237,696 | 2.3 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 8.681 | 2,046 | 241,021 | 0.2 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 117.971 | 17,252 | 2,032,294 | 1.4 |
| WELLTOWER INC | 138.832 | 9,516 | 1,121,094 | 0.8 |

| ファンド名 | 2016年1月12日現在 | | | |
|-----------------------------|------------------|--------------------|-----------------------|---------|
| | 口数 | 評価額 | | 比率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| HCP INC | 366.57 | 13,548 | 1,596,004 | 1.1 |
| KILROY REALTY CORP | 300.432 | 17,872 | 2,105,404 | 1.5 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 137.26 | 12,430 | 1,464,285 | 1.0 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 189.417 | 12,490 | 1,471,340 | 1.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 248.375 | 9,897 | 1,165,954 | 0.8 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 632.715 | 13,287 | 1,565,210 | 1.1 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 64.438 | 5,497 | 647,646 | 0.5 |
| REGENCY CENTERS CORP | 288.232 | 19,723 | 2,323,453 | 1.6 |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 557.199 | 9,282 | 1,093,529 | 0.8 |
| SL GREEN REALTY CORP | 224.656 | 23,523 | 2,771,095 | 1.9 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 538.791 | 18,852 | 2,220,800 | 1.5 |
| CUBESMART | 692.035 | 21,681 | 2,554,075 | 1.8 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 475.151 | 43,148 | 5,082,888 | 3.5 |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 388.131 | 14,438 | 1,700,852 | 1.2 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 1,134.518 | 10,301 | 1,213,507 | 0.8 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 246.26 | 9,008 | 1,061,164 | 0.7 |
| アメリカ・ドル 通貨計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 15,312.067 33銘柄 | 633,040 74,572,219 | <51.9%> |

| ファンド名 | 2016年1月12日現在 | | | |
|------------------------------|------------------|-----------------------|------------|---------|
| | 口数 | 評価額 | 外貨建金額 | 比率 |
| (カナダ) | 千口 | 千カナダ・ドル | 千円 | % |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 241.654 | 7,573 | 627,913 | 0.4 |
| カナダ・ドル 通貨計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 241.654 7,573 | 627,913 | < 0.4%> |
| (オーストラリア) | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | % |
| NATIONAL STORAGE REIT | 7,097.645 | 10,398 | 857,423 | 0.6 |
| SCENTRE GROUP | 13,680.194 | 56,088 | 4,625,082 | 3.2 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 4,496.62 | 32,150 | 2,651,157 | 1.8 |
| MIRVAC GROUP | 7,496.111 | 14,130 | 1,165,173 | 0.8 |
| WESTFIELD CORP | 4,124.767 | 37,906 | 3,125,778 | 2.2 |
| VICINITY CENTRES | 21,959.491 | 59,949 | 4,943,428 | 3.4 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 5,981.161 | 16,687 | 1,376,046 | 1.0 |
| オーストラリア・ドル 通貨計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 64,835,989 227,311 | 18,744,090 | <13.1%> |
| (香港) | 千口 | 千香港ドル | 千円 | % |
| FORTUNE REIT | 15,935.07 | 120,309 | 1,826,302 | 1.3 |
| LINK REIT | 5,178.42 | 228,109 | 3,462,700 | 2.4 |
| CHAMPION REIT | 14,763.376 | 54,919 | 833,681 | 0.6 |
| 香港ドル 通貨計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 35,876,866 403,338 | 6,122,685 | < 4.3%> |
| (シンガポール) | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| KEPPEL DC REIT | 20,389.571 | 20,593 | 1,690,723 | 1.2 |
| CAPITALAND MALL TRUST | 7,758 | 14,740 | 1,210,170 | 0.8 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 7,618.9 | 13,904 | 1,141,558 | 0.8 |
| シンガポール・ドル 通貨計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 35,766,471 49,238 | 4,042,452 | < 2.8%> |
| (イギリス) | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| ASSURA PLC | 11,423.675 | 6,328 | 1,084,931 | 0.8 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 6,130.935 | 3,831 | 656,891 | 0.5 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 2,235.176 | 24,989 | 4,283,910 | 3.0 |
| HAMMERSON PLC | 4,080.106 | 23,562 | 4,039,338 | 2.8 |
| DERWENT LONDON PLC | 347.534 | 11,934 | 2,045,900 | 1.4 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 1,911.123 | 14,648 | 2,511,236 | 1.7 |
| イギリス・ポンド 通貨計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 26,128,549 85,295 | 14,622,208 | <10.2%> |
| ユーロ (オランダ) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| WERELDHAVE NV | 394.012 | 19,515 | 2,495,240 | 1.7 |
| NSI NV | 2,403.256 | 9,084 | 1,161,519 | 0.8 |
| 国小計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 2,797,268 2銘柄 | 3,656,760 | < 2.5%> |
| ユーロ (ベルギー) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 83.943 | 6,211 | 794,238 | 0.6 |
| 国小計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 83,943 1銘柄 | 794,238 | < 0.6%> |
| ユーロ (フランス) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| KLEPIERRE | 1,674.184 | 64,330 | 8,225,300 | 5.7 |
| FONCIERE DES REGIONS | 265.163 | 20,743 | 2,652,289 | 1.8 |
| 国小計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 1,939,347 2銘柄 | 10,877,589 | < 7.6%> |
| ユーロ (ドイツ) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 1,193.346 | 14,081 | 1,800,458 | 1.3 |
| 国小計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 1,193,346 1銘柄 | 1,800,458 | < 1.3%> |

| ファンド名 | 2016年1月12日現在 | | | |
|------------------------------|------------------|---------------------|-------------|---------|
| | 口数 | 評価額 | 外貨建金額 | 比率 |
| ユーロ (スペイン) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 1,126.265 | 10,181 | 1,301,798 | 0.9 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 830.323 | 8,739 | 1,117,387 | 0.8 |
| 国小計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 1,956,588 2銘柄 | 2,419,186 | < 1.7%> |
| ユーロ (イタリア) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| BENI STABILI SPA | 19,271.73 | 13,413 | 1,715,002 | 1.2 |
| 国小計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 19,271.73 1銘柄 | 1,715,002 | < 1.2%> |
| ユーロ通貨計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 27,242,222 9銘柄 | 21,263,235 | <14.8%> |
| 合計 | □数、金額 銘柄数<比率> | 205,403,818 62銘柄 | 139,994,805 | <97.5%> |

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在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) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の決算日（2015年11月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年1月12日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの組入資産の内容等を61ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの主要な売買銘柄 投資信託証券

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | | | 売 | | | | | |
|-------------------|---|--------|-----------|---------|-------------------|---|-------|-----------|-----------|
| 銘柄 | 柄 | 口数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 柄 | 口数 | 金額 | 平均単価 |
| | | 千口 | 千円 | 円 | | | 千口 | 千円 | 円 |
| 日本リテールファンド | | 11 | 2,487,274 | 226,115 | グローバル・ワン不動産投資法人 | | 3.1 | 1,383,276 | 446,218 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | | 11 | 1,808,830 | 164,439 | 野村不動産マスターF | | 7.852 | 1,222,031 | 155,633 |
| ジャパンリアルエステイト | | 2.85 | 1,605,392 | 563,295 | 日本プライムリアルティ | | 3 | 1,204,050 | 401,350 |
| GLP投資法人 | | 12.374 | 1,523,720 | 123,138 | イオンリート投資 | | 6.1 | 1,010,183 | 165,603 |
| いちごオフィスリート投資法人 | | 17.3 | 1,521,426 | 87,943 | 森トラスト総合リート | | 4.07 | 923,725 | 226,959 |
| トップリート投資法人 | | 2.9 | 1,469,848 | 506,844 | MCUBS MidCity投資法人 | | 2.36 | 860,956 | 364,812 |
| MCUBS MidCity投資法人 | | 4.06 | 1,391,085 | 342,632 | 森ヒルズリート | | 5 | 727,970 | 145,594 |
| ケネディクス商業リート | | 4.5 | 1,194,757 | 265,501 | いちごホテルリート投資 | | 4.83 | 654,196 | 135,444 |
| 野村不動産オフィスF | | 2.2 | 1,185,689 | 538,949 | 星野リゾート・リート | | 0.386 | 541,492 | 1,402,829 |
| NMF投資法人 | | 8 | 1,167,099 | 145,887 | 日本リテールファンド | | 2 | 478,283 | 239,141 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2016年1月12日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド（34,988,783千口）の内容です。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 2016年1月12日現在 | | | |
|--------------------|--------------|-----------|-----|---|
| | 口数 | 評価額 | 比率 | 率 |
| | 千口 | 千円 | | % |
| 不動産投信 | | | | |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 3 | 1,185,000 | 1.6 | |
| MCUBS MidCity投資法人 | 2.9 | 935,250 | 1.3 | |
| 森ヒルズリート | 12 | 1,776,000 | 2.4 | |
| 産業ファンド | 3 | 1,608,000 | 2.2 | |
| 大和ハウスリート | 3.2 | 1,408,000 | 1.9 | |
| アドバンス・レジデンス | 8 | 2,022,400 | 2.7 | |
| ケネディクスレジデンス | 3.5 | 1,010,100 | 1.4 | |
| APL投資法人 | 4.7 | 2,368,800 | 3.2 | |
| GLP投資法人 | 20 | 2,090,000 | 2.8 | |
| コンフォリア・レジデンス | 3 | 635,400 | 0.9 | |
| 日本プロロジスリート | 12 | 2,353,200 | 3.2 | |
| 星野リゾート・リート | 0.6 | 715,800 | 1.0 | |
| SLA不動産投資 | 0.5 | 211,750 | 0.3 | |
| イオンリート投資 | 3.9 | 496,470 | 0.7 | |
| ヒューリックリート投資法 | 6 | 970,200 | 1.3 | |
| 日本リート投資法人 | 4 | 1,046,800 | 1.4 | |
| インベスコ・オフィス・リート | 20 | 1,904,000 | 2.6 | |
| 積水ハウス・リート投資 | 9 | 1,074,600 | 1.5 | |
| トーセイ・リート投資法人 | 2.5 | 276,250 | 0.4 | |
| ケネディクス商業リート | 4.2 | 998,340 | 1.4 | |
| ヘルスケア&メディカル投資 | 2.168 | 226,339 | 0.3 | |
| サムティ・レジデンス | 1 | 80,800 | 0.1 | |
| ジャパン・シニアリビング | 1 | 136,100 | 0.2 | |
| 野村不動産マスターF | 27 | 3,801,600 | 5.2 | |
| いちごホテルリート投資 | 4.67 | 641,191 | 0.9 | |
| 日本ビルファンド | 7.05 | 3,905,700 | 5.3 | |
| ジャパンリアルエステイト | 9.55 | 5,424,400 | 7.4 | |

| ファンド名 | 2016年1月12日現在 | | | |
|--------------------|--------------|------------|-----|---------|
| | 口数 | 評価額 | 比率 | 率 |
| | 千口 | 千円 | | % |
| 日本リテールファンド | 20 | 4,368,000 | 5.9 | |
| オリックス不動産投資 | 14 | 2,107,000 | 2.9 | |
| 日本プライムリアルティ | 4.5 | 1,766,250 | 2.4 | |
| プレミア投資法人 | 9.5 | 1,122,900 | 1.5 | |
| 東急リアル・エステート | 1.7 | 247,520 | 0.3 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 1.9 | 754,300 | 1.0 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 23 | 3,629,400 | 4.9 | |
| 森トラスト総合リート | 6.7 | 1,286,400 | 1.7 | |
| インヴェンシブル投資法人 | 34 | 2,182,800 | 3.0 | |
| フロンティア不動産投資 | 2 | 909,000 | 1.2 | |
| 平和不動産リート | 2 | 158,000 | 0.2 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 7 | 1,489,600 | 2.0 | |
| 福岡リート投資法人 | 3 | 571,800 | 0.8 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 3 | 1,572,000 | 2.1 | |
| 靄水ハウス・SLIレジデンス投資法人 | 2.5 | 247,500 | 0.3 | |
| いちごオフィスリート投資法人 | 13 | 1,060,800 | 1.4 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 3.2 | 2,000,000 | 2.7 | |
| 阪急リート投資法人 | 3 | 365,700 | 0.5 | |
| トップリート投資法人 | 2.8 | 1,216,600 | 1.7 | |
| 大和ハウス・レジデンス投資法人 | 2 | 459,600 | 0.6 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 32 | 2,752,000 | 3.7 | |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 24.5 | 1,888,950 | 2.6 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 4 | 502,800 | 0.7 | |
| 合計 | 397,738 | 71,961,410 | | |
| | 口数・金額 | 50銘柄 | | <97.7%> |
| | 銘柄数<比率> | | | |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の決算日（2015年10月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年1月12日）現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を62～64ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ北米好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | | | 売 | | | |
|-------------------------------------|-----|--------|--------|-----------------------------------|-------|--------|--------|
| 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| MERCK & CO. INC. (アメリカ) | 5 | 34,839 | 6,967 | AETNA INC (アメリカ) | 3.1 | 41,803 | 13,484 |
| VISA INC-CLASS A SHARES (アメリカ) | 3.8 | 32,227 | 8,481 | HP INC (アメリカ) | 7.6 | 32,531 | 4,280 |
| TE CONNECTIVITY LTD (スイス) | 3.2 | 26,474 | 8,273 | GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ) | 9.4 | 30,063 | 3,198 |
| ANALOG DEVICES INC (アメリカ) | 3.6 | 24,938 | 6,927 | XILINX INC (アメリカ) | 5.4 | 29,412 | 5,446 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS (アメリカ) | 2.8 | 23,550 | 8,410 | L3 COMMUNICATIONS HOLDINGS (アメリカ) | 1.9 | 26,601 | 14,000 |
| APPLE INC (アメリカ) | 1.4 | 21,202 | 15,144 | PFIZER INC (アメリカ) | 6.283 | 25,930 | 4,127 |
| HOME DEPOT INC (アメリカ) | 1.5 | 19,479 | 12,986 | ALLSTATE CORP (アメリカ) | 3.3 | 25,392 | 7,694 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP (アメリカ) | 1.7 | 18,884 | 11,108 | TYSON FOODS INC-CL A (アメリカ) | 4.9 | 25,296 | 5,162 |
| ALPHABET INC-CL A (アメリカ) | 0.2 | 18,679 | 93,398 | BLACKROCK INC (アメリカ) | 0.5 | 21,839 | 43,678 |
| EQUIFAX INC (アメリカ) | 1.8 | 18,660 | 10,367 | BANK OF AMERICA CORP (アメリカ) | 11.6 | 21,466 | 1,850 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | | | 売 | | | |
|--|--------|--------|-------|--|-------|--------|-------|
| 銘柄 | 証券数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 証券数 | 金額 | 平均単価 |
| | 千証券 | 千円 | 円 | | 千証券 | 千円 | 円 |
| CITIGROUP CAPITAL XIII 6.6919 (アメリカ) | 10.191 | 32,439 | 3,183 | INTEGRYS HOLDING INC 6 (アメリカ) | 8.375 | 27,237 | 3,252 |
| PPL CAPITAL FUNDING INC 5.9 B (アメリカ) | 8.15 | 24,908 | 3,056 | BB&T CORPORATION 5.625 E (アメリカ) | 8.295 | 24,632 | 2,969 |
| MORGAN STANLEY 6.375 I (アメリカ) | 7.9 | 24,764 | 3,134 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K (アメリカ) | 7.231 | 23,363 | 3,230 |
| ALLY FINANCIAL 8.125 2/15/40 (アメリカ) | 7.825 | 24,760 | 3,164 | JPMORGAN CHASE & CO 5.5 O (アメリカ) | 6.725 | 19,644 | 2,921 |
| BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y (アメリカ) | 8.1 | 24,548 | 3,030 | COUNTRYWIDE CAPITAL IV 6.75 (アメリカ) | 5.904 | 18,229 | 3,087 |
| COUNTRYWIDE CAPITAL IV 6.75 (アメリカ) | 7.05 | 21,927 | 3,110 | WELLS FARGO & COMPANY 5.85 (アメリカ) | 5.8 | 18,181 | 3,134 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D (アメリカ) | 6.7 | 21,169 | 3,159 | SUNTRUST BANKS INC 5.875 E (アメリカ) | 5.986 | 18,143 | 3,031 |
| WELLS FARGO & COMPANY 8 J (アメリカ) | 5.9 | 19,955 | 3,382 | FIRST NIAGARA FIN GRP 8.625 B (アメリカ) | 5.3 | 17,706 | 3,340 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K (アメリカ) | 6.1 | 19,300 | 3,163 | HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875 (アメリカ) | 4.65 | 17,487 | 3,760 |
| CHS INC 7.5 4 (アメリカ) | 6 | 19,182 | 3,197 | AFFILIATED MANAGERS GROU 6.375 (アメリカ) | 5.5 | 17,444 | 3,171 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2016年1月12日現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンド（980,194千口）の内容です。

(1) 外国株式

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | | 業種等 |
|-----------------------------|--------------|----------|--------|------------|
| | 株数 | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 15 | 48 | 5,733 | 素材 |
| AETNA INC | 11 | 115 | 13,647 | ヘルスケア |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 15 | 147 | 17,390 | 資本財・サービス |
| ALLIANT ENERGY CORP | 27 | 167 | 19,700 | 公益事業 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 45 | 260 | 30,703 | 情報技術 |
| APPLE INC | 42 | 413 | 48,748 | 情報技術 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 42 | 212 | 24,980 | 金融 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 45 | 264 | 31,185 | 金融 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 20 | 191 | 22,537 | 金融 |
| CMS ENERGY CORP | 37 | 133 | 15,725 | 公益事業 |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD | 22 | 281 | 33,182 | 情報技術 |
| TIME WARNER INC | 17 | 118 | 13,940 | 一般消費財・サービス |
| EAST WEST BANCORP INC | 23 | 85 | 10,081 | 金融 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 15 | 114 | 13,487 | 素材 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 4 | 61 | 7,290 | 生活必需品 |
| HANCO BRANDS INC | 77 | 234 | 27,656 | 一般消費財・サービス |
| EXPEDIA INC | 9 | 100 | 11,789 | 一般消費財・サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 57.34 | 422 | 49,775 | エネルギー |
| L3 COMMUNICATIONS HOLDINGS | 4.5 | 52 | 6,143 | 資本財・サービス |
| FORD MOTOR CO | 129 | 164 | 19,405 | 一般消費財・サービス |
| NEXTERA ENERGY INC | 24.62 | 259 | 30,620 | 公益事業 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 30 | 85 | 10,100 | 資本財・サービス |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 13 | 170 | 20,105 | 資本財・サービス |
| ALPHABET INC-CL A | 2 | 146 | 17,271 | 情報技術 |
| MGIC INVESTMENT CORP | 129 | 100 | 11,868 | 金融 |
| HOME DEPOT INC | 17 | 213 | 25,188 | 一般消費財・サービス |
| ASSURANT INC | 11 | 85 | 10,029 | 金融 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 145 | 146 | 17,251 | 金融 |
| JOHNSON & JOHNSON | 10 | 97 | 11,493 | ヘルスケア |
| ABBVIE INC | 30 | 161 | 19,041 | ヘルスケア |
| KROGER CO | 47 | 194 | 22,855 | 生活必需品 |
| MONSANTO CO | 16 | 147 | 17,392 | 素材 |
| MERCK & CO. INC. | 43 | 220 | 25,960 | ヘルスケア |
| NETAPP INC | 19 | 43 | 5,143 | 情報技術 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 26 | 159 | 18,750 | エネルギー |
| PATTERSON COS INC | 19 | 78 | 9,286 | ヘルスケア |
| PFIZER INC | 36 | 111 | 13,176 | ヘルスケア |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 26 | 199 | 23,482 | 生活必需品 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 30 | 297 | 35,067 | 情報技術 |
| QUALCOMM INC | 19 | 87 | 10,311 | 情報技術 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 35 | 155 | 18,347 | 資本財・サービス |
| ROSS STORES INC | 40 | 210 | 24,780 | 一般消費財・サービス |
| CHEVRON CORP | 12 | 96 | 11,417 | エネルギー |
| SYSCO CORP | 29 | 116 | 13,705 | 生活必需品 |
| AT&T INC | 89 | 302 | 35,593 | 電気通信サービス |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 11 | 50 | 5,924 | エネルギー |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 17 | 155 | 18,355 | 資本財・サービス |

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|------------------|----------------------|------------|
| | 株数 | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| VALERO ENERGY CORP | 8 | 55 | 6,509 | エネルギー |
| ANTHEM INC | 5 | 64 | 7,560 | ヘルスケア |
| WALT DISNEY CO/THE | 22 | 219 | 25,895 | 一般消費財・サービス |
| WELLS FARGO & CO | 52.26 | 261 | 30,836 | 金融 |
| WAL-MART STORES INC | 11 | 70 | 8,321 | 生活必需品 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 38 | 280 | 33,089 | 情報技術 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 17 | 150 | 17,678 | 金融 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 25 | 131 | 15,526 | 生活必需品 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 8.94 | 120 | 14,204 | ヘルスケア |
| ANALOG DEVICES INC | 36 | 184 | 21,700 | 情報技術 |
| EQUIFAX INC | 14 | 142 | 16,793 | 資本財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC | 14 | 135 | 15,914 | ヘルスケア |
| CARDINAL HEALTH INC | 19 | 150 | 17,742 | ヘルスケア |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 40 | 163 | 19,281 | 金融 |
| WW GRAINGER INC | 4 | 75 | 8,911 | 資本財・サービス |
| MICROSOFT CORP | 71 | 371 | 43,742 | 情報技術 |
| CVS HEALTH CORP | 23.75 | 225 | 26,556 | 生活必需品 |
| MEDTRONIC PLC | 26.16 | 190 | 22,496 | ヘルスケア |
| BLACKROCK INC | 5 | 154 | 18,160 | 金融 |
| ACE LTD | 17 | 187 | 22,086 | 金融 |
| PERRIGO CO PLC | 6 | 86 | 10,150 | ヘルスケア |
| アメリカ・ドル 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 2,045.57 68銘柄 | 11,110 <67.7%> | |
| (カナダ) | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| SUNCOR ENERGY INC | 53 | 169 | 14,026 | エネルギー |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 30 | 65 | 5,462 | 素材 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 23 | 116 | 9,698 | 一般消費財・サービス |
| カナダ・ドル 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 106 3銘柄 | 352 <1.5%> | |
| ファンド合計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 2,151.57 71銘柄 | 1,338,044 <69.2%> | |

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在の時価を対顧客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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | |
|---------------------------------|--------------|----------|--------|
| | 証券数 | 評価額 | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 千証券 | 千アメリカ・ドル | 千円 |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.125 Y | 3.2 | 83 | 9,876 |
| CHS INC 7.5 4 | 4.475 | 121 | 14,354 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP 6.25 | 1.35 | 34 | 4,120 |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA | 4.5 | 117 | 13,793 |
| WINTRUST FINANCIAL CORP 6.5 D | 3.7 | 98 | 11,620 |
| FIRST NIAGARA FIN GRP 8.625 B | 3.725 | 101 | 11,922 |
| VALLEY NATIONAL BANCORP 6.25 A | 4.4 | 122 | 14,378 |
| FIRST REPUBLIC BANK 5.7 F | 5.225 | 134 | 15,861 |
| CHARLES SCHWAB CORP 6 C | 1.3 | 34 | 4,111 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F | 1.65 | 43 | 5,123 |
| WELLS FARGO & COMPANY 6 V | 1.75 | 46 | 5,495 |
| SOUTHERN CO 6.25 | 4.1 | 111 | 13,108 |
| SEASPAN CORPORATION 9.5 C | 6.068 | 150 | 17,691 |
| NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.625 H | 1.2 | 30 | 3,627 |
| BB&T CORPORATION 5.2 G | 2.071 | 52 | 6,201 |
| DTE ENERGY COMPANY 5.25 | 3 | 74 | 8,771 |
| ZIONS BANCORPORATION 5.75 H | 2.1 | 52 | 6,135 |
| ASPEN INSURANCE HLDG LTD 7.25 | 0.7 | 18 | 2,181 |
| BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y | 3.2 | 85 | 10,117 |
| AMTRUST FINANCIAL SERVIC 6.75 A | 1.5 | 36 | 4,311 |
| FIRST REPUBLIC BANK/SF 5.5 | 3.321 | 83 | 9,878 |
| HANOVER INSURANCE GROUP 6.35 | 2.1 | 53 | 6,335 |
| ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.95 | 1.9 | 49 | 5,810 |
| PARTNERRE LTD 7.25 E | 3.5 | 101 | 11,898 |
| COUNTRYWIDE CAPITAL IV 6.75 | 6.05 | 153 | 18,088 |
| PARTNERRE LTD 6.5 D | 1.818 | 49 | 5,889 |
| PRIVATEBANCORP INC 7.125 | 1.513 | 40 | 4,794 |
| WELLS FARGO & COMPANY 8 J | 5.025 | 139 | 16,426 |
| CITIGROUP CAPITAL XIII 6.6919 | 7.491 | 196 | 23,111 |
| MORGAN STANLEY 6.875 F | 1.004 | 27 | 3,297 |
| ALLY FINANCIAL 8.125 2/15/40 | 7.325 | 186 | 21,969 |
| REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B | 2.471 | 66 | 7,870 |
| US BANCORP 6.5 F | 3.452 | 98 | 11,642 |
| WELLS FARGO & COMPANY 6.625 | 2.441 | 70 | 8,281 |
| PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P | 2.308 | 65 | 7,688 |
| BANK OF AMERICA CORP 6.625 W | 1.97 | 52 | 6,221 |
| ALLSTATE CORP 6.625 E | 0.628 | 17 | 2,060 |
| QWEST CORP 7.375 | 2 | 51 | 6,054 |
| QWEST CORP 7 | 1.3 | 33 | 3,993 |
| ALLSTATE CORP 5.1 | 1.1 | 27 | 3,284 |
| MORGAN STANLEY 6.625 G | 1.5 | 40 | 4,767 |
| MORGAN STANLEY 7.125 E | 1.737 | 49 | 5,880 |
| MORGAN STANLEY 6.375 I | 5.9 | 156 | 18,404 |

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | |
|--------------------------------|--------------|----------|---------|
| | 証券数 | 評価額 | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 千証券 | 千アメリカ・ドル | 千円 |
| JPMORGAN CHASE & CO 5.5 O | 0.775 | 19 | 2,315 |
| WELLS FARGO & COMPANY 5.85 | 1.7 | 44 | 5,204 |
| CITIGROUP INC 7.125 J | 4.213 | 117 | 13,856 |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.7 T | 2.2 | 61 | 7,189 |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.3 W | 0.7 | 18 | 2,189 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D | 1.6 | 43 | 5,137 |
| HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875 | 2.65 | 83 | 9,833 |
| PPL CAPITAL FUNDING INC 5.9 B | 6.15 | 160 | 18,944 |
| ASTORIA FINANCIAL CORP 6.5 C | 5.8 | 148 | 17,470 |
| 合計 | 証券数、金額 | 152,856 | 4,062 |
| | 銘柄数<比率> | 52銘柄 | <24.8%> |

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | |
|---------------------------------|--------------|----------|--------|
| | □数 | 評価額 | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME 7 A | 2 | 51 | 6,054 |
| CEDAR REALTY TRUST INC 7.25 B | 0.662 | 16 | 1,950 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST 7.125 A | 1.7 | 43 | 5,136 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES 7.125 C | 3.2 | 82 | 9,672 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST 7.75 A | 1.11 | 28 | 3,380 |
| VEREIT INC 6.7 F | 2.826 | 69 | 8,156 |
| VORNADO REALTY TRUST 5.4 L | 2.2 | 54 | 6,362 |
| 合計 | □数、金額 | 13,698 | 345 |
| | 銘柄数<比率> | 7銘柄 | <2.1%> |

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の決算日（2015年10月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年1月12日）現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を65～66ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄 株 式

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | | | 付 | | | | 売 | | | | 付 | | | |
|------------------------------------|---|--------|--------|--------|------------------------------------|---|--------|--------|--------|-----------------------------------|---|--------|--------|--------|--|
| 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | |
| | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 | |
| AVIVA PLC (イギリス) | | 44.734 | 43,111 | 963 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS (イギリス) | | 10.413 | 38,831 | 3,729 | TOTAL SA (フランス) | | 3.899 | 24,472 | 6,276 | |
| ENI SPA (イタリア) | | 10.824 | 21,382 | 1,975 | ALLIANZ SE-REG (ドイツ) | | 1.081 | 22,334 | 20,661 | OESTERREICHISCHE POST AG (オーストリア) | | 3.622 | 20,618 | 5,692 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス) | | 1.14 | 8,964 | 7,863 | REPSOL SA (スペイン) | | 12.992 | 19,400 | 1,493 | CTT-CORREIOS DE PORTUGAL (ポルトガル) | | 13.835 | 17,947 | 1,297 | |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS (スウェーデン) | | 1.54 | 7,079 | 4,596 | BP PLC (イギリス) | | 20.783 | 17,848 | 858 | NOVARTIS AG-REG (スイス) | | 1.442 | 17,320 | 12,011 | |
| KONINKLIJKE AHOLD NV (オランダ) | | 2.158 | 5,426 | 2,514 | VODAFONE GROUP PLC (イギリス) | | 33.214 | 14,580 | 438 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG (ドイツ) | | 1.318 | 14,452 | 10,965 | |
| GLAXOSMITHKLINE PLC (イギリス) | | 2.143 | 5,287 | 2,467 | | | | | | | | | | | |
| ALLIANZ SE-REG (ドイツ) | | 0.176 | 3,565 | 20,259 | | | | | | | | | | | |
| VODAFONE GROUP PLC (イギリス) | | 4.167 | 1,817 | 436 | | | | | | | | | | | |
| DNB ASA (ノルウェー) | | 1.048 | 1,726 | 1,647 | | | | | | | | | | | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2016年1月12日現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンド（950,654千口）の内容です。

外国株式

| 銘柄 | 柄 | 2016年1月12日現在 | | | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------|--|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (イギリス) | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | | |
| REXAM PLC | 291.92 | 174 | 29,976 | 素材 | | |
| PRUDENTIAL PLC | 148.44 | 202 | 34,697 | 金融 | | |
| AVIVA PLC | 406.69 | 192 | 33,025 | 金融 | | |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 159 | 214 | 36,729 | ヘルスケア | | |
| VODAFONE GROUP PLC | 900.05 | 198 | 34,068 | 電気通信サービス | | |
| KINGFISHER PLC | 445.04 | 147 | 25,222 | 一般消費財・サービス | | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 34.2 | 204 | 35,042 | 生活必需品 | | |
| NATIONAL GRID PLC | 221.59 | 208 | 35,745 | 公益事業 | | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 72.64 | 265 | 45,433 | 生活必需品 | | |
| HSBC HOLDINGS PLC | 520.46 | 259 | 44,414 | 金融 | | |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 99.24 | 134 | 23,035 | エネルギー | | |
| イギリス・ポンド 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 3,299.27 11銘柄 | 2,201 377,391 | <28.5%> | | |
| (スイス) | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | | | |
| NESTLE SA-REG | 76.85 | 539 | 63,461 | 生活必需品 | | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 10.05 | 249 | 29,333 | 金融 | | |
| NOVARTIS AG-REG | 56.11 | 452 | 53,227 | ヘルスケア | | |
| GIVAUDAN-REG | 1.38 | 239 | 28,209 | 素材 | | |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG | 25.47 | 114 | 13,425 | 素材 | | |
| スイス・フラン 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 169.86 5銘柄 | 1,596 187,657 | <14.2%> | | |

| 銘柄 | 柄 | 2016年1月12日現在 | | | | 業種等 |
|----------------------------|------------------|---------------|------------------|------------|--|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (デンマーク) | 百株 | 千デンマーク・クローネ | 千円 | | | |
| TDC A/S | 404.2 | 1,391 | 23,853 | 電気通信サービス | | |
| デンマーク・クローネ 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 404.2 1銘柄 | 1,391 <1.8%> | | | |
| (ノルウェー) | 百株 | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | | | |
| DNB ASA | 142.81 | 1,432 | 18,907 | 金融 | | |
| ノルウェー・クローネ 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 142.81 1銘柄 | 1,432 <1.4%> | | | |
| (スウェーデン) | 百株 | 千スウェーデン・クローネ | 千円 | | | |
| SWEDBANK AB - A SHARES | 123.5 | 2,188 | 30,178 | 金融 | | |
| HENNES & MAURITZ ABB SHS | 63.78 | 1,771 | 24,424 | 一般消費財・サービス | | |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 107.34 | 2,448 | 33,763 | 生活必需品 | | |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 102.92 | 1,857 | 25,617 | 資本財・サービス | | |
| スウェーデン・クローネ 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 397.54 4銘柄 | 8,265 113,984 | <8.6%> | | |
| ユーロ (オランダ) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 102.09 | 229 | 29,382 | 資本財・サービス | | |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 118.75 | 232 | 29,668 | 生活必需品 | | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 47.72 | 206 | 26,462 | 素材 | | |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 268.56 3銘柄 | 668 85,513 | <6.5%> | | |

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | | | 業種等 |
|-----------------------------|------------------|------------------|--------|----------------------|------------|
| | 株数 | 評価額 | | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| ユーロ (フランス) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| TOTAL SA | 56.36 | 210 | 26,915 | | エネルギー |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 46.76 | 227 | 29,119 | | 資本財・サービス |
| BNP PARIBAS | 59.87 | 286 | 36,667 | | 金融 |
| SANOFI | 40.64 | 299 | 38,270 | | ヘルスケア |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 203.63 4銘柄 | 1,024 | 130,972 < 9.9%> | |
| ユーロ (ドイツ) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| BAYER AG-REG | 27.89 | 286 | 36,658 | | ヘルスケア |
| SIEMENS AG-REG | 24.89 | 206 | 26,404 | | 資本財・サービス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 20.83 | 173 | 22,142 | | 一般消費財・サービス |
| BASF SE | 38.29 | 242 | 30,965 | | 素材 |
| ALLIANZ SE-REG | 15.41 | 234 | 30,027 | | 金融 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 211.45 | 331 | 42,351 | | 電気通信サービス |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 338.76 6銘柄 | 1,474 | 188,551 <14.3%> | |
| ユーロ (ポルトガル) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| CTT-CORREIOS DE PORTUGAL | 207.73 | 171 | 21,965 | | 資本財・サービス |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 207.73 1銘柄 | 171 | 21,965 < 1.7%> | |
| ユーロ (スペイン) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| ENAGAS SA | 101.15 | 261 | 33,457 | | 公益事業 |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 101.15 1銘柄 | 261 | 33,457 < 2.5%> | |
| ユーロ (イタリア) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| ENI SPA | 108.24 | 136 | 17,507 | | エネルギー |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 108.24 1銘柄 | 136 | 17,507 < 1.3%> | |
| ユーロ (オーストリア) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| OESTERREICHISCHE POST AG | 38.18 | 124 | 15,858 | | 資本財・サービス |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 38.18 1銘柄 | 124 | 15,858 < 1.2%> | |
| ユーロ通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 1,266.25 17銘柄 | 3,862 | 493,825 <37.4%> | |
| ファンド合計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 5,679.93 39銘柄 | - | 1,215,619 <91.9%> | |

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の決算日（2015年10月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年1月12日）現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を67～68ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | | | 付 | | | | 売 | | | | 付 | | | |
|----------------------------------|---|--------|---------|---------|-----------------------------------|---|-------|---------|-------|----|---|----|----|------|--|
| 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | |
| | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 | |
| CLP HOLDINGS LTD (香港) | | 142.5 | 150,191 | 1,053 | CLP HOLDINGS LTD (香港) | | 142.5 | 148,485 | 1,042 | | | | | | |
| AMCOR LIMITED (オーストラリア) | | 88 | 113,425 | 1,288 | TELSTRA CORP LTD (オーストラリア) | | 160 | 87,456 | 546 | | | | | | |
| RIO TINTO LTD (オーストラリア) | | 21.5 | 106,186 | 4,938 | WESTPAC BANKING CORP (オーストラリア) | | 25 | 81,403 | 3,256 | | | | | | |
| BHP BILLITON LIMITED (オーストラリア) | | 46.5 | 104,926 | 2,256 | DBS GROUP HOLDINGS LTD (シンガポール) | | 48 | 77,094 | 1,606 | | | | | | |
| TELSTRA CORP LTD (オーストラリア) | | 160 | 91,541 | 572 | RIO TINTO LTD (オーストラリア) | | 15.5 | 72,935 | 4,705 | | | | | | |
| CROWN CONFECTIONERY CO LTD (韓国) | | 1.19 | 83,463 | 70,137 | CHINA AIRLINES LTD (台湾) | | 1,320 | 68,610 | 51 | | | | | | |
| CRUCIALTEC CO LTD (韓国) | | 46.743 | 73,648 | 1,575 | SANTOS LTD (オーストラリア) | | 105 | 64,892 | 618 | | | | | | |
| SANTOS LTD (オーストラリア) | | 105 | 72,805 | 693 | CHICONY ELECTRONICS CO LTD (台湾) | | 210 | 64,617 | 307 | | | | | | |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国) | | 0.48 | 61,748 | 128,641 | CHINA OVERSEAS LAND & INVEST (香港) | | 142 | 58,554 | 412 | | | | | | |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL (台湾) | | 1,570 | 60,884 | 38 | CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL (台湾) | | 1,570 | 58,441 | 37 | | | | | | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2016年1月12日現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド（583,078千口）の内容です。

(1) 外国株式

| 銘柄 | 柄 | 2016年1月12日現在 | | 業種等 |
|------------------------------|-------|--------------|--------|----------|
| | | 株数 | 評価額 | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (オーストラリア) | 百株 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | |
| BHP BILLITON LIMITED | 205 | 318 | 26,286 | 素材 |
| SOUTH32 LTD | 130 | 11 | 970 | 素材 |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 130 | 145 | 12,016 | 金融 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 204 | 559 | 46,125 | 金融 |
| WESTPAC BANKING CORP | 150 | 458 | 37,799 | 金融 |
| RIO TINTO LTD | 60 | 243 | 20,037 | 素材 |
| AMCOR LIMITED | 510 | 651 | 53,703 | 素材 |
| SG FLEET GROUP LTD | 560 | 195 | 16,115 | 資本財・サービス |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 41.73 | 328 | 27,060 | 金融 |
| MACQUARIE GROUP LTD | 14 | 104 | 8,577 | 金融 |
| WESFARMERS LTD | 80 | 318 | 26,222 | 生活必需品 |
| COMPUTERSHARE LTD | 140 | 151 | 12,525 | 情報技術 |

| 銘柄 | 柄 | 2016年1月12日現在 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------|
| | | 株数 | 評価額 | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| TRANSURBAN GROUP | 百株 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | 資本財・サービス |
| DUET GROUP | 300 | 303 | 24,985 | 公益事業 |
| | 603.15 | 136 | 11,240 | |
| オーストラリア・ドル 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 3,127.88 14銘柄 | 3,925 <32.1%> | |
| (香港) | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 60 | 828 | 12,569 | 情報技術 |
| ZTE CORP-H | 450 | 662 | 10,055 | 情報技術 |
| HUANENG POWER INTL INC-H | 1,400 | 915 | 13,898 | 公益事業 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 2,000 | 984 | 14,937 | 金融 |
| BEST PACIFIC INTERNATIONAL H | 1,500 | 555 | 8,424 | 一般消費財・サービス |
| AIA GROUP LTD | 300 | 1,269 | 19,263 | 金融 |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD | 1,600 | 1,324 | 20,110 | 一般消費財・サービス |

(2) 外国投資信託証券

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | | | 業種等 |
|------------------------------|--------------|------------|-----------|---------|------------|
| | 株数 | 評価額 | | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| FIH MOBILE LTD | 百株 | 千香港ドル | 千円 | | 情報技術 |
| YESTAR INTERNATIONAL HOLDING | 3,580 | 1,013 | 15,379 | | 資本財・サービス |
| 香港ドル計 | 株数、金額 | 16,680 | 9,265 | 140,654 | |
| | 銘柄数<比率> | 9銘柄 | | <13.9%> | |
| (シンガポール) | 百株 | 千シンガポール・ドル | 千円 | | |
| SHENG SIONG GROUP LTD | 5,000 | 412 | 33,866 | | 生活必需品 |
| INNOVALUES LTD | 3,500 | 267 | 21,982 | | 一般消費財・サービス |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 500 | 146 | 11,986 | | 資本財・サービス |
| SINGAPORE POST LTD | 800 | 122 | 10,049 | | 資本財・サービス |
| ROTARY ENGINEERING LTD | 440 | 14 | 1,174 | | 資本財・サービス |
| シンガポール・ドル計 | 株数、金額 | 10,240 | 962 | 79,058 | |
| | 銘柄数<比率> | 5銘柄 | | < 7.8%> | |
| (台湾) | 百株 | 千台湾ドル | 千円 | | |
| GRAND PACIFIC PETROCHEMICAL | 3,000 | 4,470 | 15,779 | | 素材 |
| LAND MARK OPTOELECTRONICS | 70 | 3,563 | 12,577 | | 情報技術 |
| HOTA INDUSTRIAL MFG CO LTD | 400 | 4,960 | 17,508 | | 一般消費財・サービス |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 1,412.5 | 9,590 | 33,855 | | 情報技術 |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 914.61 | 3,530 | 12,462 | | 金融 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 800 | 10,640 | 37,559 | | 情報技術 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 400 | 7,720 | 27,251 | | 生活必需品 |
| 台湾ドル計 | 株数、金額 | 6,997.11 | 44,474 | 156,994 | |
| | 銘柄数<比率> | 7銘柄 | | <15.6%> | |
| (韓国) | 百株 | 千韓国ウォン | 千円 | | |
| MEDY-TOX INC | 4.2 | 233,898 | 22,898 | | ヘルスケア |
| CROWN CONFECTIONERY CO LTD | 5.2 | 319,800 | 31,308 | | 生活必需品 |
| CRUCIALTEC CO LTD | 127.43 | 182,224 | 17,839 | | 情報技術 |
| HANMI PHARM CO LTD | 1.1 | 81,730 | 8,001 | | ヘルスケア |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 3.4 | 391,680 | 38,345 | | 情報技術 |
| CELLTRION INC | 46.35 | 459,792 | 45,013 | | ヘルスケア |
| SOULBRAIN CO LTD | 33 | 129,030 | 12,632 | | 素材 |
| LG LIFE SCIENCES LTD | 12 | 79,080 | 7,741 | | ヘルスケア |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 62 | 160,890 | 15,751 | | 資本財・サービス |
| MACQUARIE KOREA INFRA FUND | 175 | 139,650 | 13,671 | | その他 |
| 韓国ウォン計 | 株数、金額 | 469.68 | 2,177,774 | 213,204 | |
| | 銘柄数<比率> | 10銘柄 | | <21.1%> | |
| ファンド合計 | 株数、金額 | 37,514.67 | — | 913,578 | |
| | 銘柄数<比率> | 45銘柄 | | <90.6%> | |

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | | |
|------------------|--------------|-------------|--------|--------|
| | □ 数 | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (オーストラリア) | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千円 | |
| SCENTRE GROUP | 61 | 250 | 20,623 | |
| GOODMAN GROUP | 25 | 152 | 12,533 | |
| 合計 | □ 数、金額 | 86 | 402 | 33,157 |
| | 銘柄数<比率> | 2銘柄 | | <3.3%> |

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(注1) 邦貨換算金額は、2016年1月12日現在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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の決算日（2015年10月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年1月12日）現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンドの組入資産の内容等を69～70ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ好配当日本株マザーファンドの主要な売買銘柄 株 式

(2015年1月14日から2016年1月12日まで)

| 買 | | | | 付 | | | | 売 | | | | 付 | | | |
|---------------|---|--------|-----------|--------|--------------|---|---------|-----------|-------|----|---|----|----|------|--|
| 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | |
| | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 | |
| 三井住友フィナンシャルG | | 605 | 3,075,167 | 5,082 | 日本航空 | | 817.6 | 3,319,671 | 4,060 | | | | | | |
| 伊藤忠 | | 2,000 | 2,855,862 | 1,427 | 三井物産 | | 1,739 | 2,693,298 | 1,548 | | | | | | |
| みずほフィナンシャルG | | 11,476 | 2,746,503 | 239 | 三菱商事 | | 1,034 | 2,448,207 | 2,367 | | | | | | |
| 日本電信電話 | | 522 | 2,729,201 | 5,228 | 伊藤忠 | | 1,494.2 | 2,303,388 | 1,541 | | | | | | |
| 日産自動車 | | 2,188 | 2,559,669 | 1,169 | 三井住友フィナンシャルG | | 460.7 | 2,300,556 | 4,993 | | | | | | |
| 日本航空 | | 608 | 2,515,266 | 4,136 | トヨタ自動車 | | 273.6 | 2,219,981 | 8,113 | | | | | | |
| トヨタ自動車 | | 306 | 2,311,523 | 7,553 | みずほフィナンシャルG | | 8,844.1 | 2,187,676 | 247 | | | | | | |
| 富士フイルムHLDGS | | 464 | 2,031,471 | 4,378 | 富士フイルムHLDGS | | 464 | 2,032,746 | 4,380 | | | | | | |
| 三菱UFJフィナンシャルG | | 2,089 | 1,725,008 | 825 | 川崎汽船 | | 6,628 | 2,007,171 | 302 | | | | | | |
| 村田製作所 | | 103.3 | 1,694,369 | 16,402 | あおぞら銀行 | | 4,370 | 1,909,910 | 437 | | | | | | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2016年1月12日現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンド（17,239,753千円）の内容です。

(1) 国内株式

| 銘柄 | 柄 | 2016年1月12日現在 | | 銘柄 | 柄 | 2016年1月12日現在 | | 銘柄 | 柄 | 2016年1月12日現在 | |
|--------------------|---|--------------|---------|-------------------|---|--------------|---------|------------------------|---|--------------|---------|
| | | 株数 | 評価額 | | | 株数 | 評価額 | | | 株数 | 評価額 |
| | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 |
| 建設業 (8.0%) | | | | サイカイオーベックス | | 194 | 39,188 | 武田薬品 | | 60 | 337,500 |
| 北弘電社 | | 278 | 111,756 | 化学 (8.2%) | | | | 小野薬品 | | 11.2 | 222,600 |
| 西松建設 | | 404 | 176,548 | 共和レザー | | 37.8 | 31,033 | ダイト | | 34.4 | 93,052 |
| 田辺工業 | | 104.9 | 94,410 | 東ソー | | 462 | 257,334 | 石油・石炭製品 (0.5%) | | | |
| イチケン | | 407 | 155,067 | 関東電化 | | 505 | 396,930 | 東燃ゼネラル石油 | | 198 | 190,674 |
| 名工建設 | | 165 | 134,640 | デンカ | | 354 | 174,168 | ガラス・土石製品 (2.0%) | | | |
| 矢作建設 | | 157.5 | 116,707 | 第一稀元素化学工 | | 20.2 | 83,931 | 神島化学 | | 110 | 53,460 |
| 大東建託 | | 25.4 | 352,298 | 日本化学工業 | | 40 | 9,120 | ノザワ | | 569 | 288,483 |
| 前田道路 | | 37 | 70,892 | 三井化学 | | 460 | 220,800 | トーヨーアサノ | | 68 | 9,656 |
| 東洋建設 | | 383.9 | 189,262 | 宇部興産 | | 811 | 187,341 | ヨシコン | | 46 | 48,300 |
| 世紀東急 | | 97.5 | 52,845 | 積水化成製品 | | 264 | 102,960 | クニミネ工業 | | 257 | 160,882 |
| テノックス | | 250 | 168,500 | タイガース ポリマー | | 220 | 148,720 | ニチハ | | 84.2 | 139,772 |
| 日成ビルド工業 | | 759 | 276,276 | 日本化薬 | | 56 | 65,912 | 鉄鋼 (1.5%) | | | |
| 大和ハウス | | 119.1 | 375,641 | 扶桑化学工業 | | 213.4 | 348,695 | 共英製鋼 | | 74.7 | 146,785 |
| ライト工業 | | 105.4 | 110,353 | 中国塗料 | | 33 | 24,948 | 山陽特殊製鋼 | | 251 | 126,755 |
| 東京エネシス | | 50 | 45,900 | 日本特殊塗料 | | 75 | 70,875 | 日本精線 | | 487 | 248,857 |
| 九電工 | | 60 | 126,120 | DIC | | 371 | 110,558 | 非鉄金属 (0.5%) | | | |
| 太平電業 | | 170 | 200,940 | コーセー | | 9 | 86,940 | 古河機金 | | 67 | 14,472 |
| 高橋カーテンウォール | | 73.2 | 54,900 | ポーラ・オルビスHD | | 19.5 | 143,520 | 日本精鉱 | | 252 | 73,332 |
| 食料品 (0.2%) | | | | 寺岡製作所 | | 214.7 | 91,247 | UACJ | | 400 | 98,400 |
| S Foods | | 41 | 82,246 | 天馬 | | 74.5 | 153,097 | 金属製品 (2.6%) | | | |
| 繊維製品 (0.8%) | | | | パーカーコーポレーション | | 506 | 174,570 | ケー・エフ・シー | | 151.9 | 344,053 |
| サイボー | | 106.6 | 54,685 | 医薬品 (2.3%) | | | | サンコーテクノ | | 97.3 | 103,040 |
| 帯人 | | 452 | 178,992 | 協和発酵キリン | | 96 | 173,376 | 横河ブリッジHLDGS | | 87.1 | 105,478 |

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | | 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | | 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | |
|------------------|--------------|-----------|----|-----------------|--------------|-----------|------------------------------|----------|--------------|-----|----|
| | 株数 | 評価額 | 千円 | | 株数 | 評価額 | 千円 | | 株数 | 評価額 | 千円 |
| 東プレ | 36.3 | 93,799 | | 倉庫・運輸関連業 (0.4%) | | | 宮崎銀行 | 242 | 84,458 | | |
| 東京製綱 | 789 | 135,708 | | 日本コンセプト | 142.8 | 135,660 | みずほフィナンシャルG | 2,631.9 | 583,755 | | |
| スーパーツール | 305 | 133,285 | | 情報・通信業 (9.6%) | | | 証券・商品先物取引業 (0.6%) | | | | |
| 機械 (3.2%) | | | | システナ | 14.3 | 21,521 | 松井証券 | 196.6 | 197,386 | | |
| タクマ | 38 | 33,972 | | 新日鉄住金SOL | 60.8 | 153,033 | 保険業 (2.3%) | | | | |
| 小池酸素 | 50 | 15,850 | | エイジア | 13.6 | 19,815 | MS & AD | 145.5 | 450,177 | | |
| 日進工具 | 35 | 74,550 | | ソリトンシステムズ | 52.7 | 65,189 | 第一生命 | 196.6 | 348,768 | | |
| レオン自動車 | 189.2 | 143,792 | | エムアップ | 47 | 27,542 | その他金融業 (0.9%) | | | | |
| 日精樹脂工業 | 126.3 | 108,491 | | SRAホールディングス | 139.5 | 386,415 | オリックス | 193 | 302,817 | | |
| オカダアイオン | 251.4 | 259,696 | | アパント | 119.6 | 170,430 | 不動産業 (4.0%) | | | | |
| 北川鉄工所 | 307 | 71,838 | | クレスコ | 93.4 | 162,329 | アーバネットコーポレーション | 371 | 102,025 | | |
| 鶴見製作所 | 111.1 | 188,092 | | フューチャーアーキテクト | 26.9 | 20,578 | サムディ | 266.3 | 296,924 | | |
| 三精テクノロジーズ | 51.4 | 32,176 | | オービックビジネスC | 6 | 37,260 | ユニソホールディングス | 41.3 | 173,873 | | |
| 北越工業 | 205.9 | 152,571 | | 大塚商会 | 25.8 | 151,188 | サンゼイランドディック | 261.4 | 223,235 | | |
| 兼松エンジニアリング | 33 | 31,680 | | 日本電信電話 | 241.6 | 1,132,862 | スターツコーポレーション | 106.5 | 228,868 | | |
| ツバキ・ナカシマ | 20.8 | 34,881 | | 沖繩セルラー電話 | 14.6 | 44,165 | シノケングループ | 199.5 | 380,845 | | |
| 電気機器 (7.5%) | | | | N T T ドコモ | 150 | 361,725 | サービス業 (8.3%) | | | | |
| 明電舎 | 219 | 97,455 | | スクウェア・エニックス・HD | 66.3 | 182,921 | トラスト・テック | 171.5 | 392,563 | | |
| 愛知電機 | 670 | 244,550 | | シーイーシー | 281.2 | 311,569 | GCAサヴィアン | 172.1 | 183,802 | | |
| SEMITEC | 62.6 | 88,579 | | ジャステック | 51.4 | 52,171 | エス・エム・エス | 44.3 | 104,237 | | |
| 寺崎電気産業 | 357.2 | 313,264 | | S C S K | 20.6 | 93,215 | キャリアデザインセンター | 206.4 | 237,566 | | |
| 戸上電機 | 221 | 115,362 | | 卸売業 (12.2%) | | | 日本エス・エイチ・エル | 17.4 | 47,884 | | |
| 能美防災 | 161.6 | 214,928 | | 横浜冷凍 | 222.7 | 224,481 | テー・オー・ダブリュー | 150.3 | 91,232 | | |
| ホーチキ | 114.3 | 111,785 | | アルコニックス | 130.3 | 189,325 | 日本ハウズイング | 25.5 | 96,007 | | |
| 日立国際電気 | 167 | 254,007 | | あいホールディングス | 54.9 | 151,578 | 山田コンサルティングG P | 40.4 | 141,602 | | |
| TDK | 18.9 | 126,819 | | クリヤマホールディングス | 70.1 | 113,001 | テクノプロ・ホールディング | 190.4 | 616,896 | | |
| アルプス電気 | 112.9 | 316,797 | | アドヴァン | 123.5 | 139,308 | ジャパンマテリアル | 92.8 | 212,512 | | |
| スミダコーポレーション | 150 | 99,300 | | 萩原電気 | 111.1 | 218,867 | 日本郵政 | 61.3 | 104,026 | | |
| リオン | 118 | 230,572 | | 岡谷銅機 | 9.3 | 74,679 | ベルシステム24H L D G S | 123.2 | 151,412 | | |
| 本多通信工業 | 82.3 | 76,621 | | 丸文 | 314 | 271,610 | セレスポ | 171 | 59,166 | | |
| 富士通フロンテック | 9.3 | 12,173 | | 日本ライフライン | 138.6 | 152,598 | 三協フロンテア | 139 | 116,760 | | |
| 村田製作所 | 22.5 | 331,987 | | 白銅 | 97.3 | 114,522 | トランス・コスモス | 49.6 | 144,385 | | |
| 輸送用機器 (9.7%) | | | | 伊藤忠 | 505.8 | 656,022 | 東海リース | 528 | 115,104 | | |
| ダイハツディーゼル | 208.7 | 145,881 | | 住友商事 | 30.8 | 35,620 | ステップ | 122.6 | 126,891 | | |
| 名村造船所 | 4.8 | 4,094 | | 三谷商事 | 17.8 | 53,150 | 合計 | 株数 | 千円 | | |
| 日産自動車 | 900.7 | 1,009,684 | | フルサト工業 | 91.4 | 154,100 | 株数 < 金額 | 38,936.4 | 35,348,957 | | |
| トヨタ自動車 | 94.4 | 637,672 | | 稲畑産業 | 162.4 | 177,016 | 銘柄数 < 比率 > | 193銘柄 | < 89.2% > | | |
| 新明和工業 | 127 | 125,730 | | 三信電気 | 170.7 | 195,972 | (注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各 | | | | |
| カルソニックカンセイ | 220 | 203,720 | | 加賀電子 | 158.5 | 245,833 | 業種の比率。 | | | | |
| 太平洋工業 | 23.6 | 28,603 | | フオーバル | 49.6 | 28,817 | (注2) 合計欄の < >内は、純資産総額に対する評価 | | | | |
| 河西工業 | 290 | 443,410 | | 丸紅建材リース | 1,755 | 349,245 | 額の比率。 | | | | |
| マツダ | 240 | 507,120 | | バイテックホールディングス | 211.1 | 250,786 | (注3) 評価額の単位未満は切捨て。 | | | | |
| 富士重工業 | 70.8 | 308,617 | | 東テク | 277.6 | 256,780 | | | | | |
| その他製品 (2.6%) | | | | ジェコス | 267.6 | 255,290 | | | | | |
| パンダイナムコH L D G S | 13.1 | 32,527 | | 小売業 (1.4%) | | | | | | | |
| SHOEI | 85.8 | 189,189 | | 日本調剤 | 25.7 | 109,739 | | | | | |
| 桑山 | 125.7 | 82,207 | | ノジマ | 99.2 | 136,598 | | | | | |
| ニッピ | 414 | 279,450 | | ハークスレイ | 119 | 150,654 | | | | | |
| ピジヨン | 64.7 | 164,532 | | 大塚家具 | 73.7 | 106,791 | | | | | |
| 岡村製作所 | 152 | 166,744 | | 銀行業 (8.3%) | | | | | | | |
| 陸運業 (1.5%) | | | | ゆうちょ銀行 | 172.9 | 271,798 | | | | | |
| 東海旅客鉄道 | 5.1 | 100,801 | | あおぞら銀行 | 2,290 | 920,580 | | | | | |
| 鴻池運輸 | 99.8 | 145,608 | | 三菱UFJフィナンシャルG | 473 | 320,221 | | | | | |
| センコー | 203 | 151,641 | | 三井住友フィナンシャルG | 144.3 | 599,710 | | | | | |
| トナミホールディングス | 459 | 144,126 | | ふくおかフィナンシャルG | 63 | 34,461 | | | | | |
| 空運業 (1.1%) | | | | 大分銀行 | 257 | 109,996 | | | | | |
| 日本航空 | 96.4 | 389,456 | | | | | | | | | |

(2) 国内投資信託証券

| 銘柄 | 2016年1月12日現在 | | |
|-------------------|--------------|---------|-----------|
| | 口数 | 評価額 | 千円 |
| MCUBS MidCity投資法人 | 2.268 | 731,430 | |
| 星野リゾート・リート | 0.106 | 126,458 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 11.471 | 986,506 | |
| 合計 | 口数 < 金額 | 13,845 | 1,844,394 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 3銘柄 | < 4.7% > |

(注1) 合計欄の < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 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

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 |

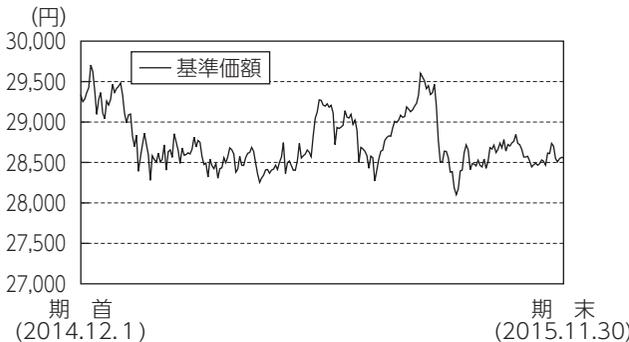
大和投資信託

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



| 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 | % | ベンチマーク | 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。

《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

○債券市場

・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イ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、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。

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は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 国債証券 | 千アメリカ・ドル 141,828 | 千アメリカ・ドル 131,234 (—) |
| | カナダ 国債証券 | 千カナダ・ドル 7,415 | 千カナダ・ドル 9,498 (—) |
| | オーストラリア 国債証券 | 千オーストラリア・ドル 6,297 | 千オーストラリア・ドル 2,948 (—) |
| 国 | シンガポール 国債証券 | 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 国債証券 | 千イギリス・ポンド 6,667 | 千イギリス・ポンド 9,319 (—) |
| | スイス 国債証券 | 千スイス・フラン 4,055 | 千スイス・フラン 4,763 (—) |

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|----------------------|-----------------------|------------------------------|
| 外 | デンマーク 国債証券 | 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 国債証券 | 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 国債証券 | 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 国債証券 | 千メキシコ・ペソ 33,638 | 千メキシコ・ペソ 25,710 (—) |
| | マレーシア 国債証券 | 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 国債証券 | 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 国債証券 | 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) 国債証券 | 千ユーロ 1,550 | 千ユーロ 2,064 (—) |
| | ユーロ (オランダ) 国債証券 | 千ユーロ 4,770 | 千ユーロ 5,334 (—) |
| | ユーロ (ベルギー) 国債証券 | 千ユーロ 3,574 | 千ユーロ 4,911 (—) |
| 国 | ユーロ (フランス) 国債証券 | 千ユーロ 16,551 | 千ユーロ 14,322 (—) |
| | ユーロ (ドイツ) 国債証券 | 千ユーロ 13,028 | 千ユーロ 16,439 (—) |
| | ユーロ (スペイン) 国債証券 | 千ユーロ 10,909 | 千ユーロ 6,769 (—) |
| | ユーロ (イタリア) 国債証券 | 千ユーロ 17,383 | 千ユーロ 17,532 (—) |
| | ユーロ (フィンランド) 国債証券 | 千ユーロ 802 | 千ユーロ 1,782 (—) |
| | ユーロ (オーストリア) 国債証券 | 千ユーロ 1,964 | 千ユーロ 2,901 (—) |
| | ユーロ (ユーロ通貨計) 国債証券 | 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 | | | 期 付 | | |
|---|------------------|---------|--|------------------|---------|
| 買 銘 | 柄 | 付 金 額 | 売 銘 | 柄 | 付 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。

■組入資産明細表

(1) 外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

| 作 成 期 区 分 | 額 面 金 額 | 当 期 | | | 未 期 | | | | |
|-----------------|------------------------|------------------------|------------------|-------------|---------|--------------------------|------------------|----------------|----------|
| | | 外 貨 建 金 額 | 評 価 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 組 入 比 率 | う ち B B 格 以 下 組 入 比 率 | 残 存 期 5 年 以 上 | 間 別 2 年 以 上 | 組 入 比 率 |
| 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 | % 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 (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 | |
| ユーロ (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 | |
| ユーロ (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 | |
| ユーロ (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 | |
| ユーロ (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 | |
| ユーロ (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 | |
| ユーロ (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 | |
| ユーロ (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 | |

外国債券インデックスマザーファンド

| 作成期 区分 | 当 期 | | | | 未 期 | | | |
|-----------------|-----------|---------|-------------|---------|-------------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 | う ち B 格 以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | 外 貨 建 金 額 | 千 円 | 千 円 | | | % | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 |
| ユーロ (オーストリア) | 15,300 | 18,722 | 2,431,655 | 1.5 | — | 0.9 | 0.4 | 0.1 |
| ユーロ (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 | 期 末 | | | | 償 還 年 月 日 |
|------|----------------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|-------------|-----------|
| | | | | 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 | 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 | |
| | 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 | |

| 区 分 | 銘 | 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 | | 償 還 年 月 日 |
|-----|----------------------------------|---|-------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | | | 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 | 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 | 1.7500 | 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 |
| | 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 |

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 | | 償 還 年 月 日 |
|----------------------------------|---|-------|--------|-------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | | | 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 | 0.8750 | 753 | 753 | 753 | 92,587 | 2017/06/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.6250 | 2,885 | 2,885 | 2,910 | 357,460 | 2019/06/30 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.1250 | 3,485 | 3,485 | 3,548 | 435,783 | 2021/06/30 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 7.5000 | 1,552 | 1,552 | 1,652 | 202,953 | 2016/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 8.7500 | 1,527 | 1,527 | 1,703 | 209,164 | 2017/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 8.8750 | 904 | 904 | 1,121 | 137,779 | 2019/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 8.1250 | 724 | 724 | 900 | 110,540 | 2019/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 8.7500 | 642 | 642 | 848 | 104,267 | 2020/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 8.0000 | 2,106 | 2,106 | 2,837 | 348,460 | 2021/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 6.2500 | 654 | 654 | 851 | 104,521 | 2023/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 6.0000 | 855 | 855 | 1,149 | 141,223 | 2026/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 6.5000 | 630 | 630 | 887 | 109,022 | 2026/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 6.1250 | 709 | 709 | 987 | 121,325 | 2027/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 5.5000 | 700 | 700 | 936 | 115,009 | 2028/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 5.2500 | 438 | 438 | 574 | 70,606 | 2028/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 5.2500 | 473 | 473 | 622 | 76,506 | 2029/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 6.2500 | 964 | 964 | 1,404 | 172,463 | 2030/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 5.3750 | 1,241 | 1,241 | 1,690 | 207,671 | 2031/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.5000 | 1,926 | 1,926 | 2,479 | 304,576 | 2036/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 5.0000 | 547 | 547 | 752 | 92,449 | 2037/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.3750 | 548 | 548 | 693 | 85,162 | 2038/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.5000 | 1,019 | 1,019 | 1,312 | 161,184 | 2038/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.5000 | 255 | 255 | 282 | 34,729 | 2039/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.2500 | 694 | 694 | 859 | 105,580 | 2039/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.5000 | 760 | 760 | 974 | 119,741 | 2039/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.3750 | 810 | 810 | 1,021 | 125,419 | 2039/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.6250 | 1,307 | 1,307 | 1,706 | 209,611 | 2040/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.3750 | 1,478 | 1,478 | 1,861 | 228,667 | 2040/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.8750 | 1,591 | 1,591 | 1,860 | 228,563 | 2040/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.2500 | 1,677 | 1,677 | 2,077 | 255,111 | 2040/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.7500 | 1,754 | 1,754 | 2,334 | 286,717 | 2041/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 4.3750 | 1,365 | 1,365 | 1,724 | 211,826 | 2041/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.7500 | 1,367 | 1,367 | 1,572 | 193,079 | 2041/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.1250 | 1,450 | 1,450 | 1,499 | 184,224 | 2041/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.1250 | 2,377 | 2,377 | 2,455 | 301,612 | 2042/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.0000 | 2,353 | 2,353 | 2,370 | 291,116 | 2042/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.7500 | 1,731 | 1,731 | 1,654 | 203,232 | 2042/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.7500 | 3,984 | 3,984 | 3,801 | 466,948 | 2042/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.1250 | 2,026 | 2,026 | 2,080 | 255,519 | 2043/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.8750 | 3,998 | 3,998 | 3,904 | 479,563 | 2043/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.6250 | 3,314 | 3,314 | 3,740 | 459,364 | 2043/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.7500 | 3,581 | 3,581 | 4,132 | 507,612 | 2043/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.6250 | 3,617 | 3,617 | 4,078 | 500,880 | 2044/02/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.3750 | 2,993 | 2,993 | 3,217 | 395,196 | 2044/05/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 0.8750 | 2,583 | 2,583 | 2,584 | 317,402 | 2017/07/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.6250 | 3,326 | 3,326 | 3,353 | 411,849 | 2019/07/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.2500 | 2,834 | 2,834 | 2,902 | 356,446 | 2021/07/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.3750 | 5,662 | 5,662 | 5,749 | 706,213 | 2024/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.1250 | 3,729 | 3,729 | 3,820 | 469,193 | 2044/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 0.8750 | 1,818 | 1,818 | 1,818 | 223,329 | 2017/08/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.6250 | 1,189 | 1,189 | 1,198 | 147,161 | 2019/08/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.0000 | 1,301 | 1,301 | 1,313 | 161,335 | 2021/08/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.0000 | 2,187 | 2,187 | 2,191 | 269,120 | 2017/09/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.7500 | 3,404 | 3,404 | 3,444 | 423,008 | 2019/09/30 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.1250 | 3,625 | 3,625 | 3,683 | 452,350 | 2021/09/30 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 0.8750 | 1,466 | 1,466 | 1,465 | 179,976 | 2017/10/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.5000 | 3,190 | 3,190 | 3,194 | 392,375 | 2019/10/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.0000 | 2,163 | 2,163 | 2,181 | 267,877 | 2021/10/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.2500 | 5,921 | 5,921 | 5,947 | 730,511 | 2024/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 3.0000 | 3,227 | 3,227 | 3,222 | 395,813 | 2044/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 0.8750 | 1,593 | 1,593 | 1,591 | 195,476 | 2017/11/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 0.3750 | 145 | 145 | 144 | 17,769 | 2016/10/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.8750 | 2,886 | 2,886 | 2,888 | 354,734 | 2021/11/30 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.5000 | 4,325 | 4,325 | 4,327 | 531,483 | 2019/11/30 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 0.5000 | 444 | 444 | 443 | 54,431 | 2016/11/30 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.0000 | 717 | 717 | 717 | 88,134 | 2017/12/15 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 2.1250 | 3,169 | 3,169 | 3,214 | 394,809 | 2021/12/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 1.6250 | 2,204 | 2,204 | 2,214 | 271,962 | 2019/12/31 |
| United States Treasury Note/Bond | 国 | 債 証 券 | 0.6250 | 1,544 | 1,544 | 1,542 | 189,448 | 2016/12/31 |

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 未 償 還 金 額 | | | 償 還 年 月 日 |
|------|--------------------------------------|-------|--------|----------|-----------|------------|-------------|------------|
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 千 円 | 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 | 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 |
| | 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 額 | 233銘柄 | | 552,013 | 567,249 | 69,669,622 | | |
| | | | | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | | | |
| カナダ | Canada Government International Bond | 国債証券 | 2.7500 | 285 | 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 |

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 | 期末 | | | 償還年月日 |
|---------|----------------------------|------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|-------|
| | | | | | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| | 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 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,018 | 1,012 | 92,967 | 2017/05/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 649 | 644 | 59,151 | 2020/09/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 505 | 495 | 45,456 | 2026/06/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 36 | 35 | 3,280 | 2017/11/01 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 363 | 357 | 32,846 | 2021/03/01 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 33銘柄 | | 32,341 | 36,282 | 3,330,391 | | |
| | | | | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | | | |
| オーストラリア | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 1,737 | 1,819 | 160,368 | 2017/02/15 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.2500 | 2,506 | 2,755 | 242,805 | 2019/03/15 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 2,050 | 2,403 | 211,807 | 2021/05/15 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 2,459 | 2,693 | 237,352 | 2020/04/15 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 1,882 | 2,249 | 198,242 | 2022/07/15 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 2,063 | 2,211 | 194,856 | 2018/01/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,918 | 2,285 | 201,371 | 2023/04/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,385 | 1,434 | 126,425 | 2017/07/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,662 | 1,944 | 171,335 | 2027/04/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,173 | 2,170 | 191,277 | 2024/04/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 964 | 975 | 85,967 | 2029/04/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,968 | 2,033 | 179,210 | 2025/04/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 958 | 1,111 | 97,989 | 2033/04/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 671 | 692 | 61,030 | 2018/10/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,790 | 2,004 | 176,629 | 2026/04/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,029 | 1,051 | 92,630 | 2019/10/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 763 | 800 | 70,514 | 2037/04/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 354 | 321 | 28,297 | 2035/06/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 386 | 376 | 33,139 | 2020/11/21 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 402 | 386 | 34,082 | 2039/06/21 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 20銘柄 | | 29,120 | 31,721 | 2,795,335 | | |
| | | | | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | | | |
| シンガポール | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0000 | 391 | 418 | 36,339 | 2018/09/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 3.2500 | 696 | 738 | 64,112 | 2020/09/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5000 | 442 | 483 | 41,962 | 2027/03/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 3.1250 | 438 | 462 | 40,213 | 2022/09/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.5000 | 599 | 617 | 53,616 | 2019/06/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 3.0000 | 768 | 805 | 69,977 | 2024/09/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.3750 | 580 | 590 | 51,265 | 2017/04/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.8750 | 279 | 283 | 24,661 | 2030/09/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.2500 | 307 | 309 | 26,919 | 2021/06/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 370 | 363 | 31,582 | 2042/04/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 0.5000 | 272 | 266 | 23,160 | 2018/04/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.7500 | 151 | 155 | 13,515 | 2023/07/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 3.3750 | 173 | 187 | 16,280 | 2033/09/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.8750 | 435 | 445 | 38,709 | 2029/07/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 1.6250 | 70 | 70 | 6,080 | 2019/10/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.3750 | 224 | 222 | 19,350 | 2025/06/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 2.0000 | 224 | 225 | 19,588 | 2020/07/01 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 国債証券 | 1.3750 | 190 | 190 | 16,570 | 2017/10/01 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 金額 | 18銘柄 | | 6,609 | 6,837 | 593,906 | | |
| | | | | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | | | |
| イギリス | United Kingdom Gilt | 国債証券 | 2.0000 | 2,380 | 2,465 | 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 | |

| 区 分 | 銘 | 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 未 評 価 額 | | | 償 還 年 月 日 |
|--------|---------------------------|----|------|--------|---------|-----------|------------|-------------|-----------|
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 千 円 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | | % | 千円 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| | 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 | 銘金 | 柄数 | | | 61,592 | 73,782 | 13,620,299 | | |
| スイス | SWISS GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.0000 | 420 | 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 | 銘金 | 柄数 | | | 3,343 | 4,041 | 481,635 | | |
| デンマーク | DANISH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 7.0000 | 3,055 | 4,823 | 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 | 銘金 | 柄数 | | | 48,572 | 62,187 | 1,082,676 | | |
| ノルウェー | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 4.2500 | 5,755 | 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 | 銘金 | 柄数 | | | 28,682 | 31,539 | 445,017 | | |
| スウェーデン | SWEDISH GOVERNMENT BOND | | 国債証券 | 5.0000 | 5,775 | 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 | |

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 | 評価価額 | | 償還年月日 |
|-------|--------------------------|------|---------|-----------------------|-----------------------|--------------|------------|
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000% | 千スウェーデン・クローネ 4,760 | 千スウェーデン・クローネ 5,532 | 千円 77,624 | 2025/05/12 |
| 通貨小計 | 銘柄数 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 19銘柄 | | | 203,967 | 226,176 | 1,671,446 | |
| 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 | 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 | | | 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 |

| 当 | | 期 | | | 未 | | 償還年月日 | | | | | | | | |
|--------------|----|-----------------------------|------|---|---|---|--------|---|------------|--------|-----------|---------|---|---|------------|
| 区 | 分 | 銘 | 柄 | 種 | 類 | 年 | | 利 | 率 | 額 | 面 | 金 | 額 | 評 | 価 |
| | | | | | | | | | | | | 外 | | 貨 | |
| | | | | | | | | | | | | 建 | | 算 | |
| | | | | | | | | | | | | 金 | | 金 | |
| | | | | | | | | | | | | 千 | | 千 | |
| | | | | | | | | | | | | 円 | | 円 | |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.7500 | % | 千南アフリカ・ランド | 2,839 | 2,748 | 23,468 | | | 2023/02/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.7500 | | 千南アフリカ・ランド | 8,752 | 8,311 | 70,982 | | | 2048/02/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.5000 | | 千南アフリカ・ランド | 6,321 | 5,920 | 50,560 | | | 2037/01/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.0000 | | 千南アフリカ・ランド | 3,801 | 3,508 | 29,961 | | | 2030/01/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.7500 | | 千南アフリカ・ランド | 2,902 | 2,754 | 23,525 | | | 2044/01/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.2500 | | 千南アフリカ・ランド | 4,943 | 4,613 | 39,399 | | | 2032/03/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 | 債 | 証 | 券 | 8.8750 | | 千南アフリカ・ランド | 3,166 | 3,083 | 26,333 | | | 2035/02/28 |
| 通貨小計 | 銘金 | 柄数 | 15銘柄 | | | | | | 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 | 2,802 | 85,278 | | | 2022/09/23 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.2500 | | 千ポーランド・ズロチ | 2,029 | 2,167 | 65,971 | | | 2017/10/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000 | | 千ポーランド・ズロチ | 1,912 | 2,175 | 66,199 | | | 2019/10/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | - | | 千ポーランド・ズロチ | 812 | 791 | 24,089 | | | 2017/07/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | | 千ポーランド・ズロチ | 782 | 766 | 23,327 | | | 2020/04/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500 | | 千ポーランド・ズロチ | 627 | 817 | 24,872 | | | 2029/04/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.2500 | | 千ポーランド・ズロチ | 2,256 | 2,595 | 78,971 | | | 2020/10/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500 | | 千ポーランド・ズロチ | 2,284 | 2,732 | 83,141 | | | 2021/10/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7500 | | 千ポーランド・ズロチ | 1,177 | 1,228 | 37,384 | | | 2017/04/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | | 千ポーランド・ズロチ | 3,083 | 3,415 | 103,929 | | | 2023/10/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | | 千ポーランド・ズロチ | 1,720 | 1,805 | 54,955 | | | 2018/04/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | | 千ポーランド・ズロチ | 2,099 | 2,144 | 65,268 | | | 2018/07/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500 | | 千ポーランド・ズロチ | 1,840 | 1,932 | 58,806 | | | 2019/07/25 |
| | | Poland Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500 | | 千ポーランド・ズロチ | 1,891 | 1,993 | 60,672 | | | 2025/07/25 |
| 通貨小計 | 銘金 | 柄数 | 14銘柄 | | | | | | 24,821 | 27,369 | 832,868 | | | | |
| ユーロ (アイルランド) | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | | 千ユーロ | 759 | 861 | 111,833 | | | 2018/10/18 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.4000 | | 千ユーロ | 684 | 792 | 102,868 | | | 2019/06/18 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.9000 | | 千ユーロ | 570 | 701 | 91,105 | | | 2019/10/18 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.4000 | | 千ユーロ | 1,131 | 1,576 | 204,791 | | | 2025/03/13 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000 | | 千ユーロ | 765 | 948 | 123,150 | | | 2020/10/18 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000 | | 千ユーロ | 169 | 187 | 24,311 | | | 2017/10/18 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.9000 | | 千ユーロ | 504 | 624 | 81,123 | | | 2023/03/20 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.4000 | | 千ユーロ | 847 | 1,024 | 133,113 | | | 2024/03/18 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.4000 | | 千ユーロ | 761 | 851 | 110,580 | | | 2030/05/15 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8000 | | 千ユーロ | 372 | 383 | 49,764 | | | 2022/03/15 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | | 千ユーロ | 391 | 387 | 50,272 | | | 2045/02/18 |
| | | IRISH TREASURY | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | | 千ユーロ | 1,035 | 1,238 | 160,883 | | | 2020/04/18 |
| 国小計 | 銘金 | 柄数 | 12銘柄 | | | | | | 7,988 | 9,576 | 1,243,799 | | | | |
| ユーロ (オランダ) | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 7.5000 | | 千ユーロ | 214 | 325 | 42,231 | | | 2023/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000 | | 千ユーロ | 1,239 | 1,910 | 248,118 | | | 2028/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | | 千ユーロ | 1,195 | 1,810 | 235,186 | | | 2037/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | | 千ユーロ | 991 | 1,241 | 161,236 | | | 2023/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | | 千ユーロ | 1,405 | 1,517 | 197,036 | | | 2017/07/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | | 千ユーロ | 2,093 | 2,331 | 302,861 | | | 2018/07/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | | 千ユーロ | 1,347 | 1,555 | 202,058 | | | 2019/07/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.5000 | | 千ユーロ | 1,146 | 1,340 | 174,053 | | | 2020/07/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | | 千ユーロ | 1,349 | 2,077 | 269,781 | | | 2042/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500 | | 千ユーロ | 1,463 | 1,732 | 224,956 | | | 2021/07/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | | 千ユーロ | 1,465 | 1,513 | 196,515 | | | 2017/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 | | 千ユーロ | 1,438 | 1,640 | 213,110 | | | 2022/07/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | | 千ユーロ | 866 | 1,052 | 136,730 | | | 2033/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | | 千ユーロ | 1,477 | 1,527 | 198,412 | | | 2018/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | | 千ユーロ | 1,385 | 1,539 | 199,895 | | | 2023/07/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | | 千ユーロ | 575 | 603 | 78,323 | | | 2019/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | | 千ユーロ | 317 | 320 | 41,680 | | | 2017/04/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | | 千ユーロ | 955 | 1,269 | 164,903 | | | 2047/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | | 千ユーロ | 1,620 | 1,835 | 238,383 | | | 2024/07/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 | | 千ユーロ | 1,374 | 1,399 | 181,804 | | | 2020/01/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | - | | 千ユーロ | 749 | 754 | 98,048 | | | 2018/04/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 | | 千ユーロ | 943 | 911 | 118,436 | | | 2025/07/15 |
| 国小計 | 銘金 | 柄数 | 22銘柄 | | | | | | 25,606 | 30,210 | 3,923,765 | | | | |
| ユーロ (ベルギー) | | Belgium Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.8000 | | 千ユーロ | 1,163 | 1,168 | 151,721 | | | 2025/06/22 |
| | | Belgium Government Bond | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | | 千ユーロ | 349 | 330 | 42,972 | | | 2031/06/22 |

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 | 未 償 還 金 額 | | 償 還 年 月 日 |
|------------|-------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | | | 評 価 | | |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| | 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 金額 | 23銘柄 | | 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 |
| | 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 金額 | 43銘柄 | | 97,396 | 117,550 | 15,267,493 | |

| 区分 | 銘柄 | 種類 | 年 利率 | 額 面 金 額 | 未 償 還 金 額 | | | 償 還 年 月 日 |
|------------|-------------------------|------|---------|---------------|---------------|---------------|------------|-----------|
| | | | | | 評 価 額 | | | |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 千 円 | |
| ユーロ (ドイツ) | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500% | 千ユーロ 774 | 千ユーロ 1,151 | 千円 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 | |
| | 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 金額 | 51銘柄 | | 77,160 | 91,742 | 11,915,494 | | |
| ユーロ (スペイン) | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 千ユーロ 3,108 | 千ユーロ 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 | |

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 | 未 償 還 金 額 | | | 償 還 年 月 日 |
|------------|-----------------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|------------|-----------|
| | | | | | 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 | | |
| | 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 金額 | 35銘柄 | | 56,527 | 67,542 | 8,772,406 | | |
| ユーロ (イタリア) | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| | 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 | |

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 未 | | | 償 還 年 月 日 |
|--------------|-----------------------------------|---------|--------|---------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | | | | | 評 価 額 | | | |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 千 円 | 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 | 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 |
| | 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 額 | 59銘柄 | | 99,157 | 120,989 | 15,714,095 | | |
| ユーロ (フィンランド) | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| | 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 額 | 15銘柄 | | 6,284 | 7,155 | 929,311 | | |
| ユーロ (オーストリア) | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| | 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 | | 2017/07/15 |
| | 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 額 | 20銘柄 | | 15,300 | 18,722 | 2,431,655 | | |
| 通貨小計 | 銘 柄 数 額 | 280銘柄 | | 409,987 | 494,094 | 64,172,933 | | |
| 合 計 | 銘 柄 数 額 | 729銘柄 | | | | 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 |
| | 千円 | % |
| 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) 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 A 1,705,324,690円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A (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5 0 V A (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3 0 V A (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5 0 V A (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、D C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3 0 453,561,180円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 223,580,955円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 140,934,888円、D Cダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 208,558,781円、D C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、D Cダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 51,355,053円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 11,127,145円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 11,074,521円、D C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4 0 V A 1,816,582,601円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 190,939,449円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 7,736,607,136円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 546,037,516円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 350,468,264円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A (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2 5 30,209,709円、ダイワライフスタイル5 0 48,765,591円、ダイワライフスタイル7 5 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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

運用報告書 第11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）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の第11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NOMURA-BPI総合指数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 | 内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。） |
| 運用方法 | 主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下 |

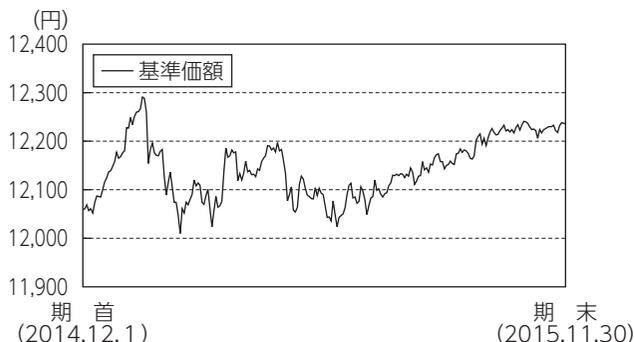
大和投資信託

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



| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | NOMURA-BPI 総 合 指 数 | | 公 社 債 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|-----------------|---------|-------|-----------------------|-------|------------------|----------------|
| | 円 | 騰 落 率 | ベンチマーク | 騰 落 率 | | |
| (期首)2014年12月1日 | 12,059 | — | 12,076 | — | 98.0 | — |
| 12月末 | 12,176 | 1.0 | 12,196 | 1.0 | 99.4 | — |
| 2015年1月末 | 12,179 | 1.0 | 12,199 | 1.0 | 99.3 | — |
| 2月末 | 12,114 | 0.5 | 12,131 | 0.5 | 99.3 | — |
| 3月末 | 12,120 | 0.5 | 12,139 | 0.5 | 99.3 | — |
| 4月末 | 12,160 | 0.8 | 12,180 | 0.9 | 99.2 | — |
| 5月末 | 12,103 | 0.4 | 12,122 | 0.4 | 98.5 | — |
| 6月末 | 12,097 | 0.3 | 12,115 | 0.3 | 99.4 | — |
| 7月末 | 12,132 | 0.6 | 12,150 | 0.6 | 99.3 | — |
| 8月末 | 12,152 | 0.8 | 12,170 | 0.8 | 98.5 | — |
| 9月末 | 12,191 | 1.1 | 12,205 | 1.1 | 99.4 | — |
| 10月末 | 12,237 | 1.5 | 12,252 | 1.5 | 99.1 | — |
| (期末)2015年11月30日 | 12,236 | 1.5 | 12,250 | 1.4 | 96.9 | — |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) NOMURA-BPI総合指数は、同指数の原データをもとに、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。NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数であり、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その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

(注3) 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4) 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

【基準価額・騰落率】

期首：12,059円 期末：12,236円 騰落率：1.5%

【基準価額の主な変動要因】

債券からの利息収入に加えて、金利水準の低下による債券の値上がり益が発生したことにより、ベンチマーク (NOMURA-BPI総合指数) の騰落率は1.4%となりました。同指数への連動をめざす当ファンドも値上がりし、期末の基準価額は12,236円、騰落率はベンチマークとほぼ同等の1.5%となりました。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内長期金利は、期首から2015年1月中旬にかけて、世界経済の成長鈍化観測や原油価格急落によるインフレ圧力低下などを受けて欧米長期金利が大きく低下したことや、日銀の量的・質的金融緩和の強化により国債需給が一段と改善したことなどを背景に、低下基調を強めました。1月下旬以降は、株価の上昇や低調な国債入札などを受けて金利は上昇しました。3月半ばからは、ECB (欧州中央銀行) による国債買い入れの開始や、FOMC (米国連邦公開市場委員会) での低水準の政策金利見通しなどから欧米長期金利が低下したことを受けて、国内長期金利も低下しました。4月下旬以降は、欧米の早期金融引き締め観測や国内景況感の改善、株価の上昇などにより、金利は上昇しました。6月半ばからは、ギリシャのデフォルト (債務不履行) 懸念や中国経済の先行き不透明感、新興国通貨安の進行、国内景況感の悪化、米国の利上げ先送り観測、株価の下落などを背景に、金利は低下基調が続きました。10月以降は、株価は上昇に転じましたが良好な国債需給が下支えとなり、金利は低位で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後も、ベンチマーク (NOMURA-BPI総合指数) との高い連動性を維持するように運用を行ないます。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド (国債以外の債券における国債との利回り格差) への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

◆ポートフォリオについて

当ファンドの騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデレション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は0.1%で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッドの変動に対する感応度を適切にコントロールしたほか、社債の信用スプレッドも落ち着いた動きが続いたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。

《今後の運用方針》

ベンチマークと高い連動性を維持するように運用を行なっています。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッドへの感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、当ファンドは現在、NOMURA-BPI総合指数に含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ 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 | － |
| 合計 | － |

(注) 費用の項目および算出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。

■ 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 |
|---|-------|-----------|------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国債証券 | 3,375,937 | 3,857,622 (－) |
| | 地方債証券 | 521,686 | 305,775 (－) |
| 内 | 特殊債券 | 306,511 | 302,126 (－) |
| | 社債券 | 401,127 | 607,108 (－) |

(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) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。
(注4) 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 | 金額 | 売付 | 金額 |
| | | 銘柄 | 千円 | 銘柄 | 千円 |
| 124 | 5年国債 0.1% 2020/6/20 | 205,221 | 349 | 2年国債 0.1% 2017/2/15 | 170,286 |
| 123 | 5年国債 0.1% 2020/3/20 | 195,042 | 122 | 5年国債 0.1% 2019/12/20 | 135,202 |
| 122 | 5年国債 0.1% 2019/12/20 | 185,373 | 344 | 2年国債 0.1% 2016/9/15 | 135,178 |
| 338 | 10年国債 0.4% 2025/3/20 | 175,597 | 307 | 10年国債 1.3% 2020/3/20 | 124,664 |
| 339 | 10年国債 0.4% 2025/6/20 | 174,164 | 123 | 5年国債 0.1% 2020/3/20 | 105,076 |
| 349 | 2年国債 0.1% 2017/2/15 | 170,261 | 378 | 東北電力 3.85% 2016/4/25 | 104,021 |
| 125 | 5年国債 0.1% 2020/9/20 | 120,337 | 95 | 5年国債 0.6% 2016/3/20 | 102,751 |
| 337 | 10年国債 0.3% 2024/12/20 | 117,724 | 293 | 大阪府公債 2.1% 2016/8/30 | 102,156 |
| 119 | 5年国債 0.1% 2019/6/20 | 115,152 | 18-2 | 北九州市債 1.79% 2016/12/20 | 101,816 |
| 340 | 10年国債 0.4% 2025/9/20 | 114,061 | 18-4 | 札幌市公債 1.8% 2016/9/20 | 101,803 |

(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。

■ 組入資産明細表

(1) 国内(邦貨建)公社債(種類別、新株予約権付社債券(転換社債券)を除く)

| 作成期 | 当 | | | 期 | | | 末 | | |
|--------------|------------|------------|------|-------------|-----------|------|------|------|--|
| | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | うちBB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 | |
| 区分 | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % | % | |
| 国債証券 | 8,937,000 | 9,796,404 | 67.4 | － | 54.4 | 12.7 | － | 0.3 | |
| 地方債証券 | 1,710,800 | 1,769,345 | 12.2 | － | 2.1 | 6.4 | － | 3.6 | |
| 特殊債券(除く金融債券) | 1,250,000 | 1,290,663 | 8.9 | － | 1.4 | 4.3 | － | 3.2 | |
| 金融債券 | 100,000 | 100,294 | 0.7 | － | － | － | － | 0.7 | |
| 普通社債券 | 1,103,000 | 1,125,529 | 7.7 | － | 0.7 | 4.9 | － | 2.1 | |
| 合計 | 13,100,800 | 14,082,236 | 96.9 | － | 58.7 | 28.4 | － | 9.9 | |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2) 国内(邦貨建)公社債(銘柄別、新株予約権付社債券(転換社債券)を除く)

| 区分 | 当 | | | 期 | | | 末 | |
|------|-------|--------|---------|---------|------------|--|---|--|
| | 銘柄 | 年利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 | | | |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | | | | |
| 357 | 2年国債 | 0.1000 | 45,000 | 45,096 | 2017/10/15 | | | |
| 114 | 5年国債 | 0.3000 | 62,000 | 62,529 | 2018/09/20 | | | |
| 115 | 5年国債 | 0.2000 | 55,000 | 55,315 | 2018/09/20 | | | |
| 296 | 10年国債 | 1.5000 | 35,000 | 36,474 | 2018/09/20 | | | |
| 40 | 20年国債 | 2.3000 | 51,000 | 54,291 | 2018/09/20 | | | |
| 116 | 5年国債 | 0.2000 | 133,000 | 133,809 | 2018/12/20 | | | |
| 297 | 10年国債 | 1.4000 | 20,000 | 20,853 | 2018/12/20 | | | |
| 298 | 10年国債 | 1.3000 | 61,000 | 63,418 | 2018/12/20 | | | |
| 117 | 5年国債 | 0.2000 | 99,000 | 99,635 | 2019/03/20 | | | |
| 299 | 10年国債 | 1.3000 | 10,000 | 10,426 | 2019/03/20 | | | |
| 300 | 10年国債 | 1.5000 | 8,000 | 8,394 | 2019/03/20 | | | |
| 41 | 20年国債 | 1.5000 | 40,000 | 41,970 | 2019/03/20 | | | |
| 42 | 20年国債 | 2.6000 | 22,000 | 23,881 | 2019/03/20 | | | |
| 119 | 5年国債 | 0.1000 | 31,000 | 31,093 | 2019/06/20 | | | |
| 301 | 10年国債 | 1.5000 | 35,000 | 36,849 | 2019/06/20 | | | |
| 302 | 10年国債 | 1.4000 | 54,000 | 56,661 | 2019/06/20 | | | |
| 120 | 5年国債 | 0.2000 | 10,000 | 10,070 | 2019/09/20 | | | |
| 121 | 5年国債 | 0.1000 | 25,000 | 25,080 | 2019/09/20 | | | |
| 303 | 10年国債 | 1.4000 | 44,000 | 46,305 | 2019/09/20 | | | |
| 304 | 10年国債 | 1.3000 | 50,000 | 52,430 | 2019/09/20 | | | |
| 43 | 20年国債 | 2.9000 | 14,000 | 15,533 | 2019/09/20 | | | |
| 122 | 5年国債 | 0.1000 | 50,000 | 50,161 | 2019/12/20 | | | |
| 305 | 10年国債 | 1.3000 | 100,000 | 105,157 | 2019/12/20 | | | |
| 123 | 5年国債 | 0.1000 | 90,000 | 90,288 | 2020/03/20 | | | |
| 306 | 10年国債 | 1.4000 | 10,000 | 10,587 | 2020/03/20 | | | |
| 307 | 10年国債 | 1.3000 | 5,000 | 5,272 | 2020/03/20 | | | |
| 44 | 20年国債 | 2.5000 | 32,000 | 35,398 | 2020/03/20 | | | |
| 45 | 20年国債 | 2.4000 | 20,000 | 22,038 | 2020/03/20 | | | |
| 124 | 5年国債 | 0.1000 | 185,000 | 185,586 | 2020/06/20 | | | |
| 308 | 10年国債 | 1.3000 | 100,000 | 105,744 | 2020/06/20 | | | |
| 309 | 10年国債 | 1.1000 | 103,000 | 107,980 | 2020/06/20 | | | |
| 46 | 20年国債 | 2.2000 | 19,000 | 20,869 | 2020/06/22 | | | |
| 125 | 5年国債 | 0.1000 | 120,000 | 120,373 | 2020/09/20 | | | |
| 310 | 10年国債 | 1.0000 | 30,000 | 31,387 | 2020/09/20 | | | |
| 311 | 10年国債 | 0.8000 | 42,000 | 43,539 | 2020/09/20 | | | |

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

| 区 分 | 当 期 | 年 率 | 末 | | | 償還年月日 |
|-----|-------|--------|---------|---------|-----|------------|
| | | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 價 値 | |
| 銘 柄 | 柄 | % | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 47 | 20年国債 | 2.2000 | 23,000 | 25,387 | | 2020/09/21 |
| 312 | 10年国債 | 1.2000 | 89,000 | 94,202 | | 2020/12/20 |
| 48 | 20年国債 | 2.5000 | 9,000 | 10,116 | | 2020/12/21 |
| 313 | 10年国債 | 1.3000 | 75,000 | 79,972 | | 2021/03/20 |
| 314 | 10年国債 | 1.1000 | 77,000 | 81,291 | | 2021/03/20 |
| 49 | 20年国債 | 2.1000 | 4,000 | 4,435 | | 2021/03/22 |
| 50 | 20年国債 | 1.9000 | 30,000 | 32,951 | | 2021/03/22 |
| 315 | 10年国債 | 1.2000 | 90,000 | 95,725 | | 2021/06/20 |
| 316 | 10年国債 | 1.1000 | 59,000 | 62,427 | | 2021/06/20 |
| 51 | 20年国債 | 2.0000 | 25,000 | 27,698 | | 2021/06/21 |
| 317 | 10年国債 | 1.1000 | 35,000 | 37,114 | | 2021/09/20 |
| 318 | 10年国債 | 1.0000 | 10,000 | 10,546 | | 2021/09/20 |
| 52 | 20年国債 | 2.1000 | 19,000 | 21,247 | | 2021/09/21 |
| 319 | 10年国債 | 1.1000 | 129,000 | 137,085 | | 2021/12/20 |
| 320 | 10年国債 | 1.0000 | 35,000 | 36,982 | | 2021/12/20 |
| 53 | 20年国債 | 2.1000 | 13,000 | 14,602 | | 2021/12/20 |
| 54 | 20年国債 | 2.2000 | 14,000 | 15,810 | | 2021/12/20 |
| 321 | 10年国債 | 1.0000 | 65,000 | 68,810 | | 2022/03/20 |
| 322 | 10年国債 | 0.9000 | 75,000 | 78,926 | | 2022/03/20 |
| 55 | 20年国債 | 2.0000 | 41,000 | 45,976 | | 2022/03/21 |
| 323 | 10年国債 | 0.8000 | 60,000 | 63,245 | | 2022/06/20 |
| 324 | 10年国債 | 0.9000 | 96,000 | 100,567 | | 2022/06/20 |
| 56 | 20年国債 | 2.0000 | 12,000 | 13,513 | | 2022/06/20 |
| 57 | 20年国債 | 1.9000 | 24,000 | 26,862 | | 2022/06/20 |
| 325 | 10年国債 | 0.8000 | 102,000 | 106,966 | | 2022/09/20 |
| 58 | 20年国債 | 1.9000 | 35,000 | 39,308 | | 2022/09/20 |
| 59 | 20年国債 | 1.7000 | 3,000 | 3,339 | | 2022/12/20 |
| 60 | 20年国債 | 1.4000 | 16,000 | 17,474 | | 2022/12/20 |
| 328 | 10年国債 | 0.6000 | 30,000 | 31,063 | | 2023/03/20 |
| 61 | 20年国債 | 1.0000 | 40,000 | 42,592 | | 2023/03/20 |
| 329 | 10年国債 | 0.8000 | 56,000 | 58,803 | | 2023/06/20 |
| 62 | 20年国債 | 0.8000 | 16,000 | 16,807 | | 2023/06/20 |
| 63 | 20年国債 | 1.8000 | 30,000 | 33,769 | | 2023/06/20 |
| 330 | 10年国債 | 0.8000 | 81,000 | 85,091 | | 2023/09/20 |
| 331 | 10年国債 | 0.6000 | 75,000 | 77,631 | | 2023/09/20 |
| 64 | 20年国債 | 1.9000 | 35,000 | 39,752 | | 2023/09/20 |
| 332 | 10年国債 | 0.6000 | 135,000 | 139,664 | | 2023/12/20 |
| 65 | 20年国債 | 1.9000 | 42,000 | 47,807 | | 2023/12/20 |
| 66 | 20年国債 | 1.8000 | 30,000 | 33,909 | | 2023/12/20 |
| 333 | 10年国債 | 0.6000 | 155,000 | 160,254 | | 2024/03/20 |
| 67 | 20年国債 | 1.9000 | 19,000 | 21,679 | | 2024/03/20 |
| 68 | 20年国債 | 2.2000 | 25,000 | 29,151 | | 2024/03/20 |
| 69 | 20年国債 | 2.1000 | 12,000 | 13,894 | | 2024/03/20 |
| 334 | 10年国債 | 0.6000 | 166,000 | 171,507 | | 2024/06/20 |
| 70 | 20年国債 | 2.4000 | 18,000 | 21,346 | | 2024/06/20 |
| 71 | 20年国債 | 2.2000 | 17,000 | 19,874 | | 2024/06/20 |
| 335 | 10年国債 | 0.5000 | 130,000 | 133,142 | | 2024/09/20 |
| 72 | 20年国債 | 2.1000 | 53,000 | 61,654 | | 2024/09/20 |
| 336 | 10年国債 | 0.5000 | 48,000 | 49,104 | | 2024/12/20 |
| 337 | 10年国債 | 0.3000 | 100,000 | 100,531 | | 2024/12/20 |
| 73 | 20年国債 | 2.0000 | 30,000 | 34,737 | | 2024/12/20 |
| 74 | 20年国債 | 2.1000 | 22,000 | 25,669 | | 2024/12/20 |
| 338 | 10年国債 | 0.4000 | 145,000 | 146,841 | | 2025/03/20 |

| 区 分 | 当 期 | 年 率 | 末 | | | 償還年月日 |
|-----|-------|--------|---------|---------|-----|------------|
| | | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 價 値 | |
| 銘 柄 | 柄 | % | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 75 | 20年国債 | 2.1000 | 14,000 | 16,367 | | 2025/03/20 |
| 76 | 20年国債 | 1.9000 | 25,000 | 28,773 | | 2025/03/20 |
| 339 | 10年国債 | 0.4000 | 158,000 | 159,761 | | 2025/06/20 |
| 78 | 20年国債 | 1.9000 | 17,000 | 19,597 | | 2025/06/20 |
| 79 | 20年国債 | 2.0000 | 14,000 | 16,269 | | 2025/06/20 |
| 80 | 20年国債 | 2.1000 | 20,000 | 23,439 | | 2025/06/20 |
| 340 | 10年国債 | 0.4000 | 109,000 | 110,037 | | 2025/09/20 |
| 81 | 20年国債 | 2.0000 | 18,000 | 20,952 | | 2025/09/20 |
| 82 | 20年国債 | 2.1000 | 28,000 | 32,860 | | 2025/09/20 |
| 83 | 20年国債 | 2.1000 | 25,000 | 29,404 | | 2025/12/20 |
| 84 | 20年国債 | 2.0000 | 27,000 | 31,477 | | 2025/12/20 |
| 85 | 20年国債 | 2.1000 | 31,000 | 36,518 | | 2026/03/20 |
| 86 | 20年国債 | 2.3000 | 6,000 | 7,187 | | 2026/03/20 |
| 87 | 20年国債 | 2.2000 | 20,000 | 23,759 | | 2026/03/20 |
| 88 | 20年国債 | 2.3000 | 33,000 | 39,626 | | 2026/06/20 |
| 89 | 20年国債 | 2.2000 | 15,000 | 17,859 | | 2026/06/20 |
| 90 | 20年国債 | 2.2000 | 37,000 | 44,146 | | 2026/09/20 |
| 91 | 20年国債 | 2.3000 | 18,000 | 21,663 | | 2026/09/20 |
| 92 | 20年国債 | 2.1000 | 45,000 | 53,320 | | 2026/12/20 |
| 93 | 20年国債 | 2.0000 | 18,000 | 21,146 | | 2027/03/20 |
| 94 | 20年国債 | 2.1000 | 36,000 | 42,706 | | 2027/03/20 |
| 95 | 20年国債 | 2.3000 | 30,000 | 36,331 | | 2027/06/20 |
| 96 | 20年国債 | 2.1000 | 23,000 | 27,330 | | 2027/06/20 |
| 97 | 20年国債 | 2.2000 | 25,000 | 30,036 | | 2027/09/20 |
| 98 | 20年国債 | 2.1000 | 29,000 | 34,516 | | 2027/09/20 |
| 99 | 20年国債 | 2.1000 | 43,000 | 51,226 | | 2027/12/20 |
| 100 | 20年国債 | 2.2000 | 35,000 | 42,160 | | 2028/03/20 |
| 101 | 20年国債 | 2.4000 | 20,000 | 24,572 | | 2028/03/20 |
| 102 | 20年国債 | 2.4000 | 10,000 | 12,308 | | 2028/06/20 |
| 103 | 20年国債 | 2.3000 | 21,000 | 25,583 | | 2028/06/20 |
| 104 | 20年国債 | 2.1000 | 24,000 | 28,652 | | 2028/06/20 |
| 105 | 20年国債 | 2.1000 | 38,000 | 45,423 | | 2028/09/20 |
| 106 | 20年国債 | 2.2000 | 21,000 | 25,355 | | 2028/09/20 |
| 107 | 20年国債 | 2.1000 | 45,000 | 53,852 | | 2028/12/20 |
| 108 | 20年国債 | 1.9000 | 18,000 | 21,087 | | 2028/12/20 |
| 109 | 20年国債 | 1.9000 | 35,000 | 41,006 | | 2029/03/20 |
| 110 | 20年国債 | 2.1000 | 26,000 | 31,127 | | 2029/03/20 |
| 111 | 20年国債 | 2.2000 | 35,000 | 42,388 | | 2029/06/20 |
| 112 | 20年国債 | 2.1000 | 34,000 | 40,747 | | 2029/06/20 |
| 113 | 20年国債 | 2.1000 | 66,000 | 79,121 | | 2029/09/20 |
| 114 | 20年国債 | 2.1000 | 45,000 | 53,955 | | 2029/12/20 |
| 115 | 20年国債 | 2.2000 | 17,000 | 20,617 | | 2029/12/20 |
| 2 | 30年国債 | 2.4000 | 9,000 | 11,151 | | 2030/02/20 |
| 116 | 20年国債 | 2.2000 | 27,000 | 32,774 | | 2030/03/20 |
| 117 | 20年国債 | 2.1000 | 37,000 | 44,394 | | 2030/03/20 |
| 3 | 30年国債 | 2.3000 | 4,000 | 4,904 | | 2030/05/20 |
| 118 | 20年国債 | 2.0000 | 33,000 | 39,155 | | 2030/06/20 |
| 119 | 20年国債 | 1.8000 | 13,000 | 15,067 | | 2030/06/20 |
| 120 | 20年国債 | 1.6000 | 37,000 | 41,838 | | 2030/06/20 |
| 121 | 20年国債 | 1.9000 | 56,000 | 65,672 | | 2030/09/20 |
| 122 | 20年国債 | 1.8000 | 14,000 | 16,217 | | 2030/09/20 |
| 4 | 30年国債 | 2.9000 | 8,000 | 10,505 | | 2030/11/20 |
| 123 | 20年国債 | 2.1000 | 42,000 | 50,452 | | 2030/12/20 |

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

| 区 分 | 当 期 銘 柄 | 年 利 率 | 期 末 | | 償 還 年 月 日 |
|-----|------------|--------|---------|--------|------------|
| | | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| | | % | 千 円 | 千 円 | |
| 124 | 20年国債 | 2.0000 | 30,000 | 35,600 | 2030/12/20 |
| 125 | 20年国債 | 2.2000 | 25,000 | 30,370 | 2031/03/20 |
| 126 | 20年国債 | 2.0000 | 21,000 | 24,909 | 2031/03/20 |
| 127 | 20年国債 | 1.9000 | 24,000 | 28,134 | 2031/03/20 |
| 5 | 30年国債 | 2.2000 | 8,000 | 9,728 | 2031/05/20 |
| 128 | 20年国債 | 1.9000 | 27,000 | 31,631 | 2031/06/20 |
| 129 | 20年国債 | 1.8000 | 28,000 | 32,386 | 2031/06/20 |
| 130 | 20年国債 | 1.8000 | 28,000 | 32,381 | 2031/09/20 |
| 131 | 20年国債 | 1.7000 | 40,000 | 45,658 | 2031/09/20 |
| 6 | 30年国債 | 2.4000 | 9,000 | 11,205 | 2031/11/20 |
| 132 | 20年国債 | 1.7000 | 25,000 | 28,504 | 2031/12/20 |
| 133 | 20年国債 | 1.8000 | 40,000 | 46,214 | 2031/12/20 |
| 134 | 20年国債 | 1.8000 | 25,000 | 28,853 | 2032/03/20 |
| 135 | 20年国債 | 1.7000 | 24,000 | 27,330 | 2032/03/20 |
| 136 | 20年国債 | 1.6000 | 20,000 | 22,468 | 2032/03/20 |
| 7 | 30年国債 | 2.3000 | 12,000 | 14,768 | 2032/05/20 |
| 137 | 20年国債 | 1.7000 | 18,000 | 20,471 | 2032/06/20 |
| 138 | 20年国債 | 1.5000 | 24,000 | 26,551 | 2032/06/20 |
| 139 | 20年国債 | 1.6000 | 24,000 | 26,923 | 2032/06/20 |
| 140 | 20年国債 | 1.7000 | 67,000 | 76,098 | 2032/09/20 |
| 8 | 30年国債 | 1.8000 | 5,000 | 5,755 | 2032/11/22 |
| 9 | 30年国債 | 1.4000 | 11,000 | 11,954 | 2032/12/20 |
| 141 | 20年国債 | 1.7000 | 48,000 | 54,440 | 2032/12/20 |
| 142 | 20年国債 | 1.8000 | 27,000 | 31,050 | 2032/12/20 |
| 10 | 30年国債 | 1.1000 | 15,000 | 15,541 | 2033/03/20 |
| 143 | 20年国債 | 1.6000 | 48,000 | 53,589 | 2033/03/20 |
| 144 | 20年国債 | 1.5000 | 14,000 | 15,407 | 2033/03/20 |
| 11 | 30年国債 | 1.7000 | 9,000 | 10,175 | 2033/06/20 |
| 145 | 20年国債 | 1.7000 | 72,000 | 81,407 | 2033/06/20 |
| 12 | 30年国債 | 2.1000 | 11,000 | 13,146 | 2033/09/20 |
| 146 | 20年国債 | 1.7000 | 67,000 | 75,628 | 2033/09/20 |
| 13 | 30年国債 | 2.0000 | 11,000 | 12,949 | 2033/12/20 |
| 147 | 20年国債 | 1.6000 | 73,000 | 81,059 | 2033/12/20 |
| 14 | 30年国債 | 2.4000 | 22,000 | 27,334 | 2034/03/20 |
| 148 | 20年国債 | 1.5000 | 64,000 | 69,867 | 2034/03/20 |
| 15 | 30年国債 | 2.5000 | 21,000 | 26,445 | 2034/06/20 |
| 149 | 20年国債 | 1.5000 | 60,000 | 65,358 | 2034/06/20 |
| 16 | 30年国債 | 2.5000 | 17,000 | 21,390 | 2034/09/20 |
| 150 | 20年国債 | 1.4000 | 73,000 | 78,115 | 2034/09/20 |
| 17 | 30年国債 | 2.4000 | 17,000 | 21,095 | 2034/12/20 |
| 151 | 20年国債 | 1.2000 | 65,000 | 67,133 | 2034/12/20 |
| 18 | 30年国債 | 2.3000 | 20,000 | 24,442 | 2035/03/20 |
| 152 | 20年国債 | 1.2000 | 61,000 | 62,820 | 2035/03/20 |
| 19 | 30年国債 | 2.3000 | 15,000 | 18,308 | 2035/06/20 |
| 153 | 20年国債 | 1.3000 | 72,000 | 75,162 | 2035/06/20 |
| 20 | 30年国債 | 2.5000 | 16,000 | 20,082 | 2035/09/20 |
| 154 | 20年国債 | 1.2000 | 50,000 | 51,145 | 2035/09/20 |
| 21 | 30年国債 | 2.3000 | 16,000 | 19,489 | 2035/12/20 |
| 22 | 30年国債 | 2.5000 | 17,000 | 21,302 | 2036/03/20 |
| 23 | 30年国債 | 2.5000 | 20,000 | 25,049 | 2036/06/20 |
| 24 | 30年国債 | 2.5000 | 15,000 | 18,777 | 2036/09/20 |
| 25 | 30年国債 | 2.3000 | 17,000 | 20,645 | 2036/12/20 |
| 26 | 30年国債 | 2.4000 | 32,000 | 39,449 | 2037/03/20 |
| 27 | 30年国債 | 2.5000 | 31,000 | 38,835 | 2037/09/20 |

| 区 分 | 当 期 銘 柄 | 年 利 率 | 期 末 | | 償 還 年 月 日 |
|-----------------|------------|--------|--------------------|-----------|------------|
| | | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| | | % | 千 円 | 千 円 | |
| 28 | 30年国債 | 2.5000 | 35,000 | 43,891 | 2038/03/20 |
| 29 | 30年国債 | 2.4000 | 34,000 | 42,018 | 2038/09/20 |
| 30 | 30年国債 | 2.3000 | 40,000 | 48,675 | 2039/03/20 |
| 31 | 30年国債 | 2.2000 | 38,000 | 45,497 | 2039/09/20 |
| 32 | 30年国債 | 2.3000 | 47,000 | 57,318 | 2040/03/20 |
| 33 | 30年国債 | 2.0000 | 57,000 | 65,967 | 2040/09/20 |
| 34 | 30年国債 | 2.2000 | 55,000 | 66,057 | 2041/03/20 |
| 35 | 30年国債 | 2.0000 | 53,000 | 61,352 | 2041/09/20 |
| 36 | 30年国債 | 2.0000 | 53,000 | 61,291 | 2042/03/20 |
| 37 | 30年国債 | 1.9000 | 59,000 | 66,900 | 2042/09/20 |
| 38 | 30年国債 | 1.8000 | 35,000 | 38,838 | 2043/03/20 |
| 39 | 30年国債 | 1.9000 | 36,000 | 40,753 | 2043/06/20 |
| 40 | 30年国債 | 1.8000 | 31,000 | 34,340 | 2043/09/20 |
| 41 | 30年国債 | 1.7000 | 27,000 | 29,249 | 2043/12/20 |
| 42 | 30年国債 | 1.7000 | 33,000 | 35,730 | 2044/03/20 |
| 43 | 30年国債 | 1.7000 | 37,000 | 40,039 | 2044/06/20 |
| 44 | 30年国債 | 1.7000 | 35,000 | 37,854 | 2044/09/20 |
| 45 | 30年国債 | 1.5000 | 38,000 | 39,230 | 2044/12/20 |
| 46 | 30年国債 | 1.5000 | 40,000 | 41,259 | 2045/03/20 |
| 47 | 30年国債 | 1.6000 | 44,000 | 46,421 | 2045/06/20 |
| 48 | 30年国債 | 1.4000 | 35,000 | 35,184 | 2045/09/20 |
| 1 | 40年国債 | 2.4000 | 24,000 | 30,073 | 2048/03/20 |
| 2 | 40年国債 | 2.2000 | 23,000 | 27,649 | 2049/03/20 |
| 3 | 40年国債 | 2.2000 | 19,000 | 22,839 | 2050/03/20 |
| 4 | 40年国債 | 2.2000 | 30,000 | 36,095 | 2051/03/20 |
| 5 | 40年国債 | 2.0000 | 35,000 | 40,150 | 2052/03/20 |
| 6 | 40年国債 | 1.9000 | 19,000 | 21,249 | 2053/03/20 |
| 7 | 40年国債 | 1.7000 | 31,000 | 32,867 | 2054/03/20 |
| 8 | 40年国債 | 1.4000 | 24,000 | 23,262 | 2055/03/20 |
| 種別 小計 | 銘柄数 金額 | | 224銘柄 8,937,000 | 9,796,404 | |
| 種別 小計 | 銘柄数 金額 | | 17銘柄 1,710,800 | 1,769,345 | |
| 種別 小計 | 銘柄数 金額 | | 17銘柄 1,710,800 | 1,769,345 | |
| 特殊債券 (除く金額別) | | | | | |
| 16 | 政保政策投資B | 1.8000 | 100,000 | 102,154 | 2017/02/28 |
| 27 | 政保道路機構 | 1.8000 | 50,000 | 51,077 | 2017/02/28 |
| 27 | 国際協力銀行 | 1.7700 | 100,000 | 102,147 | 2017/03/17 |
| 26 | 公営企業 | 1.7800 | 100,000 | 102,196 | 2017/03/24 |

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

| 当 | | 期 | | 末 | |
|----------|---------------|--------|------------|------------|------------|
| 区 分 | 銘 柄 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 28 公営企業 | 1.8900 | 100,000 | 103,393 | 2017/10/25 |
| | 3 政保地方公共6年 | 0.4000 | 100,000 | 100,712 | 2018/01/30 |
| | 30 国際協力銀行 | 1.8700 | 100,000 | 104,028 | 2018/03/20 |
| | 56 政保道路機構 | 1.4000 | 100,000 | 103,183 | 2018/04/20 |
| | 2 政保地方公営機 | 1.6000 | 100,000 | 104,543 | 2018/11/16 |
| | 5 日本政策投資CO | 1.7450 | 100,000 | 105,305 | 2019/03/20 |
| | 98 政保道路機構 | 1.3000 | 100,000 | 104,989 | 2020/01/31 |
| | 122 政保道路機構 | 0.9000 | 100,000 | 103,933 | 2020/11/30 |
| | 190 政保道路機構 | 0.6050 | 100,000 | 102,998 | 2023/05/31 |
| 種別 小計 | 13銘柄 | | 1,250,000 | 1,290,663 | |
| 金融債券 | い744 利付商工債 | 0.3500 | 100,000 | 100,294 | 2017/05/26 |
| 種別 小計 | 1銘柄 | | 100,000 | 100,294 | |
| 普通社債券 | 28 みずほコーポレート | 0.5150 | 100,000 | 100,434 | 2017/01/25 |
| | 137 三菱東京UFJKB | 0.2750 | 100,000 | 100,187 | 2017/07/20 |
| | 10 首都高速道路 | 0.3360 | 100,000 | 100,378 | 2017/09/20 |
| | 261 北海道電力 | 2.7750 | 3,000 | 3,149 | 2017/11/24 |
| | 4 成田国際空港 | 1.7000 | 100,000 | 103,217 | 2017/12/20 |
| | 15 NTTドコモ | 1.9600 | 100,000 | 104,729 | 2018/06/20 |
| | 35 みずほBK | 0.2850 | 100,000 | 100,247 | 2019/01/25 |
| | 27 東日本高速道 | 0.2480 | 100,000 | 100,300 | 2019/06/20 |
| | 164 オリックス | 1.1460 | 100,000 | 103,083 | 2019/08/07 |
| | 62 トヨタファイナンス | 0.2030 | 100,000 | 100,100 | 2019/12/20 |
| | 70 東日本旅客鉄道 | 1.1930 | 100,000 | 104,833 | 2020/09/29 |
| | 33 中日本高速道 | 1.0840 | 100,000 | 104,868 | 2021/09/17 |
| 種別 小計 | 12銘柄 | | 1,103,000 | 1,125,529 | |
| 合計 | 267銘柄 | | 13,100,800 | 14,082,236 | |

(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 |
| 公社債 | 14,082,236 | 96.3 |
| コール・ローン等、その他 | 545,574 | 3.7 |
| 投資信託財産総額 | 14,627,811 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■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 | 14,627,811,930円 |
| コール・ローン等 | 396,862,219 |
| 公社債(評価額) | 14,082,236,990 |
| 未収入金 | 100,179,000 |
| 未収利息 | 47,286,771 |
| 前払費用 | 1,246,950 |
| (B) 負債 | 94,270,690 |
| 未払金 | 68,267,690 |
| 未払解約金 | 26,453,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 14,533,091,240 |
| 元本 | 11,877,469,267 |
| 次期繰越損益金 | 2,655,621,973 |
| (D) 受益権総口数 | 11,877,469,267口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 12,236円 |

*期首における元本額は12,283,016,710円、当期中における追加設定元本額は1,888,134,327円、同解約元本額は2,293,681,770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・ライフ・バランス30 3,883,405,627円、ダイワ・ライフ・バランス50 2,084,412,987円、ダイワ・ライフ・バランス70 657,302,460円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 488,959,205円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) 397,708,621円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 119,915,940円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 55,681,571円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 32,673,590円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,443,902円、ダイワ世界バランスファンド40VA 3,024,230,544円、ダイワ世界バランスファンド60VA 267,014,453円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA 318,164,716円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA 546,555,651円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は12,236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 | 181,802,759円 |
| 受取利息 | 181,802,759 |
| (B) 有価証券売買損益 | 29,376,220 |
| 売買益 | 98,133,240 |
| 売買損 | △ 68,757,020 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 211,178,979 |
| (D) 前期繰越損益金 | 2,528,607,551 |
| (E) 解約差損益金 | △ 488,936,230 |
| (F) 追加信託差損益金 | 404,771,673 |
| (G) 合計(C+D+E+F) | 2,655,621,973 |
| 次期繰越損益金(G) | 2,655,621,973 |

(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。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

運用報告書 第21期 (決算日 2015年9月15日)

(計算期間 2015年3月17日～2015年9月15日)

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの第21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 | 信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。） |
| 運用方法 | ①海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。 ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ. 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 ロ. 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。 ③外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。 ⑤外貨建資産の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。 |
| 投資信託証券組入制限 | 無制限 |

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



| 年 月 日 | 基準 価 額 | | S & P先進国 R E I T 指数 (除く日本、円換算) | | 投資信託証券 組入比率 |
|----------------|--------|------------|-----------------------------------|------------|----------------|
| | 円 | 騰落率 (%) | 騰落率 (%) | 騰落率 (%) | |
| (期首)2015年3月16日 | 20,227 | - | 21,170 | - | 98.5 |
| 3月末 | 20,646 | 2.1 | 21,699 | 2.5 | 97.3 |
| 4月末 | 20,209 | △0.1 | 20,899 | △1.3 | 98.4 |
| 5月末 | 20,731 | 2.5 | 21,411 | 1.1 | 98.2 |
| 6月末 | 19,644 | △2.9 | 20,164 | △4.8 | 98.6 |
| 7月末 | 20,722 | 2.4 | 21,205 | 0.2 | 97.5 |
| 8月末 | 19,566 | △3.3 | 19,989 | △5.6 | 98.1 |
| (期末)2015年9月15日 | 19,103 | △5.6 | 19,465 | △8.1 | 98.3 |

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) S & P先進国 R E I T 指数 (除く日本、円換算) は、S & P先進国 R E I T 指数 (除く日本、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日
 を10,000として大和投資信託が計算したものです。S & P先進国 R E I T 指数 (除く日本、米ドルベース) の所有権およびその他一切の権利は、
 S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。
 (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。

《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：20,227円 期末：19,103円 騰落率：△5.6%

【基準価額の主な変動要因】

米国を中心に海外リート市況が下落したことがマイナス要因となり、
 当期の基準価額は値下がりしました。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は総じて下落しました。

米国リート市況は下落しました。2015年4月下旬に発表された
 米国の1-3月期GDP (国内総生産) 成長率は低調な伸びにとど
 まったものの、景気減速は冬の寒波の影響による一時的なものとの
 見方を背景に年内の利上げ観測が徐々に強まり、長期国債利回りが
 上昇したことが嫌気され、4月から6月にかけてリート市況は下
 落しました。その後は、F R B (米国連邦準備制度理事会) が慎重
 なペースでの利上げを示唆したことで金融政策に対する安心感が広
 がり、市況は上昇に転じました。しかし、8月に入り中国経済の減
 速に対する懸念が急速に強まり、世界的に株式市況が大幅に下落し
 たため米国リート市況も下落し、期末にかけて軟調な展開となりま
 した。

米国以外の国・地域も総じて下落しました。金融緩和など景気支
 援策を打ち出しているにもかかわらず中国の景気減速に歯止めが
 からないことが、欧州やアジアの景気の先行きに対する警戒を強め、
 ユーロ圏やアジア・オセアニアは期末にかけて下げ足を速めました。

英国については、好調なロンドンの不動産市場を背景に主要リート
 の業績が堅調なものになったことが支援材料となり、小幅ながら上
 昇しました。

○為替相場

為替相場は、対円で主要通貨はまちまちの展開となりました。

米ドルは、米国の利上げ観測の強まりを背景に買われ、2015年
 5月中旬から8月中旬にかけて円安米ドル高基調が続きました。し
 かしその後は、世界的な株安や景気に対する不透明感の強まりを受
 けて利上げ観測が後退し、米ドルが売られて円高米ドル安に振れた
 ため、米ドルは上昇分を失いました。ユーロは、ユーロ圏の景気回
 復期待を背景に買われる展開となりました。加えて、8月以降は新
 興国経済への慎重な見方を背景に新興国通貨を売ってユーロを買
 う動きが広まったことも下支え要因となり、円安ユーロ高になりま
 した。英ポンドは、堅調な英国経済を背景に将来の利上げ観測が強
 まる場面もあったことから買われ、円安英ポンド高になりました。
 オーストラリア・ドルは、経済的に結び付きの深い中国経済の減速
 に対する懸念や金属価格の下落を背景に売られ、円高オーストラ
 リア・ドル安になりました。

◆前期における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&ステアーズ・キャ
 ピタル・マネジメント・イंक (以下、C & S) に運用の指図にか
 かる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。
 銘柄選択に際しては、良好な財務体質を有し、低コストでの資金
 調達により物件取得や事業拡大を図ることが可能であり、かつ保有
 不動産の価値と比較して価格が割安なリートを選択します。用途別
 では、米国では住宅施設やオフィスを保有するリート、欧州ではロ
 ンドンのオフィスや商業施設に加えてユーロ圏の商業施設、パリな
 ど主要都市のオフィスを保有するリートに注目しています。

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & S に運用の指図
 にかかる権限を委託しております。
 当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし保有不動産の
 価値など比べて魅力的であると考える銘柄に着目するとともに、安
 定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。

国・地域別配分では大きなリスクを取らず各地域にバランス良く投
 資を行ないましたが、E C B (欧州中央銀行) による追加金融緩和を
 受けて堅調に推移したフランスの商業施設リートなどの組入れを引
 下げ、ユーロ圏のオーバーウエート幅を縮小しました。また、リート
 価格が堅調に推移し割安感が後退したロンドンにオフィスを保有す
 るリートや産業施設リートなどを一部売却し、英国をニュートラル程
 度に引下げたほか、オフィス賃料の上昇ペースの鈍化が懸念されたため
 大手オフィスリート売却し、シンガポールをアンダーウエートに引
 下げました。一方、リート価格の下落により割安感が高まった商業
 施設大手リートや大手ホテルリートなどを買い増し、米国をニュート
 ラル程度に引上げました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設け
 ておりません。
 当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、それぞれ
 △5.6%、△8.1%となりました。

《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を
 委託し、今後の運用を行なってまいります。
 銘柄選択に際しては、良好な財務体質を有し、低コストでの資金調
 達により物件取得や事業拡大を図ることが可能であり、かつ保有不動産
 の価値と比較して価格が割安なリートを選択します。用途別では、米
 国では個人用倉庫や住宅施設を保有するリート、欧州ではロンドンの
 オフィスや商業施設、競争力の高い大規模な優良商業施設を保有するユーロ
 圏のリートに加えて、景気を持ち直しを背景に賃料上昇や空室率の改善が
 期待されるスペインやイタリアのリートにも注目しています。

■ 1万口当りの費用の明細

| 項目 | 当期 |
|---------------------|-------------|
| 売買委託手数料 (投資信託証券) | 11円 (11) |
| 有価証券取引税 (投資信託証券) | 2 (2) |
| その他費用 (保管費用) | 3 (3) |
| 合計 | 17 |

(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は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

投資信託証券

(2015年3月17日から2015年9月15日まで)

| | 買付 | | 売付 | |
|---|----------------------------------|------------------------------|------------------------|------------------------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 | 千口 8,489.043 () | 千アメリカ・ドル 269,215 () | 千口 9,706.745 () | 千アメリカ・ドル 268,344 () |
| | 千口 — () | 千カナダ・ドル — () | 千口 209.563 () | 千カナダ・ドル 7,382 () |
| | 千口 12,753.912 (△3,813.984) | 千オーストラリア・ドル 34,315 () | 千口 5,956.943 () | 千オーストラリア・ドル 39,781 () |
| 国 | 千口 399 () | 千香港ドル 18,457 () | 千口 6,843.5 () | 千香港ドル 55,147 () |

■ 主要な売買銘柄

投資信託証券

(2015年3月17日から2015年9月15日まで)

| 当 | | | | 期 | | | |
|-------------------------------------|---------------|-----------------|-------------|-------------------------------------|---------------|-----------------|-------------|
| 銘柄 | 買付 | | | 銘柄 | 売付 | | |
| | 口数 | 金額 | 平均単価 | | 口数 | 金額 | 平均単価 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ) | 千口 247.673 | 千円 5,699,172 | 円 23,010 | UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス) | 千口 126.556 | 千円 4,080,954 | 円 32,246 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC (アメリカ) | 1,449.962 | 3,675,498 | 2,534 | LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス) | 1,250.748 | 3,127,370 | 2,500 |
| HEALTH CARE REIT INC (アメリカ) | 312.683 | 2,904,752 | 9,289 | GOODMAN GROUP (オーストラリア) | 4,629.711 | 2,733,815 | 590 |
| KLEPIERRE (フランス) | 431.742 | 2,335,579 | 5,409 | GECINA SA (フランス) | 158.349 | 2,508,876 | 15,843 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS (アメリカ) | 458.896 | 2,092,907 | 4,560 | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC (アメリカ) | 1,161.62 | 2,320,262 | 1,997 |
| SCENTRE GROUP (オーストラリア) | 5,518.244 | 1,975,183 | 357 | EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ) | 245.618 | 2,251,378 | 9,166 |
| DDR CORP (アメリカ) | 909.584 | 1,928,071 | 2,119 | MACERICH CO/THE (アメリカ) | 215.919 | 2,100,605 | 9,728 |
| EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ) | 212.323 | 1,893,486 | 8,917 | KEPPEL REIT (シンガポール) | 19,011.064 | 2,086,111 | 109 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC (アメリカ) | 211.331 | 1,799,440 | 8,514 | HOME PROPERTIES INC (アメリカ) | 222.203 | 1,950,996 | 8,780 |
| STRATEGIC HOTELS & RESORTS I (アメリカ) | 989.095 | 1,584,476 | 1,601 | DOUGLAS EMMETT INC (アメリカ) | 546.991 | 1,940,838 | 3,548 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

| | 買付 | | 売付 | |
|---|------------------------------|------------------------------|-------------------------|-----------------------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 | 千口 2,797.3 () | 千シンガポール・ドル 2,942 (△19) | 千口 32,201.994 () | 千シンガポール・ドル 48,037 () |
| | 千口 373.016 () | 千イギリス・ポンド 4,800 () | 千口 5,140.525 () | 千イギリス・ポンド 41,926 () |
| | 千口 150.252 () | 千ユーロ 7,536 () | 千口 247.874 () | 千ユーロ 871 () |
| | 千口 29.156 () | 千ユーロ 2,113 () | 千口 46.16 () | 千ユーロ 3,397 () |
| | 千口 554.097 (△170.475) | 千ユーロ 26,905 (738) | 千口 505.763 () | 千ユーロ 58,428 () |
| | 千口 241.358 () | 千ユーロ 3,137 (△497) | 千口 58.505 () | 千ユーロ 733 () |
| | 千口 1,292.786 (294.165) | 千ユーロ 12,424 (1,988) | 千口 — () | 千ユーロ — () |
| | 千口 8,765.372 () | 千ユーロ 5,940 () | 千口 — () | 千ユーロ — () |
| | 千口 11,033.021 (123.69) | 千ユーロ 58,058 (2,229) | 千口 858.302 () | 千ユーロ 63,430 () |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付()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4) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 当 期 末 | | | 比 率 |
|------------------------------|------------------|-----------------------|------------|---------|
| | 口 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| 不動産ファンド (アメリカ) | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 399,022 | 71,400 | 8,615,244 | 5.7 |
| BIOMED REALTY TRUST INC | 802,742 | 15,252 | 1,840,318 | 1.2 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 954,954 | 34,378 | 4,148,090 | 2.8 |
| VORNADO REALTY TRUST | 388,714 | 34,401 | 4,150,847 | 2.8 |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I | 730,575 | 6,801 | 820,687 | 0.5 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | 245,463 | 10,041 | 1,211,654 | 0.8 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 990,815 | 69,931 | 8,437,961 | 5.6 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 1,897,583 | 33,549 | 4,048,054 | 2.7 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 422.28 | 6,009 | 725,051 | 0.5 |
| CYRUSONE INC | 396,321 | 13,229 | 1,596,234 | 1.1 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 247,047 | 9,592 | 1,157,471 | 0.8 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 1,196 | 19 | 2,346 | 0.0 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 953,161 | 8,740 | 1,054,627 | 0.7 |
| SUN COMMUNITIES INC | 242,968 | 15,771 | 1,902,935 | 1.3 |
| DDR CORP | 1,692,407 | 25,639 | 3,093,718 | 2.1 |
| HEALTH CARE REIT INC | 515,194 | 32,637 | 3,938,045 | 2.6 |
| KILROY REALTY CORP | 287,052 | 18,873 | 2,277,296 | 1.5 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 632,715 | 12,129 | 1,463,502 | 1.0 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 133,042 | 9,845 | 1,187,910 | 0.8 |
| REGENCY CENTERS CORP | 379,099 | 22,495 | 2,714,270 | 1.8 |
| SL GREEN REALTY CORP | 297,048 | 31,106 | 3,753,354 | 2.5 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 458,896 | 15,161 | 1,829,437 | 1.2 |
| STRATEGIC HOTELS & RESORTS I | 819,699 | 11,492 | 1,386,631 | 0.9 |
| CUBESMART | 873,055 | 22,027 | 2,657,799 | 1.8 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 562,291 | 41,075 | 4,956,152 | 3.3 |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 425,867 | 12,252 | 1,478,349 | 1.0 |
| DIAMONDRACK HOSPITALITY CO | 1,331,161 | 15,760 | 1,901,715 | 1.3 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 297,319 | 9,656 | 1,165,204 | 0.8 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 937,271 | 12,690 | 1,531,253 | 1.0 |
| アメリカ・ドル 通貨計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 18,314,939 621,963 | 75,046,169 | <50.0%> |
| (カナダ) | 千口 | 千カナダ・ドル | 千円 | % |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 241,654 | 8,237 | 750,068 | 0.5 |
| カナダ・ドル 通貨計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 241,654 1銘柄 | 750,068 | < 0.5%> |
| (オーストラリア) | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | % |
| NATIONAL STORAGE REIT | 5,270,509 | 7,826 | 675,601 | 0.4 |
| SCENTRE GROUP | 14,050,055 | 53,530 | 4,620,770 | 3.1 |
| WESTFIELD CORP | 8,552,172 | 83,383 | 7,197,678 | 4.8 |
| GOODMAN GROUP | 2,846,861 | 16,397 | 1,415,468 | 0.9 |
| FEDERATION CENTRES | 19,508,797 | 52,868 | 4,563,638 | 3.0 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 34,250,764 | 14,556 | 1,256,523 | 0.8 |
| オーストラリア・ドル 通貨計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 84,479,158 6銘柄 | 19,729,681 | <13.1%> |
| (香港) | 千口 | 千香港ドル | 千円 | % |
| FORTUNE REIT | 14,784.07 | 109,697 | 1,707,994 | 1.1 |
| LINK REIT | 5,046.92 | 210,204 | 3,272,879 | 2.2 |
| CHAMPION REIT | 14,763.376 | 57,134 | 889,580 | 0.6 |
| 香港ドル 通貨計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 34,594,366 3銘柄 | 5,870,454 | < 3.9%> |

| ファンド名 | 当 期 末 | | | 比 率 |
|------------------------------|------------------|--------------------|-----------------------|---------|
| | 口 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| KEPPEL DC REIT | 18,142.271 | 18,142 | 1,565,133 | 1.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 11,177.6 | 24,478 | 2,111,798 | 1.4 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 6,938.4 | 13,182 | 1,137,293 | 0.8 |
| シンガポール・ドル 通貨計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 36,258,271 3銘柄 | 55,804 4,814,226 | < 3.2%> |
| (イギリス) | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 3,324,289 | 40,257 | 7,488,230 | 5.0 |
| HAMMERSON PLC | 4,685,511 | 28,605 | 5,320,824 | 3.5 |
| DERWENT LONDON PLC | 453,832 | 16,278 | 3,028,048 | 2.0 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 1,852,718 | 12,552 | 2,334,828 | 1.6 |
| イギリス・ポンド 通貨計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 10,316.35 4銘柄 | 97,693 18,171,931 | <12.1%> |
| ユーロ (オランダ) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| WERELDHAVE NV | 580.313 | 28,725 | 3,917,870 | 2.6 |
| NSI NV | 2,555,002 | 8,968 | 1,223,153 | 0.8 |
| 国 小 計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 3,135,315 2銘柄 | 37,693 5,141,023 | < 3.4%> |
| ユーロ (ベルギー) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 83,943 | 5,768 | 786,774 | 0.5 |
| 国 小 計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 83,943 1銘柄 | 5,768 786,774 | < 0.5%> |
| ユーロ (フランス) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| KLEPIERRE | 1,587,659 | 60,632 | 8,269,693 | 5.5 |
| FONCIERE DES REGIONES | 299.95 | 22,211 | 3,029,398 | 2.0 |
| 国 小 計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 1,887,609 2銘柄 | 82,843 11,299,092 | < 7.5%> |
| ユーロ (ドイツ) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 995,916 | 11,218 | 1,530,158 | 1.0 |
| 国 小 計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 995,916 1銘柄 | 11,218 1,530,158 | < 1.0%> |
| ユーロ (スペイン) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 1,300,222 | 11,636 | 1,587,168 | 1.1 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 875,059 | 8,960 | 1,222,136 | 0.8 |
| 国 小 計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 2,175,281 2銘柄 | 20,597 2,809,305 | < 1.9%> |
| ユーロ (イタリア) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| BENI STABILI SPA | 19,533,668 | 12,872 | 1,755,705 | 1.2 |
| 国 小 計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 19,533,668 1銘柄 | 12,872 1,755,705 | < 1.2%> |
| ユーロ通貨計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 27,811,732 9銘柄 | 170,995 23,322,059 | <15.5%> |
| 合 計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 212,016.47 55銘柄 | - 147,704,591 | <98.3%> |

(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) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年9月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託証券 | 147,704,591 | 98.2 |
| コール・ローン等、その他 | 2,680,970 | 1.8 |
| 投資信託財産総額 | 150,385,562 | 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、9月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=120.66円、1カナダ・ドル=91.05円、1オーストラリア・ドル=86.32円、1香港ドル=15.57円、1シンガポール・ドル=86.27円、1ニュージーランド・ドル=76.37円、1イギリス・ポンド=186.01円、1ユーロ=136.39円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(149,376,853千円)の投資信託財産総額(150,385,562千円)に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年9月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------|------------------|
| (A) 資産 | 150,570,931,413円 |
| コール・ローン等 | 2,164,807,835 |
| 投資信託証券(評価額) | 147,704,591,383 |
| 未収入金 | 494,712,078 |
| 未収配当金 | 206,820,117 |
| (B) 負債 | 343,369,029 |
| 未払金 | 206,857,029 |
| 未払解約金 | 136,512,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 150,227,562,384 |
| 元本 | 78,638,864,347 |
| 次期繰越損益金 | 71,588,698,037 |
| (D) 受益権総口数 | 78,638,864,347口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 19,103円 |

* 期首における元本額は86,713,865,485円、当期中における追加設定元本額は324,576,874円、同解約元本額は8,399,578,012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・グローバルREIT・オープン(毎月分配型)71,830,957,667円、ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)58,507,124円、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)32,200,443円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)34,872,075円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)165,828,855円、6資産バランスファンド(分配型)288,786,619円、6資産バランスファンド(成長型)571,277,728円、ダイワ3資産分散ファンド(インカム&キャッシュ、外債、内外リート)(隔月分配型)30,637,811円、りそな ワールド・リート・ファンド3,042,132,116円、世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)98,625,443円、「ししがん」SR1三資産バランス・オープン(奇数月分配型)7,468,644円、常陽3分法ファンド453,559,608円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)102,232,516円、ダイワ・海外株式&REITファンド(毎月分配型)33,489,351円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)179,825,825円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)237,289,843円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)284,534,824円、ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用)227,584,555円、ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)901,557,543円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド(部分為替ヘッジあり)22,907,304円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)34,588,453円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,103円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月17日 至2015年9月15日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益 | 2,916,488,205円 |
| 受取配当金 | 2,915,697,794 |
| 受取利息 | 790,411 |
| (B) 有価証券売買損益 | △11,690,344,966 |
| 売買益 | 6,019,347,872 |
| 売買損 | △17,709,692,838 |
| (C) その他費用 | △ 28,827,822 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 8,802,684,583 |
| (E) 前期繰越損益金 | 88,679,978,419 |
| (F) 解約差損益金 | △ 8,621,503,925 |
| (G) 追加信託差損益金 | 332,908,126 |
| (H) 合計(D+E+F+G) | 71,588,698,037 |
| 次期繰越損益金(H) | 71,588,698,037 |

(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。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

運用報告書 第20期（決算日 2015年11月10日）

（計算期間 2015年5月12日～2015年11月10日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの第20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 | 信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。） |
| 運用方法 | ①わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ．個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 ロ．個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。 ③不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本とします。 |
| 投資信託証券組入制限 | 無制限 |

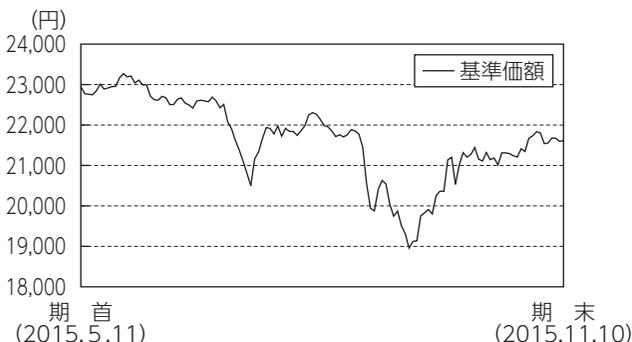
大和投資信託

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



| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東証REIT指数(配当込み) (参考指数) | | 投資信託 証券 組入比率 |
|-----------------|---------|-------|--------------------------|-------|--------------------|
| | 円 | % | 円 | % | % |
| (期首)2015年5月11日 | 22,945 | - | 3,247.69 | - | 97.2 |
| 5月末 | 23,040 | 0.4 | 3,257.97 | 0.3 | 96.7 |
| 6月末 | 22,427 | △ 2.3 | 3,157.69 | △ 2.8 | 97.3 |
| 7月末 | 21,980 | △ 4.2 | 3,100.40 | △ 4.5 | 97.7 |
| 8月末 | 20,545 | △10.5 | 2,881.06 | △11.3 | 97.4 |
| 9月末 | 21,020 | △ 8.4 | 2,964.58 | △ 8.7 | 97.6 |
| 10月末 | 21,805 | △ 5.0 | 3,061.58 | △ 5.7 | 97.8 |
| (期末)2015年11月10日 | 21,617 | △ 5.8 | 3,029.91 | △ 6.7 | 97.8 |

(注) 騰落率は期首比。

《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：22,945円 期末：21,617円 騰落率：△5.8%

【基準価額の主な変動要因】

オフィス・ビル空室率の低下などファンダメンタルズの改善傾向は好感されたものの、中国をはじめとした世界経済の先行き不透明感や、米国の利上げに対する警戒感などを背景にJリート市況が軟調に推移したため、基準価額は値下がりしました。

◆投資環境について

○Jリート（不動産投信）市況

Jリート市況は、期首より、おおむね横ばい圏の動きで始まりました。オフィス・ビル空室率の低下や実物不動産取引の活発化などファンダメンタルズの改善傾向は好感された一方、Jリート各社によるエクイティ・ファイナンスが需給面での重しとなりました。2015年7月に入ると、ギリシャのデフォルト（債務不履行）リスクや中国の株式市場の調整などを受けて先行き不透明感が強まり、大きく下落する展開となりました。その後も、米国の利上げ時期に関する思惑の変化などにより値動きが荒くなる局面もありましたが、国内株式市況が反発したことなどを背景に、Jリート市況は期末にかけて戻り基調となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつJリートに幅広く分散投資を行ない、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。現状の個別銘柄ごとのバリュエーション格差は過去と比較して大きくないと判断していることから、ポートフォリオ戦略については、各種バリュエーション指標での割安度よりも、経営戦略や業績の変化等を重視した銘柄選別を行なっていく方針です。また、バリュエーション面での割安感は薄れつつあるものの、相対的に景気敏感なオフィス・セクターや、訪日観光客の増加などテーマ性のあるホテル・セクターにも引き続き注目しています。

◆ポートフォリオについて

投資信託証券の組入比率につきましては、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本としており、期を通じておおむね96~98%台程度で推移させました。銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄ではインベスコ・オフィス・ジェイリート、MCUBS MidCity、ジャパン・ホテル・リートなどを東証REIT指数と比較してオーバーウエートとし、日本リテールファンド、日本ビルファンド、大和ハウス・レジデンシャル等をアンダーウエートとしました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。当ファンドは、参考指数として東証REIT指数（配当込み）を用いています。投資口価格のパフォーマンスが東証REIT指数（配当込み）を上回ったジャパン・ホテル・リート、日本賃貸住宅、インヴィンシブルなどをオーバーウエートとしていたことや、投資口価格のパフォーマンスが東証REIT指数（配当込み）を下回ったフロンティア不動産や積水ハウス・S1レジデンシャルのアンダーウエートなどがプラスに寄りました。他方、投資口価格のパフォーマンスが東証REIT指数（配当込み）を上回った日本ビルファンドをアンダーウエートとしたことや、投資口価格のパフォーマンスが東証REIT指数（配当込み）を下回ったヘルスケア&メディカルやケネディクス商業リートのオーバーウエートなどがマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつJリートに幅広く分散投資を行ない、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。現状の個別銘柄ごとのバリュエーション格差は過去と比較して大きくないと判断していることから、ポートフォリオ戦略については、各種バリュエーション指標での割安度よりも、経営戦略や業績の変化等を重視した銘柄選別を継続していく方針です。また、賃料の上昇ペースが緩慢ではあるものの、相対的に景気敏感なオフィス・セクターや、訪日観光客の増加などにより変動賃料の増加が期待できるホテル・セクターにも引き続き注目しています。

■ 1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|-----------|
| 売買委託手数料 (投資信託証券) | 9円 (9) |
| 有価証券取引税 | — |
| その他費用 | — |
| 合 計 | 9 |

(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は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

投資信託証券

(2015年5月12日から2015年11月10日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---------|------------|---------------|------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内 | 111.226 | 17,049,984 | 38.045 (—) | 7,162,672 (—) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 売付()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) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

投資信託証券

(2015年5月12日から2015年11月10日まで)

| 当 | | | | 期 | | | | | |
|-----------------|---|-----|-----------|---------|----------------|---|-------|---------|---------|
| 買 | | 付 | | 売 | | 付 | | | |
| 銘 | 柄 | 口 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 | 柄 | 口 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | | 千口 | 千円 | 円 | | | 千口 | 千円 | 円 |
| 日本リートファンド | | 8 | 1,796,886 | 224,610 | 森ヒルズリート | | 5 | 727,970 | 145,594 |
| NMF 投資法人 | | 8 | 1,167,099 | 145,887 | 森トラスト総合リート | | 2.9 | 639,960 | 220,676 |
| 日本賃貸住宅投資法人 | | 13 | 1,015,551 | 78,119 | 日本プライムリアルティ | | 1.5 | 580,441 | 386,960 |
| いちごオフィスリート投資法人 | | 11 | 917,051 | 83,368 | 日本リートファンド | | 2 | 478,283 | 239,141 |
| アドバンス・レジデンス | | 3.5 | 913,451 | 260,986 | いちごオフィスリート投資法人 | | 5 | 408,330 | 81,666 |
| 野村不動産オフィスF | | 1.7 | 892,367 | 524,922 | 日本ビルファンド | | 0.702 | 385,780 | 549,544 |
| 野村不レジデンシャル | | 1.3 | 850,664 | 654,357 | S I A不動産投資 | | 0.9 | 371,617 | 412,907 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | | 2 | 809,674 | 404,837 | ヒューリックリート投資法 | | 2 | 320,428 | 160,214 |
| ジャパンリアルエステイト | | 1.3 | 721,580 | 555,061 | 産業ファンド | | 0.6 | 314,570 | 524,283 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | | 4 | 676,085 | 169,021 | プレミアム投資法人 | | 0.5 | 310,457 | 620,914 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■ 組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 当 期 末 | | | |
|--------------------|-------|-----------|-----|---|
| | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 | 率 |
| | 千口 | 千円 | % | |
| 不動産投信 | | | | |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 3 | 1,261,500 | 1.7 | |
| MCUBS MidCity投資法人 | 5 | 1,765,000 | 2.4 | |
| 森ヒルズリート | 10 | 1,485,000 | 2.0 | |
| 産業ファンド | 3 | 1,647,000 | 2.2 | |
| 大和ハウスリート | 2 | 983,000 | 1.3 | |
| アドバンス・レジデンス | 8 | 2,136,000 | 2.9 | |
| ケネディクスレジデンシャル | 3.5 | 1,049,300 | 1.4 | |
| A P I 投資法人 | 4.6 | 2,288,500 | 3.1 | |
| G L P 投資法人 | 20 | 2,374,000 | 3.2 | |
| コンフォリア・レジデンシャル | 3 | 689,700 | 0.9 | |
| 日本プロロジスリート | 9 | 1,971,900 | 2.7 | |
| 星野リゾート・リート | 0.605 | 719,345 | 1.0 | |
| S I A不動産投資 | 0.1 | 46,950 | 0.1 | |
| イオンリート投資 | 4 | 573,600 | 0.8 | |
| ヒューリックリート投資法 | 5 | 809,500 | 1.1 | |

| フ ァ ン ド 名 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|--------|-----------|-----|---|
| | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 | 率 |
| | 千口 | 千円 | % | |
| 日本リート投資法人 | 4 | 1,150,000 | 1.6 | |
| インベスコ・オフィス・Jリート | 20 | 1,948,000 | 2.6 | |
| 積水ハウス・リート投資 | 9 | 1,134,000 | 1.5 | |
| トーセイ・リート投資法人 | 4.5 | 512,100 | 0.7 | |
| ケネディクス商業リート | 4.2 | 975,240 | 1.3 | |
| ヘルスケア&メディカル投資 | 3 | 334,200 | 0.5 | |
| サムティ・レジデンシャル | 1 | 86,800 | 0.1 | |
| ジャパン・シニアリビング | 1 | 152,300 | 0.2 | |
| 野村不動産マスターF | 31.095 | 4,801,068 | 6.5 | |
| 日本ビルファンド | 6.6 | 3,649,800 | 4.9 | |
| ジャパンリアルエステイト | 8.8 | 4,734,400 | 6.4 | |
| 日本リートファンド | 17 | 3,911,700 | 5.3 | |
| オリックス不動産投資 | 14 | 2,234,400 | 3.0 | |
| 日本プライムリアルティ | 6 | 2,349,000 | 3.2 | |
| プレミアム投資法人 | 9.5 | 1,101,050 | 1.5 | |

| ファン ド 名 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------|---------|---------------------|---------|--|
| | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 | |
| | 千口 | 千円 | % | |
| 東急リアル・エステート | 2 | 292,600 | 0.4 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 3 | 1,191,000 | 1.6 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 16 | 2,630,400 | 3.6 | |
| 森トラス2.0総合リート | 7 | 1,486,800 | 2.0 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 34 | 2,380,000 | 3.2 | |
| フロンティア不動産投資 | 2 | 970,000 | 1.3 | |
| 平和不動産リート | 1 | 88,700 | 0.1 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 7 | 1,595,300 | 2.2 | |
| 福岡リート投資法人 | 3 | 584,700 | 0.8 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 3 | 1,599,000 | 2.2 | |
| 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 | 2.5 | 279,250 | 0.4 | |
| いちごオフィスリート投資法人 | 13 | 1,089,400 | 1.5 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 3.2 | 1,936,000 | 2.6 | |
| 阪急リート投資法人 | 1.5 | 194,550 | 0.3 | |
| トップリート投資法人 | 2.8 | 1,282,400 | 1.7 | |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 2 | 493,400 | 0.7 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 32 | 2,796,800 | 3.8 | |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 24 | 1,934,400 | 2.6 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 5 | 655,500 | 0.9 | |
| 合 計 | 口 数、金 額 | 384.5 72,354,553 | | |
| | 銘柄数<比率> | 49銘柄 | <97.8%> | |

※日本アコモデーションファンド投資法人、MCUBS MidCity投資法人、森ビルズリート、産業ファンド、大和ハウスリート、ケネディクスレジデンシャル、API投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、イオンリート投資、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、積水ハウス・リート投資、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、サムディ・レジデンシャル、日本ビルファンド、ジャパンリアルエステイト、日本リテールファンド、オリックス不動産投資、日本プライムリアルティ、プレミア投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、平和不動産リート、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、大和ハウス・レジデンシャル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定されている法人等をいいます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメント、ミカサ・アセット・マネジメントが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。
 (注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年11月10日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託証券 | 72,354,553 | 97.4 |
| コール・ローン等、その他 | 1,932,496 | 2.6 |
| 投資信託財産総額 | 74,287,049 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年11月10日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------|-----------------|
| (A) 資産 | 74,287,049,296円 |
| コール・ローン等 | 1,293,453,694 |
| 投資信託証券(評価額) | 72,354,553,000 |
| 未収入金 | 62,064,122 |
| 未収配当金 | 576,978,480 |
| (B) 負債 | 295,297,842 |
| 未払金 | 283,265,842 |
| 未払解約金 | 12,032,000 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 73,991,751,454 |
| 元本 | 34,228,198,951 |
| 次期繰越損益金 | 39,763,552,503 |
| (D) 受益権総口数 | 34,228,198,951口 |
| 1万口当り基準価額(C / D) | 21,617円 |

*期首における元本額は30,357,414,771円、当期中における追加設定元本額は5,491,747,501円、同解除元本額は1,620,963,321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、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)29,980,743円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)31,284,848円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)149,446,393円、6資産バランスファンド(分配型)265,244,531円、6資産バランスファンド(成長型)535,281,033円、ダイワ三資産分散ファンド(インカム&キャッシュ、外債、内外リート)(隔月分配型)27,888,605円、世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)89,010,489円、「しがぎん」SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)3,360,756円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)93,569,209円、成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-07 189,659,371円、成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-08 144,108,589円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)168,337,856円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)223,520,278円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)270,736,177円、DCダイワJ-REITアクティブファンド373,826,791円、ダイワファンドラップ J-REITセレクト30,561,762,111円、ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(成長型)192,047,048円、ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(安定型)54,072,852円、ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)336,536,562円、ダイワJリート・ファンド488,524,709円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は21,617円です。

■損益の状況

当期 自2015年5月12日 至2015年11月10日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益 | 1,146,915,920円 |
| 受取配当金 | 1,105,895,882 |
| 受取利息 | 457,002 |
| その他収益金 | 40,563,036 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 5,266,032,758 |
| 売買益 | 668,122,080 |
| 売買損 | △ 5,934,154,838 |
| (C) 当期損益金(A + B) | △ 4,119,116,838 |
| (D) 前期繰越損益金 | 39,297,234,521 |
| (E) 解約差損益金 | △ 1,872,809,679 |
| (F) 追加信託差損益金 | 6,458,244,499 |
| (G) 合計(C + D + E + F) | 39,763,552,503 |
| 次期繰越損益金(G) | 39,763,552,503 |

(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。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

運用報告書 第20期（決算日 2015年10月15日）

（計算期間 2015年4月16日～2015年10月15日）

ダイワ北米好配当株マザーファンドの第20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 | 北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券 |
| 運用方法 | ①銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。 ②外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。 ③株式およびハイブリッド優先証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ④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。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 |
| 株式組入制限 | 無制限 |

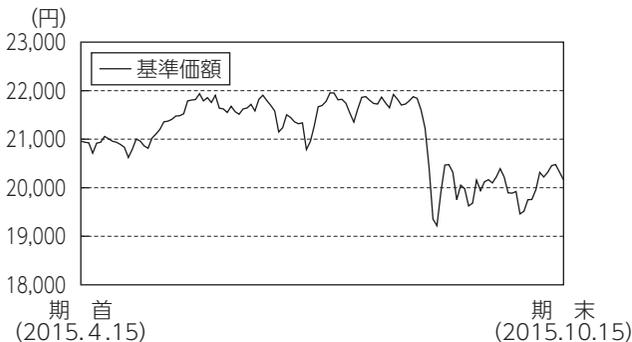
大和投資信託

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



| 年月日 | 基準価額 | | MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、円換算) | | 株式組入比率 | | ハイブリッド優先証券組入比率 | | 投資信託証券組入比率 | |
|-----------------|--------|------|--------------------------|------|--------|------|----------------|---|------------|---|
| | 円 | 騰落率 | (参考指数) | 騰落率 | % | % | % | % | % | % |
| (期首)2015年4月15日 | 20,959 | - | 22,502 | - | 71.5 | 22.3 | 2.0 | | | |
| 4月末 | 20,892 | △0.3 | 22,542 | 0.2 | 71.9 | 22.3 | 2.0 | | | |
| 5月末 | 21,806 | 4.0 | 23,554 | 4.7 | 71.3 | 21.9 | 2.2 | | | |
| 6月末 | 21,150 | 0.9 | 22,655 | 0.7 | 72.3 | 22.6 | 2.2 | | | |
| 7月末 | 21,877 | 4.4 | 23,431 | 4.1 | 72.4 | 22.2 | 2.0 | | | |
| 8月末 | 20,477 | △2.3 | 21,643 | △3.8 | 71.8 | 22.6 | 2.1 | | | |
| 9月末 | 19,517 | △6.9 | 20,265 | △9.9 | 70.4 | 24.0 | 2.1 | | | |
| (期末)2015年10月15日 | 20,163 | △3.8 | 21,329 | △5.2 | 71.8 | 22.7 | 2.2 | | | |

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIノースアメリカ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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。
 (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。

《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：20,959円 期末：20,163円 騰落率：△3.8%

【基準価額の主な変動要因】

当期は株式市況の下落がマイナス要因となり、基準価額は値下がりしました。

◆投資環境について

○北米株式市況

米国株式市況は下落しました。堅調な米国経済を受けた根強い利上げ観測を背景に、期首から2015年8月中旬までは狭いレンジで一進一退の展開になりました。その後、景気対策を打ち出してはいるものの景気減速に歯止めがかからない中国経済の先行きに対する不安や中国本土株式市況の大幅下落を背景に、市場のリスク回避姿勢が急速に強まったため、北米株式市況は8月下旬に大きく下落しました。9月に入り、FRB (米国連邦準備制度理事会) が中国経済鈍化の影響に対する不透明感などを理由に利上げを見送ったことが市場に安心感をもたらし、期末にかけて市況はやや持ち直しました。

業種別では、中国をはじめとした新興国経済の鈍化により資源需要の伸びが弱まるとの見方からエネルギーセクターや素材セクターの下落率が大きくなりました。一方、事業拡大が続くインターネット小売関連銘柄を中心に小売セクターが上昇しました。

○米国ハイブリッド優先証券市況

米国ハイブリッド優先証券市況は小幅ながら上昇しました。期首から2015年6月にかけては、欧州経済に対する過度の懸念の後退を背景にドイツ国債利回りが急上昇 (債券価格は下落) したことや、米国の利上げ観測の広まりを受けて米国長期国債利回りが上昇したことがマイナス要因となり、市況は下落しました。その後は、財政問題を抱えるギリシャの支援協議の混迷や中国経済の減速に対する不安などを背景に市場のリスク回避姿勢が強まり、長期国債利回りが低下したことが支援材料となり市況は上昇に転じると、期末にかけてそれまでの下落分を取り戻しました。

○為替相場

米ドル円は、円安に振れた後に円が反発し、期末には1米ドル＝118円99銭とおおむね期首なみの水準となりました。2015年5月中旬から6月上旬にかけて、米国の利上げ観測の強まりから米ドルが買われて大きく円安米ドル高が進みました。その後は一進一退の展開になりましたが、世界的な株安や中国の景気減速に対する懸念を背景に市場のリスク回避姿勢が強まり、低リスク資産と考えられている円が買われ、8月下旬以降は円高米ドル安になりました。

◆前期における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、コーペン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク (以下、C&S) に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。普通株式については、今後もキャッシュフローおよび配当の成長が期待できるセクターや銘柄に重点を置いたポートフォリオを継続します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築してまいります。

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。

有価証券の組入比率は、株式を67～74%程度、ハイブリッド優先証券等を20～27%程度としました。

銘柄選択にあたって、C&Sでは、長期的なビジネスモデルが確立した銘柄に絞って調査しております。当ファンドでは、その中から魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できるキャッシュフローを生み出せると考える銘柄を中心にポートフォリオを構築しました。その結果、業種別では、金融セクターやIT (情報技術) セクターを高位で組入れました。また個別銘柄では、APPLE (情報技術)、EXXON MOBIL (エネルギー)、MICROSOFT (情報技術) などを高位で組入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当ファンドの当期の基準価額と参考指数の騰落率は、「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》

外貨資産の運用にあたっては、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。普通株式については、今後もキャッシュフローおよび配当の成長が期待できる業種や銘柄に重点を置いたポートフォリオを継続します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■ 1万口当りの費用の明細

| 項目 | 当期 |
|--------------|------|
| 売買委託手数料 | 7円 |
| (株式) | (2) |
| (ハイブリッド優先証券) | (4) |
| (投資信託証券) | (0) |
| 有価証券取引税 | 0 |
| (株式) | (0) |
| (ハイブリッド優先証券) | (0) |
| (投資信託証券) | (0) |
| その他費用 | 10 |
| (保管費用) | (10) |
| (その他) | (0) |
| 合計 | 17 |

(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は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株式

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 国 | 地域 | 買付 | | 売付 | |
|---|------|--------------|----------------|-------|----------|
| | | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 |
| 外 | アメリカ | 百株 | 千アメリカ・ドル | 百株 | 千アメリカ・ドル |
| | | 448 (75) | 2,969 (△ 3) | 808.8 | 3,606 |
| 国 | カナダ | 百株 | 千カナダ・ドル | 百株 | 千カナダ・ドル |
| | | 23 (-) | 163 (-) | 49 | 226 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 国 | 地域 | 買付 | | 売付 | |
|---|------|----------------------|-----------------|-----------------|---------------|
| | | 証券数 | 金額 | 証券数 | 金額 |
| 外 | アメリカ | 千証券 | 千アメリカ・ドル | 千証券 | 千アメリカ・ドル |
| | | 123.506 (△ 2.032) | 3,168 (△ 52) | 135.206 (-) | 3,496 (-) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付()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4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 国 | 地域 | 買付 | | 売付 | |
|---|------|---------------|-------------|---------------|-------------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 | アメリカ | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千口 | 千アメリカ・ドル |
| | | 5.488 (-) | 131 (-) | 5.336 (-) | 134 (-) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付()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4) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 当 | | | | 期 | | | |
|-------------------------------------|-----|--------|--------|------------------------------------|-----|--------|--------|
| 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
| 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 |
| VISA INC-CLASS A SHARES (アメリカ) | 3.6 | 30,254 | 8,404 | ALLSTATE CORP (アメリカ) | 3.3 | 25,392 | 7,694 |
| APPLE INC (アメリカ) | 1.4 | 21,202 | 15,144 | GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ) | 6.6 | 21,028 | 3,186 |
| TE CONNECTIVITY LTD (スイス) | 2.4 | 19,662 | 8,192 | LAS VEGAS SANDS CORP (アメリカ) | 3.9 | 18,575 | 4,763 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC (アメリカ) | 1.5 | 17,949 | 11,966 | XILINX INC (アメリカ) | 3.4 | 17,881 | 5,259 |
| ANALOG DEVICES INC (アメリカ) | 2.6 | 17,492 | 6,728 | L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS (アメリカ) | 1.3 | 17,470 | 13,438 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC (アメリカ) | 0.9 | 16,472 | 18,302 | VF CORP (アメリカ) | 2 | 17,322 | 8,661 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC (カナダ) | 2.3 | 16,187 | 7,038 | UNITED CONTINENTAL HOLDINGS (アメリカ) | 2.5 | 17,127 | 6,850 |
| ACCENTURE PLC-CL A (アイルランド) | 1.2 | 14,295 | 11,913 | BECTON DICKINSON AND CO (アメリカ) | 0.9 | 15,733 | 17,482 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC (アメリカ) | 0.9 | 14,212 | 15,792 | CMS ENERGY CORP (アメリカ) | 3.5 | 14,565 | 4,161 |
| EAST WEST BANCORP INC (アメリカ) | 2.3 | 12,122 | 5,270 | HEWLETT-PACKARD CO (アメリカ) | 3.6 | 14,400 | 4,000 |

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 当 | | | | 期 | | | |
|---------------------------------------|-------|--------|-------|---------------------------------------|-------|--------|-------|
| 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
| 銘柄 | 証券数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 証券数 | 金額 | 平均単価 |
| CITIGROUP CAPITAL XIII 7.875 (アメリカ) | 8.341 | 26,601 | 3,189 | INTEGRYS HOLDING INC 6 (アメリカ) | 6.675 | 21,467 | 3,216 |
| ALLY FINANCIAL 8.125 2/15/40 (アメリカ) | 5.725 | 18,119 | 3,164 | BB&T CORPORATION 5.625 E (アメリカ) | 6.295 | 18,677 | 2,967 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D (アメリカ) | 5.2 | 16,523 | 3,177 | SUNTRUST BANKS INC 5.875 E (アメリカ) | 5.986 | 18,143 | 3,031 |
| WELLS FARGO & COMPANY 8 J (アメリカ) | 4.9 | 16,463 | 3,359 | REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A (アメリカ) | 5.3 | 16,593 | 3,130 |
| FIRST NIAGARA FIN GRP 8.625 B (アメリカ) | 4.675 | 15,190 | 3,249 | BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y (アメリカ) | 4.9 | 15,186 | 3,099 |
| INTEGRYS HOLDING INC 6 (アメリカ) | 4.3 | 14,086 | 3,275 | PPL CAPITAL FUNDING INC 5.9 B (アメリカ) | 4.8 | 14,995 | 3,123 |
| COUNTRYWIDE CAPITAL IV 6.75 (アメリカ) | 4.4 | 13,685 | 3,110 | HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875 (アメリカ) | 3.975 | 14,968 | 3,765 |
| SOUTHERN CO 6.25 (アメリカ) | 4.1 | 12,207 | 2,977 | REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ) | 4.044 | 13,140 | 3,249 |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA (アメリカ) | 4 | 12,062 | 3,015 | WELLS FARGO & COMPANY 5.85 (アメリカ) | 4.2 | 12,979 | 3,090 |
| FIRST REPUBLIC BANK 5.7 F (アメリカ) | 4.1 | 11,855 | 2,891 | JPMORGAN CHASE & CO 5.5 O (アメリカ) | 4.225 | 12,366 | 2,927 |

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 |
|-----------------------------|-------|-------|---------|--------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 39 | — | — | — | 一般調剤・サービス |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | — | 15 | 78 | 9,375 | 素材 |
| AETNA INC | 35 | 33 | 366 | 43,629 | ヘルスケア |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | — | 15 | 147 | 17,537 | 資本財・サービス |
| DEVON ENERGY CORP | 11 | 11 | 49 | 5,844 | エネルギー |
| ALLIANT ENERGY CORP | 20 | 27 | 160 | 19,125 | 公益事業 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 24 | 48 | 296 | 35,331 | 情報技術 |
| APPLE INC | 31 | 45 | 495 | 59,012 | 情報技術 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 35 | 45 | 245 | 29,246 | 金融 |
| BECTON DICKINSON AND CO | 9 | — | — | — | ヘルスケア |
| JPMORGAN CHASE & CO | 45 | 47 | 281 | 33,549 | 金融 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 20 | 22 | 236 | 28,159 | 金融 |
| CMS ENERGY CORP | 72 | 37 | 131 | 15,673 | 公益事業 |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD | 13 | 16 | 187 | 22,362 | 情報技術 |
| EAST WEST BANCORP INC | — | 23 | 87 | 10,399 | 金融 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 23 | 15 | 141 | 16,804 | 素材 |
| HANESBRANDS INC | 69 | 81 | 233 | 27,748 | 一般調剤・サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 54.34 | 60.34 | 483 | 57,553 | エネルギー |
| L3 COMMUNICATIONS HOLDINGS | 21.5 | 10.5 | 114 | 13,680 | 資本財・サービス |
| FORD MOTOR CO | 134 | 129 | 193 | 23,039 | 一般調剤・サービス |
| NEXTERA ENERGY INC | 24.62 | 24.62 | 248 | 29,567 | 公益事業 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 109 | 43 | 118 | 14,121 | 資本財・サービス |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 5 | 11 | 153 | 18,259 | 資本財・サービス |
| GENERAL MILLS INC | 19 | — | — | — | 生活必需品 |
| HALLIBURTON CO | 7 | 7 | 27 | 3,225 | エネルギー |
| HOME DEPOT INC | 19 | 20 | 240 | 28,621 | 一般調剤・サービス |
| ASSURANT INC | — | 11 | 87 | 10,427 | 金融 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 183 | 159 | 167 | 19,922 | 金融 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 25 | 11 | 59 | 7,119 | 一般調剤・サービス |
| HEWLETT-PACKARD CO | 36 | — | — | — | 情報技術 |
| JOHNSON & JOHNSON | 14 | 10 | 94 | 11,248 | ヘルスケア |
| ABBVIE INC | 47 | 38 | 204 | 24,389 | ヘルスケア |
| KROGER CO | 35 | 47 | 170 | 20,317 | 生活必需品 |
| MCDONALD'S CORP | 6.97 | — | — | — | 一般調剤・サービス |
| MONSANTO CO | 11 | 16 | 144 | 17,180 | 素材 |
| MERCK & CO. INC. | 47 | 43 | 213 | 25,347 | ヘルスケア |
| NETAPP INC | 50 | 29 | 98 | 11,691 | 情報技術 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 6 | — | — | — | 資本財・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 26 | 26 | 192 | 22,862 | エネルギー |
| PFIZER INC | 19.83 | — | — | — | ヘルスケア |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 33 | 26 | 192 | 22,958 | 生活必需品 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 23 | 30 | 307 | 36,564 | 情報技術 |
| QUALCOMM INC | 35 | 27 | 158 | 18,836 | 情報技術 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 50 | 43 | 183 | 21,883 | 資本財・サービス |
| ROSS STORES INC | 23 | 40 | 194 | 23,084 | 一般調剤・サービス |
| CHEVRON CORP | 16 | 12 | 107 | 12,816 | エネルギー |
| SYSCO CORP | — | 22 | 88 | 10,588 | 生活必需品 |
| AT&T INC | 89 | 89 | 296 | 35,233 | 電気通信サービス |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 7 | 11 | 53 | 6,359 | エネルギー |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 20 | 17 | 174 | 20,806 | 資本財・サービス |

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------------|------------------|------------------|---------------------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| ANTHEM INC | — | 4 | 57 | 6,822 | ヘルスケア |
| WALT DISNEY CO/THE | 23 | 25 | 264 | 31,452 | 一般調剤・サービス |
| WELLS FARGO & CO | 51.26 | 52.26 | 269 | 32,024 | 金融 |
| WAL-MART STORES INC | 34 | 23 | 138 | 16,428 | 生活必需品 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS | 25 | — | — | — | 資本財・サービス |
| VISA INC-CLASS A SHARES | — | 36 | 267 | 31,784 | 情報技術 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 7 | 17 | 146 | 17,436 | 金融 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 50 | 35 | 155 | 18,445 | 生活必需品 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 4.94 | 11.94 | 148 | 17,612 | ヘルスケア |
| BANK OF AMERICA CORP | 64 | — | — | — | 金融 |
| ANALOG DEVICES INC | — | 26 | 158 | 18,868 | 情報技術 |
| EQUIFAX INC | 16 | 14 | 145 | 17,354 | 資本財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC | 14 | 16 | 157 | 18,731 | ヘルスケア |
| CARDINAL HEALTH INC | 32 | 37 | 290 | 34,609 | ヘルスケア |
| INTEL CORP | 28 | — | — | — | 情報技術 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 47 | 37 | 169 | 20,199 | 金融 |
| WW GRAINGER INC | — | 4 | 88 | 10,540 | 資本財・サービス |
| MICROSOFT CORP | 94 | 79 | 368 | 43,880 | 情報技術 |
| CVS HEALTH CORP | 30.75 | 34.75 | 349 | 41,535 | 生活必需品 |
| MEDTRONIC PLC | 18.16 | 26.16 | 188 | 22,474 | ヘルスケア |
| BLACKROCK INC | 8 | 9 | 290 | 34,533 | 金融 |
| ACE LTD | 18 | 21 | 221 | 26,374 | 金融 |
| ALLSTATE CORP | 33 | — | — | — | 金融 |
| XILINX INC | 46 | 20 | 90 | 10,799 | 情報技術 |
| VF CORP | 20 | — | — | — | 一般調剤・サービス |
| アメリカ・ドル 通貨計 | 株数・金額 総額<比率> | 2,306.37 66銘柄 | 2,020.57 63銘柄 | 11,878 1,413,418 | <69.7%> |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダドル | 千円 | |
| SUNCOR ENERGY INC | 53 | 53 | 196 | 18,063 | エネルギー |
| TRANSCANADA CORP | 15 | — | — | — | エネルギー |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 43 | 37 | 105 | 9,710 | 素材 |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 28 | — | — | — | 電気通信サービス |
| MAGNIA INTERNATIONAL INC | — | 23 | 148 | 13,678 | 一般調剤・サービス |
| カナダ・ドル 通貨計 | 株数・金額 総額<比率> | 139 4銘柄 | 113 3銘柄 | 450 41,453 | <2.0%> |
| ファンド合計 | 株数・金額 総額<比率> | 2,445.37 70銘柄 | 2,133.57 66銘柄 | 1,454,871 | <71.8%> |

(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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

| 銘柄 | 期首 | | 当期 | | 期末 | |
|--------------------------------|-------|-------|----------|--------|-------|--------|
| | 証券数 | 証券数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| | | | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| (アメリカ) | 千証券 | 千証券 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| STATE STREET CORP 6 | 1 | — | — | — | — | — |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.125 Y | 3.2 | 3.2 | 81 | 9,644 | | |
| CHS INC 7.5 4 | 5 | 3,475 | 94 | 11,193 | | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP 6.25 | 1.2 | 1.35 | 35 | 4,216 | | |
| HANCOCK HOLDING CO 5.95 | 2.1 | — | — | — | | |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA | — | 4 | 101 | 12,017 | | |
| WINTRUST FINANCIAL CORP 6.5 D | — | 3.7 | 96 | 11,473 | | |
| FIRST NIAGARA FIN GRP 8.625 B | 4.35 | 6.225 | 167 | 19,977 | | |
| VALLEY NATIONAL BANCORP 6.25 A | — | 3.7 | 95 | 11,385 | | |
| FIRST REPUBLIC BANK 5.7 F | — | 4.1 | 98 | 11,742 | | |
| CHARLES SCHWAB CORP 6 C | — | 1.3 | 33 | 3,994 | | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F | — | 1.65 | 42 | 5,014 | | |
| SCE TRUST IV 5.375 J | — | 1 | 26 | 3,123 | | |
| WELLS FARGO & COMPANY 6 V | — | 1.75 | 45 | 5,357 | | |
| QWEST CORP 6.625 | — | 2.075 | 51 | 6,157 | | |
| SOUTHERN CO 6.25 | — | 4.1 | 104 | 12,430 | | |
| SEASPAN CORPORATION 9.5 C | 0.818 | 3,593 | 92 | 11,038 | | |
| AXIS CAPITAL HDGS LTD 6.875 C | 0.19 | — | — | — | | |
| NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.7 G | 0.818 | — | — | — | | |
| FIRST REPUBLIC BANK/SF 6.2 B | 1.57 | — | — | — | | |
| NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.625 H | — | 2.2 | 55 | 6,612 | | |
| BB&T CORPORATION 5.2 G | 0.971 | 2,071 | 50 | 5,995 | | |
| NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.125 I | 1 | — | — | — | | |
| DTE ENERGY COMPANY 5.25 | — | 2 | 48 | 5,759 | | |
| ZIONS BANCORPORATION 5.75 H | 2 | 2 | 47 | 5,687 | | |
| ASPEN INSURANCE HLDG LTD 7.25 | 0.7 | 0.7 | 18 | 2,193 | | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.75 | 2,495 | — | — | — | | |
| BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y | 5.6 | 3.2 | 82 | 9,778 | | |
| CHS INC 7.1 2 | 2.126 | — | — | — | | |
| REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A | 3.8 | — | — | — | | |
| FIRST REPUBLIC BANK/SF 5.5 | 4.271 | 4,821 | 117 | 13,962 | | |
| KEMPER CORP 7.375 | 2.2 | 1.04 | 28 | 3,335 | | |
| CITY NATIONAL CORP 5.5 C | 2.5 | — | — | — | | |
| HANOVER INSURANCE GROUP 6.35 | 5.8 | 2.1 | 53 | 6,339 | | |
| WELLS FARGO & COMPANY 5.2 | 0.907 | — | — | — | | |
| ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.95 | 2.9 | 0.9 | 22 | 2,728 | | |
| BERKLEY (WR) CORPORATION 5.625 | 1,814 | — | — | — | | |
| SCE TRUST II 5.1 | 0.753 | — | — | — | | |
| PARTNERRE LTD 7.25 E | — | 3.5 | 98 | 11,661 | | |
| COUNTRYWIDE CAPITAL IV 6.75 | — | 3.4 | 86 | 10,312 | | |
| METLIFE INC 6.5 B | 0.7 | — | — | — | | |
| PARTNERRE LTD 6.5 D | — | 1,818 | 48 | 5,775 | | |
| PRINCIPAL FINL GROUP 6.518 B | 1,332 | — | — | — | | |
| QWEST CORP 6.125 | 2.96 | — | — | — | | |
| FIRST REPUBLIC BANK/SF 5.625 | 2 | — | — | — | | |
| SCE TRUST III 5.75 | 3.3 | — | — | — | | |
| PRIVATEBANCORP INC 7.125 | 2,952 | 1,513 | 41 | 4,905 | | |
| WELLS FARGO & COMPANY 8 J | 0.625 | 4,025 | 112 | 13,371 | | |
| CITIGROUP CAPITAL XIII 7.875 | — | 5,641 | 146 | 17,398 | | |
| FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I | 2,817 | 2.1 | 57 | 6,799 | | |
| MORGAN STANLEY 6.875 F | 3,626 | 2,004 | 53 | 6,383 | | |
| ALLY FINANCIAL 8.125 2/15/40 | 3.6 | 7,325 | 186 | 22,243 | | |
| REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B | 6,515 | 2,471 | 64 | 7,674 | | |
| US BANCORP 6.5 F | 2.1 | 3,452 | 100 | 11,899 | | |
| WELLS FARGO & COMPANY 6.625 | 3,941 | 2,441 | 67 | 8,042 | | |

| 銘柄 | 期首 | | 当期 | | 期末 | |
|---------------------------------|-------------------|-----------------|-----------------|------------------|--------------------|--------|
| | 証券数 | 証券数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| | | | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P | 0.958 | 2,308 | 62 | 7,491 | | |
| BANK OF AMERICA CORP 6.625 W | 1.1 | 1.97 | 51 | 6,099 | | |
| INTEGRYS HOLDING INC 6 | 2.375 | — | — | — | | |
| ALLSTATE CORP 6.625 E | 1.303 | 0.628 | 17 | 2,032 | | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K | 6.031 | 3,421 | 90 | 10,738 | | |
| QWEST CORP 7 | 1.3 | 1.3 | 33 | 4,023 | | |
| ALLSTATE CORP 5.1 | — | 1.1 | 28 | 3,365 | | |
| MORGAN STANLEY 6.625 G | 1.5 | 1.5 | 39 | 4,681 | | |
| MORGAN STANLEY 7.125 E | 1,737 | 1,737 | 47 | 5,685 | | |
| BB&T CORPORATION 5.625 E | 5.295 | — | — | — | | |
| MORGAN STANLEY 6.375 I | 2 | 2.1 | 53 | 6,396 | | |
| REINSURANCE GRP OF AMER 6.2 | — | 1 | 28 | 3,353 | | |
| SUNTRUST BANKS INC 5.875 E | 4,486 | — | — | — | | |
| STATE STREET CORP 5.25 C | 0.8 | — | — | — | | |
| STATE STREET CORP 5.9 D | — | 1 | 26 | 3,105 | | |
| JPMORGAN CHASE & CO 5.5 O | 3 | 0.775 | 19 | 2,276 | | |
| WELLS FARGO & COMPANY 5.85 | 7.5 | 3.3 | 84 | 10,060 | | |
| CITIGROUP INC 7.125 J | 2,813 | 4,213 | 114 | 13,650 | | |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.7 T | 1.8 | 3.2 | 86 | 10,295 | | |
| JPMORGAN CHASE & CO 6.3 W | 1.7 | 0.7 | 18 | 2,161 | | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D | — | 1.6 | 43 | 5,132 | | |
| HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875 | 6.3 | 2,325 | 71 | 8,484 | | |
| PPL CAPITAL FUNDING INC 5.9 B | 4.8 | 2.2 | 55 | 6,602 | | |
| ASTORIA FINANCIAL CORP 6.5 C | 6.8 | 5.8 | 148 | 17,722 | | |
| PARTNERRE LTD 5.875 F | 1.7 | — | — | — | | |
| 合計 | 証券数、金額 銘柄数<比率> | 161,849 60銘柄 | 148,117 57銘柄 | 3,874 <22.7%> | 460,989 <22.7%> | |

(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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首 | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|--------------|---------------|---------------|------------------|--------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| | | | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| (アメリカ) | 口数 | 口数 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| NORTHSTAR REALTY FIN 8.875 C | 1.5 | 1.5 | 36 | 4,358 | | |
| PUBLIC STORAGE 5.9 S | — | 0.8 | 20 | 2,436 | | |
| RETAIL PROPERTIES OF AME 7 A | 2 | 2 | 51 | 6,080 | | |
| CEDAR REALTY TRUST INC 7.25 B | — | 0.662 | 16 | 1,951 | | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES 7.125 C | 3.6 | 3.2 | 80 | 9,572 | | |
| CORPORATE OFFICE PROP TR 7.375 L | 1,298 | — | — | — | | |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST 7.75 A | 1,894 | 1,894 | 49 | 5,859 | | |
| VEREIT INC 6.7 F | 1 | 2,826 | 68 | 8,177 | | |
| VORNADO REALTY TRUST 5.4 L | — | 2.2 | 50 | 6,015 | | |
| EXCEL TRUST INC 8.125 B | 2,138 | — | — | — | | |
| PUBLIC STORAGE 5.375 V | 1.5 | — | — | — | | |
| 合計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 14.93 8銘柄 | 15.082 8銘柄 | 373 <2.2%> | 44,453 <2.2%> | |

(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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

■投資信託財産の構成

2015年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 1,454,871 | 69.4 |
| ハイブリッド優先証券 | 460,989 | 22.0 |
| 投資信託証券 | 44,453 | 2.1 |
| コール・ローン等、その他 | 135,392 | 6.5 |
| 投資信託財産総額 | 2,095,706 | 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、10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=118.99円、1カナダ・ドル=92.09円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(2,006,430千円)の投資信託財産総額(2,095,706千円)に対する比率は、95.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|-----------------------|
| (A) 資産 | 2,095,706,786円 |
| コール・ローン等 | 78,336,956 |
| 株式(評価額) | 1,454,871,694 |
| ハイブリッド優先証券(評価額) | 460,989,498 |
| 投資信託証券(評価額) | 44,453,555 |
| 未収入金 | 52,740,605 |
| 未収配当金 | 2,768,453 |
| 未収利息 | 1,546,025 |
| (B) 負債 | 68,156,508 |
| 未払金 | 67,156,508 |
| 未払解約金 | 1,000,000 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 2,027,550,278 |
| 元本 | 1,005,593,164 |
| 次期繰越損益金 | 1,021,957,114 |
| (D) 受益権総口数 | 1,005,593,164口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 20,163円 |

* 期首における元本額は1,096,386,553円、当期中における追加設定元本額は70,738,375円、同解約元本額は161,531,764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、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)20,706,336円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)22,360,164円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)369,406,445円、ダイワ・株・債券/コモディティ・バランスファンド59,961,631円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)65,698,459円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)78,773,873円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)155,876,238円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)232,810,018円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,163円です。

■損益の状況

当期 自2015年4月16日 至2015年10月15日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------|
| (A) 配当等収益 | 33,695,803円 |
| 受取配当金 | 18,061,504 |
| 受取利息 | 13,798,118 |
| その他収益金 | 1,836,181 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 106,181,160 |
| 売買益 | 45,958,414 |
| 売買損 | △ 152,139,574 |
| (C) その他費用 | △ 1,081,556 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | △ 73,566,913 |
| (E) 前期繰越損益金 | 1,201,515,455 |
| (F) 解約差損益金 | △ 184,493,053 |
| (G) 追加信託差損益金 | 78,501,625 |
| (H) 合計(D + E + F + G) | 1,021,957,114 |
| 次期繰越損益金(H) | 1,021,957,114 |

(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。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

運用報告書 第20期（決算日 2015年10月15日）

（計算期間 2015年4月16日～2015年10月15日）

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの第20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 | 欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 |
| 運用方法 | ①銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。 ②外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。 ③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ④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。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 |
| 株式組入制限 | 無制限 |

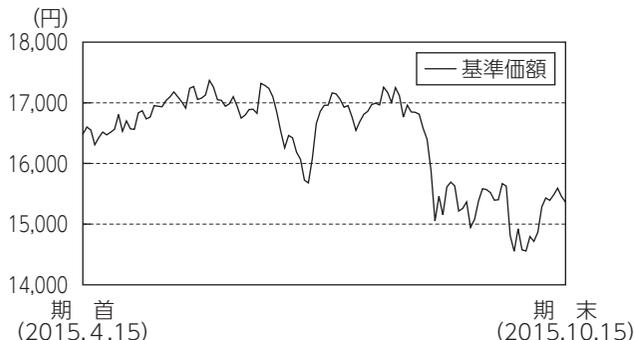
大和投資信託

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



| 年月日 | 基準価額 | | MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、円換算) (参考指数) | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 |
|-----------------|--------|-------|-------------------------------------|-------|------------|------------|
| | 円 | % | 騰落率 | % | % | % |
| (期首)2015年4月15日 | 16,484 | - | 17,725 | - | 97.9 | - |
| 4月末 | 16,531 | 0.3 | 17,854 | 0.7 | 99.1 | - |
| 5月末 | 17,268 | 4.8 | 18,861 | 6.4 | 96.2 | - |
| 6月末 | 16,533 | 0.3 | 18,137 | 2.3 | 95.5 | - |
| 7月末 | 16,860 | 2.3 | 18,410 | 3.9 | 96.2 | - |
| 8月末 | 15,692 | △ 4.8 | 16,926 | △ 4.5 | 92.1 | - |
| 9月末 | 14,557 | △11.7 | 15,646 | △11.7 | 92.9 | - |
| (期末)2015年10月15日 | 15,363 | △ 6.8 | 16,660 | △ 6.0 | 93.0 | - |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIヨーロッパ指数(配当込み、円換算)は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIヨーロッパ指数(配当込み、ユーロベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIヨーロッパ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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。

(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) 株式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

【基準価額・騰落率】

期首：16,484円 期末：15,363円 騰落率：△6.8%

【基準価額の主な変動要因】

欧州株式市況が下落したことがマイナス要因となり、基準価額は値下がりしました。

◆投資環境について

○欧州株式市況

欧州株式は下落しました。期首から、欧州域内の国債利回りの上昇などにより下落が始まりました。その後も、ギリシャと国際債権団との交渉が決裂したことを受けて、上値の重い展開が続きました。2015年7月には、ユーロ圏首脳会合でギリシャ救済案が合意されたことなどを好感して一時反発しました。しかし8月以降は、中国をはじめとする新興国の景気への懸念や中国株式の急落から、欧州株式も大幅下落となりました。さらに、米国の利上げ開始時期への不透明感やドイツの自動車大手が米国の排ガス検査で不正

行為を行っていたことなどがマイナス材料となり、期首比で下落して期末を迎えました。

○為替相場

ユーロの対円相場は上昇しました。期首から2015年6月中旬にかけては、ユーロ圏の景気回復期待や欧州域内の国債利回りの上昇などを受けて、ユーロは堅調に推移しました。しかし6月下旬以降は、ギリシャのユーロ離脱への懸念が高まったことなどが嫌気されて、上値が重い展開となりました。8月に入ると、中国経済への不安を背景に市場でのリスク回避姿勢が強まった影響から再び軟調となり、上げ幅を縮小して期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア・インベスト・マネジメント・リミテッド(以下、パイオニア社)に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、景気回復局面で収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、パイオニア社に運用の指図にかかる権限を委託しております。

株式組入比率は、高位に維持しました。銘柄選定にあたって、パイオニア社では、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、景気回復局面で収益改善が見込まれる銘柄に選別投資しました。そのような運用方針において、セクター別では、金融セクターや生活必需品セクター、個別銘柄では、NESTLE(スイス、生活必需品)、NOVARTIS(スイス、ヘルスケア)、BRITISH AMERICAN TOBACCO(英国、生活必需品)などを高位で組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。参考指数は欧州株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア社に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、景気回復局面で収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------|------------|
| 売買委託手数料 (株式) | 1円 (1) |
| 有価証券取引税 (株式) | 3 (3) |
| その他費用 (保管費用) | 15 (14) |
| その他 | (1) |
| 合 計 | 19 |

(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は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

株 式

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | | |
|---|---------------|-----------------------|-------------------------------|--------------|-----------------------|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 | |
| 外 | イギリス | 百株 468.77 (-) | 千イギリス・ポンド 261 (-) | 百株 910.89 | 千イギリス・ポンド 528 |
| | スイス | 百株 (1.21) | 千スイス・フラン - (△ 3) | 百株 24.7 | 千スイス・フラン 267 |
| | デンマーク | 百株 (-) | 千デンマーク・クローネ - (-) | 百株 59.25 | 千デンマーク・クローネ 268 |
| | ノルウェー | 百株 (-) | 千ノルウェー・クローネ - (-) | 百株 55.38 | 千ノルウェー・クローネ 726 |
| | スウェーデン | 百株 15.4 (-) | 千スウェーデン・クローネ 495 (△ 61) | 百株 54.6 | 千スウェーデン・クローネ 1,285 |
| | ユーロ (オランダ) | 百株 21.58 (-) | 千ユーロ 40 (-) | 百株 81.32 | 千ユーロ 175 |
| | ユーロ (フランス) | 百株 9.45 (-) | 千ユーロ 53 (△ 5) | 百株 56.02 | 千ユーロ 308 |
| | ユーロ (ドイツ) | 百株 1.76 (-) | 千ユーロ 26 (-) | 百株 66.98 | 千ユーロ 444 |

| | 買 付 | | 売 付 | | |
|---|-----------------|-------------------------|----------------------|--------------|---------------|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 | |
| 外 | ユーロ (ポルトガル) | 百株 (-) | 千ユーロ (-) | 百株 66.44 | 千ユーロ 64 |
| | ユーロ (スペイン) | 百株 (3.71) | 千ユーロ (6) | 百株 88.84 | 千ユーロ 120 |
| | ユーロ (イタリア) | 百株 108.24 (-) | 千ユーロ 158 (-) | 百株 - | 千ユーロ - |
| | ユーロ (オーストリア) | 百株 (-) | 千ユーロ (-) | 百株 33.18 | 千ユーロ 137 |
| | ユーロ (ユーロ通貨計) | 百株 141.03 (3.71) | 千ユーロ 277 (0) | 百株 392.78 | 千ユーロ 1,252 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 当 | | | | 期 | | | | | |
|------------------------------------|---|--------|--------|--------|------------------------------------|---|--------|--------|--------|
| 銘 | 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 | 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 |
| AVIVA PLC (イギリス) | | 44.734 | 43,111 | 963 | TOTAL SA (フランス) | | 3.583 | 22,604 | 6,308 |
| ENI SPA (イタリア) | | 10.824 | 21,382 | 1,975 | ALLIANZ SE-REG (ドイツ) | | 1.081 | 22,334 | 20,661 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス) | | 0.945 | 7,181 | 7,599 | OESTERREICHISCHE POST AG (オーストリア) | | 3.318 | 18,851 | 5,681 |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS (スウェーデン) | | 1.54 | 7,079 | 4,596 | BP PLC (イギリス) | | 20.783 | 17,848 | 858 |
| KONINKLIJKE AHOLD NV (オランダ) | | 2.158 | 5,426 | 2,514 | VODAFONE GROUP PLC (イギリス) | | 33.214 | 14,580 | 438 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC (イギリス) | | 2.143 | 5,287 | 2,467 | KONINKLIJKE AHOLD NV (オランダ) | | 5.938 | 14,001 | 2,357 |
| ALLIANZ SE-REG (ドイツ) | | 0.176 | 3,565 | 20,259 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS (イギリス) | | 3.789 | 13,969 | 3,686 |
| | | | | | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG (ドイツ) | | 1.184 | 12,626 | 10,664 |
| | | | | | DNB ASA (ノルウェー) | | 5.538 | 11,203 | 2,023 |
| | | | | | REPSOL SA (スペイン) | | 7.402 | 11,106 | 1,500 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■組入資産明細表
外国株式

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|------------------|-----------------|--------------------|----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| BP PLC | 207.83 | — | — | — | エネルギー |
| REXAM PLC | 352.72 | 291.92 | 156 | 28,758 | 素材 |
| PRUDENTIAL PLC | 170.18 | 148.44 | 216 | 39,920 | 金融 |
| AVIVA PLC | — | 406.69 | 186 | 34,403 | 金融 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 157.72 | 159 | 208 | 38,456 | ヘルスケア |
| VODAFONE GROUP PLC | 1,232.19 | 900.05 | 183 | 33,826 | 電気通信サービス |
| KINGFISHER PLC | 510.29 | 445.04 | 156 | 28,895 | 一般消費サービス |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 39.21 | 34.2 | 206 | 38,005 | 生活必需品 |
| NATIONAL GRID PLC | 254.07 | 221.59 | 201 | 37,017 | 公益事業 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 83.28 | 72.64 | 271 | 49,985 | 生活必需品 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 596.77 | 520.46 | 268 | 49,413 | 金融 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 137.13 | 99.24 | 175 | 32,317 | エネルギー |
| イギリス・ポンド 通貨計 | 3,741.39 11銘柄 | 3,299.27 11銘柄 | 2,232 | 411,002 <28.1%> | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイスフラン | 千円 | |
| NESTLE SA-REG | 88.11 | 76.85 | 571 | 71,616 | 生活必需品 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 11.52 | 10.05 | 250 | 31,453 | 金融 |
| NOVARTIS AG-REG | 64.33 | 56.11 | 490 | 61,502 | ヘルスケア |
| GIVAUDAN-REG | 1.58 | 1.38 | 233 | 29,231 | 素材 |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG | 27.81 | 25.47 | 135 | 16,951 | 素材 |
| スイス・フラン 通貨計 | 193.35 5銘柄 | 169.86 5銘柄 | 1,681 | 210,756 <14.4%> | |
| (デンマーク) | 百株 | 百株 | 千デンマーク クローネ | 千円 | |
| TDC A/S | 463.45 | 404.2 | 1,341 | 24,536 | 電気通信サービス |
| デンマーク・クローネ 通貨計 | 463.45 1銘柄 | 404.2 1銘柄 | 1,341 | 24,536 <1.7%> | |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千ノルウェー クローネ | 千円 | |
| DNB ASA | 198.19 | 142.81 | 1,673 | 24,637 | 金融 |
| ノルウェー・クローネ 通貨計 | 198.19 1銘柄 | 142.81 1銘柄 | 1,673 | 24,637 <1.7%> | |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千スウェーデン クローネ | 千円 | |
| SWEDBANK AB - A SHARES | 141.59 | 123.5 | 2,342 | 34,345 | 金融 |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 55.47 | 63.78 | 2,007 | 29,424 | 一般消費サービス |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 136.76 | 107.34 | 2,375 | 34,823 | 生活必需品 |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 102.92 | 102.92 | 2,010 | 29,467 | 資本財・サービス |
| スウェーデン・クローネ 通貨計 | 436.74 4銘柄 | 397.54 4銘柄 | 8,735 | 128,061 <8.8%> | |
| ユーロ(オランダ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 117.04 | 102.09 | 225 | 30,764 | 資本財・サービス |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 156.55 | 118.75 | 205 | 28,054 | 生活必需品 |
| KONINKLIJKE DSM NV | 54.71 | 47.72 | 216 | 29,594 | 素材 |
| 国小計 | 328.3 3銘柄 | 268.56 3銘柄 | 647 | 88,413 <6.0%> | |
| ユーロ(フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| TOTAL SA | 92.19 | 56.36 | 251 | 34,333 | エネルギー |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 42.78 | 46.76 | 236 | 32,317 | 資本財・サービス |
| BNP PARIBAS | 68.64 | 59.87 | 318 | 43,404 | 金融 |

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 |
|-----------------------------|------------------|------------------|------------------|-----------------------------|----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| SANOFI | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| | 46.59 | 40.64 | 345 | 47,117 | ヘルスケア |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 250.2 4銘柄 | 203.63 4銘柄 | 1,151 157,173 <10.7%> | |
| ユーロ(ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| BAYER AG-REG | 31.97 | 27.89 | 301 | 41,109 | ヘルスケア |
| SIEMENS AG-REG | 28.54 | 24.89 | 208 | 28,436 | 資本財・サービス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 32.67 | 20.83 | 180 | 24,659 | 一般消費サービス |
| BASF SE | 43.9 | 38.29 | 268 | 36,601 | 素材 |
| ALLIANZ SE-REG | 24.46 | 15.41 | 222 | 30,348 | 金融 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 242.44 | 211.45 | 309 | 42,205 | 電気通信サービス |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 403.98 6銘柄 | 338.76 6銘柄 | 1,490 203,360 <13.9%> | |
| ユーロ(ポルトガル) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| CTT-CORREIOS DE PORTUGAL | 274.17 | 207.73 | 204 | 27,846 | 資本財・サービス |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 274.17 1銘柄 | 207.73 1銘柄 | 204 27,846 <1.9%> | |
| ユーロ(スペイン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| REPSOL SA | 126.21 | 55.9 | 67 | 9,277 | エネルギー |
| ENAGAS SA | 115.97 | 101.15 | 268 | 36,590 | 公益事業 |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 242.18 2銘柄 | 157.05 2銘柄 | 336 45,867 <3.1%> | |
| ユーロ(イタリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ENI SPA | — | 108.24 | 166 | 22,661 | エネルギー |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | — 1銘柄 | 108.24 1銘柄 | 166 22,661 <1.5%> | |
| ユーロ(オーストリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| OESTERREICHISCHE POST AG | 71.36 | 38.18 | 121 | 16,622 | 資本財・サービス |
| 国小計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 71.36 1銘柄 | 38.18 1銘柄 | 121 16,622 <1.1%> | |
| ユーロ通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 1,570.19 17銘柄 | 1,322.15 18銘柄 | 4,117 561,944 <38.4%> | |
| ファンド合計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 6,603.31 39銘柄 | 5,735.83 40銘柄 | — 1,360,938 <93.0%> | |

(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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 1,360,938 | 93.0 |
| コール・ローン等、その他 | 102,053 | 7.0 |
| 投資信託財産総額 | 1,462,991 | 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、10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝118.99円、1イギリス・ポンド＝184.14円、1スイス・フラン＝125.34円、1デンマーク・クローネ＝18.29円、1ノルウェー・クローネ＝14.72円、1スウェーデン・クローネ＝14.66円、1ユーロ＝136.48円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(1,422,136千円)の投資信託財産総額(1,462,991千円)に対する比率は、97.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------|----------------|
| (A) 資産 | 1,462,991,397円 |
| コール・ローン等 | 100,864,938 |
| 株式(評価額) | 1,360,938,077 |
| 未収配当金 | 1,188,382 |
| (B) 負債 | — |
| (C) 純資産総額(A - B) | 1,462,991,397 |
| 元本 | 952,261,509 |
| 次期繰越損益金 | 510,729,888 |
| (D) 受益権総口数 | 952,261,509口 |
| 1万口当り基準価額(C / D) | 15,363円 |

* 期首における元本額は1,081,762,769円、当期中における追加設定元本額は53,116,754円、同解約元本額は182,618,014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、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)26,193,797円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)29,008,270円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)479,952,759円、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド76,252,353円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)83,809,190円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)43,180,616円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)85,620,595円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)128,243,929円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,363円です。

■損益の状況

当期 自2015年4月16日 至2015年10月15日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|--------------|
| (A) 配当等収益 | 36,884,625円 |
| 受取配当金 | 36,871,923 |
| 受取利息 | 12,702 |
| (B) 有価証券売買損益 | △134,212,901 |
| 売買益 | 107,687,116 |
| 売買損 | △241,900,017 |
| (C) その他費用 | △ 1,539,050 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | △ 98,867,326 |
| (E) 前期繰越損益金 | 701,446,561 |
| (F) 解約差損益金 | △124,281,593 |
| (G) 追加信託差損益金 | 32,432,246 |
| (H) 合計(D + E + F + G) | 510,729,888 |
| 次期繰越損益金(H) | 510,729,888 |

(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。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

運用報告書 第20期（決算日 2015年10月15日）

（計算期間 2015年4月16日～2015年10月15日）

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの第20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 | アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 |
| 運用方法 | ①銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。 ②株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ③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。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 |
| 株式組入制限 | 無制限 |

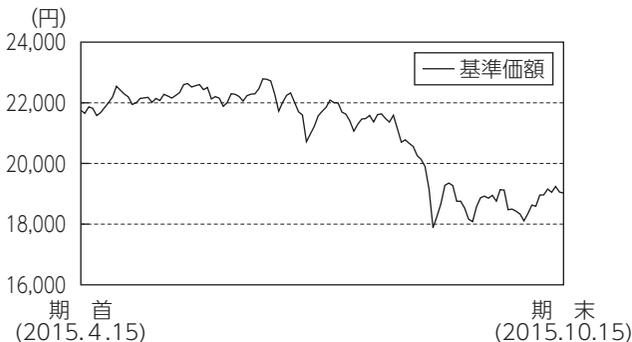
大和投資信託

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



| 年 月 日 | 基準 価 額 | | MSCIパシフィック指数 (除く日本、配当込み、円換算) | | 株 式 組入比率 | | 株 式 先物比率 | | 投資信託 組入比率 | |
|-----------------|--------|-------|---------------------------------|-------|-------------|---|-------------|---|--------------|--|
| | 円 | % | (参考指数) | % | % | % | % | % | | |
| (期首)2015年4月15日 | 21,752 | - | 23,708 | - | 91.5 | - | 3.3 | | | |
| 4月末 | 22,415 | 3.0 | 24,152 | 1.9 | 93.2 | - | 3.5 | | | |
| 5月末 | 22,519 | 3.5 | 23,880 | 0.7 | 92.5 | - | 3.5 | | | |
| 6月末 | 21,725 | △ 0.1 | 22,685 | △ 4.3 | 89.0 | - | 3.6 | | | |
| 7月末 | 21,481 | △ 1.2 | 22,714 | △ 4.2 | 89.4 | - | - | | | |
| 8月末 | 19,354 | △11.0 | 20,092 | △15.3 | 93.5 | - | - | | | |
| 9月末 | 18,109 | △16.7 | 18,530 | △21.8 | 89.4 | - | - | | | |
| (期末)2015年10月15日 | 19,026 | △12.5 | 20,107 | △15.2 | 94.7 | - | - | | | |

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) MSCIパシフィック指数 (除く日本、配当込み、円換算) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIパシフィック指数 (除く日本、配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIパシフィック指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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。
 (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) 株式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

【基準価額・騰落率】

期首：21,752円 期末：19,026円 騰落率：△12.5%

【基準価額の主な変動要因】

当期の基準価額は、主として株価の下落を反映して、値下がりしました。

◆投資環境について

○アジア・オセアニア株式市況

アジア・オセアニア株式市況は下落しました。期首から2015年8月下旬にかけては、2015年内の米国利上げ観測や中国の株式信用取引規制強化に対する懸念、ギリシャのユーロ離脱懸念、中国人民元の実質的な切下げを受けた中国および新興国株式市場でのリスクオフの動きなどから、軟調な値動きとなりました。9月上旬から期末にかけては、中国財政部が経済成長の目標達成へ向けて積極的な財政措置を実施する旨を示したことや、米国の労働市場回復の緩みを受けて早期の利上げ観測が後退したことなどから反発しました。

○為替相場

香港ドルは米ドルペッグ制 (米ドルに連動する政策) を採用しているため、米ドルに連動した値動きとなりました。米ドルは、2015年内の米国利上げ観測を受けた日米金利差拡大の思惑から円対円対上昇したものの、8月後半の世界同時株安を背景としたリスク回避の流れから下落に転じ、ほぼ横ばいでの推移となりました。オーストラリア・ドルは、コモディティ価格の下落などを受けて、円高オーストラリア・ドル安となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

オーストラリアや香港、韓国、台湾を中心に市場分散に配慮したポートフォリオとする方針です。革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景として、市場予想を上回る業績が期待できる企業を選別して投資を行ないます。また、世界的な低金利が継続していることから、配当利回りの高い銘柄に注目しています。

◆ポートフォリオについて

オーストラリアや香港、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組入れました。国別では、雇用や住宅市場の底堅い推移から堅調な株価動向が見込まれたオーストラリアや、革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景にIT (情報技術) 企業の好業績が見込まれた台湾を組入高位としました。個別銘柄では、製品の内製化による採算改善や高い配当利回りが見込まれたオーストラリアの素材銘柄や、ウェアラブル機器等の売上高増加が見込まれた台湾のIT銘柄を組入高位としました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。

参考指数はアジア・オセアニア企業で構成されるMSCIパシフィック指数 (除く日本、配当込み、円換算) を代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

オーストラリアや香港、台湾、韓国を中心に市場分散に配慮したポートフォリオとする方針です。革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景として、市場予想を上回る業績が期待できる企業を選別して投資を行ないます。また、高い成長性などを背景に今後株式市場での認知度の高まりが見込まれる中小型株に注目しています。

■ 1万口当りの費用の明細

| 項目 | 当期 |
|-----------------------------|-----------------------|
| 売買委託手数料 (株式) (投資信託証券) | 148円 (146) (2) |
| 有価証券取引税 (株式) | 53 (53) |
| その他費用 (保管費用) (その他) | 35 (33) (2) |
| 合計 | 236 |

(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は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-------|-----------|-------------------------|----------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 | オーストラリア | 百株 | 千オーストラリア・ドル 5,499 (492,88) | 百株 | 千オーストラリア・ドル 6,193 106) |
| | | 7,067 | 5,619 | | |
| | 香港 | 百株 | 千香港ドル 36,828 () | 百株 | 千香港ドル 27,928 () |
| | 34,518.55 | 33,463 | | | |
| 国 | シンガポール | 百株 | 千シンガポール・ドル 4,085 () | 百株 | 千シンガポール・ドル 649 () |
| | | 3,160 | 800 | | |
| | 台湾 | 百株 | 千台湾ドル 19,450 (264.87) | 百株 | 千台湾ドル 52,632 682) |
| | | 34,722.84 | 88,724 | | |
| 韓国 | 百株 | 千韓国ウォン 824.43 () | 百株 | 千韓国ウォン 3,870,262 () | |
| 819.9 | 3,713,787 | | | | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|---------|-----|-------------|-----------|-------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 | オーストラリア | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千口 | 千オーストラリア・ドル |
| 国 | | () | () | 86 () | 535 () |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付()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4) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 当 | | | | 期 | | | | | |
|-----------------------------------|---|--------|---------|---------|-----------------------------------|---|-------|---------|--------|
| 買 | | 付 | | 売 | | 付 | | | |
| 銘 | 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 | 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 |
| CLP HOLDINGS LTD (香港) | | 142.5 | 150,191 | 1,053 | CLP HOLDINGS LTD (香港) | | 142.5 | 148,485 | 1,042 |
| TELSTRA CORP LTD (オーストラリア) | | 160 | 91,541 | 572 | TELSTRA CORP LTD (オーストラリア) | | 160 | 87,456 | 546 |
| RIO TINTO LTD (オーストラリア) | | 15.5 | 82,463 | 5,320 | WESTPAC BANKING CORP (オーストラリア) | | 25 | 81,403 | 3,256 |
| CROWN CONFECTIONERY CO LTD (韓国) | | 1.02 | 70,952 | 69,560 | RIO TINTO LTD (オーストラリア) | | 15.5 | 72,935 | 4,705 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国) | | 0.48 | 61,099 | 127,291 | CHINA AIRLINES LTD (台湾) | | 970 | 53,602 | 55 |
| CRUCIALTEC CO LTD (韓国) | | 31.743 | 49,982 | 1,574 | CROWN CONFECTIONERY CO LTD (韓国) | | 0.67 | 49,517 | 73,906 |
| AMCOR LIMITED (オーストラリア) | | 38 | 48,009 | 1,263 | BHP BILLITON LIMITED (オーストラリア) | | 21 | 47,171 | 2,246 |
| BHP BILLITON LIMITED (オーストラリア) | | 20.5 | 45,106 | 2,200 | KING YUAN ELECTRONICS CO LTD (台湾) | | 500 | 43,743 | 87 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国) | | 31 | 40,181 | 1,296 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR (香港) | | 11 | 42,892 | 3,899 |
| CHINA AIRLINES LTD (台湾) | | 700 | 37,863 | 54 | SYDNEY AIRPORT (オーストラリア) | | 80 | 41,490 | 518 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|------------------|---------------------|-------------------|--------------------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (オーストラリア) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| BHP BILLITON LIMITED | 130 | 125 | 308 | 26,848 | 素材 |
| SOUTH32 LTD | - | 130 | 19 | 1,680 | 素材 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | - | 45 | 138 | 12,085 | エネルギー |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | - | 260 | 263 | 22,944 | 金融 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 100 | 108 | 340 | 29,617 | 金融 |
| WESTPAC BANKING CORP | 250 | 100 | 304 | 26,491 | 金融 |
| SANTOS LTD | 350 | - | - | - | エネルギー |
| AUST AND NZ BANKING GROUP | - | 90 | 257 | 22,440 | 金融 |
| AMCOR LIMITED | 500 | 680 | 887 | 77,230 | 素材 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | - | 41.73 | 311 | 27,078 | 金融 |
| QANTAS AIRWAYS LTD | - | 500 | 190 | 16,535 | 資本財・サービス |
| MACQUARIE GROUP LTD | 35 | - | - | - | 金融 |
| CSL LTD | 20 | 17 | 151 | 13,204 | ヘルスケア |
| WESFARMERS LTD | - | 80 | 321 | 28,009 | 生活必需品 |
| COMPUTERSHARE LTD | - | 140 | 150 | 13,073 | 情報技術 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | - | 140 | 260 | 22,699 | ヘルスケア |
| TRANSURBAN GROUP | 300 | 300 | 303 | 26,448 | 資本財・サービス |
| SYDNEY AIRPORT | 800 | - | - | - | 資本財・サービス |
| DUET GROUP | 950 | 603.15 | 134 | 11,705 | 公益事業 |
| SPARK INFRASTRUCTURE GROUP | 1,000 | - | - | - | 公益事業 |
| オーストラリア・ドル 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 4,435 3,359.88 | 4,344 3,359.88 | 378,094 <34.2%> | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| GEELEY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | - | 3,000 | 1,116 | 17,130 | 一般消費・サービス |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 70 | 35 | 688 | 10,567 | 金融 |
| TONGDA GROUP HOLDINGS LTD | 5,500 | - | - | - | 情報技術 |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 600 | - | - | - | 金融 |
| PETROCHINA CO LTD-H | 1,300 | - | - | - | エネルギー |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 1,500 | - | - | - | 金融 |
| BEST PACIFIC INTERNATIONAL H | - | 1,500 | 511 | 7,851 | 一般消費・サービス |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 155.55 | - | - | - | 金融 |
| AIA GROUP LTD | 600 | 300 | 1,315 | 20,192 | 金融 |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD | - | 1,600 | 1,328 | 20,384 | 一般消費・サービス |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 740 | - | - | - | 金融 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | - | 150 | 626 | 9,612 | 金融 |
| CHINA AIRCRAFT LEASING GROUP | 1,000 | - | - | - | 資本財・サービス |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 600 | - | - | - | 金融 |
| YESTAR INTERNATIONAL HOLDING | - | 7,790 | 2,352 | 36,112 | 資本財・サービス |
| 香港ドル 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 12,065.55 14,375 | 7,938 14,375 | 121,852 <11.0%> | |
| (シンガポール) | 百株 | 百株 | 千シンガポール ドル | 千円 | |
| EZION HOLDINGS LTD | 1,500 | - | - | - | エネルギー |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 125 | 170 | 296 | 25,607 | 金融 |
| SHENG SIONG GROUP LTD | 3,500 | 5,000 | 427 | 36,944 | 生活必需品 |
| CAPITALAND LTD | 1,000 | - | - | - | 金融 |
| INNOVALUES LTD | - | 2,000 | 130 | 11,234 | 一般消費・サービス |
| M1 LTD | 570 | 450 | 129 | 11,161 | 電気通信サービス |
| ROTARY ENGINEERING LTD | 440 | 440 | 16 | 1,463 | 資本財・サービス |
| シンガポール・ドル 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 7,135 8,060 | 999 8,060 | 86,411 <7.8%> | |

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|----------------------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾ドル | 千円 | |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 150 | - | - | - | 一般消費・サービス |
| MAKALOT INDUSTRIAL CO LTD | 110 | 113.84 | 2,669 | 9,770 | 一般消費・サービス |
| HOTA INDUSTRIAL MFG CO LTD | 853.74 | - | - | - | 一般消費・サービス |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 3,000 | 2,512.5 | 20,602 | 75,405 | 情報技術 |
| KING YUAN ELECTRONICS CO LTD | 5,000 | - | - | - | 情報技術 |
| CHINA AIRLINES LTD | 6,200 | 3,500 | 3,885 | 14,219 | 資本財・サービス |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 1,500 | 700 | 3,213 | 11,759 | 金融 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 8,700 | 7,000 | 6,328 | 23,160 | 金融 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 500 | - | - | - | 電気通信サービス |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP | 800 | - | - | - | 情報技術 |
| BIZLINK HOLDING INC | - | 241.42 | 3,657 | 13,386 | 資本財・サービス |
| SPORTLINK INTERNATIONAL INC | 209.1 | - | - | - | 資本財・サービス |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | - | 210 | 3,706 | 13,565 | 一般消費・サービス |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 900 | 914.61 | 3,571 | 13,071 | 金融 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 800 | 800 | 10,920 | 39,967 | 情報技術 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 450 | 472.5 | 4,068 | 14,889 | 情報技術 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | - | 400 | 8,460 | 30,963 | 生活必需品 |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 2,700 | - | - | - | 情報技術 |
| 台湾ドル 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 31,872.84 15銘柄 | 16,864.87 11銘柄 | 260,159 <23.6%> | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国ウォン | 千円 | |
| TORAY CHEMICAL KOREA INC | 90 | - | - | - | 一般消費・サービス |
| CROWN CONFECTIONERY CO LTD | - | 3.5 | 236,600 | 24,795 | 生活必需品 |
| LOTTE CHEMICAL CORP | 14 | - | - | - | 素材 |
| COSMAX INC | - | 7 | 133,350 | 13,975 | 生活必需品 |
| CRUCIALTEC CO LTD | - | 207.43 | 302,847 | 31,738 | 情報技術 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 2.1 | 4.7 | 589,380 | 61,767 | 情報技術 |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP | 30 | - | - | - | 公益事業 |
| SK TELECOM | 7 | - | - | - | 電気通信サービス |
| MACQUARIE KOREA INFRA FUND | 600 | 300 | 237,300 | 24,869 | その他 |
| PARTRON CO LTD | - | 180 | 173,700 | 18,203 | 情報技術 |
| ISC CO LTD | 30 | 75 | 225,000 | 23,580 | 情報技術 |
| 韓国ウォン 通貨計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 773.1 7銘柄 | 777.63 7銘柄 | 1,898,177 <18.0%> | |
| ファンド合計 | 株数、金額 銘柄数<比率> | 56,281.49 49銘柄 | 43,437.38 46銘柄 | 1,045,447 <94.7%> | |

(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) < >は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首 | | 当 期 | | 期 末 | |
|----------------------------|------------------|-----------|------------|--------|-------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 評 価 額 | 比 率 |
| (オーストラリア) GOODMAN GROUP | 千口 | 千口 | オーストラリア・ドル | 千円 | | |
| | 86 | - | - | - | - | - |
| 合 計 | 口数、金額 銘柄数<比率> | 86 1銘柄 | - | - | - | <-> |

■投資信託財産の構成

2015年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 | | 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|-------|-----|
| | 評 価 額 | 比 率 | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 | % | | |
| | 1,045,447 | 94.7 | | |
| コール・ローン等、その他 | 58,816 | 5.3 | | |
| 投資信託財産総額 | 1,104,264 | 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、10月15日における邦貨換算レートは、1オーストラリア・ドル=87.03円、1香港ドル=15.35円、1シンガポール・ドル=86.42円、1台湾ドル=3.66円、100韓国ウォン=10.48円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(1,088,614千円)の投資信託財産総額(1,104,264千円)に対する比率は、98.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 | 期 末 |
|----------------|-----|----------------|
| (A) 資産 | | 1,110,355,583円 |
| コール・ローン等 | | 45,917,498 |
| 株式(評価額) | | 1,045,447,330 |
| 未収入金 | | 18,513,683 |
| 未収配当金 | | 477,072 |
| (B) 負債 | | 6,107,870 |
| 未払金 | | 6,091,400 |
| その他未払費用 | | 16,470 |
| (C) 純資産総額(A-B) | | 1,104,247,713 |
| 元本 | | 580,380,670 |
| 次期繰越損益金 | | 523,867,043 |
| (D) 受益権総口数 | | 580,380,670口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | | 19,026円 |

*期首における元本額は701,501,310円、当期中における追加設定元本額は13,249,339円、同解約元本額は134,369,979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、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)21,285,343円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)23,869,333円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)375,493,723円、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド59,880,269円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)65,607,238円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)5,746,044円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)11,327,582円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)17,171,138円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は19,026円です。

■損益の状況

当期 自2015年4月16日 至2015年10月15日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------------|
| (A) 配当等収益 | 31,586,070円 |
| 受取配当金 | 31,544,726 |
| 受取利息 | 41,344 |
| (B) 有価証券売買損益 | △189,992,647 |
| 売買益 | 68,844,718 |
| 売買損 | △258,837,365 |
| (C) その他費用 | △ 2,213,596 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △160,620,173 |
| (E) 前期繰越損益金 | 824,411,227 |
| (F) 解約差損益金 | △153,224,672 |
| (G) 追加信託差損益金 | 13,300,661 |
| (H) 合計(D+E+F+G) | 523,867,043 |
| 次期繰越損益金(H) | 523,867,043 |

(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。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

運用報告書 第21期（決算日 2015年10月15日）

（計算期間 2015年4月16日～2015年10月15日）

ダイワ好配当日本株マザーファンドの第21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 | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。以下同じ。） |
| 運用方法 | ①主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。 ②株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。 ③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。 ④J-R E I T（不動産投資信託証券）に投資することがあります。J-R E I Tへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-R E I Tは、外貨建資産を保有する場合があります。 |
| 株式組入制限 | 無制限 |

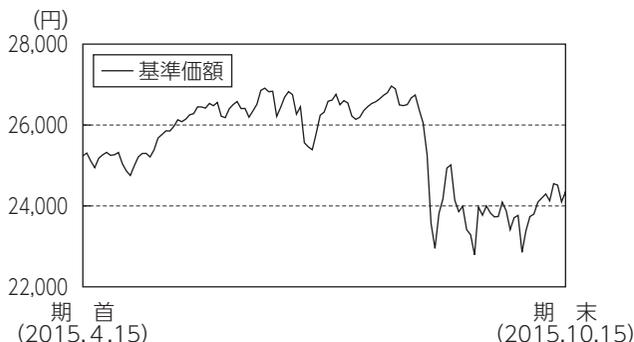
大和投資信託

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



| 年月日 | 基準価額 | | T O P I X (参考指数) | | 株式 | 株式 | 投資信託 |
|-----------------|--------|------|------------------|-------|------|-----|--------|
| | 円 | % | 騰落率 | 騰落率 | 組比率 | 先比率 | 証券組入比率 |
| (期首)2015年4月15日 | 25,239 | - | 1,588.81 | - | 92.3 | 1.8 | 4.8 |
| 4月末 | 25,041 | △0.8 | 1,592.79 | 0.3 | 90.4 | 0.9 | 4.7 |
| 5月末 | 26,279 | 4.1 | 1,673.65 | 5.3 | 91.7 | 0.9 | 4.4 |
| 6月末 | 26,434 | 4.7 | 1,630.40 | 2.6 | 93.5 | 0.3 | 4.5 |
| 7月末 | 26,453 | 4.8 | 1,659.52 | 4.5 | 93.7 | - | 4.4 |
| 8月末 | 25,015 | △0.9 | 1,537.05 | △3.3 | 91.5 | 0.9 | 4.3 |
| 9月末 | 23,390 | △7.3 | 1,411.16 | △11.2 | 89.0 | 2.5 | 5.1 |
| (期末)2015年10月15日 | 24,353 | △3.5 | 1,490.72 | △6.2 | 90.3 | 0.5 | 4.8 |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式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

【基準価額・騰落率】

期首：25,239円 期末：24,353円 騰落率：△3.5%

【基準価額の主な変動要因】

わが国の株式に投資した結果、国内株式市況の下落を反映し、基準価額は値下がりしました。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、ECB（欧州中央銀行）による量的金融緩和の導入や国内景気の持ち直し、良好な株式需給関係、円安の進行などを受けて、大きく上昇しました。しかし2015年6月からは、ギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念や中国株の急落が上値の抑制要因となり、さらに8月以降は中国を中心とした世界経済の先行き懸念が株価を大きく押し下げました。9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）では利上げが見送られましたが、かえって实体经济の弱さを市場参加者に意識させる結果となり、期末にかけて不安定な推移が続きました。

◆前期における「今後の運用方針」

引き続き、予想配当利回りが高い銘柄のうち、PER（株価収益率）、PBR（株価純資産倍率）などのバリュエーション面から割安感があり、業績改善が期待される銘柄を中心としたポートフォリオを継続する方針です。特に、株主還元の積極化が期待される銘柄や自動車の電装化・安全対策、ウェアラブル端末、マイナンバー、電力自由化、軍事・航空に関連する銘柄などに注目してまいります。また、株価が割安となり企業買収の対象となり得る銘柄や中長期での成長が期待される銘柄などにも注目してまいります。

◆ポートフォリオについて

企業の収益性・安全性などのファンダメンタルズやPER、PBRなどの株価指標、株式需給やテクニカル要因等にも留意して、おおむね210~230銘柄程度を選択して投資しました。

株式組入比率（株式先物、Jリートを含む。）は、設定・解約に対応する場合を除いて、おおむね93~100%程度としました。

業種構成は、業績好調な銘柄やバリュエーション面から魅力的な銘柄などを買付け、建設業、情報・通信業、銀行業、輸送用機器などの組入比率を上げました。一方、大幅に上昇した銘柄や上値の重い銘柄などを売却し、電気機器、機械、化学、食品などの組入比率を下げました。期末では、卸売業、化学、輸送用機器、建設業などを中心としたポートフォリオとしました。

個別銘柄では、大幅に上昇した村田製作所やヤマハ発動機などを売却しました。一方、バリュエーションの割安な日本電信電話やM C U B S M i d c i t y 投資法人などを買付けました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。

参考指数との差異については、組入れていた中小型銘柄の一部が大幅に上昇したことがプラスに寄りました。特に、河西工業やオカモトなどの中小型銘柄の株価が大幅に上昇したことがプラス要因となりました。

《今後の運用方針》

引き続き、予想配当利回りが高い銘柄のうち、PER、PBRなどのバリュエーション面から割安感があり、業績改善が期待される銘柄を中心としたポートフォリオを継続する方針です。とりわけテーマ性のある銘柄（訪日外国人の増加により恩恵を受ける銘柄やマイナンバー関連、電力小売自由化関連銘柄など）やバリュエーションが割安で株価に出遅れ感のある銘柄などに注目してまいります。また、株主還元策の強化により市場の評価が高まることが想定される銘柄や、企業買収の対象となり得る銘柄、中長期での成長が期待される銘柄などにも注目してまいります。

■ 1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|----------|------|
| 売買委託手数料 | 39円 |
| (株式) | (36) |
| (先物) | (2) |
| (投資信託証券) | (1) |
| 有価証券取引税 | — |
| その他費用 | — |
| 合 計 | 39 |

(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は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---------------------------|-------------------------|----------------|------------------|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国内 | 千株 50,918.7 (408.2) | 千円 59,044,431 (-) | 千株 66,582.2 | 千円 75,216,878 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 当 | | | | | 期 | | | | |
|---------------|---|-------|-----------|-------|---------------|---|-------|-----------|--------|
| 買 | | 付 | | | 売 | | 付 | | |
| 銘 | 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 | 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | | 千株 | 千円 | 円 | | | 千株 | 千円 | 円 |
| 日本電信電話 | | 522 | 2,729,201 | 5,228 | 伊藤忠 | | 1,160 | 1,791,728 | 1,544 |
| 三井住友フィナンシャルG | | 494 | 2,557,583 | 5,177 | 村田製作所 | | 96.1 | 1,778,027 | 18,501 |
| みずほフィナンシャルG | | 7,190 | 1,772,765 | 246 | 三井住友フィナンシャルG | | 342 | 1,740,147 | 5,088 |
| 伊藤忠 | | 1,204 | 1,760,686 | 1,462 | 日本航空 | | 386.4 | 1,649,472 | 4,268 |
| 日本航空 | | 382.4 | 1,624,964 | 4,249 | みずほフィナンシャルG | | 5,776 | 1,507,510 | 260 |
| 三井物産 | | 968 | 1,508,577 | 1,558 | 三井物産 | | 928 | 1,411,059 | 1,520 |
| 三菱UFJフィナンシャルG | | 1,610 | 1,379,327 | 856 | 三菱UFJフィナンシャルG | | 1,630 | 1,322,131 | 811 |
| 住友商事 | | 986 | 1,346,995 | 1,366 | 住友商事 | | 1,060 | 1,317,426 | 1,242 |
| 日産自動車 | | 1,120 | 1,289,297 | 1,151 | 日本たばこ産業 | | 280 | 1,215,171 | 4,339 |
| MS & AD | | 267 | 1,058,670 | 3,965 | 日本電信電話 | | 234 | 1,162,613 | 4,968 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | |
|----|------------|-----------------|--------------------|------------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国内 | 千口 8.03 | 千円 1,388,004 | 千口 7.689 (-) | 千円 1,944,973 (-) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 売付()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) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2015年4月16日から2015年10月15日まで)

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|--------------|--------------|---------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国内 株式先物取引 | 百万円 9,575 | 百万円 10,601 | 百万円 - | 百万円 - |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 国内株式

| 銘柄 | 期首当期末 | | | 銘柄 | 期首当期末 | | | 銘柄 | 期首当期末 | | |
|--------------|-------|-------|---------|-----------------|-------|-------|---------|---------------|-------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| 水産・農林業 (-) | 千株 | 千株 | 千円 | 千株 | 千株 | 千円 | 千株 | 千株 | 千円 | | |
| 日本水産 | 822 | - | - | デクセリアルズ | - | 244.2 | 361,171 | DMG森精機 | 312 | - | - |
| 建設業 (8.8%) | | | | 寺岡製作所 | 170.8 | 214.7 | 94,038 | ディスコ | 33 | - | - |
| ウエストホールディングス | 243 | - | - | 有沢製作所 | 696 | 634 | 483,742 | 日進工具 | 19.7 | 35 | 73,395 |
| 第一カッター興業 | 3.4 | - | - | 天馬 | - | 82 | 163,754 | パンチ工業 | 139 | 22 | 19,844 |
| 安藤・間 | - | 616 | 498,960 | パーカーコーポレーション | 518 | 506 | 193,798 | やまびこ | 131.7 | - | - |
| 東急建設 | 782 | - | - | 医薬品 (1.4%) | | | | レオン自動車 | 832 | 330 | 188,760 |
| 北弘電社 | 278 | 278 | 113,702 | 協和発酵キリン | 142 | 32 | 58,976 | 日精エーエスピー | 36.1 | - | - |
| 第一建設工業 | 101.7 | 73.9 | 85,797 | 武田薬品 | 59 | - | - | 日精樹脂工業 | 123 | 157 | 162,809 |
| 大豊建設 | 488 | - | - | 科研製薬 | 150 | 48 | 423,840 | オカダアイオン | 311 | 266 | 305,368 |
| 田辺工業 | 104.9 | 104.9 | 96,298 | エーザイ | 29 | - | - | 北川鉄工所 | 150 | 662 | 202,572 |
| イチケン | - | 464 | 203,696 | 小野薬品 | - | 6 | 86,580 | 鶴見製作所 | 226 | 163.5 | 328,471 |
| 名工建設 | 185 | 165 | 140,415 | 日本ケミファ | 212 | - | - | 三精テクノロジー | - | 50 | 36,050 |
| 矢作建設 | - | 322.3 | 358,719 | ダイト | 66 | 50 | 135,050 | 北越工業 | 287 | 269 | 229,995 |
| 大東建託 | 11 | 17.6 | 226,424 | 石油・石炭製品 (1.6%) | | | | 加藤製作所 | 884 | - | - |
| 前田道路 | - | 105 | 231,840 | 東燃ゼネラル石油 | 430 | 672 | 832,608 | タダノ | 6 | 100 | 140,200 |
| 東洋建設 | - | 688 | 378,400 | MORESCO | 162 | - | - | 兼松エンジニアリング | 30 | 33 | 32,505 |
| 世紀東急 | - | 434 | 262,136 | JXホールディングス | 1,400 | - | - | JUKI | 810 | - | - |
| テノックス | 250 | 250 | 192,500 | ゴム製品 (1.7%) | | | | 電気機器 (6.7%) | | | |
| 日成ビルド工業 | - | 1,060 | 403,860 | 東洋ゴム | - | 100 | 247,200 | ミネベア | 112 | - | - |
| 大和ハウス | - | 157 | 479,321 | ブリヂストン | 152 | - | - | 富士電機 | 80 | - | - |
| ライト工業 | - | 173 | 211,060 | オカモト | 316 | 400 | 486,800 | 明電舎 | - | 573 | 237,795 |
| 積水ハウス | 208 | - | - | フコク | 218.2 | - | - | ダイヘン | 870 | - | - |
| 東京エネシス | 52 | 84 | 85,512 | 相模ゴム | 6 | 138 | 152,904 | 愛知電機 | 788 | 788 | 286,044 |
| 九電工 | - | 76 | 158,688 | ガラス・土石製品 (1.8%) | | | | 田淵電機 | 430 | - | - |
| 太平電業 | - | 264 | 335,016 | 神島化学 | - | 110 | 55,110 | SEMITEC | 79.1 | 79.4 | 105,522 |
| 明星工業 | 260 | - | - | 日本電気硝子 | 350 | - | - | 寺崎電気産業 | 365.5 | 365.5 | 441,524 |
| 高橋カーテンウォール | 8.9 | 81.2 | 68,857 | 太平洋セメント | - | 240 | 92,160 | ミマエンジニアリング | 342 | - | - |
| 食料品 (0.7%) | | | | ノザフ | 612 | 569 | 311,243 | 戸上電機 | 627 | 512 | 343,040 |
| 岩塚製菓 | 22.7 | - | - | トニーオーサノ | 68 | 68 | 11,560 | 富士通 | 680 | - | - |
| S Foods | 337 | 175 | 381,675 | ヨシコシ | - | 44.2 | 51,714 | 能美防災 | 265.6 | 200 | 281,000 |
| 日本たばこ産業 | 162 | - | - | クニミネ工業 | 257 | 257 | 181,185 | ホーチキ | 94 | 137 | 163,715 |
| 繊維製品 (0.7%) | | | | ニチハ | - | 126 | 217,728 | アルプス電気 | 124 | 33 | 109,560 |
| サイボー | 99.9 | 106.6 | 54,152 | 鉄鋼 (1.0%) | | | | スマダコーポレーション | - | 462 | 393,162 |
| 帝人 | 960 | 580 | 230,260 | 日新製鋼 | 232 | - | - | リオン | 132 | 118 | 202,134 |
| サカイ オーベックス | 220 | 320 | 60,800 | 共栄製鋼 | - | 118 | 252,520 | 本多通信工業 | 55 | 90 | 89,910 |
| 化学 (10.3%) | | | | 東洋鋼板 | 139 | - | - | アオイ電子 | 154.7 | - | - |
| 旭化成 | 240 | 100 | 79,270 | 中部鋼板 | 255.2 | - | - | 京享 | 183 | - | - |
| 共和レザー | 53.5 | 72 | 81,720 | モリ工業 | 787 | - | - | 協立電機 | - | 2.4 | 3,631 |
| 住友化学 | - | 480 | 328,320 | 栗本鉄工所 | 510 | - | - | 三社電機製作所 | 479.5 | - | - |
| 東ソー | 1,410 | 790 | 489,800 | 日本精線 | 490 | 487 | 254,214 | 山一電機 | 584 | 388.4 | 384,516 |
| セントラル硝子 | 46 | - | - | 非鉄金属 (0.9%) | | | | 富士通フロンテック | 236.3 | 199.6 | 347,703 |
| 関東電化 | 1,046 | 757 | 641,936 | 日本軽金属HD | - | 400 | 79,600 | ファナック | 22 | - | - |
| デンカ | 770 | 480 | 258,240 | 古河機金 | - | 527 | 152,303 | 芝浦電子 | 200.7 | 22.9 | 42,136 |
| 第一稀元素化学工 | 146.8 | 31.4 | 142,870 | 日本精鋳 | 251 | 271 | 92,140 | 村田製作所 | 74.1 | - | - |
| 日本化学工業 | - | 78 | 20,826 | リョービ | - | 330 | 146,190 | 指月電機 | 32 | - | - |
| 大日精化 | 506 | - | - | 金属製品 (2.7%) | | | | 小糸製作所 | 36 | - | - |
| アイカ工業 | 63 | - | - | ケー・エフ・シー | 160.1 | 160.1 | 459,326 | スター精密 | 265 | - | - |
| 宇部興産 | - | 860 | 198,660 | サンコーテクノ | 185.2 | 171.2 | 217,766 | キャノン | 128 | - | - |
| 積水化成成品 | 426 | 456 | 176,928 | 横河ブリッジHLDGS | - | 142 | 158,046 | 輸送用機器 (10.2%) | | | |
| タイガース ポリマー | 195 | 229 | 161,903 | 駒井ハルテック | 630 | - | - | ダイハツディーゼル | 245 | 233 | 184,303 |
| 日本化薬 | - | 100 | 120,800 | 三和ホールディングス | 246 | - | - | 三桜工業 | 260 | - | - |
| 扶桑化学工業 | 228.8 | 223 | 328,925 | 三協立山 | - | 6 | 10,116 | 名村造船所 | 232 | - | - |
| 中国塗料 | 55 | 72 | 60,192 | 東ブレ | - | 62 | 155,124 | サノヤホールディングス | 400 | - | - |
| 日本特殊塗料 | 58 | 86.5 | 90,652 | 東京製綱 | - | 1,300 | 237,900 | 日産自動車 | 958 | 1,280 | 1,532,160 |
| 太陽ホールディングス | 49.2 | - | - | スーパーツール | 307 | 305 | 146,705 | トヨタ自動車 | 106 | 144 | 1,044,144 |
| DIC | 3,100 | - | - | 機械 (3.5%) | | | | 新明和工業 | - | 318 | 401,316 |
| 富士フィルムHLDGS | 92 | 96 | 436,704 | タクマ | - | 84 | 82,404 | 大同メタル工業 | 118 | - | - |
| コーセー | - | 14.6 | 164,250 | アマダホールディングス | 248 | - | - | カルソニックカンセイ | - | 300 | 288,000 |
| ポーラ・オルビスHD | 31 | 26 | 193,700 | 牧野フライス | 938 | - | - | 河西工業 | 719 | 493 | 710,413 |
| JCU | 110.5 | - | - | 小池酸素 | 46 | 50 | 16,850 | マツダ | - | 234 | 533,286 |
| | | | | 旭ダイヤモンド | 60 | - | - | 富士重工業 | 40 | 54 | 241,704 |

| 銘柄 | 期首 | | 当期末 | |
|------------------------|-------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| ヤマハ発動機 | 千株 | 千株 | 千円 | 千円 |
| IJテクノロジ-HD | 348 | - | - | - |
| ジャムコ | 111 | - | - | - |
| 精密機器 (-) | - | 63 | 297,675 | - |
| 国際計測器 | 127 | - | - | - |
| HOYA | 66 | - | - | - |
| ニプロ | 196 | - | - | - |
| その他製品 (2.5%) | - | - | - | - |
| ブロッコリー | 159 | - | - | - |
| パンダイナムコHLDGS | - | 144 | 426,960 | - |
| S HOE I | 181 | 108.4 | 195,662 | - |
| フジシールインターナショナル | 42 | - | - | - |
| 桑山 | 131.3 | 131.3 | 85,345 | - |
| ニッピ | 414 | 414 | 306,774 | - |
| ピジヨン | - | 95 | 293,550 | - |
| 陸運業 (1.5%) | - | - | - | - |
| 東海旅客鉄道 | - | 12.2 | 249,429 | - |
| 鴻池運輸 | - | 16 | 22,912 | - |
| 山丸 | 480 | - | - | - |
| センコー | 650 | 270 | 237,060 | - |
| トナミホールディングス | 490 | 592 | 226,736 | - |
| 丸和運輸機関 | - | 24 | 55,392 | - |
| 海運業 (0.2%) | - | - | - | - |
| 商船三井 | 850 | 300 | 92,400 | - |
| 川崎汽船 | 1,260 | - | - | - |
| 川崎近海汽船 | 245 | - | - | - |
| 空運業 (1.3%) | - | - | - | - |
| 日本航空 | 160 | 156 | 668,460 | - |
| 倉庫・運輸関連業 (0.4%) | - | - | - | - |
| 東陽倉庫 | 495 | 202 | 51,712 | - |
| 日本コンセプト | 45.7 | 142.8 | 143,085 | - |
| 情報・通信業 (8.4%) | - | - | - | - |
| システナ | 7 | 39 | 45,552 | - |
| エイジア | 43.6 | 26 | 30,030 | - |
| ソリトンシステムズ | 223.7 | 154.4 | 155,789 | - |
| エムアップ | 6 | 45 | 28,440 | - |
| SRAホールディングス | 93.6 | 163.4 | 339,218 | - |
| アパント | 133 | 133 | 191,387 | - |
| グレスコ | 90 | 100 | 179,900 | - |
| フューチャーアーキテクト | 505.6 | 245 | 169,785 | - |
| CAC HOLDINGS | 54 | - | - | - |
| オービックビジネス | - | 11.2 | 69,552 | - |
| 大塚商会 | - | 37 | 220,890 | - |
| ネットワンシステムズ | 252 | - | - | - |
| アルゴグラフィックス | 157.9 | - | - | - |
| 日本ユニシス | 52 | - | - | - |
| 日本電信電話 | - | 350 | 1,505,350 | - |
| KDDI | 96 | - | - | - |
| 沖縄セルラー電話 | 72.5 | 66.2 | 214,488 | - |
| NTTドコモ | 204 | - | - | - |
| NTTデータ | - | 28 | 164,360 | - |
| スクウェア・エニックス・HD | - | 114 | 361,950 | - |
| シーイーシー | 364 | 295 | 304,145 | - |
| カブコン | - | 36 | 86,724 | - |
| ジャストテック | 63.2 | 112 | 126,784 | - |
| SCSK | - | 33 | 145,035 | - |
| 卸売業 (13.9%) | - | - | - | - |
| 横浜冷凍 | - | 278 | 276,054 | - |
| アルコニック | 296 | 236.4 | 401,643 | - |
| あいホールディングス | - | 84 | 241,752 | - |
| クリヤマホールディングス | 300.2 | 230 | 347,760 | - |
| アドヴァン | 1 | 43.2 | 43,934 | - |
| 秋原電機 | 133.3 | 118 | 210,512 | - |
| 岡谷銅機 | 9.3 | 9.3 | 78,585 | - |

| 銘柄 | 期首 | | 当期末 | |
|--------------------------|-------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| 丸文 | 千株 | 千株 | 千円 | 千円 |
| 日本ライフライン | 210 | 314 | 272,238 | - |
| 白銅 | - | 82 | 105,780 | - |
| 伊藤忠 | 192 | 196 | 257,348 | - |
| 三井物産 | 740 | 784 | 1,156,792 | - |
| 三井住友 | 210 | - | - | - |
| 丸藤ノートパイル | 210 | 250 | 371,625 | - |
| 住友商事 | 29 | 18 | 5,004 | - |
| 三菱商事 | 174 | 100 | 127,650 | - |
| 三谷商事 | 19.6 | - | - | - |
| 阪和興業 | 70.8 | 70.8 | 213,816 | - |
| フルサト工業 | 400 | - | - | - |
| ニチモウ | 116.3 | 91.4 | 162,417 | - |
| 稲畑産業 | - | 89 | 21,805 | - |
| 伊藤忠エネクス | 426 | 346 | 462,602 | - |
| リョーサン | 243 | 242 | 231,352 | - |
| 三信電気 | 23.3 | - | - | - |
| 加賀電子 | - | 247 | 313,196 | - |
| フオーバル | 234 | 218 | 367,330 | - |
| 丸紅建材リース | 16 | 62 | 39,928 | - |
| 日鉄住金物産 | 1,889 | 1,858 | 423,624 | - |
| 因幡電機産業 | 1,201 | - | - | - |
| パイテックホールディングス | 69 | - | - | - |
| 東テック | 341.7 | 300.8 | 444,883 | - |
| ジェコス | 274 | 277.6 | 233,739 | - |
| ローソン | 359.2 | 285 | 312,075 | - |
| 小売業 (1.4%) | - | - | - | - |
| コメ兵 | 12.6 | - | - | - |
| 日本調剤 | 80 | - | - | - |
| ノジマ | - | 35 | 151,725 | - |
| 良品計画 | - | 129 | 183,051 | - |
| ハークスレイ | 0.6 | - | - | - |
| 大塚家具 | - | 119 | 159,817 | - |
| 銀行業 (7.0%) | 55 | 145 | 223,300 | - |
| あおぞら銀行 | 3,380 | 3,440 | 1,479,200 | - |
| 三菱UFJフィナンシャルG | 600 | 580 | 430,186 | - |
| 三井住友フィナンシャルG | 66 | 218 | 1,007,378 | - |
| 大分銀行 | 400 | 390 | 186,420 | - |
| 宮崎銀行 | 302 | 363 | 143,385 | - |
| みずほフィナンシャルG | - | 1,414 | 327,906 | - |
| 証券・商品先物取引業 (0.1%) | - | - | - | - |
| FPG | 444 | - | - | - |
| 東海東京HD | 90 | - | - | - |
| 極東証券 | 179 | - | - | - |
| 岩井コスモホールディング | 25 | 30 | 41,340 | - |
| 保険業 (0.8%) | - | - | - | - |
| 損保ジャパン興亜HD | 158 | - | - | - |
| MS&AD | - | 78 | 262,002 | - |
| 第一生命 | 82 | 80 | 157,600 | - |
| 東京海上HD | 98 | - | - | - |
| その他金融業 (0.4%) | - | - | - | - |
| オリックス | 330 | 114 | 195,795 | - |
| 不動産業 (3.4%) | - | - | - | - |
| アーバネットコーポレーション | - | 371 | 112,042 | - |
| サムディ | - | 270.3 | 305,439 | - |
| エニジホールディングス | 106 | 56 | 282,800 | - |
| サンセイイランディック | 338.3 | 344.7 | 346,768 | - |
| スターツコーポレーション | 209.8 | 148.1 | 281,390 | - |
| シノケングループ | 309 | 239 | 426,137 | - |
| サービス業 (6.8%) | - | - | - | - |
| ミクシィ | .75 | - | - | - |
| トラスト・テック | 205 | 182 | 396,214 | - |
| GCAサヴィアン | 300 | 240 | 349,440 | - |
| エス・エム・エス | 147 | 102 | 229,704 | - |

| 銘柄 | 期首 | | 当期末 | |
|----------------|----------|----------|------------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| 学情 | 千株 | 千株 | 千円 | 千円 |
| キャリアデザインセンター | 199 | - | - | - |
| ワールドホールディングス | - | 238.1 | 270,957 | - |
| 日本エス・エイチ・エル | 83 | 111.6 | 183,024 | - |
| テー・オー・ダブリュー | 17.4 | 17.4 | 43,587 | - |
| 日本ハウズイング | 168 | 294 | 227,262 | - |
| 山田コンサルティングGP | 25.5 | 25.5 | 90,015 | - |
| フルキャストホールディングス | 34.9 | 48 | 157,200 | - |
| テクノプロ・ホールディング | 160 | - | - | - |
| ジャパンマテリアル | 246 | 299 | 953,810 | - |
| セレスポ | - | 65.2 | 135,420 | - |
| 三協フロンテア | 171 | 171 | 61,560 | - |
| 東海リース | 134 | 139 | 125,934 | - |
| ステップ | 508 | 528 | 113,520 | - |
| | 15.3 | 136 | 139,944 | - |
| 合計 | 株数 | 株数 | 千円 | 千円 |
| | 67,521.7 | 52,266.4 | 51,420,096 | <90.3%> |
| | 銘柄数<比率> | 228銘柄 | 204銘柄 | <90.3%> |

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 国内投資信託証券

| 銘柄 | 期首 | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-------|-----------|--------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | 評価額 |
| MCUBS MidCity投資法人 | 千口 | 千口 | 千円 | 千円 |
| 星野リゾート・リート | 1.172 | 3.38 | 1,074,840 | - |
| ケネディクス商業リート | 0.894 | 0.23 | 2,753,310 | - |
| ヘルスケア&メディカル投資 | 1.168 | - | - | - |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 0.295 | - | - | - |
| | 17.3 | 17.56 | 1,406,556 | - |
| 合計 | 口数 | 口数 | 千円 | 千円 |
| | 20,829 | 21.17 | 2,756,706 | <4.8%> |
| | 銘柄数<比率> | 5銘柄 | 3銘柄 | <4.8%> |

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

| 銘柄別 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|----------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 T O P I X | 百万円 298 | 百万円 - |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 51,420,096 | % 87.5 |
| 投資信託証券 | 2,756,706 | 4.7 |
| コール・ローン等、その他 | 4,557,003 | 7.8 |
| 投資信託財産総額 | 58,733,806 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年10月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|------------------------|
| (A) 資産 | 58,733,806,064円 |
| コール・ローン等 | 2,105,063,854 |
| 株式(評価額) | 51,420,096,400 |
| 投資信託証券(評価額) | 2,756,706,000 |
| 未収入金 | 2,032,772,470 |
| 未収配当金 | 419,167,340 |
| (B) 負債 | 1,806,319,722 |
| 未払金 | 1,805,319,722 |
| 未払解約金 | 1,000,000 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 56,927,486,342 |
| 元本 | 23,375,682,621 |
| 次期繰越損益金 | 33,551,803,721 |
| (D) 受益権総口数 | 23,375,682,621口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 24,353円 |

*期首における元本額は29,847,152,893円、当期中における追加設定元本額は4,934,914,725円、同解約元本額は11,406,384,997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、ダイワ好配当日本株投信Q (FOFs用) (適格機関投資家専用) 10,042,916,067円、ダイワ好配当日本株投信(季節点描) 11,361,202,247円、ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株) 45,794,507円、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 52,380,043円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 56,665,163円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 924,092,345円、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド151,334,220円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型) 162,857,153円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 97,288,848円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) 193,129,279円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 288,022,749円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は24,353円です。

■損益の状況

当期 自2015年4月16日 至2015年10月15日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|-------------------------|
| (A) 配当等収益 | 627,202,440円 |
| 受取配当金 | 625,432,150 |
| 受取利息 | 548,996 |
| その他収益金 | 1,221,294 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 2,209,192,771 |
| 売買益 | 4,390,095,472 |
| 売買損 | △ 6,599,288,243 |
| (C) 先物取引等損益 | △ 7,319,330 |
| 取引益 | 109,846,606 |
| 取引損 | △ 117,165,936 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | △ 1,589,309,661 |
| (E) 前期繰越損益金 | 45,484,936,110 |
| (F) 解約差損益金 | △ 17,634,416,003 |
| (G) 追加信託差損益金 | 7,290,593,275 |
| (H) 合計(D + E + F + G) | 33,551,803,721 |
| 次期繰越損益金(H) | 33,551,803,721 |

(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。