

★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                                                                    | 信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。                                                                                       |                                                                         |
| 主要投資対象                                                                  | ベビーファンド                                                                                                                  | 下記の各マザーファンドの受益証券                                                        |
|                                                                         | トピックス・インデックス・マザーファンド                                                                                                     | 東京証券取引所第1部上場株式（上場予定を含みます。）                                              |
|                                                                         | 外国株式インデックスマザーファンド                                                                                                        | 外国の株式（預託証券を含みます。）                                                       |
|                                                                         | ダイワＪ－ＲＥＩＴ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・グローバルＲＥＩＴインデックス・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。）                                |
|                                                                         | ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド                                                                                                   | わが国の公社債等（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。）                               |
|                                                                         | 外国債券インデックスマザーファンド                                                                                                        | 外国の公社債                                                                  |
| ベビーファンドの運用方法                                                            | ①主として、マザーファンドを通じて内外の株式、債券、リート（ＲＥＩＴ）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないます。                                |                                                                         |
|                                                                         | ②マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2040年に近づくに従って株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。 |                                                                         |
|                                                                         | 当初設定時の基本配分比率                                                                                                             |                                                                         |
|                                                                         | トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券                                                                                                | …信託財産の純資産総額の48%                                                         |
|                                                                         | 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券                                                                                                   | …信託財産の純資産総額の32%                                                         |
|                                                                         | ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券                                                                                                    | …信託財産の純資産総額の5%                                                          |
|                                                                         | ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券                                                                                         | …信託財産の純資産総額の5%                                                          |
|                                                                         | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券                                                                                           | …信託財産の純資産総額の5%                                                          |
|                                                                         | 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券                                                                                                   | …信託財産の純資産総額の5%                                                          |
|                                                                         | ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。                                                                                       |                                                                         |
| ④2040年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。 |                                                                                                                          |                                                                         |
| 組入制限                                                                    | 株式組入上限比率                                                                                                                 |                                                                         |
|                                                                         | トピックス・インデックス・マザーファンド                                                                                                     | 無制限                                                                     |
|                                                                         | 外国株式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）                                                                                                | 純資産総額の10%以下                                                             |
|                                                                         | ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド                                                                                                   |                                                                         |
|                                                                         | 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                                                             |
|                                                                         | 投資信託証券組入上限比率                                                                                                             |                                                                         |
|                                                                         | ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド                                                                                                         | 無制限                                                                     |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・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とし、原則として、基準価額の水増し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ァンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

運用報告書（全体版）  
第 8 期  
（決算日 2015年12月18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・ターゲットイヤー2040」は、このたび、第8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/>

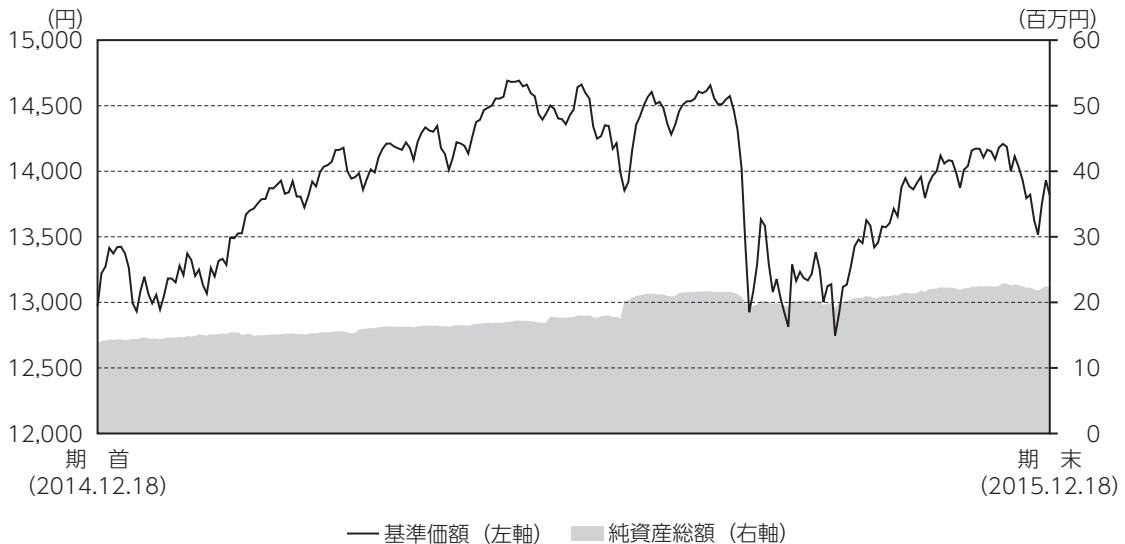
最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額 |            |            | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 不 動 産<br>投信指数<br>先物比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|------------------|---------|------------|------------|-------------|-------------|---------------|-------------|--------------------|-----------------------|--------------|
|                  | 円       | 税込み<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 |             |             |               |             |                    |                       |              |
| 4期末(2011年12月19日) | 円 6,293 | 円 0        | % △14.0    | % 73.4      | % 1.2       | % 11.1        | % -         | % 13.6             | % -                   | 百万円 1        |
| 5期末(2012年12月18日) | 7,645   | 0          | 21.5       | 73.6        | 0.9         | 11.6          | -           | 13.3               | -                     | 3            |
| 6期末(2013年12月18日) | 11,001  | 0          | 43.9       | 71.7        | 0.6         | 13.9          | -           | 13.2               | -                     | 9            |
| 7期末(2014年12月18日) | 12,972  | 0          | 17.9       | 69.1        | 0.7         | 15.0          | -           | 14.7               | -                     | 13           |
| 8期末(2015年12月18日) | 13,817  | 0          | 6.5        | 66.8        | 0.7         | 16.1          | -           | 15.7               | 0.1                   | 22           |

(注1) 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2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。  
(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。  
(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。  
(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

## 《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：12,972円

期 末：13,817円

騰落率：6.5%

#### ■組入ファンドの当期中の騰落率

| 組入ファンド                      | 騰落率   |
|-----------------------------|-------|
| トピックス・インデックス・マザーファンド        | 13.9% |
| 外国株式インデックスマザーファンド           | 3.6%  |
| ダイワJーREITマザーファンド            | △1.5% |
| ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド | 4.3%  |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)  | 1.4%  |
| 外国債券インデックスマザーファンド           | △2.3% |

#### ■基準価額の主な変動要因

内外の株式、債券、リートに投資した結果、内外の株式や海外リートが上昇したことなどが寄与し、基準価額は上昇しました。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・ターゲットイヤー2040

| 年 月 日            | 基 準    | 価 額    | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 | 投資信託<br>証 券<br>組入比率 | 不 動 産<br>投 信 指 数<br>先 物 比 率 |
|------------------|--------|--------|-------------|-------------|---------------|-------------|---------------------|-----------------------------|
|                  |        | 騰 落 率  |             |             |               |             |                     |                             |
| (期首) 2014年12月18日 | 円      | %<br>— | %<br>69.1   | %<br>0.7    | %<br>15.0     | %<br>—      | %<br>14.7           | %<br>—                      |
| 12月末             | 13,375 | 3.1    | 69.3        | 0.7         | 14.7          | —           | 14.6                | —                           |
| 2015年 1 月末       | 13,250 | 2.1    | 69.4        | 0.6         | 14.8          | —           | 14.6                | —                           |
| 2 月末             | 13,869 | 6.9    | 70.2        | 0.6         | 14.5          | —           | 14.1                | —                           |
| 3 月末             | 13,985 | 7.8    | 67.3        | 0.9         | 15.7          | —           | 15.4                | —                           |
| 4 月末             | 14,176 | 9.3    | 68.0        | 0.9         | 15.5          | —           | 14.9                | —                           |
| 5 月末             | 14,682 | 13.2   | 68.0        | 1.0         | 15.4          | —           | 15.0                | —                           |
| 6 月末             | 14,249 | 9.8    | 67.4        | 0.5         | 15.9          | —           | 15.3                | —                           |
| 7 月末             | 14,509 | 11.8   | 67.8        | 0.6         | 15.6          | —           | 15.4                | —                           |
| 8 月末             | 13,584 | 4.7    | 67.0        | 1.0         | 15.2          | —           | 15.0                | —                           |
| 9 月末             | 12,917 | △ 0.4  | 66.2        | 1.2         | 15.9          | —           | 16.0                | —                           |
| 10月末             | 13,958 | 7.6    | 67.3        | 1.0         | 15.6          | —           | 15.4                | —                           |
| 11月末             | 14,091 | 8.6    | 67.6        | 0.7         | 15.4          | —           | 15.5                | —                           |
| (期末) 2015年12月18日 | 13,817 | 6.5    | 66.8        | 0.7         | 16.1          | —           | 15.7                | 0.1                         |

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

## ○国内株式市況

国内株式市況は、期首から2015年1月前半にかけて、原油価格の急落によるロシア経済への不安などが警戒される局面もありましたが、1月後半以降は、ECB（欧州中央銀行）による量的金融緩和の決定や国内景気の持ち直し、企業業績の拡大、良好な株式需給関係、円安の進行などを受けて株価は大きく上昇しました。しかし6月からは、ギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念や中国株式市況の急落が上値の抑制要因となりました。さらに8月以降は、中国を中心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、ドイツ大手自動車会社の排ガス不正問題の波及懸念、スイス大手資源商社の経営不安観測などが重なり、株価は大きく下落しました。10月に入ると、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、中国で追加金融緩和が実施されたこと、国内企業の良好な決算が発表されたこと、米国の年内利上げ開始が織り込まれ市場の不透明感が後退したことなどを受けて株価は上昇しましたが、12月から期末にかけては、原油の大幅安などからリスク回避の動きが強まり、世界的な株安を受けて、軟調に推移しました。

## ○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は、期首から、原油価格の下落に歯止めがかかったことなどが好感され上昇し、その後はECBの量的金融緩和の発表やウクライナ問題をめぐる関係国の停戦合意などを背景に、2015年7月末までおおむね堅調に推移しました。8月に入ると、中国での人民元の事実上の切下げを受けて中国株が大幅に下落し、世界の金融市場に動揺が広がったことなどを受けて急落しました。しかし10月以降は、米国を中心とした企業の業績発表がおおむね好調であったことや、ECBの追加金融緩和への期待が高まったことなどを受けて上昇し、期を通じてはやや上昇して期末を迎えました。

## ○国内リート市況

期首から、長期金利が低下傾向であったことを背景に、2015年1月中旬にかけて市況は大きく上昇しました。その後は、長期金利が反転して上昇する局面やJリート各社による公募増資に伴う需給要因を嫌気して市況は調整局面に入り、2月以降は不安定な長期金利動向の影響を受けて方向感の定まらない相場展開となりました。7月に入ると、ギリシャのデフォルト懸念の高まりや中国株式市況の急落など市場環境が悪化する中で、大口とみられる売りをきっかけに国内リート市況は一時的に大幅に下落し、その後も上値が重い展開となりました。8月中旬以降は、中国経済の減速をはじめとする世界的な景気変調への警戒感が強まり、国内リート市況も急落しました。9月中旬に入ると、国内株式市況の反発などを受けて国内リート市況はいったん持ち直したものの、長期金利の低下傾向や公募増資の動きが一段落して需給環境が改善したことが好感された一方で、米国の利上げに対する警戒感で上値が抑えられたことなどを背景に、期末にかけては一進一退の動きとなりました。

## ○海外リート市況

海外リート市況は、期を通じて欧州で上昇しました。

米国では、期首から2015年1月まで、長期金利の低下が続き不動産賃料の上昇が見込めたことや、決算発表が市場予想を上回るリートが多かったことが好感されて、堅調に推移しました。しかし2月に入ると、景気回復期待の高まりを受けて長期金利が上昇したことから下落に転じました。3月以降も、FRB（米国連邦準備制度理事会）議長が年内の利上げを示唆するなど長期金利上昇に対する警戒感が根強いことから上値が重い展開が続き、8月には中国株式市況の急落からのリスク回避の動きが強まったことで、米国でもリート市況は一時急落しました。9月以降は、景気指標の悪化は嫌気されたものの、

結果として短期的に利上げ観測が後退したことが好材料となり10月まで上昇基調でしたが、期末にかけては上値が重い展開となりました。

欧州では、期首から、金利低下による資金調達コストの改善などでリートの決算が堅調だったことから上昇基調でした。その後も、ECBの量的金融緩和の決定を受けて資産価格の上昇や景気改善が期待されたことから、大幅に上昇しました。しかし2015年4月には、ギリシャ債務交渉の展開が見えないことからリスク回避の動きが強まり下落に転じました。7月以降は、一時、中国株式市況の急落局面での下落があったものの、ECBがさらなる金融緩和を示唆し、英国不動産市場のオフィス需要がなお根強いことなども好感され、堅調に推移して期末を迎えました。

オーストラリアも、RBA（オーストラリア準備銀行）の利下げ観測が強まったことで期首から上昇しました。2015年2月以降は、中国経済に対する懸念や資源価格の下落が悪材料となったものの、低金利を背景とした不動産価格の値上がりなどの好材料もあり、結果として小動きで期末を迎えました。

アジアでは、期首から、香港やシンガポールのオフィス需要が根強いことや、中国人民銀行の予想外の利下げから不動産関連に資金が流入したことで、上昇しました。しかし2015年2月以降、中国経済に対する懸念や6月中旬からの中国株式市況の下落が悪材料となり、下落しました。9月からは、中国政府の景気対策等が好感されて下げ止まっ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の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、金利は低下しました。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を受けて、金利は低下しました。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。

## ○海外債券市況

米国の国債金利はやや上昇した一方で、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、米国でも大きく金利上昇に転じました。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によるリスク回避的な市場環境やFRB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月半ば以降は、米国の経済指標が改善して年内の利上げ期待が高まったことから米国は金利上昇に転じましたが、ユーロ圏ではECBによる追加金融緩和への期待の高まりを受けて、金利低下が続きました。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て期末を迎えました。

ユーロ円為替相場は、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、ユーロは対円で下落しました。4月後半から6月半ばにかけては、欧州の金利上昇を受けてユーロは対円で上昇しましたが、その後はリスク回避姿勢が強まったことやECBの追加金融緩和への期待の高まりから、下落傾向が続きました。しかし12月初旬にECBより発表された追加金融緩和策が市場の期待を下回るとやや上昇に転じ、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

マザーファンドの受益証券への投資を通じて、2040年に近づくに従って株式等の組み入れを漸減させ、債券の組み入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行なっております。

### ○トピックス・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、TOPIXに連動する投資成果をめざして運用を行なっております。

### ○外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましては、当ファンドの運用方針に基づき、MSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なっております。

### ○ダイワJ-REITマザーファンド

今後の運用につきましては、当ファンドの運用の基本方針に基づき、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

### ○ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

今後の運用につきましては、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークであるS&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。リートの組入比率は、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないます。また、保有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。

### ○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（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。

### ○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。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドの特色に基づき、6種類（国内株式・海外株式・国内リート・海外リート・国内債券・海外債券）の各マザーファンドの受益証券へ基本配分比率を参考に投資を行ないました。

当期における基本配分比率は、純資産総額に対してそれぞれ以下の通りとし、比率の見直しを2015年3月に行ないました。

|                                  | 期首～2015年3月 | 2015年3月～期末 |
|----------------------------------|------------|------------|
| トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券        | 43%        | 42%        |
| 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券           | 28%        | 27%        |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券            | 7%         | 8%         |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券 | 7%         | 7%         |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券   | 8%         | 8%         |
| 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券           | 7%         | 8%         |

○トピックス・インデックス・マザーファンド

株式を中心に、一部ＴＯＰＩＸ先物取引も利用し、株式組入比率（株式先物を含む。）につきましては、期を通じておおむね100％程度を維持しました。

株式ポートフォリオは、最適化の手法（株価変動を数理的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがＴＯＰＩＸと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定する体系的な手法）を用いて構築しています。

期中、資金変動への対応、新規上場等のＴＯＰＩＸの構成の変化への対応のため、随時、株式の売買を行ないました。

当期末の組入銘柄数は、1,396銘柄となっております。

○外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、Ｓ＆Ｐ500先物取引も一部利用し、株式組入比率（リート、株式先物を含む。）につきましては、期を通じておおむね100％程度の水準を維持しました。

外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とMSCIコクサイ指数（円ベース）との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

ポートフォリオは、MSCIコクサイ指数採用銘柄を中心に、期末では22カ国、1,266銘柄の構成となっています。

○ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。組入比率については、期を通じて97～100％程度としました。2015年12月9日以降は、約款変更に伴い東証ＲＥＩＴ指数先物の組入れを行ない、現物と先物を合わせた実質組入比率を100％程度としました。

○ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）との連動性を維持するような運用を行ないました。

具体的には、S & P 先進国 R E I T 指数採用銘柄全銘柄に投資しました。期末では、15カ国、312銘柄となっております。

### ○ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

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化に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

### ○外国債券インデックスマザーファンド

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

## ベンチマークとの差異について

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および参考指数を設けておりません。

## 分配金について

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

## ■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目        | 当 期                         |       |
|------------|-----------------------------|-------|
|            | 2014年12月19日<br>～2015年12月18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)                         | 4,898 |

（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です。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

マザーファンドの受益証券への投資を通じて、2040年に近づくに従って株式等の組み入れを漸減させ、債券の組み入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行なってまいります。

### ○トピックス・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、T O P I Xに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

### ○外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましては、M S C I コクサイ指数（円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

### ○ダイワJ-R E I Tマザーファンド

今後の運用につきましては、当ファンドの運用の基本方針に基づき、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

### ○ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド

今後の運用につきましては、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークであるS & P先進国R E I T指数（除く日本）（円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。リートの組入比率は、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないます。また、保有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。

### ○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出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。

### ○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。

## 1 万口当りの費用の明細

| 項 目      | 当期                      |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|----------|-------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|          | (2014.12.19~2015.12.18) |         |                                                                    |
|          | 金 額                     | 比 率     |                                                                    |
| 信託報酬     | 98円                     | 0.702%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は13,900円です。                       |
| (投信会社)   | (45)                    | (0.324) | 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)   | (45)                    | (0.324) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                    |
| (受託銀行)   | (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  | 1                       | 0.007   | 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<br>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)     | (0)                     | (0.002) |                                                                    |
| (先物)     | (1)                     | (0.004) |                                                                    |
| (投資信託証券) | (0)                     | (0.002) |                                                                    |
| 有価証券取引税  | 0                       | 0.002   | 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<br>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)                     | (0.001) |                                                                    |
| (投資信託証券) | (0)                     | (0.001) |                                                                    |
| その他費用    | 7                       | 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)   | (6)                     | (0.046) | 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)                     | (0.007) | 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      | 106                     | 0.765   |                                                                    |

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況  
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

|                             | 設 定   |       | 解 約 |     |
|-----------------------------|-------|-------|-----|-----|
|                             | 口 数   | 金 額   | 口 数 | 金 額 |
|                             | 千口    | 千円    | 千口  | 千円  |
| トピックス・インデックス・マザーファンド        | 3,620 | 3,308 | 901 | 800 |
| 外国株式インデックスマザーファンド           | 1,283 | 2,594 | 282 | 566 |
| 外国債券インデックスマザーファンド           | 368   | 1,057 | 66  | 191 |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド            | 427   | 975   | 62  | 148 |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド | 341   | 720   | 80  | 165 |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）   | 739   | 899   | 175 | 213 |

(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

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

| 項 目               | 当 期                  |
|-------------------|----------------------|
|                   | トピックス・インデックス・マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 19,957,594千円         |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 131,225,186千円        |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.15                 |
|                   | 外国株式インデックスマザーファンド    |
| (a) 期中の株式売買金額     | 9,351,659千円          |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 77,559,181千円         |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.12                 |

(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) トピックス・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

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

| 決 算 期   | 当 期          |                        |           |               |                        |           |
|---------|--------------|------------------------|-----------|---------------|------------------------|-----------|
|         | 買付額等<br>A    | うち利<br>害関係人との<br>取引状況B | B／A       | 売付額等<br>C     | うち利<br>害関係人との<br>取引状況D | D／C       |
| 区 分     |              |                        |           |               |                        |           |
|         | 百万円<br>4,692 | 百万円<br>511             | %<br>10.9 | 百万円<br>15,264 | 百万円<br>4,947           | %<br>32.4 |
| 株式      |              |                        |           |               |                        |           |
| 株式先物取引  | 18,875       | —                      | —         | 18,709        | —                      | —         |
| コール・ローン | 1,176,611    | —                      | —         | —             | —                      | —         |

(注) 平均保有割合0.0%

※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。

(3) 外国株式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。

(4) 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。

(5) ダイワＪ－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。

(6) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ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。

(7) 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

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

| 決 算 期   | 当 期          |                        |           |              |                        |           |
|---------|--------------|------------------------|-----------|--------------|------------------------|-----------|
|         | 買付額等<br>A    | うち利<br>害関係人との<br>取引状況B | B／A       | 売付額等<br>C    | うち利<br>害関係人との<br>取引状況D | D／C       |
| 区 分     |              |                        |           |              |                        |           |
|         | 百万円<br>4,882 | 百万円<br>524             | %<br>10.7 | 百万円<br>4,966 | 百万円<br>653             | %<br>13.2 |
| 公社債     |              |                        |           |              |                        |           |
| コール・ローン | 24,117       | —                      | —         | —            | —                      | —         |

(注) 平均保有割合0.0%

(8) 利害関係人の発行する有価証券等

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

| 種 類    | 当 期                  |            |              |
|--------|----------------------|------------|--------------|
|        | トピックス・インデックス・マザーファンド |            |              |
|        | 買 付 額                | 売 付 額      | 期 末 保 有 額    |
| 株式     | 百万円<br>2             | 百万円<br>48  | 百万円<br>389   |
|        | ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド     |            |              |
|        | 買 付 額                | 売 付 額      | 期 末 保 有 額    |
| 投資信託証券 | 百万円<br>1,403         | 百万円<br>233 | 百万円<br>5,963 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

(9) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

| 種 類    | 当 期              |              |
|--------|------------------|--------------|
|        | ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド |              |
|        | 買 付 額            | 期 末 保 有 額    |
| 投資信託証券 | 百万円<br>1,246     | 百万円<br>1,246 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

(10) 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

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

| 項 目              | 当 期  |
|------------------|------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 1千円  |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0千円  |
| (B)／(A)          | 0.2% |

(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、大和証券グループ本社、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    | 期 末   |
|-----------------------------|-------|--------|-------|
|                             | □ 数   | □ 数    | 評 価 額 |
|                             | 千口    | 千口     | 千円    |
| トピックス・インデックス・マザーファンド        | 7,351 | 10,070 | 9,216 |
| 外国株式インデックスマザーファンド           | 1,985 | 2,985  | 5,966 |
| 外国債券インデックスマザーファンド           | 335   | 637    | 1,821 |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド            | 419   | 783    | 1,800 |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド | 474   | 735    | 1,593 |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)   | 923   | 1,488  | 1,831 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年12月18日現在

| 項 目                         | 当 期    | 期 末   |
|-----------------------------|--------|-------|
|                             | 評 価 額  | 比 率   |
|                             | 千円     | %     |
| トピックス・インデックス・マザーファンド        | 9,216  | 41.2  |
| 外国株式インデックスマザーファンド           | 5,966  | 26.7  |
| 外国債券インデックスマザーファンド           | 1,821  | 8.2   |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド            | 1,800  | 8.1   |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド | 1,593  | 7.1   |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)   | 1,831  | 8.2   |
| コール・ローン等、その他                | 114    | 0.5   |
| 投資信託財産総額                    | 22,344 | 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、12月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝122.49円、1カナダ・ドル＝87.78円、1オーストラリア・ドル＝87.24円、1香港ドル＝15.80円、1シンガポール・ドル＝86.30円、1ニュージーランド・ドル＝81.97円、1イギリス・ポンド＝182.61円、1イスラエル・シェケル＝31.47円、1スイス・フラン＝123.13円、1デンマーク・クローネ＝17.80円、1ノルウェー・クローネ＝13.98円、1スウェーデン・クローネ＝14.32円、1メキシコ・ペソ＝7.19円、1マレーシア・リンギット＝28.33円、1南アフリカ・ランド＝8.05円、1ポーランド・ズロチ＝30.88円、1ユーロ＝132.83円です。

(注3) 外国株式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 (77,454,632千円) の投資信託財産総額 (77,570,993千円) に対する比率は、99.8%です。  
外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (162,797,168千円) の投資信託財産総額 (163,712,345千円) に対する比率は、99.4%です。  
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ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 (2,767,219千円) の投資信託財産総額 (2,816,552千円) に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年12月18日現在

| 項 目                              | 当 期 末       |
|----------------------------------|-------------|
| (A) 資産                           | 22,344,395円 |
| コール・ローン等                         | 114,237     |
| トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)        | 9,216,701   |
| 外国株式インデックスマザーファンド(評価額)           | 5,966,446   |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額)           | 1,821,902   |
| ダイワJ-REITマザーファンド(評価額)            | 1,800,396   |
| ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド(評価額) | 1,593,691   |
| ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)(評価額)   | 1,831,022   |
| (B) 負債                           | 73,851      |
| 未払信託報酬                           | 73,133      |
| その他未払費用                          | 718         |
| (C) 純資産総額(A - B)                 | 22,270,544  |
| 元本                               | 16,118,592  |
| 次期繰越損益金                          | 6,151,952   |
| (D) 受益権総口数                       | 16,118,592口 |
| 1万口当り基準価額(C / D)                 | 13,817円     |

\*期首における元本額は10,662,947円、当期中における追加設定元本額は6,366,392円、同解約元本額は910,747円です。  
\*当期末の計算口数当りの純資産額は13,817円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月19日 至2015年12月18日

| 項 目               | 当 期          |
|-------------------|--------------|
| (A) 有価証券売買損益      | 919,909円     |
| 売買益               | 1,006,455    |
| 売買損               | △ 86,546     |
| (B) 信託報酬等         | △ 129,122    |
| (C) 当期損益金(A + B)  | 790,787      |
| (D) 前期繰越損益金       | 3,701,963    |
| (E) 追加信託差損益金      | 1,659,202    |
| (配当等相当額)          | ( 3,403,170) |
| (売買損益相当額)         | (△1,743,968) |
| (F) 合計(C + D + E) | 6,151,952    |
| 次期繰越損益金(F)        | 6,151,952    |
| 追加信託差損益金          | 1,659,202    |
| (配当等相当額)          | ( 3,403,170) |
| (売買損益相当額)         | (△1,743,968) |
| 分配準備積立金           | 4,492,750    |

(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「収益分配金の計算過程（総額）」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目                        | 当 期         |
|----------------------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | 0円          |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 790,787     |
| (c) 収益調整金                  | 3,403,170   |
| (d) 分配準備積立金                | 3,701,963   |
| (e) 当期分配可能額(a + b + c + d) | 7,895,920   |
| (f) 分配金                    | 0           |
| (g) 翌期繰越分配可能額(e - f)       | 7,895,920   |
| (h) 受益権総口数                 | 16,118,592口 |

《お知らせ》

●マザーファンドにおける先物取引の利用について

当ファンドの主要投資対象である「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」において、不動産投信指数先物取引を利用できるように変更しました。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2014年12月18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11,640円です。」

＜補足情報＞

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2015年9月24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（2015年12月18日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を15～20ページに併せて掲載いたしました。

■トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

(2014年12月19日から2015年12月18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    |  |
| リクルートホールディングス |   | 51.7 | 204,737 | 3,960 | トヨタ自動車        |   | 139.5  | 1,093,364 | 7,837 |    |   |    |    |      |  |
| ソフトバンクグループ    |   | 23.1 | 156,495 | 6,774 | 三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ |   | 450.2  | 363,929   | 808   |    |   |    |    |      |  |
| 三井住友フィナンシャルＧ  |   | 28.7 | 138,535 | 4,827 | キャノン          |   | 58.8   | 235,492   | 4,004 |    |   |    |    |      |  |
| 日本たばこ産業       |   | 28.6 | 133,000 | 4,650 | 本田技研          |   | 52     | 212,997   | 4,096 |    |   |    |    |      |  |
| ソニー           |   | 29.3 | 103,045 | 3,516 | 日本電信電話        |   | 32.5   | 202,278   | 6,223 |    |   |    |    |      |  |
| 武田薬品          |   | 16.3 | 94,831  | 5,817 | 三井住友フィナンシャルＧ  |   | 40.8   | 201,743   | 4,944 |    |   |    |    |      |  |
| ブリヂストン        |   | 16.9 | 77,168  | 4,566 | ソフトバンクグループ    |   | 28.1   | 201,666   | 7,176 |    |   |    |    |      |  |
| トヨタ自動車        |   | 10.4 | 74,964  | 7,208 | パナソニック        |   | 118.15 | 173,929   | 1,472 |    |   |    |    |      |  |
| 日立            |   | 101  | 69,388  | 687   | ＮＴＴＤコモ        |   | 73.8   | 166,451   | 2,255 |    |   |    |    |      |  |
| 三井物産          |   | 38.6 | 59,407  | 1,539 | ＫＤＤＩ          |   | 39.5   | 160,541   | 4,064 |    |   |    |    |      |  |

(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、2015年12月18日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（140,729,416千口）の内容です。

(1) 国内株式

| 銘柄            | 柄     | 2015年12月18日現在<br>株数 評価額 | 銘柄         | 柄     | 2015年12月18日現在<br>株数 評価額 | 銘柄      | 柄     | 2015年12月18日現在<br>株数 評価額 | 銘柄         | 柄    | 2015年12月18日現在<br>株数 評価額 |
|---------------|-------|-------------------------|------------|-------|-------------------------|---------|-------|-------------------------|------------|------|-------------------------|
| 水産・農林業 (0.1%) | 千株    | 千円                      | 鹿島建設       | 千株    | 千円                      | 世紀東急    | 千株    | 千円                      | 東芝プラントシステム | 千株   | 千円                      |
| 極洋            | 35    | 9,170                   | 不動テトラ      | 297   | 215,622                 | 福田組     | 11.3  | 7,254                   | 東洋エンジニア    | 9.8  | 12,397                  |
| 日本水産          | 76.2  | 35,814                  | 鉄建建設       | 49.5  | 7,078                   | 住友林業    | 11    | 14,696                  | 千代田化工建     | 34   | 10,846                  |
| マルハニチロ        | 14    | 27,986                  | 西松建設       | 41    | 11,890                  | 日本基礎技術  | 44    | 70,664                  | 新興プランテック   | 44   | 40,524                  |
| サカタのタネ        | 10.7  | 28,922                  | 三井住友建設     | 72    | 33,264                  | 日成ビルド工業 | 9     | 4,572                   | 日本製粉       | 13.5 | 13,257                  |
| ホクト           | 7     | 16,527                  | 大豊建設       | 247.5 | 28,462                  | パナホーム   | 20    | 7,500                   | 日清製粉Ｇ本社    |      |                         |
| 鉱業 (0.3%)     |       |                         | 前田建設       | 25    | 15,025                  | 大和ハウス   | 25    | 22,600                  | 昭和産業       | 43   | 37,281                  |
| 日鉄鉱業          | 19    | 10,317                  | ナカノフドー建設   | 40    | 31,600                  | ライト工業   | 187   | 629,816                 | 中部銅料       | 69.5 | 136,359                 |
| 三井松島          | 52    | 6,968                   | 奥村組        | 6.5   | 4,907                   | 積水ハウス   | 12.7  | 14,160                  | フィード・ワン    | 29   | 12,934                  |
| 国際石油開発帝石      | 332.2 | 379,040                 | 東鉄工業       | 61    | 41,175                  | 日特建設    | 210.9 | 414,523                 | 日本甜菜糖      | 7.3  | 7,307                   |
| 日本海洋掘削        | 2.5   | 6,637                   | 浅沼組        | 8     | 22,880                  | ユアテック   | 8.5   | 4,165                   | 三井製糖       | 47.2 | 6,372                   |
| 石油資源開発        | 10.1  | 32,067                  | 戸田建設       | 23    | 7,176                   | 関電工     | 11    | 12,529                  | 森永製菓       | 49   | 9,849                   |
| K&Oエナジーグループ   | 5.1   | 8,766                   | 熊谷組        | 75    | 50,250                  | きんでん    | 9.5   | 25,346                  | 中村屋        | 27   | 14,958                  |
| 建設業 (2.9%)    |       |                         | 北野建設       | 92    | 30,544                  | 東京エネシス  | 25    | 20,575                  | 江崎グリコ      | 59   | 38,114                  |
| ショーボンドHＤ      | 6.3   | 27,909                  | 三井ホーム      | 20    | 6,440                   | トーエネック  | 38    | 60,192                  | 不二家        | 23   | 10,810                  |
| ミサワホーム        | 20.4  | 20,134                  | 矢作建設       | 13    | 7,267                   | 住友電設    | 8     | 8,008                   | 山崎製パン      | 14.5 | 93,815                  |
| 安藤・間          | 42.8  | 29,489                  | ピーエス三菱     | 9.5   | 7,752                   | 日本電設工業  | 10    | 8,460                   | 第一屋製パン     | 51   | 10,353                  |
| 東急建設          | 20.8  | 19,052                  | 日本ハウスHLDGS | 12.8  | 5,004                   | 協和エクシオ  | 5.8   | 8,874                   | ゼロソフ       | 46   | 115,920                 |
| コムシスホールディングス  | 28.6  | 48,963                  | 大東建設       | 14.3  | 6,520                   | 九電工     | 10.7  | 27,370                  | 亀田製菓       | 44   | 5,368                   |
| ミサワホーム        | 8.6   | 7,516                   | 新日本建設      | 23.3  | 323,287                 | 三機工業    | 25.1  | 30,747                  | 寿スピリッツ     | 21   | 9,093                   |
| 高松コンストラクションGP | 5.3   | 13,758                  | NIPPO      | 9.9   | 6,712                   | 日揮      | 12    | 26,196                  | カルビー       | 3.9  | 18,349                  |
| 東建コーポレーション    | 2.5   | 23,075                  | 前田道路       | 15    | 30,345                  | 中外炉工業   | 15.7  | 15,872                  | 森永乳業       | 1.9  | 9,614                   |
| 大成建設          | 326   | 259,822                 | 日本道路       | 63    | 117,306                 | 太平電業    | 23.3  | 115,451                 | 雪印メグミルク    | 23.3 | 115,451                 |
| 大林組           | 190   | 219,070                 | 東亜建設       | 20    | 42,360                  | 高砂熱学    | 28    | 6,524                   | プリマハム      | 59   | 33,217                  |
| 清水建設          | 194   | 200,984                 | 若菜建設       | 9     | 10,827                  | 明星工業    | 9     | 10,827                  | 日本ハム       | 3.8  | 6,851                   |
| 飛島建設          | 44.7  | 8,895                   | 五洋建設       | 58    | 18,618                  | 日比谷総合設備 | 19.2  | 33,849                  |            | 33.7 | 200,852                 |
| 長谷工コーポレーション   | 74.1  | 100,776                 | 大林道路       | 44    | 6,336                   |         | 13.8  | 7,038                   |            | 37.4 | 372,878                 |
| 松井建設          | 10.3  | 7,755                   |            | 20.7  | 10,908                  |         | 7.9   | 23,202                  |            | 15.2 | 48,108                  |
| 銭高組           | 10    | 5,570                   |            | 70.9  | 35,591                  |         | 10    | 8,540                   |            | 44   | 14,256                  |
|               |       |                         |            | 8     | 6,712                   |         | 8.7   | 14,163                  |            | 46   | 106,214                 |









| 銘柄                       | 2015年12月18日現在<br>株数 評価額 | 銘柄                  | 2015年12月18日現在<br>株数 評価額 | 銘柄             | 2015年12月18日現在<br>株数 評価額 |
|--------------------------|-------------------------|---------------------|-------------------------|----------------|-------------------------|
| 沖縄銀行                     | 千株 千円<br>4.6 21,367     | ジャックス               | 千株 千円<br>33 14,157      | ぐるなび           | 千株 千円<br>7.2 19,080     |
| 琉球銀行                     | 11.5 19,239             | オリコ                 | 239.6 62,296            | 一休             | 4.6 15,709              |
| セブン銀行                    | 206.8 107,949           | 日立キャピタル             | 13.2 42,966             | ファンコミュニケーションズ  | 14.9 11,517             |
| みずほフィナンシャルG              | 7,816.9 1,902,633       | オリックス               | 392.8 662,653           | J Pホールディングス    | 19.1 6,646              |
| 高知銀行                     | 35 4,970                | 三菱UFJ リース           | 141.1 87,340            | E P Sホールディングス  | 6.8 9,084               |
| 山口フィナンシャルG               | 51 71,604               | 日本取引所グループ           | 163.2 315,302           | プレステージ・インター    | 6.2 7,347               |
| 長野銀行                     | 31 6,293                | イー・ギャランティ           | 2.6 7,007               | アミューズ          | 1.8 10,602              |
| 名古屋銀行                    | 48 20,592               | NECキャピタルリソリューション    | 3.4 5,650               | ドリームインキュベータ    | 2.8 6,543               |
| 北洋銀行                     | 81.7 33,987             | <b>不動産業 (2.8%)</b>  |                         | ケネディクス         | 79.7 36,662             |
| 愛知銀行                     | 2 12,640                | 日本駐車場開発             | 69.2 9,757              | 電通             | 65.7 444,132            |
| 第三銀行                     | 39 6,903                | ヒューリック              | 115.9 124,824           | イオンファンタジー      | 2.8 5,703               |
| 中京銀行                     | 27 6,156                | 野村不動産HLDGS          | 36.4 84,666             | みらかホールディングス    | 15 80,250               |
| 東日本銀行                    | 29 11,049               | 三重交通グループHD          | 12.7 5,842              | アルプス技研         | 2.9 7,357               |
| 大光銀行                     | 27 6,534                | プレサンスコーポレーション       | 2 7,950                 | オリエンタルランド      | 63.3 449,430            |
| 愛媛銀行                     | 31 7,750                | ユニゾホールディングス         | 3.6 16,740              | ダスキン           | 17.3 38,060             |
| トマト銀行                    | 40 7,000                | 日本管理センター            | 4.4 6,336               | 明光ネットワークジャパン   | 8.1 11,348              |
| みなと銀行                    | 57 11,286               | オープンハウス             | 8.4 19,622              | ファルコホールディングス   | 4 5,892                 |
| 京葉銀行                     | 44 24,288               | 東急不動産HD             | 135.2 103,563           | ラウンドワン         | 20.8 11,544             |
| 関西アーバン銀行                 | 6.4 8,492               | 飯田GHD               | 51.6 118,938            | リゾートトラスト       | 24.6 75,030             |
| 栃木銀行                     | 31 21,235               | パーク24               | 28.2 80,172             | ビー・エム・エル       | 4 14,040                |
| 北日本銀行                    | 2.4 7,884               | 三井不動産               | 294 923,160             | りらいあコミュニケーション  | 10.9 12,186             |
| 東和銀行                     | 86 9,116                | 三菱地所                | 413 1,050,878           | ユー・エス・エス       | 71.2 132,218            |
| 福島銀行                     | 85 8,160                | 平和不動産               | 12.2 16,335             | サイバーエージェント     | 14.5 74,240             |
| 大東銀行                     | 51 10,710               | 東京建物                | 61.7 84,652             | 楽天             | 275.5 381,567           |
| トモニホールディングス              | 45.2 20,475             | ダイビル                | 14.8 14,592             | セントラルスポーツ      | 3 6,933                 |
| フィデアホール                  | 35 9,240                | 京阪神ビルディング           | 10.4 7,207              | フルキャストホールディングス | 6.6 4,732               |
| 池田泉州HD                   | 49.6 24,056             | 住友不動産               | 134 487,760             | テクノプロ・ホールディング  | 8.6 31,261              |
| <b>証券・商品先物取引業 (1.2%)</b> |                         | 大京                  | 107 21,079              | ジャパンマテリアル      | 3 7,503                 |
| F P G                    | 17.5 15,085             | テオオーシー              | 23 23,368               | ペクトル           | 2.6 5,020               |
| SBIホールディングス              | 67 88,306               | 東京楽天地               | 19 9,709                | リクルートホールディングス  | 118 430,110             |
| ジャフコ                     | 9.6 44,160              | レオパレス21             | 66.1 45,344             | リロ・ホールディング     | 2.3 31,648              |
| 大和証券G本社                  | 518 389,536             | スターネットコーポレーション      | 6.8 16,054              | 東祥             | 2.2 6,842               |
| 野村ホールディングス               | 1,068.3 743,857         | フジ住宅                | 7.3 5,511               | エイチ・アイ・エス      | 9.8 36,554              |
| 岡三証券グループ                 | 48 33,936               | 空港施設                | 12.1 6,957              | 共立メンテナンス       | 4.5 45,045              |
| 丸三証券                     | 17.6 21,929             | 住友不動産販売             | 4.6 12,751              | イチネンホールディングス   | 6.8 7,738               |
| 東洋証券                     | 29 11,020               | ゴールドクレスト            | 4.9 11,069              | 建設技術研究所        | 4.8 6,168               |
| 東海東京HD                   | 62.3 44,233             | タカラレーベン             | 25.8 18,214             | 東京テアトル         | 56 7,672                |
| 光世証券                     | 32 5,664                | サンヨーハウジング 名古屋       | 5.9 6,844               | よみうりランド        | 16 6,432                |
| 水戸証券                     | 25.4 10,363             | イオンモール              | 35.7 76,076             | 東京都競馬          | 45 12,285               |
| いちよし証券                   | 13.6 14,987             | トーセイ                | 9.7 7,313               | 常盤興産           | 35 5,425                |
| 松井証券                     | 23.8 26,584             | エヌ・ティ・ティ都市開発        | 33 39,039               | カナモト           | 8.6 25,679              |
| マネックスG                   | 65.4 20,797             | サンフロンティア不動産         | 7.8 7,098               | 東京ドーム          | 50 28,550               |
| カブドットコム証券                | 48.4 18,246             | エフ・ジェー・ネクスト         | 8.4 4,284               | 西尾レントオール       | 5.1 15,835              |
| 極東証券                     | 9.2 14,480              | 日本空港ビルデング           | 17.8 98,078             | トランス・コスモス      | 7.2 21,708              |
| 岩井コスモホールディング             | 7.2 9,727               | <b>サービス業 (3.3%)</b> |                         | 乃村工藝社          | 13.5 25,042             |
| 藍澤證券                     | 10.8 7,538              | 日本工営                | 23 10,120               | 藤田観光           | 24 13,344               |
| マナーズクウェアHD               | 2.7 3,909               | ネクスト                | 17.7 25,700             | KNT-CTホールディングス | 31 7,471                |
| <b>保険業 (2.5%)</b>        |                         | 日本M&Aセンター           | 9.3 52,080              | 日本管財           | 5.8 11,304              |
| 損保ジャパン興亜HD               | 123.6 466,837           | アコーディア・ゴルフ          | 16.3 18,859             | トーカイ           | 3.1 10,819              |
| アニコムホールディングス             | 4.4 12,526              | タケエ                 | 5.9 6,071               | セコム            | 61.2 500,922            |
| MS & AD                  | 166.1 559,590           | パナソニックグループ          | 5.8 5,121               | 丹青社            | 12.2 12,004             |
| SONY F H                 | 53.6 115,561            | GCA ユーヴィアン          | 5.9 7,127               | メイテック          | 7.6 32,034              |
| 第一生命                     | 355.8 720,139           | エス・エム・エス            | 7.8 18,462              | アサツー ディ・ケイ     | 10.5 35,017             |
| 東京海上HD                   | 224.2 1,014,505         | デンポホールディングス         | 41.5 77,397             | 応用地質           | 7.4 10,404              |
| T & Dホールディングス            | 203.3 324,873           | クックパッド              | 13.4 36,126             | 船井総研ホールディング    | 7.8 15,919              |
| <b>その他金融業 (1.4%)</b>     |                         | スタジオアリス             | 3.5 7,598               | ベネッセホールディングス   | 19.5 66,300             |
| 全国保証                     | 14.8 59,422             | シミックホールディングス        | 3.4 5,382               | イオンディライト       | 6 23,130                |
| クレディセゾン                  | 42.6 103,390            | 総合警備保障              | 19.7 112,093            | ニチイ学館          | 11.4 9,906              |
| 芙蓉総合リース                  | 6.6 37,224              | カカココム               | 42.9 103,045            | ダイセキ           | 12 24,300               |
| 興銀リース                    | 11.1 27,683             | ディップ                | 6.8 18,407              |                |                         |
| 東京センチュリーリース              | 13.3 54,796             | ツクイ                 | 7.7 10,348              |                |                         |
| 日本証券金融                   | 27.9 17,744             | エムスリー               | 5.1 133,977             |                |                         |
| アイフル                     | 91.2 35,750             | ツカダ・グローバルHOLD       | 6.1 4,910               |                |                         |
| ポケットカード                  | 8.6 4,661               | アウトソーシング            | 3.1 10,028              |                |                         |
| リコーリース                   | 4.9 18,130              | ウェルネット              | 2.8 8,047               |                |                         |
| イオンフィナンシャルサービス           | 36.8 100,280            | ディー・エヌ・エー           | 26.7 51,023             |                |                         |
| アコム                      | 111.3 66,780            | 博報堂DYHLDGS          | 81.7 108,334            |                |                         |

(2) 先物取引の銘柄別残高  
(評価額)

| 銘柄別   | 2015年12月18日現在<br>買建額 売建額 |
|-------|--------------------------|
| 国内    | 百万円 百万円                  |
| トピックス | 1,226 ー                  |

(注) 単位未満は切捨て。

## ■有価証券の貸付および借入の状況

| 区分 | 2015年12月18日現在<br>貸付 借入             |
|----|------------------------------------|
| 株式 | 株 株<br>2,569,000 (1,630,400) ー (ー) |

(注1) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ1,630,400株を貸付しています。

| 銘柄 | 株数・金額                | 千株 千円       |
|----|----------------------|-------------|
| 合計 | 92,708.3 127,617,012 | 1,396 99.1% |

(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&lt; &gt;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。

外国株式インデックスマザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040）が投資対象としている「外国株式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（2015年12月18日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を21～33ページに併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

| 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      |
| KINDER MORGAN INC (アメリカ)    |   | 19.5 | 94,951 | 4,869  | APPLE INC (アメリカ)           |   | 14.4 | 218,151 | 15,149 |
| SYNCHRONY FINANCIAL (アメリカ)  |   | 17.5 | 66,348 | 3,791  | GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ) |   | 30.4 | 105,080 | 3,456  |
| APPLE INC (アメリカ)            |   | 4.6  | 63,867 | 13,884 | EXXON MOBIL CORP (アメリカ)    |   | 8.9  | 94,197  | 10,584 |
| FACEBOOK INC-A (アメリカ)       |   | 3.8  | 41,268 | 10,860 | MICROSOFT CORP (アメリカ)      |   | 12.9 | 73,099  | 5,666  |
| VONOVIA SE (ドイツ)            |   | 10.4 | 40,934 | 3,935  | JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)   |   | 4.8  | 58,833  | 12,256 |
| BANCO SANTANDER SA (スペイン)   |   | 46.6 | 38,143 | 818    | WELLS FARGO & CO (アメリカ)    |   | 7.1  | 48,020  | 6,763  |
| EXXON MOBIL CORP (アメリカ)     |   | 3.7  | 35,849 | 9,689  | PFIZER INC (アメリカ)          |   | 11.3 | 47,416  | 4,196  |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG (スイス) |   | 4.1  | 35,275 | 8,603  | NESTLE SA-REG (スイス)        |   | 5.05 | 46,886  | 9,284  |
| GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)  |   | 11.9 | 35,085 | 2,948  | CHEVRON CORP (アメリカ)        |   | 3.5  | 44,497  | 12,713 |
| ALPHABET INC-CL C (アメリカ)    |   | 0.45 | 33,929 | 75,399 | JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ) |   | 5.4  | 43,437  | 8,043  |

(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、2015年12月18日現在における外国株式インデックスマザーファンド（38,798,220千円）の内容です。

(1) 外国株式

| 銘                            | 柄 | 2015年12月18日現在 |          |         |            | 業 種 等                        | 銘  | 柄        | 2015年12月18日現在 |         |            |  | 業 種 等 |       |        |
|------------------------------|---|---------------|----------|---------|------------|------------------------------|----|----------|---------------|---------|------------|--|-------|-------|--------|
|                              |   | 株 数           | 評 価 額    |         | 外貨建金額      |                              |    |          | 邦貨換算金額        | 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      |            |                              | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円            |         |            |  |       |       |        |
| PALO ALTO NETWORKS INC       |   | 15            | 279      | 34,279  | 情報技術       | ALTERA CORP                  |    | 65       | 344           | 42,189  | 情報技術       |  |       |       |        |
| JARDEN CORP                  |   | 40            | 228      | 27,991  | 一般消費財・サービス | HONEYWELL INTERNATIONAL INC  |    | 158      | 1,616         | 198,004 | 資本財・サービス   |  |       |       |        |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     |   | 13            | 180      | 22,116  | ヘルスケア      | TOTAL SYSTEM SERVICES INC    |    | 37.51    | 198           | 24,254  | 情報技術       |  |       |       |        |
| SYNCHRONY FINANCIAL          |   | 175           | 525      | 64,328  | 金融         | WR BERKLEY CORP              |    | 21       | 112           | 13,810  | 金融         |  |       |       |        |
| ABBOTT LABORATORIES          |   | 317           | 1,434    | 175,741 | ヘルスケア      | AUTOZONE INC                 |    | 6.7      | 506           | 61,987  | 一般消費財・サービス |  |       |       |        |
| ALCOA INC                    |   | 273           | 249      | 30,597  | 素材         | DOLLAR TREE INC              |    | 47.21    | 361           | 44,284  | 一般消費財・サービス |  |       |       |        |
| VERISK ANALYTICS INC         |   | 33            | 253      | 31,088  | 資本財・サービス   | PINNACLE WEST CAPITAL        |    | 24       | 152           | 18,693  | 公益事業       |  |       |       |        |
| LAS VEGAS SANDS CORP         |   | 87            | 363      | 44,566  | 一般消費財・サービス | CELANESE CORP-SERIES A       |    | 33       | 217           | 26,645  | 素材         |  |       |       |        |
| AMPHENOL CORP-CL A           |   | 66            | 348      | 42,628  | 情報技術       | DR HORTON INC                |    | 71.66    | 225           | 27,667  | 一般消費財・サービス |  |       |       |        |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  |   | 60.29         | 361      | 44,220  | 情報技術       | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK |    | 21       | 50            | 6,217   | エネルギー      |  |       |       |        |
| QORVO INC                    |   | 32            | 168      | 20,676  | 情報技術       | DENTSPLY INTERNATIONAL INC   |    | 30       | 180           | 22,143  | ヘルスケア      |  |       |       |        |
| AFLAC INC                    |   | 91            | 549      | 67,303  | 金融         | AUTODESK INC                 |    | 48       | 291           | 35,712  | 情報技術       |  |       |       |        |
| DARDEN RESTAURANTS INC       |   | 29            | 169      | 20,741  | 一般消費財・サービス | MOODY'S CORP                 |    | 39       | 381           | 46,758  | 金融         |  |       |       |        |
| ADOBE SYSTEMS INC            |   | 107           | 1,007    | 123,462 | 情報技術       | DEVON ENERGY CORP            |    | 82       | 237           | 29,108  | エネルギー      |  |       |       |        |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   |   | 50            | 206      | 25,257  | 素材         | ALBEMARLE CORP               |    | 24       | 125           | 15,410  | 素材         |  |       |       |        |
| LULULEMON ATHLETICA INC      |   | 25            | 125      | 15,311  | 一般消費財・サービス | ALLIANT ENERGY CORP          |    | 25       | 159           | 19,509  | 公益事業       |  |       |       |        |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL     |   | 68            | 110      | 13,543  | 金融         | CITIGROUP INC                |    | 633.23   | 3,345         | 409,849 | 金融         |  |       |       |        |
| GARMIN LTD                   |   | 26            | 92       | 11,312  | 一般消費財・サービス | AUTOMATIC DATA PROCESSING    |    | 101      | 856           | 104,922 | 情報技術       |  |       |       |        |
| AETNA INC                    |   | 74.79         | 814      | 99,726  | ヘルスケア      | AMERICAN ELECTRIC POWER      |    | 105      | 602           | 73,850  | 公益事業       |  |       |       |        |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC |   | 43            | 560      | 68,661  | 素材         | NETSUITE INC                 |    | 8        | 66            | 8,100   | 情報技術       |  |       |       |        |

| 銘柄                            | 2015年12月18日現在 |        |              | 業 種 等      |
|-------------------------------|---------------|--------|--------------|------------|
|                               | 株 数           | 評 価 額  | 外貨建金額 邦貨換算金額 |            |
| ALLEGHANY CORP                | 百株            | 千円     |              |            |
| DUN & BRADSTREET CORP         | 3.5           | 167    | 20,529       | 金融         |
| HESS CORP                     | 7.5           | 78     | 9,561        | 資本財・サービス   |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I  | 57            | 280    | 34,351       | エネルギー      |
| DANAHER CORP                  | 36            | 245    | 30,038       | ヘルスケア      |
| AVNET INC                     | 131           | 1,203  | 147,448      | 資本財・サービス   |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 28            | 122    | 15,025       | 情報技術       |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A      | 23.7          | 588    | 72,102       | 金融         |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO     | 38            | 308    | 37,828       | 一般消費財・サービス |
| BUNGE LTD                     | 134           | 459    | 56,282       | 生活必需品      |
| TE CONNECTIVITY LTD           | 31            | 198    | 24,317       | 生活必需品      |
| APPLE INC                     | 88.25         | 559    | 68,522       | 情報技術       |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 1,205         | 13,132 | 1,608,549    | 情報技術       |
| BOEING CO/THE                 | 94            | 506    | 62,037       | 金融         |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 136           | 1,979  | 242,483      | 資本財・サービス   |
| SPECTRA ENERGY CORP           | 32.15         | 191    | 23,490       | 金融         |
| BECTON DICKINSON AND CO       | 140.96        | 323    | 39,608       | エネルギー      |
| CDK GLOBAL INC                | 44.37         | 691    | 84,735       | ヘルスケア      |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP       | 29            | 139    | 17,068       | 情報技術       |
| CH. ROBINSON WORLDWIDE INC    | 67            | 131    | 16,142       | エネルギー      |
| CR BARD INC                   | 31            | 199    | 24,377       | 資本財・サービス   |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP  | 16            | 304    | 37,358       | ヘルスケア      |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    | 240.71        | 993    | 121,653      | 金融         |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B   | 859.54        | 3,962  | 485,364      | 電気通信サービス   |
| ANSYS INC                     | 248           | 3,322  | 406,967      | 金融         |
| H&R BLOCK INC                 | 19            | 173    | 21,262       | 情報技術       |
| BB&T CORP                     | 51            | 171    | 21,039       | 一般消費財・サービス |
| BROADCOM CORP-CL A            | 168           | 635    | 77,847       | 金融         |
| BAKER HUGHES INC              | 116.5         | 657    | 80,597       | 情報技術       |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO       | 92.23         | 399    | 48,984       | エネルギー      |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO     | 356           | 2,466  | 302,105      | ヘルスケア      |
| JPMORGAN CHASE & CO           | 13            | 98     | 12,078       | 生活必需品      |
| LEGG MASON INC                | 781.2         | 5,177  | 634,227      | 金融         |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 21.5          | 84     | 10,289       | 金融         |
| CIGNA CORP                    | 56            | 397    | 48,708       | 金融         |
| LKQ CORP                      | 55.5          | 793    | 97,214       | ヘルスケア      |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD      | 68            | 190    | 23,313       | 一般消費財・サービス |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP  | 10            | 111    | 13,598       | 金融         |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B     | 221.42        | 106    | 12,991       | 電気通信サービス   |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 25            | 253    | 31,078       | 生活必需品      |
| DOLLAR GENERAL CORP           | 39.6          | 416    | 50,979       | 金融         |
| SERVICENOW INC                | 65            | 465    | 56,959       | 一般消費財・サービス |
| CATERPILLAR INC               | 30            | 261    | 32,069       | 情報技術       |
| CMS ENERGY CORP               | 121           | 785    | 96,190       | 資本財・サービス   |
| MOSAIC CO/THE                 | 60            | 217    | 26,604       | 公益事業       |
| DELTA AIR LINES INC           | 68            | 196    | 24,021       | 素材         |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO     | 44            | 224    | 27,502       | 資本財・サービス   |
| CORNING INC                   | 44            | 341    | 41,817       | 生活必需品      |
| CISCO SYSTEMS INC             | 266           | 481    | 58,941       | 情報技術       |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS     | 1,083         | 2,893  | 354,458      | 情報技術       |
| ISIS PHARMACEUTICALS INC      | 192           | 1,252  | 153,408      | 素材         |
| MORGAN STANLEY                | 26            | 151    | 18,535       | ヘルスケア      |
| WABCO HOLDINGS INC            | 317           | 1,026  | 125,729      | 金融         |
| DOW CHEMICAL CO/THE           | 11            | 107    | 13,149       | 資本財・サービス   |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD        | 239           | 1,200  | 147,107      | 素材         |
| UNITED THERAPEUTICS CORP      | 56            | 786    | 96,361       | 情報技術       |
| ENSCO PLC-CL A                | 9             | 142    | 17,433       | ヘルスケア      |
|                               | 49            | 75     | 9,237        | エネルギー      |

| 銘柄                            | 2015年12月18日現在 |       |              | 業 種 等      |
|-------------------------------|---------------|-------|--------------|------------|
|                               | 株 数           | 評 価 額 | 外貨建金額 邦貨換算金額 |            |
| DICK'S SPORTING GOODS INC     | 百株            | 千円    |              |            |
| ACUITY BRANDS INC             | 20            | 72    | 8,865        | 一般消費財・サービス |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC   | 9             | 209   | 25,653       | 資本財・サービス   |
| ARAMARK                       | 15            | 132   | 16,201       | ヘルスケア      |
| DTE ENERGY COMPANY            | 48            | 155   | 19,096       | 一般消費財・サービス |
| CENTENE CORP                  | 38            | 303   | 37,213       | 公益事業       |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP      | 22            | 136   | 16,669       | ヘルスケア      |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS  | 20            | 238   | 29,191       | 金融         |
| GARTNER INC                   | 38            | 90    | 11,082       | ヘルスケア      |
| SPLUNK INC                    | 17            | 153   | 18,843       | 情報技術       |
| WHITEWAVE FOODS CO            | 26            | 141   | 17,293       | 情報技術       |
| AGCO CORP                     | 36            | 137   | 16,831       | 生活必需品      |
| DOMINION RESOURCES INC/VA     | 17            | 75    | 9,283        | 資本財・サービス   |
| MONSTER BEVERAGE CORP         | 127           | 857   | 105,066      | 公益事業       |
| DEERE & CO                    | 30            | 450   | 55,227       | 生活必需品      |
| AIRGAS INC                    | 66            | 507   | 62,176       | 資本財・サービス   |
| QUANTA SERVICES INC           | 15            | 206   | 25,261       | 素材         |
| TIME WARNER INC               | 49            | 97    | 11,919       | 資本財・サービス   |
| VMWARE INC-CLASS A            | 176.33        | 1,143 | 140,088      | 一般消費財・サービス |
| BAXALTA INC                   | 19            | 108   | 13,284       | 情報技術       |
| NASDAQ INC                    | 116           | 431   | 52,913       | ヘルスケア      |
| WESTLAK CHEMICAL CORP         | 27            | 151   | 18,546       | 金融         |
| CONSOLIDATED EDISON INC       | 12            | 64    | 7,891        | 素材         |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP        | 62            | 398   | 48,771       | 公益事業       |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC   | 26            | 187   | 23,016       | 一般消費財・サービス |
| COLGATE-PALMOLIVE CO          | 21            | 152   | 18,669       | 資本財・サービス   |
| AMETEK INC                    | 184           | 1,238 | 151,749      | 生活必需品      |
| CHURCH & DWIGHT CO INC        | 52.25         | 279   | 34,272       | 資本財・サービス   |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A     | 29            | 247   | 30,279       | 生活必需品      |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A      | 10            | 90    | 11,049       | 情報技術       |
| COSTCO WHOLESALE CORP         | 86            | 754   | 92,373       | 素材         |
| SCANA CORP                    | 94            | 1,510 | 185,007      | 生活必需品      |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC     | 29            | 178   | 21,821       | 公益事業       |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP INC | 26            | 231   | 28,302       | 生活必需品      |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC    | 12            | 189   | 23,184       | 金融         |
| LEUCADIA NATIONAL CORP        | 6.5           | 360   | 44,179       | 一般消費財・サービス |
| CUMMINS INC                   | 66            | 107   | 13,225       | 金融         |
| ACTIVISION BLIZZARD INC       | 37            | 318   | 38,958       | 資本財・サービス   |
| HANESBRANDS INC               | 109           | 423   | 51,896       | 情報技術       |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 85            | 249   | 30,558       | 一般消費財・サービス |
| TRANSDIGM GROUP INC           | 107           | 236   | 28,991       | 一般消費財・サービス |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A  | 11            | 241   | 29,599       | 資本財・サービス   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC          | 28            | 282   | 34,643       | 電気通信サービス   |
| KINDER MORGAN INC             | 76            | 351   | 43,055       | 資本財・サービス   |
| HCA HOLDINGS INC              | 393.81        | 605   | 74,141       | エネルギー      |
| CABOT OIL & GAS CORP          | 71            | 459   | 56,303       | ヘルスケア      |
| T-MOBILE US INC               | 88            | 135   | 16,545       | エネルギー      |
| ZILLOW GROUP INC - C          | 59.5          | 233   | 28,569       | 電気通信サービス   |
| COCA-COLA CO/THE              | 18            | 43    | 5,386        | 情報技術       |
| COCA-COLA ENTERPRISES         | 878           | 3,818 | 467,718      | 生活必需品      |
| EXPEDITORS INTL WASH INC      | 47            | 230   | 28,215       | 生活必需品      |
| EATON VANCE CORP              | 40            | 185   | 22,690       | 資本財・サービス   |
| FMC TECHNOLOGIES INC          | 25            | 79    | 9,765        | 金融         |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 49            | 142   | 17,429       | エネルギー      |
| CSX CORP                      | 33            | 308   | 37,777       | 金融         |
| FLUOR CORP                    | 208           | 532   | 65,223       | 資本財・サービス   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS  | 33            | 152   | 18,642       | 資本財・サービス   |
|                               | 22            | 267   | 32,790       | ヘルスケア      |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                            | 2015年12月18日現在 |              |           | 業 種 等      |
|-------------------------------|---------------|--------------|-----------|------------|
|                               | 株 数           | 評 価 額        | 業 種 等     |            |
|                               | 株 数           | 外貨建金額        | 邦貨換算金額    |            |
| EXPEDIA INC                   | 百株 21.75      | 千アメリカ・ドル 279 | 千円 34,279 | 一般消費財・サービス |
| AUTOLIV INC                   | 18.5          | 229          | 28,142    | 一般消費財・サービス |
| AMAZON.COM INC                | 84            | 5,633        | 690,042   | 一般消費財・サービス |
| FLOWSERVE CORP                | 29            | 118          | 14,493    | 資本財・サービス   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP     | 46            | 372          | 45,634    | ヘルスケア      |
| EXXON MOBIL CORP              | 880.55        | 6,864        | 840,865   | エネルギー      |
| FLIR SYSTEMS INC              | 31            | 88           | 10,803    | 情報技術       |
| AES CORP                      | 143           | 131          | 16,114    | 公益事業       |
| L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS   | 18            | 211          | 25,939    | 資本財・サービス   |
| EVEREST RE GROUP LTD          | 10            | 181          | 22,282    | 金融         |
| EOG RESOURCES INC             | 116           | 850          | 104,150   | エネルギー      |
| EQT CORP                      | 32            | 152          | 18,716    | エネルギー      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC       | 39            | 205          | 25,122    | 情報技術       |
| AMERISOURCEBERGEN CORP        | 44            | 450          | 55,156    | ヘルスケア      |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 72.9          | 297          | 36,414    | ヘルスケア      |
| FORD MOTOR CO                 | 791.23        | 1,106        | 135,491   | 一般消費財・サービス |
| MACY'S INC                    | 73.98         | 255          | 31,263    | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A    | 34.4          | 91           | 11,157    | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A          | 53.87         | 215          | 26,427    | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY MEDIA CORP - A        | 21            | 81           | 9,923     | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C    | 58.2          | 147          | 18,093    | 一般消費財・サービス |
| MOBILEYE NV                   | 17            | 68           | 8,362     | 情報技術       |
| NEXTERA ENERGY INC            | 95            | 982          | 120,333   | 公益事業       |
| FREEPORT-MCMORAN INC          | 223.08        | 136          | 16,722    | 素材         |
| US BANCORP                    | 379           | 1,661        | 203,475   | 金融         |
| UNITED RENTALS INC            | 22            | 147          | 18,028    | 資本財・サービス   |
| F5 NETWORKS INC               | 16            | 158          | 19,390    | 情報技術       |
| FASTENAL CO                   | 60            | 239          | 29,390    | 資本財・サービス   |
| FISERV INC                    | 50            | 464          | 56,902    | 情報技術       |
| GENERAL ELECTRIC CO           | 1,994         | 6,091        | 746,168   | 資本財・サービス   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING | 33            | 188          | 23,084    | 一般消費財・サービス |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO     | 56            | 182          | 22,293    | 一般消費財・サービス |
| GENERAL MOTORS CO             | 308           | 1,050        | 128,686   | 一般消費財・サービス |
| TRIPADVISOR INC               | 25            | 213          | 26,145    | 一般消費財・サービス |
| LINKEDIN CORP - A             | 23            | 531          | 65,121    | 情報技術       |
| GENERAL DYNAMICS CORP         | 57            | 787          | 96,462    | 資本財・サービス   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC       | 83            | 1,515        | 185,653   | 金融         |
| GAMESTOP CORP-CLASS A         | 23            | 66           | 8,184     | 一般消費財・サービス |
| ALPHABET INC-CL A             | 61.5          | 4,734        | 579,923   | 情報技術       |
| ALPHABET INC-CL C             | 65.67         | 4,921        | 602,835   | 情報技術       |
| GENERAL MILLS INC             | 126           | 721          | 88,327    | 生活必需品      |
| FIRSTENERGY CORP              | 87.68         | 276          | 33,862    | 公益事業       |
| GENUINE PARTS CO              | 33            | 283          | 34,710    | 一般消費財・サービス |
| FIFTH THIRD BANCORP           | 175           | 354          | 43,482    | 金融         |
| MEDIVATION INC                | 34            | 148          | 18,182    | ヘルスケア      |
| HARRIS CORP                   | 25            | 207          | 25,453    | 情報技術       |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC   | 38            | 161          | 19,763    | 資本財・サービス   |
| HALLIBURTON CO                | 184           | 628          | 77,035    | エネルギー      |
| HOME DEPOT INC                | 270           | 3,546        | 434,404   | 一般消費財・サービス |
| ASSURANT INC                  | 16            | 129          | 15,853    | 金融         |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     | 178           | 197          | 24,245    | 金融         |
| HERSHEY CO/THE                | 33            | 296          | 36,310    | 生活必需品      |
| HARLEY-DAVIDSON INC           | 45            | 204          | 25,035    | 一般消費財・サービス |
| HUMANIA INC                   | 32            | 566          | 69,331    | ヘルスケア      |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS     | 38            | 254          | 31,158    | 一般消費財・サービス |
| NXP SEMICONDUCTORS NV         | 26            | 219          | 26,936    | 情報技術       |
| HELMERICH & PAYNE             | 23            | 119          | 14,593    | エネルギー      |

| 銘柄                             | 2015年12月18日現在 |              |           | 業 種 等      |
|--------------------------------|---------------|--------------|-----------|------------|
|                                | 株 数           | 評 価 額        | 業 種 等     |            |
|                                | 株 数           | 外貨建金額        | 邦貨換算金額    |            |
| HENRY SCHEIN INC               | 百株 18         | 千アメリカ・ドル 279 | 千円 34,218 | ヘルスケア      |
| HP INC                         | 392           | 466          | 57,139    | 情報技術       |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISES    | 392           | 560          | 68,711    | 情報技術       |
| HOLLYFRONTIER CORP             | 39            | 164          | 20,188    | エネルギー      |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD         | 28            | 195          | 23,984    | 金融         |
| HARMAN INTERNATIONAL           | 14            | 127          | 15,656    | 一般消費財・サービス |
| KRAFT HEINZ CO/THE             | 128.03        | 920          | 112,787   | 生活必需品      |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP    | 199           | 2,721        | 333,335   | 情報技術       |
| INTERNATIONAL PAPER CO         | 86            | 324          | 39,734    | 素材         |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 32            | 176          | 21,675    | 資本財・サービス   |
| ZOETIS INC                     | 103           | 481          | 58,956    | ヘルスケア      |
| INGERSOLL-RAND PLC             | 57.29         | 306          | 37,487    | 資本財・サービス   |
| CHENIERE ENERGY INC            | 47            | 175          | 21,462    | エネルギー      |
| LEGGETT & PLATT INC            | 31            | 134          | 16,434    | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C    | 134.23        | 517          | 63,399    | 一般消費財・サービス |
| JUNIPER NETWORKS INC           | 75            | 218          | 26,742    | 情報技術       |
| JIM SMUCKER CO/THE             | 24            | 296          | 36,347    | 生活必需品      |
| JOHNSON & JOHNSON              | 585           | 6,062        | 742,649   | ヘルスケア      |
| ABBVIE INC                     | 350.29        | 1,974        | 241,909   | ヘルスケア      |
| HOLOGIC INC                    | 51            | 195          | 23,988    | ヘルスケア      |
| KIMBERLY-CLARK CORP            | 77            | 968          | 118,688   | 生活必需品      |
| KROGER CO                      | 200           | 838          | 102,744   | 生活必需品      |
| KLA-TENCOR CORP                | 33            | 224          | 27,506    | 情報技術       |
| LOCKHEED MARTIN CORP           | 57            | 1,226        | 150,265   | 資本財・サービス   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC      | 17            | 242          | 29,733    | 情報技術       |
| L BRANDS INC                   | 53            | 511          | 62,699    | 一般消費財・サービス |
| LOWE'S COS INC                 | 196           | 1,468        | 179,820   | 一般消費財・サービス |
| ELI LILLY & CO                 | 211           | 1,819        | 222,838   | ヘルスケア      |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC     | 65            | 338          | 41,489    | 電気通信サービス   |
| LAM RESEARCH CORP              | 33            | 259          | 31,811    | 情報技術       |
| RANGE RESOURCES CORP           | 37            | 78           | 9,594     | エネルギー      |
| JONES LANG LASALLE INC         | 9             | 146          | 17,956    | 金融         |
| LOEWS CORP                     | 61            | 225          | 27,616    | 金融         |
| LINCOLN NATIONAL CORP          | 54.49         | 273          | 33,532    | 金融         |
| MCDONALD'S CORP                | 199           | 2,338        | 286,412   | 一般消費財・サービス |
| 3M CO                          | 132           | 1,964        | 240,670   | 資本財・サービス   |
| FACEBOOK INC-A                 | 456           | 4,843        | 593,296   | 情報技術       |
| MANPOWERGROUP INC              | 17            | 143          | 17,522    | 資本財・サービス   |
| MCGRAW HILL FINANCIAL INC      | 58            | 552          | 67,719    | 金融         |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS      | 12            | 171          | 20,981    | 素材         |
| CONCHO RESOURCES INC           | 28            | 267          | 32,743    | エネルギー      |
| PHILLIPS 66                    | 113           | 924          | 113,194   | エネルギー      |
| MURPHY OIL CORP                | 36            | 78           | 9,613     | エネルギー      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL      | 93            | 199          | 24,434    | 一般消費財・サービス |
| MATTEL INC                     | 72            | 193          | 23,679    | 一般消費財・サービス |
| MCCORMICK & CO-NON VTD SHRS    | 25            | 211          | 25,964    | 生活必需品      |
| MYLAN NV                       | 87            | 460          | 56,448    | ヘルスケア      |
| METLIFE INC                    | 203           | 963          | 118,036   | 金融         |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD   | 84            | 71           | 8,714     | 情報技術       |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC         | 34.28         | 235          | 28,788    | 情報技術       |
| MONSANTO CO                    | 98.06         | 938          | 114,996   | 素材         |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL   | 6             | 199          | 24,404    | ヘルスケア      |
| ROCKWELL AUTOMATION INC        | 28            | 280          | 34,304    | 資本財・サービス   |
| MERCK & CO. INC.               | 598.21        | 3,150        | 385,864   | ヘルスケア      |
| MASCO CORP                     | 74            | 209          | 25,715    | 資本財・サービス   |
| M & T BANK CORP                | 32.19         | 401          | 49,184    | 金融         |
| MARSH & MCLENNAN COS           | 115           | 641          | 78,573    | 金融         |

| 銘柄                           | 2015年12月18日現在 |          |         | 業 種 等      |
|------------------------------|---------------|----------|---------|------------|
|                              | 株 数           | 評 価 額    |         |            |
|                              |               | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株            | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| MARriott INTERNATIONAL -CL A | 47.82         | 315      | 38,676  | 一般消費財・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 22            | 177      | 21,698  | 情報技術       |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | 44            | 173      | 21,251  | 一般消費財・サービス |
| TOWERS WATSON & CO-CL A      | 15            | 197      | 24,247  | 資本財・サービス   |
| VANTIV INC - CL A            | 33            | 160      | 19,620  | 情報技術       |
| FIREEYE INC                  | 22            | 46       | 5,699   | 情報技術       |
| REALOGY HOLDINGS CORP        | 32            | 120      | 14,800  | 金融         |
| NETAPP INC                   | 67            | 189      | 23,225  | 情報技術       |
| NIKE INC -CL B               | 143           | 1,862    | 228,094 | 一般消費財・サービス |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 65            | 552      | 67,723  | 資本財・サービス   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 45            | 208      | 25,597  | 情報技術       |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 27            | 159      | 19,499  | 金融         |
| ALLY FINANCIAL INC           | 93            | 171      | 20,994  | 金融         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 39            | 734      | 89,957  | 資本財・サービス   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 62            | 517      | 63,382  | 一般消費財・サービス |
| NEWMONT MINING CORP          | 115           | 202      | 24,806  | 素材         |
| ADT CORP/THE                 | 39.62         | 131      | 16,087  | 資本財・サービス   |
| MCKESSON CORP                | 49            | 931      | 114,050 | ヘルスケア      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 60            | 225      | 27,626  | 情報技術       |
| XYLEM INC                    | 38            | 138      | 16,970  | 資本財・サービス   |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 330           | 2,939    | 360,076 | 生活必需品      |
| NUCOR CORP                   | 68            | 261      | 32,042  | 素材         |
| WESTERN UNION CO             | 113.46        | 205      | 25,196  | 情報技術       |
| NEWELL RUBBERMAID INC        | 60            | 268      | 32,940  | 一般消費財・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 163           | 1,082    | 132,613 | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA CORP - C       | 45            | 167      | 20,559  | 一般消費財・サービス |
| PAYCHEX INC                  | 68            | 362      | 44,436  | 情報技術       |
| PATTERSON COS INC            | 19            | 84       | 10,333  | ヘルスケア      |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 21            | 534      | 65,426  | 一般消費財・サービス |
| ALTRIA GROUP INC             | 411           | 2,401    | 294,156 | 生活必需品      |
| P G & E CORP                 | 102           | 549      | 67,280  | 公益事業       |
| PFIZER INC                   | 1,313.63      | 4,246    | 520,210 | ヘルスケア      |
| ALKERMES PLC                 | 32            | 248      | 30,451  | ヘルスケア      |
| XCEL ENERGY INC              | 106           | 385      | 47,261  | 公益事業       |
| STRYKER CORP                 | 72            | 667      | 81,763  | ヘルスケア      |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 29            | 276      | 33,813  | 資本財・サービス   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 32            | 417      | 51,155  | エネルギー      |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 14            | 119      | 14,578  | 一般消費財・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 577.37        | 4,635    | 567,827 | 生活必需品      |
| EXELON CORP                  | 187.22        | 498      | 61,000  | 公益事業       |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 48            | 891      | 109,235 | ヘルスケア      |
| CONOCOPHILLIPS               | 264           | 1,248    | 152,891 | エネルギー      |
| PEPSICO INC                  | 309           | 3,096    | 379,251 | 生活必需品      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 97            | 793      | 97,250  | 金融         |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 38            | 225      | 27,597  | 公益事業       |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 134           | 1,383    | 169,487 | 情報技術       |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 22            | 122      | 15,023  | 金融         |
| PENTAIR PLC                  | 40.05         | 198      | 24,322  | 資本財・サービス   |
| QUALCOMM INC                 | 333           | 1,583    | 193,911 | 情報技術       |
| PARTNERRE LTD                | 10            | 138      | 17,024  | 金融         |
| INVESCO LTD                  | 90.5          | 282      | 34,575  | 金融         |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 15.5          | 237      | 29,061  | 一般消費財・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 62            | 280      | 34,349  | 金融         |
| ENERGEN CORP                 | 17            | 75       | 9,301   | エネルギー      |
| RAYTHEON COMPANY             | 66            | 841      | 103,051 | 資本財・サービス   |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 18            | 97       | 11,967  | 一般消費財・サービス |
| RED HAT INC                  | 39            | 307      | 37,672  | 情報技術       |

| 銘柄                           | 株数       | 2015年12月18日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|----------|---------------|---------|------------|
|                              |          | 評価額           | 業種等     |            |
|                              |          | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株       | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 16       | 882           | 108,083 | ヘルスケア      |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 53       | 232           | 28,460  | 資本財・サービス   |
| PRICELINE GROUP INC/THE      | 11       | 1,445         | 177,012 | 一般消費財・サービス |
| ROSS STORES INC              | 88       | 473           | 58,056  | 一般消費財・サービス |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 21       | 130           | 15,937  | 素材         |
| RESMED INC                   | 30       | 165           | 20,280  | ヘルスケア      |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 31       | 213           | 26,143  | ヘルスケア      |
| ROBERT HALF INTL INC         | 28       | 128           | 15,711  | 資本財・サービス   |
| REYNOLDS AMERICAN INC        | 184.78   | 840           | 102,983 | 生活必需品      |
| RITE AID CORP                | 196      | 154           | 18,918  | 生活必需品      |
| RALPH LAUREN CORP            | 13       | 146           | 17,953  | 一般消費財・サービス |
| AUTONATION INC               | 17       | 101           | 12,444  | 一般消費財・サービス |
| ROCKWELL COLLINS INC         | 27       | 242           | 29,679  | 資本財・サービス   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 288.35   | 280           | 34,366  | 金融         |
| CHEVRON CORP                 | 400.18   | 3,623         | 443,809 | エネルギー      |
| EDISON INTERNATIONAL         | 69       | 420           | 51,471  | 公益事業       |
| TESLA MOTORS INC             | 20       | 466           | 57,175  | 一般消費財・サービス |
| SYMANTEC CORP                | 147      | 296           | 36,300  | 情報技術       |
| ENDO INTERNATIONAL PLC       | 43       | 263           | 32,329  | ヘルスケア      |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 33.22    | 357           | 43,759  | 資本財・サービス   |
| SYNOPSYS INC                 | 34       | 153           | 18,832  | 情報技術       |
| CHARTER COMMUNICATION-A      | 18       | 329           | 40,354  | 一般消費財・サービス |
| CBRE GROUP INC - A           | 64       | 226           | 27,735  | 金融         |
| TWITTER INC                  | 104      | 242           | 29,694  | 情報技術       |
| NAVIENT CORP                 | 87       | 108           | 13,299  | 金融         |
| SANDISK CORP                 | 44       | 329           | 40,330  | 情報技術       |
| SOUTHERN CO/THE              | 196      | 911           | 111,661 | 公益事業       |
| SYSCO CORP                   | 125      | 515           | 63,158  | 生活必需品      |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 68.23    | 772           | 94,665  | 金融         |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO       | 79       | 40            | 4,983   | エネルギー      |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 32       | 167           | 20,566  | 金融         |
| STERICYCLE INC               | 18       | 213           | 26,162  | 資本財・サービス   |
| SCHLUMBERGER LTD             | 270.67   | 1,873         | 229,428 | エネルギー      |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 35       | 156           | 19,146  | 資本財・サービス   |
| AT&T INC                     | 1,304.91 | 4,440         | 543,930 | 電気通信サービス   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 38       | 165           | 20,252  | 資本財・サービス   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 17       | 447           | 54,806  | 素材         |
| SEMPRA ENERGY                | 50       | 479           | 58,764  | 公益事業       |
| TIFFANY & CO                 | 28       | 205           | 25,115  | 一般消費財・サービス |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 70       | 237           | 29,084  | 情報技術       |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 217      | 1,226         | 150,258 | 情報技術       |
| SALESFORCE.COM INC           | 133      | 1,043         | 127,771 | 情報技術       |
| SIGNET JEWELERS LTD          | 17       | 197           | 24,242  | 一般消費財・サービス |
| WESTROCK CO                  | 55.3     | 248           | 30,393  | 素材         |
| TIME WARNER CABLE            | 60.53    | 1,116         | 136,801 | 一般消費財・サービス |
| TYCO INTERNATIONAL PLC       | 89.25    | 279           | 34,196  | 資本財・サービス   |
| TESORO CORP                  | 28       | 296           | 36,337  | エネルギー      |
| UNION PACIFIC CORP           | 184      | 1,422         | 174,287 | 資本財・サービス   |
| MARATHON OIL CORP            | 143      | 182           | 22,385  | エネルギー      |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 118      | 605           | 74,177  | エネルギー      |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 181      | 1,699         | 208,116 | 資本財・サービス   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 150      | 1,500         | 183,735 | 資本財・サービス   |
| UNUM GROUP                   | 54       | 178           | 21,874  | 金融         |
| SPRINT CORP                  | 177.65   | 63            | 7,833   | 電気通信サービス   |
| QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD | 19       | 132           | 16,258  | ヘルスケア      |
| VOYA FINANCIAL INC           | 50       | 183           | 22,483  | 金融         |
| AMEREN CORPORATION           | 51       | 224           | 27,505  | 公益事業       |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 2015年12月18日現在 |          |         | 業 種 等      |
|------------------------------|---------------|----------|---------|------------|
|                              | 株 数           | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株            | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 203.26        | 2,423    | 296,825 | ヘルスケア      |
| VERISIGN INC                 | 22            | 193      | 23,673  | 情報技術       |
| VALERO ENERGY CORP           | 108.92        | 780      | 95,632  | エネルギー      |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 13            | 241      | 29,527  | 一般消費財・サービス |
| FNF GROUP                    | 52.38         | 173      | 21,217  | 金融         |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 20            | 232      | 28,447  | ヘルスケア      |
| ANTHEM INC                   | 57            | 792      | 97,055  | ヘルスケア      |
| WALT DISNEY CO/THE           | 339           | 3,797    | 465,111 | 一般消費財・サービス |
| WELLS FARGO & CO             | 1,030.72      | 5,717    | 700,324 | 金融         |
| FOOT LOCKER INC              | 29            | 185      | 22,737  | 一般消費財・サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 96            | 511      | 62,652  | 資本財・サービス   |
| WILLIAMS COS INC             | 151           | 357      | 43,835  | エネルギー      |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 29            | 249      | 30,502  | 一般消費財・サービス |
| WHITING PETROLEUM CORP       | 44            | 42       | 5,238   | エネルギー      |
| WHIRLPOOL CORP               | 17            | 249      | 30,616  | 一般消費財・サービス |
| WAL-MART STORES INC          | 343           | 2,023    | 247,798 | 生活必需品      |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 37            | 372      | 45,643  | ヘルスケア      |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 168           | 144      | 17,717  | エネルギー      |
| WYNN RESORTS LTD             | 18            | 115      | 14,170  | 一般消費財・サービス |
| XEROX CORP                   | 229.44        | 233      | 28,638  | 情報技術       |
| WABTEC CORP                  | 21            | 147      | 18,088  | 資本財・サービス   |
| TJX COMPANIES INC            | 145           | 1,024    | 125,481 | 一般消費財・サービス |
| WATERS CORP                  | 18            | 236      | 28,949  | ヘルスケア      |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  | 20            | 114      | 14,042  | 資本財・サービス   |
| ALLERGAN PLC                 | 83.07         | 2,571    | 314,933 | ヘルスケア      |
| WHOLE FOODS MARKET INC       | 78            | 260      | 31,891  | 生活必需品      |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 186           | 1,550    | 189,874 | 生活必需品      |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC    | 34            | 156      | 19,211  | 金融         |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 49            | 291      | 35,651  | 情報技術       |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 67.3          | 344      | 42,256  | 公益事業       |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 109           | 415      | 50,882  | 公益事業       |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 410           | 3,226    | 395,188 | 情報技術       |
| PPL CORP                     | 143           | 485      | 59,414  | 公益事業       |
| PEPCO HOLDINGS INC           | 56            | 147      | 18,026  | 公益事業       |
| PULTEGROUP INC               | 74            | 131      | 16,089  | 一般消費財・サービス |
| PPG INDUSTRIES INC           | 58            | 569      | 69,793  | 素材         |
| NORTHERN TRUST CORP          | 49            | 352      | 43,196  | 金融         |
| PRECISION CASTPARTS CORP     | 30            | 694      | 85,065  | 資本財・サービス   |
| NVIDIA CORP                  | 116.5         | 380      | 46,620  | 情報技術       |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 110.93        | 1,061    | 130,008 | 金融         |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A | 95.5          | 252      | 30,882  | 一般消費財・サービス |
| TERADATA CORP                | 32            | 85       | 10,512  | 情報技術       |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 65            | 343      | 42,102  | 生活必需品      |
| NETFLIX INC                  | 86            | 1,053    | 129,053 | 一般消費財・サービス |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 85            | 1,174    | 143,847 | ヘルスケア      |
| NRG ENERGY INC               | 71            | 67       | 8,279   | 公益事業       |
| TORCHMARK CORP               | 26.75         | 152      | 18,673  | 金融         |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 31            | 206      | 25,258  | 金融         |
| TEXTRON INC                  | 59            | 244      | 29,933  | 資本財・サービス   |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 266.5         | 732      | 89,737  | 一般消費財・サービス |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 96            | 271      | 33,195  | 一般消費財・サービス |
| NEWS CORP - CLASS A          | 83.37         | 111      | 13,643  | 一般消費財・サービス |
| OGE ENERGY CORP              | 42            | 107      | 13,128  | 公益事業       |
| OMNICOM GROUP                | 53            | 390      | 47,826  | 一般消費財・サービス |
| ORACLE CORP                  | 731.83        | 2,702    | 331,047 | 情報技術       |
| MASTERCARD INC-CLASS A       | 214           | 2,125    | 260,372 | 情報技術       |
| ONEOK INC                    | 46            | 91       | 11,190  | エネルギー      |

| 銘柄                           | 2015年12月18日現在 |          |         | 業 種 等      |
|------------------------------|---------------|----------|---------|------------|
|                              | 株 数           | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株            | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| OCEANEERING INTL INC         | 21            | 79       | 9,692   | エネルギー      |
| CENTURYLINK INC              | 120.95        | 307      | 37,630  | 電気通信サービス   |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 21            | 387      | 47,484  | 資本財・サービス   |
| YUM! BRANDS INC              | 92            | 664      | 81,362  | 一般消費財・サービス |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 13            | 349      | 42,844  | 情報技術       |
| MOLSON COORS BREWING CO-B    | 33            | 309      | 37,883  | 生活必需品      |
| NOBLE ENERGY INC             | 89            | 277      | 34,034  | エネルギー      |
| BANK OF AMERICA CORP         | 2,223.01      | 3,845    | 471,072 | 金融         |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 34            | 342      | 41,913  | ヘルスケア      |
| NORDSTROM INC                | 30            | 154      | 18,865  | 一般消費財・サービス |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 190           | 1,321    | 161,910 | 金融         |
| ANALOG DEVICES INC           | 67            | 376      | 46,056  | 情報技術       |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 60            | 208      | 25,597  | 金融         |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 273.72        | 1,645    | 201,603 | 金融         |
| ASHLAND INC                  | 14            | 144      | 17,719  | 素材         |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 109           | 509      | 62,391  | エネルギー      |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 41            | 318      | 39,071  | 情報技術       |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 38            | 357      | 43,730  | 一般消費財・サービス |
| MALLINCKRODT PLC             | 25            | 179      | 21,931  | ヘルスケア      |
| AVERY DENNISON CORP          | 19            | 119      | 14,678  | 素材         |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 131           | 791      | 96,951  | 情報技術       |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 141           | 634      | 77,719  | 資本財・サービス   |
| ACON PLC                     | 60            | 559      | 68,547  | 金融         |
| AMGEN INC                    | 162           | 2,615    | 320,331 | ヘルスケア      |
| CORE LABORATORIES N.V.       | 10            | 111      | 13,678  | エネルギー      |
| COACH INC                    | 59            | 192      | 23,588  | 一般消費財・サービス |
| EATON CORP PLC               | 100.86        | 505      | 61,932  | 資本財・サービス   |
| CELGENE CORP                 | 169           | 1,895    | 232,200 | ヘルスケア      |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 37            | 517      | 63,399  | 生活必需品      |
| APPLIED MATERIALS INC        | 260           | 469      | 57,516  | 情報技術       |
| CIT GROUP INC                | 39            | 157      | 19,347  | 金融         |
| CELMAREX ENERGY CO           | 19            | 181      | 22,281  | エネルギー      |
| CME GROUP INC                | 69            | 655      | 80,266  | 金融         |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 82.44         | 277      | 34,000  | エネルギー      |
| ECOLAB INC                   | 58            | 668      | 81,913  | 素材         |
| EQUIFAX INC                  | 26            | 294      | 36,051  | 資本財・サービス   |
| GAP INC/THE                  | 50            | 126      | 15,433  | 一般消費財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC          | 311           | 3,183    | 389,934 | ヘルスケア      |
| ST JUDE MEDICAL INC          | 59            | 360      | 44,127  | ヘルスケア      |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 41.48         | 385      | 47,267  | 生活必需品      |
| HORMEL FOODS CORP            | 32            | 254      | 31,157  | 生活必需品      |
| STATE STREET CORP            | 89.43         | 593      | 72,736  | 金融         |
| STAPLES INC                  | 136           | 128      | 15,792  | 一般消費財・サービス |
| SUNTRUST BANKS INC           | 110.48        | 477      | 58,515  | 金融         |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 252           | 836      | 102,510 | ヘルスケア      |
| IHS INC-CLASS A              | 15            | 174      | 21,429  | 資本財・サービス   |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 116           | 435      | 53,339  | ヘルスケア      |
| B/E AEROSPACE INC            | 23            | 96       | 11,779  | 資本財・サービス   |
| CAMPBELL SOUP CO             | 40            | 212      | 26,036  | 生活必需品      |
| CROWN HOLDINGS INC           | 31            | 151      | 18,568  | 素材         |
| CHUBB CORP                   | 49            | 641      | 78,632  | 金融         |
| CARDINAL HEALTH INC          | 71            | 624      | 76,496  | ヘルスケア      |
| FEDEX CORP                   | 57            | 865      | 106,013 | 資本財・サービス   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 116.54        | 866      | 106,177 | 金融         |
| FMC CORP                     | 28            | 105      | 12,875  | 素材         |
| FLEXTRONICS INTL LTD         | 122           | 134      | 16,460  | 情報技術       |
| CERNER CORP                  | 66            | 398      | 48,813  | ヘルスケア      |

| 銘柄                           | 株数     | 2015年12月18日現在 |            | 業種等 |
|------------------------------|--------|---------------|------------|-----|
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額     |     |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円         |     |
| 18                           | 212    | 26,036        | 素材         |     |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 34     | 32,342        | 情報技術       |     |
| INTEL CORP                   | 1,004  | 429,323       | 情報技術       |     |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP   | 41     | 31,418        | エネルギー      |     |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 88     | 24,242        | 一般消費財・サービス |     |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 92     | 48,806        | 金融         |     |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 70     | 79,355        | 資本財・サービス   |     |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 553    | 27,230        | 一般消費財・サービス |     |
| ILLUMINA INC                 | 30     | 66,603        | ヘルスケア      |     |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 119    | 5,422         | エネルギー      |     |
| SEALED AIR CORP              | 44     | 23,212        | 素材         |     |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 8      | 52,824        | ヘルスケア      |     |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 14     | 14,178        | 情報技術       |     |
| SNAP-ON INC                  | 12     | 25,054        | 資本財・サービス   |     |
| CALPINE CORP                 | 72     | 11,024        | 公益事業       |     |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 43     | 16,475        | 一般消費財・サービス |     |
| CARMAX INC                   | 46     | 32,201        | 一般消費財・サービス |     |
| COMERICA INC                 | 40     | 20,730        | 金融         |     |
| CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV  | 23     | 10,795        | 資本財・サービス   |     |
| DUKE ENERGY CORP             | 148.28 | 1,045         | 公益事業       |     |
| TARGET CORP                  | 126    | 111,632       | 一般消費財・サービス |     |
| DOVER CORP                   | 35     | 25,491        | 資本財・サービス   |     |
| WW GRAINGER INC              | 13     | 31,027        | 資本財・サービス   |     |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 26     | 13,248        | 資本財・サービス   |     |
| JOHNSON CONTROLS INC         | 142    | 67,643        | 一般消費財・サービス |     |
| CINTAS CORP                  | 21     | 23,284        | 資本財・サービス   |     |
| CA INC                       | 71.05  | 202           | 情報技術       |     |
| CONAGRA FOODS INC            | 90     | 44,790        | 生活必需品      |     |
| CLOROX COMPANY               | 28     | 45,045        | 生活必需品      |     |
| ENTERGY CORP                 | 38     | 31,293        | 公益事業       |     |
| MICROSOFT CORP               | 1,614  | 1,101,182     | 情報技術       |     |
| INCYTE CORP                  | 34     | 47,814        | ヘルスケア      |     |
| CVS HEALTH CORP              | 235.74 | 2,232         | 生活必需品      |     |
| MEDTRONIC PLC                | 301.88 | 2,351         | ヘルスケア      |     |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 230    | 329           | 情報技術       |     |
| BLACKROCK INC                | 26     | 858           | 金融         |     |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 91     | 162           | 公益事業       |     |
| HASBRO INC                   | 24     | 159           | 一般消費財・サービス |     |
| KELLOGG CO                   | 56     | 401           | 生活必需品      |     |
| KEYCORP                      | 184    | 239           | 金融         |     |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 24     | 172           | 資本財・サービス   |     |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 347.11 | 1,539         | 生活必需品      |     |
| KOHL'S CORP                  | 44     | 195           | 一般消費財・サービス |     |
| COOPER COS INC/THE           | 10     | 136           | ヘルスケア      |     |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 100    | 166           | 金融         |     |
| APACHE CORP                  | 81.1   | 348           | エネルギー      |     |
| ACE LTD                      | 70     | 809           | 金融         |     |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 20     | 109           | 情報技術       |     |
| ALLSTATE CORP                | 89     | 555           | 金融         |     |
| EBAY INC                     | 237    | 664           | 情報技術       |     |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 234    | 831           | 情報技術       |     |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 32     | 213           | 素材         |     |
| XILINX INC                   | 56     | 263           | 情報技術       |     |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 143.1  | 1,239         | ヘルスケア      |     |
| DISH NETWORK CORP-A          | 47     | 273           | 一般消費財・サービス |     |
| YAHOO! INC                   | 193    | 641           | 情報技術       |     |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 49     | 437           | 生活必需品      |     |

| 銘柄                          | 株数     | 2015年12月18日現在 |            | 業種等        |
|-----------------------------|--------|---------------|------------|------------|
|                             |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額     |            |
| TOLL BROTHERS INC           | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円         |            |
| 38                          | 128    | 15,769        | 一般消費財・サービス |            |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD      | 54     | 14,505        | 情報技術       |            |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP      | 53     | 229           | 情報技術       |            |
| LENNAR CORP-A               | 39     | 189           | 一般消費財・サービス |            |
| LEAR CORP                   | 17     | 207           | 一般消費財・サービス |            |
| E*TRADE FINANCIAL CORP      | 57     | 170           | 金融         |            |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC   | 83     | 119           | 資本財・サービス   |            |
| PROGRESSIVE CORP            | 128    | 402           | 金融         |            |
| PRAXAIR INC                 | 62     | 638           | 素材         |            |
| PACCAR INC                  | 76.37  | 347           | 資本財・サービス   |            |
| PVH CORP                    | 17     | 125           | 一般消費財・サービス |            |
| EMC CORP/MA                 | 411    | 1,050         | 情報技術       |            |
| BIOGEN INC                  | 50.3   | 1,494         | ヘルスケア      |            |
| STARBUCKS CORP              | 314    | 1,868         | 一般消費財・サービス |            |
| PERRIGO CO PLC              | 31     | 453           | ヘルスケア      |            |
| EVERSOURCE ENERGY           | 66.8   | 345           | 公益事業       |            |
| INTUIT INC                  | 57     | 557           | 情報技術       |            |
| BORGWARNER INC              | 48     | 197           | 一般消費財・サービス |            |
| BEST BUY CO INC             | 65     | 193           | 一般消費財・サービス |            |
| BALL CORP                   | 28     | 197           | 素材         |            |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 288.47 | 536           | ヘルスケア      |            |
| BED BATH & BEYOND INC       | 36     | 186           | 一般消費財・サービス |            |
| XL GROUP PLC                | 63     | 241           | 金融         |            |
| ELECTRONIC ARTS INC         | 68     | 483           | 情報技術       |            |
| VULCAN MATERIALS CO         | 29     | 274           | 素材         |            |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC  | 52     | 613           | ヘルスケア      |            |
| VF CORP                     | 71     | 443           | 一般消費財・サービス |            |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING | 94.71  | 440           | 一般消費財・サービス |            |
| VIACOM INC-CLASS B          | 72.71  | 289           | 一般消費財・サービス |            |
| MOHAWK INDUSTRIES INC       | 13     | 251           | 一般消費財・サービス |            |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC   | 60     | 122           | 情報技術       |            |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC  | 22     | 172           | ヘルスケア      |            |
| CARNIVAL CORP               | 87     | 439           | 一般消費財・サービス |            |
| COMCAST CORP-CLASS A        | 521.7  | 2,994         | 一般消費財・サービス |            |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD  | 125    | 86            | 金融         |            |
| アメリカ・ドル                     | 株数、金額  | 67,169.73     | 389,999    | 47,771,052 |
| 通貨                          | 通貨計    | 銘柄数比率         | 588銘柄      | <61.6%>    |
| (カナダ)                       | 百株     | 千カナダ・ドル       | 千円         |            |
| IMPERIAL OIL LTD            | 66     | 280           | エネルギー      |            |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC  | 4      | 232           | 情報技術       |            |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD      | 30     | 64            | エネルギー      |            |
| RESTAURANT BRANDS INTERN    | 43.87  | 220           | 一般消費財・サービス |            |
| SILVER WHEATON CORP         | 90     | 149           | 素材         |            |
| INTACT FINANCIAL CORP       | 29     | 255           | 金融         |            |
| BCE INC                     | 34.3   | 183           | 電気通信サービス   |            |
| FRANCO-NEVADA CORP          | 35     | 219           | 素材         |            |
| SUNCOR ENERGY INC           | 318.8  | 1,129         | エネルギー      |            |
| METRO INC                   | 55     | 212           | 生活必需品      |            |
| NATIONAL BANK OF CANADA     | 70     | 284           | 金融         |            |
| BANK OF NOVA SCOTIA         | 266    | 1,520         | 金融         |            |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 87     | 818           | 金融         |            |
| TORONTO-DOMINION BANK       | 404    | 2,217         | 金融         |            |
| GREAT-WEST LIFE CO INC      | 67     | 232           | 金融         |            |
| NEGL ENERGY CORP            | 38     | 29            | エネルギー      |            |
| ROYAL BANK OF CANADA        | 315    | 2,360         | 金融         |            |
| TOURMALINE OIL CORP         | 38     | 81            | エネルギー      |            |
| VERMILION ENERGY INC        | 25     | 90            | エネルギー      |            |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株数     | 2015年12月18日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
| TRANSCANADA CORP             | 百株     | 千カナダ・ドル       | 千円      | エネルギー      |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 154    | 717           | 62,940  | エネルギー      |
| BOMBARDIER INC-B             | 75     | 225           | 19,750  | エネルギー      |
| BARRICK GOLD CORP            | 366    | 42            | 3,758   | 資本財・サービス   |
| CAE INC                      | 245    | 237           | 20,839  | 素材         |
| THOMSON REUTERS CORP         | 74     | 112           | 9,854   | 資本財・サービス   |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 78.04  | 412           | 36,176  | 一般消費財・サービス |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 178    | 427           | 37,515  | 素材         |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 39     | 98            | 8,640   | 生活必需品      |
| VERESIN INC                  | 14     | 73            | 6,478   | 素材         |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 62     | 53            | 4,658   | エネルギー      |
| ELEMENT FINANCIAL CORP       | 6      | 135           | 11,862  | 素材         |
| LOBLOW COMPANIES LTD         | 82     | 135           | 11,862  | 金融         |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 48.6   | 317           | 27,857  | 生活必需品      |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 28     | 89            | 7,887   | 公益事業       |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 81     | 384           | 33,737  | 電気通信サービス   |
| KINROSS GOLD CORP            | 48     | 167           | 14,717  | 素材         |
| BANK OF MONTREAL             | 295    | 73            | 6,421   | 素材         |
| POWER CORP OF CANADA         | 143    | 1,129         | 99,152  | 金融         |
| METHANEX CORP                | 80     | 237           | 20,849  | 金融         |
| CAMECO CORP                  | 22     | 98            | 8,638   | 素材         |
| TELUS CORP                   | 92     | 149           | 13,123  | エネルギー      |
| POWER FINANCIAL CORP         | 54     | 204           | 17,974  | 電気通信サービス   |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 56     | 183           | 16,093  | 金融         |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 121    | 52            | 4,599   | 素材         |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 17     | 202           | 17,777  | 一般消費財・サービス |
| AGRIUM INC                   | 208    | 67            | 5,933   | 素材         |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 29     | 373           | 32,754  | 素材         |
| FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD   | 243    | 685           | 60,216  | エネルギー      |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 4.5    | 291           | 25,552  | 金融         |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 89     | 509           | 44,765  | 一般消費財・サービス |
| BLACKBERRY LTD               | 11     | 117           | 10,325  | 生活必需品      |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 119    | 129           | 11,375  | 情報技術       |
| ENBRIDGE INC                 | 132    | 576           | 50,588  | 金融         |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 189    | 829           | 72,831  | エネルギー      |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 190    | 847           | 74,351  | 金融         |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE | 425    | 868           | 76,217  | 金融         |
| GOLDCORP INC                 | 71     | 1,107         | 97,243  | ヘルスケア      |
| ENCANA CORP                  | 177.59 | 271           | 23,788  | 素材         |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 184    | 128           | 11,241  | エネルギー      |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 34     | 602           | 52,915  | 資本財・サービス   |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 28     | 124           | 10,952  | 金融         |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 52     | 209           | 18,386  | 一般消費財・サービス |
| CGI GROUP INC - CLASS A      | 176    | 1,365         | 119,901 | 資本財・サービス   |
| HUSKY ENERGY INC             | 49     | 278           | 24,469  | 情報技術       |
| ONEX CORPORATION             | 74     | 104           | 9,204   | エネルギー      |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 20     | 168           | 14,773  | 金融         |
| FINNING INTERNATIONAL INC    | 87     | 216           | 19,015  | 一般消費財・サービス |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        | 39     | 70            | 6,179   | 資本財・サービス   |
| ELDERADO GOLD CORP           | 34     | 143           | 12,600  | 資本財・サービス   |
| IGM FINANCIAL INC            | 172    | 68            | 6,009   | 素材         |
| OPEN TEXT CORP               | 23     | 81            | 7,161   | 金融         |
| CI FINANCIAL CORP            | 28     | 186           | 16,356  | 情報技術       |
| SAPUTO INC                   | 48     | 147           | 12,918  | 金融         |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 58     | 188           | 16,531  | 生活必需品      |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B   | 147    | 56            | 4,993   | 素材         |
| YAMANA GOLD INC              | 90     | 559           | 49,147  | 生活必需品      |
|                              | 201    | 50            | 4,428   | 素材         |

| 銘柄                           | 株数      | 2015年12月18日現在 |           | 業種等        |
|------------------------------|---------|---------------|-----------|------------|
|                              |         | 評価額           | 価額        |            |
|                              |         | 外貨建金額         | 邦貨換算金額    |            |
| FORTIS INC                   | 百株      | 千カナダ・ドル       | 千円        | 公益事業       |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP   | 61      | 230           | 20,261    | エネルギー      |
| CENOVUS ENERGY INC           | 105     | 160           | 14,064    | エネルギー      |
| DOLLARAMA INC                | 183     | 319           | 28,015    | エネルギー      |
| ALTAGAS LTD                  | 27      | 212           | 18,673    | 一般消費財・サービス |
| KEYERA CORP                  | 31      | 93            | 8,242     | エネルギー      |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 40      | 160           | 14,048    | エネルギー      |
| INTER PIPELINE LTD           | 34      | 78            | 6,888     | エネルギー      |
| CANADIAN OIL SANDS LTD       | 74      | 163           | 14,310    | エネルギー      |
| ARC RESOURCES LTD            | 112     | 92            | 8,101     | エネルギー      |
| カナダ・ドル 株数、金額                 | 8,648.7 | 29,604        | 2,598,647 |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 86銘柄    | < 3.4%>       | < 3.4%>   |            |
| (オーストラリア)                    | 百株      | 千オーストラリア・ドル   | 千円        |            |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         | 545     | 116           | 10,127    | 金融         |
| BHP BILLITON LIMITED         | 702     | 1,194         | 104,234   | 素材         |
| SOUTH32 LTD                  | 1,182   | 125           | 10,930    | 素材         |
| LENDELEASE GROUP             | 121     | 162           | 14,197    | 金融         |
| ASCIANO LTD                  | 216     | 190           | 16,620    | 資本財・サービス   |
| ALUMINA LTD                  | 699     | 76            | 6,707     | 素材         |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 161     | 431           | 37,670    | エネルギー      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 397     | 72            | 6,355     | 素材         |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK    | 118     | 132           | 11,570    | 金融         |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 570     | 1,649         | 143,909   | 金融         |
| WESTPAC BANKING CORP         | 704.98  | 2,268         | 197,914   | 金融         |
| SANTOS LTD                   | 340     | 118           | 10,322    | エネルギー      |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    | 602     | 1,597         | 139,331   | 金融         |
| RIO TINTO LTD                | 97      | 420           | 36,692    | 素材         |
| ORIGIN ENERGY LTD            | 364     | 160           | 13,972    | エネルギー      |
| AMCOR LIMITED                | 267     | 352           | 30,793    | 素材         |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 468     | 229           | 20,046    | 資本財・サービス   |
| OIL SEARCH LTD               | 295     | 180           | 15,724    | エネルギー      |
| SEEK LTD                     | 175     | 110           | 9,657     | 資本財・サービス   |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 146     | 119           | 10,393    | 生活必需品      |
| NEWCREST MINING LTD          | 176     | 225           | 19,714    | 素材         |
| INCITEC PIVOT LTD            | 456     | 171           | 14,918    | 素材         |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 370     | 2,985         | 260,457   | 金融         |
| CALTEX AUSTRALIA LTD         | 60      | 219           | 19,105    | エネルギー      |
| ORICA LTD                    | 83      | 124           | 10,839    | 素材         |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 306     | 369           | 32,248    | 金融         |
| CIMIC GROUP LTD              | 29      | 68            | 5,950     | 資本財・サービス   |
| WOOLWORTHS LTD               | 281     | 661           | 57,682    | 生活必需品      |
| COCA-COLA AMATIL LTD         | 137     | 123           | 10,804    | 生活必需品      |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 205     | 93            | 8,137     | 一般消費財・サービス |
| CROWN RESORTS LTD            | 106     | 122           | 10,708    | 一般消費財・サービス |
| QANTAS AIRWAYS LTD           | 145.54  | 56            | 4,951     | 資本財・サービス   |
| TELSTRA CORP LTD             | 936     | 509           | 44,421    | 電気通信サービス   |
| AMP LTD                      | 665     | 367           | 32,024    | 金融         |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 114     | 185           | 16,191    | 素材         |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 64.84   | 513           | 44,823    | 金融         |
| CSL LTD                      | 103     | 1,066         | 93,029    | ヘルスケア      |
| WESFARMERS LTD               | 244.45  | 961           | 83,917    | 生活必需品      |
| COCHLEAR LTD                 | 17      | 159           | 13,954    | ヘルスケア      |
| SUNCORP GROUP LTD            | 287     | 330           | 28,843    | 金融         |
| BORAL LTD                    | 227     | 125           | 10,911    | 素材         |
| ASX LTD                      | 42      | 169           | 14,824    | 金融         |
| COMPUTERSHARE LTD            | 139     | 157           | 13,775    | 情報技術       |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD   | 140     | 54            | 4,751     | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           | 柄                | 2015年12月18日現在     |         |                      | 業 種 等 |
|------------------------------|------------------|-------------------|---------|----------------------|-------|
|                              |                  | 株 数               | 外貨建金額   | 邦貨換算金額               |       |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 百株               | 511               | 275     | 24,028               | 金融    |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 95               | 169               | 14,785  | ヘルスケア                |       |
| TRANSURBAN GROUP             | 424              | 430               | 37,581  | 資本財・サービス             |       |
| ILUKA RESOURCES LTD          | 120              | 65                | 5,705   | 素材                   |       |
| SYDNEY AIRPORT               | 251              | 155               | 13,532  | 資本財・サービス             |       |
| TATTS GROUP LTD              | 369              | 157               | 13,745  | 一般消費財・サービス           |       |
| AGL ENERGY LTD               | 152              | 262               | 22,927  | 公益事業                 |       |
| BRAMBLES LTD                 | 349              | 385               | 33,643  | 資本財・サービス             |       |
| APA GROUP                    | 242              | 205               | 17,924  | 公益事業                 |       |
| DUET GROUP                   | 500              | 115               | 10,076  | 公益事業                 |       |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 29               | 190               | 16,662  | ヘルスケア                |       |
| オーストラリア・ドル<br>通 貨 計          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 16,445.81<br>55銘柄 | 21,948  | 1,914,772<br>< 2.5%> |       |
| (香港)                         | 百株               | 千香港ドル             | 千円      |                      |       |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 300              | 2,103             | 33,227  | 公益事業                 |       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 520              | 1,232             | 19,471  | 一般消費財・サービス           |       |
| MTR CORP                     | 320              | 1,187             | 18,757  | 資本財・サービス             |       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 380              | 3,604             | 56,947  | 金融                   |       |
| SINO LAND CO                 | 880              | 999               | 15,794  | 金融                   |       |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 586.69           | 5,937             | 93,809  | 資本財・サービス             |       |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 290              | 1,233             | 19,496  | 金融                   |       |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 125              | 1,055             | 16,678  | 金融                   |       |
| CLP HOLDINGS LTD             | 410              | 2,679             | 42,333  | 公益事業                 |       |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS       | 330              | 430               | 6,809   | 資本財・サービス             |       |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 258.06           | 1,224             | 19,347  | 金融                   |       |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 1,494.93         | 2,239             | 35,382  | 公益事業                 |       |
| HANG SENG BANK LTD           | 168              | 2,472             | 39,072  | 金融                   |       |
| WHEELOCK & CO LTD            | 250              | 793               | 12,541  | 金融                   |       |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 1,130            | 858               | 13,569  | 金融                   |       |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 245              | 4,919             | 77,729  | 金融                   |       |
| LI & FUNG LTD                | 1,320            | 653               | 10,323  | 一般消費財・サービス           |       |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 520              | 915               | 14,460  | 金融                   |       |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY       | 65               | 380               | 6,013   | 情報技術                 |       |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG     | 210              | 535               | 8,460   | 一般消費財・サービス           |       |
| NWS HOLDINGS LTD             | 465              | 525               | 8,302   | 資本財・サービス             |       |
| KERRY PROPERTIES LTD         | 180              | 384               | 6,071   | 金融                   |       |
| BANK OF EAST ASIA            | 290.4            | 797               | 12,594  | 金融                   |       |
| SJM HOLDINGS LTD             | 470              | 257               | 4,069   | 一般消費財・サービス           |       |
| SWIRE PROPERTIES LTD         | 300              | 685               | 10,830  | 金融                   |       |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 596.69           | 3,066             | 48,458  | 金融                   |       |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE   | 150              | 1,055             | 16,672  | 公益事業                 |       |
| AIA GROUP LTD                | 2,628            | 12,377            | 195,570 | 金融                   |       |
| SANDS CHINA LTD              | 540              | 1,420             | 22,439  | 一般消費財・サービス           |       |
| SHANGRI-LA ASIA LTD          | 300              | 208               | 3,299   | 一般消費財・サービス           |       |
| TECHTRON INDUSTRIES CO LTD   | 315              | 990               | 15,652  | 一般消費財・サービス           |       |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD       | 200              | 193               | 3,058   | 一般消費財・サービス           |       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 825              | 1,934             | 30,567  | 金融                   |       |
| WYNN MACAU LTD               | 380              | 354               | 5,595   | 一般消費財・サービス           |       |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 570              | 559               | 8,834   | 電気通信サービス             |       |
| 香 港 ド ル<br>通 貨 計             | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 18,012.77<br>35銘柄 | 60,268  | 952,246<br>< 1.2%>   |       |
| (シンガポール)                     | 百株               | 千シンガポール・ドル        | 千円      |                      |       |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 290              | 554               | 47,826  | 金融                   |       |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 385              | 638               | 55,121  | 金融                   |       |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 124.7            | 137               | 11,880  | 資本財・サービス             |       |
| KEPPEL CORP LTD              | 315              | 203               | 17,588  | 資本財・サービス             |       |
| UOL GROUP LTD                | 132              | 80                | 6,937   | 金融                   |       |

| 銘柄                           | 柄                | 2015年12月18日現在     |         |                    | 業 種 等 |
|------------------------------|------------------|-------------------|---------|--------------------|-------|
|                              |                  | 株 数               | 外貨建金額   | 邦貨換算金額             |       |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        | 百株               | 112               | 84      | 7,287              | 金融    |
| CAPITALAND LTD               | 590              | 192               | 16,598  | 金融                 |       |
| SEMBCORP MARINE LTD          | 250              | 44                | 3,851   | 資本財・サービス           |       |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 410              | 160               | 13,834  | 一般消費財・サービス         |       |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 30               | 103               | 8,932   | 一般消費財・サービス         |       |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 670              | 584               | 50,477  | 金融                 |       |
| GENTING SINGAPORE PLC        | 1,530            | 118               | 10,233  | 一般消費財・サービス         |       |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 1,750.5          | 661               | 57,103  | 電気通信サービス           |       |
| NOBLE GROUP LTD              | 1,151.81         | 48                | 4,174   | 資本財・サービス           |       |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 350              | 103               | 8,940   | 資本財・サービス           |       |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | 290              | 88                | 7,608   | 資本財・サービス           |       |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 2,194            | 70                | 6,058   | 生活必需品              |       |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 190              | 145               | 12,576  | 金融                 |       |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       | 468              | 138               | 11,995  | 資本財・サービス           |       |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 560              | 163               | 14,111  | 生活必需品              |       |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 690              | 142               | 12,266  | 金融                 |       |
| シンガポール・ドル<br>通 貨 計           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12,483.01<br>21銘柄 | 4,465   | 385,406<br>< 0.5%> |       |
| (ニュージーランド)                   | 百株               | 千ニュージーランド・ドル      | 千円      |                    |       |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        | 526.89           | 166               | 13,626  | 電気通信サービス           |       |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 234              | 124               | 10,165  | 資本財・サービス           |       |
| CONTACT ENERGY LTD           | 130              | 61                | 5,019   | 公益事業               |       |
| FLETCHER BUILDING LTD        | 201              | 141               | 11,582  | 素材                 |       |
| ニュージーランド・ドル<br>通 貨 計         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,091.89<br>4銘柄   | 492     | 40,393<br>< 0.1%>  |       |
| (イギリス)                       | 百株               | 千イギリス・ポンド         | 千円      |                    |       |
| MERLIN ENTERTAINMENT         | 141              | 62                | 11,437  | 一般消費財・サービス         |       |
| TUI AG-DI                    | 107.47           | 131               | 23,981  | 一般消費財・サービス         |       |
| BP PLC                       | 3,979            | 1,354             | 247,263 | エネルギー              |       |
| UNILEVER PLC                 | 277.6            | 793               | 144,879 | 生活必需品              |       |
| BARCLAYS PLC                 | 3,657            | 799               | 146,048 | 金融                 |       |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 394              | 225               | 41,262  | 資本財・サービス           |       |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    | 353              | 161               | 29,523  | 一般消費財・サービス         |       |
| RANDGOLD RESOURCES LTD       | 19               | 75                | 13,798  | 素材                 |       |
| REXAM PLC                    | 151.6            | 90                | 16,499  | 素材                 |       |
| PRUDENTIAL PLC               | 563              | 846               | 154,573 | 金融                 |       |
| INMARSAT PLC                 | 94               | 106               | 19,396  | 電気通信サービス           |       |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 681.91           | 200               | 36,697  | 金融                 |       |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 44.09            | 115               | 21,062  | 素材                 |       |
| BAE SYSTEMS PLC              | 677              | 335               | 61,356  | 資本財・サービス           |       |
| AVIVA PLC                    | 883.66           | 447               | 81,650  | 金融                 |       |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 1,061.02         | 1,423             | 259,919 | ヘルスケア              |       |
| MELROSE INDUSTRIES PLC       | 240.42           | 68                | 12,521  | 資本財・サービス           |       |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 160              | 69                | 12,738  | 情報技術               |       |
| ROYAL MAIL PLC               | 171              | 75                | 13,864  | 資本財・サービス           |       |
| RELX PLC                     | 247.46           | 290               | 53,051  | 一般消費財・サービス         |       |
| BG GROUP PLC                 | 744              | 703               | 128,498 | エネルギー              |       |
| DIAGEO PLC                   | 549              | 1,006             | 183,813 | 生活必需品              |       |
| RIO TINTO PLC                | 276              | 513               | 93,694  | 素材                 |       |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 557              | 306               | 55,932  | 金融                 |       |
| TESCO PLC                    | 1,753            | 253               | 46,352  | 生活必需品              |       |
| FRESNILLO PLC                | 50               | 32                | 5,975   | 素材                 |       |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 193              | 216               | 39,472  | ヘルスケア              |       |
| GLENCORE PLC                 | 2,369.25         | 191               | 34,958  | 素材                 |       |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 57               | 84                | 15,342  | 金融                 |       |
| SMITHS GROUP PLC             | 84.33            | 78                | 14,275  | 資本財・サービス           |       |
| BABCOCK INTL GROUP PLC       | 61               | 60                | 11,072  | 資本財・サービス           |       |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株数        | 2015年12月18日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|-----------|---------------|---------|------------|
|                              |           | 評価額           |         |            |
|                              |           | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株        | 千円            | 千円      |            |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | 298.83    | 121           | 22,258  | 金融         |
| DIXONS CARPHONE PLC          | 209       | 101           | 18,624  | 一般消費財・サービス |
| PEARSON PLC                  | 173.63    | 130           | 23,827  | 一般消費財・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC            | 285.25    | 72            | 13,324  | 生活必需品      |
| NEXT PLC                     | 31        | 229           | 41,919  | 一般消費財・サービス |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 689       | 136           | 24,899  | 一般消費財・サービス |
| WHITBREAD PLC                | 40.11     | 179           | 32,696  | 一般消費財・サービス |
| IMI PLC                      | 58.5      | 49            | 9,117   | 資本財・サービス   |
| BUNZL PLC                    | 72.55     | 134           | 24,549  | 資本財・サービス   |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC      | 206       | 59            | 10,871  | 金融         |
| GKN PLC                      | 365       | 109           | 19,969  | 一般消費財・サービス |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL  | 55        | 31            | 5,790   | 一般消費財・サービス |
| VODAFONE GROUP PLC           | 5,773.83  | 1,239         | 226,370 | 電気通信サービス   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 31        | 93            | 17,050  | 素材         |
| KINGFISHER PLC               | 519.11    | 170           | 31,225  | 一般消費財・サービス |
| WPP PLC                      | 282       | 431           | 78,788  | 一般消費財・サービス |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 147.27    | 136           | 24,889  | 公益事業       |
| SEVERN TRENT PLC             | 51.33     | 110           | 20,265  | 公益事業       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 139       | 858           | 156,738 | 生活必需品      |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 110       | 108           | 19,856  | 金融         |
| SCHRODERS PLC                | 27        | 79            | 14,461  | 金融         |
| TATE & LYLE PLC              | 101       | 59            | 10,863  | 生活必需品      |
| AMEC FOSTER WHEELER PLC      | 86        | 33            | 6,164   | エネルギー      |
| SSE PLC                      | 214       | 317           | 57,953  | 公益事業       |
| WEIR GROUP PLC/THE           | 48        | 45            | 8,309   | 資本財・サービス   |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 212       | 130           | 23,808  | 一般消費財・サービス |
| ASTRAZENECA PLC              | 276       | 1,223         | 223,475 | ヘルスケア      |
| WOLSELEY PLC                 | 56.15     | 207           | 37,938  | 資本財・サービス   |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 1,306     | 344           | 62,817  | 金融         |
| 3I GROUP PLC                 | 210.91    | 99            | 18,090  | 金融         |
| SKY PLC                      | 222       | 244           | 44,674  | 一般消費財・サービス |
| ASHTED GROUP PLC             | 112       | 126           | 23,049  | 資本財・サービス   |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 241.14    | 142           | 25,936  | 情報技術       |
| NATIONAL GRID PLC            | 813.28    | 753           | 137,508 | 公益事業       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 12,469.65 | 889           | 162,356 | 金融         |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 217.6     | 92            | 16,855  | 金融         |
| IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC   | 207       | 728           | 132,943 | 生活必需品      |
| CENTRICA PLC                 | 1,071.6   | 228           | 41,778  | 公益事業       |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC      | 32        | 107           | 19,663  | 金融         |
| ARM HOLDINGS PLC             | 305       | 317           | 57,923  | 情報技術       |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 401.6     | 1,498         | 273,727 | 生活必需品      |
| ICAP PLC                     | 120       | 60            | 11,022  | 金融         |
| SABMILLER PLC                | 210       | 850           | 155,309 | 生活必需品      |
| BHP BILLITON PLC             | 455.77    | 319           | 58,259  | 素材         |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 77        | 262           | 47,863  | 生活必需品      |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 4,215     | 2,241         | 409,250 | 金融         |
| SHIRE PLC                    | 128       | 569           | 104,014 | ヘルスケア      |
| OLD MUTUAL PLC               | 1,040.25  | 178           | 32,635  | 金融         |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 298.83    | 78            | 14,379  | 素材         |
| MONDI PLC                    | 75        | 100           | 18,420  | 素材         |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 509       | 75            | 13,784  | 生活必需品      |
| CARNIVAL PLC                 | 41.61     | 147           | 27,004  | 一般消費財・サービス |
| EASYJET PLC                  | 35        | 60            | 10,961  | 資本財・サービス   |
| COMPASS GROUP PLC            | 366.41    | 422           | 77,147  | 一般消費財・サービス |
| PERSIMMON PLC                | 68        | 132           | 24,263  | 一般消費財・サービス |
| BT GROUP PLC                 | 1,826     | 859           | 156,952 | 電気通信サービス   |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 44        | 66            | 12,100  | 生活必需品      |

| 銘 柄                          | 2015年12月18日現在    |                    |                   | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|--------------------|-------------------|------------|
|                              | 株 数              | 評 価 額              |                   |            |
|                              |                  | 外貨建金額              | 邦貨換算金額            |            |
|                              | 百株               | 千イギリス・ポンド          | 千円                |            |
| WILLIAM HILL PLC             | 192              | 72                 | 13,323            | 一般消費財・サービス |
| BURBERRY GROUP PLC           | 95.89            | 115                | 21,030            | 一般消費財・サービス |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 50.73            | 130                | 23,845            | 一般消費財・サービス |
| AGGREKO PLC                  | 54.68            | 49                 | 9,126             | 資本財・サービス   |
| CAPITA PLC                   | 142.9            | 172                | 31,574            | 資本財・サービス   |
| TRAVIS PERKINS PLC           | 53               | 102                | 18,727            | 資本財・サービス   |
| INTERTEK GROUP PLC           | 35               | 95                 | 17,499            | 資本財・サービス   |
| ITV PLC                      | 825              | 220                | 40,299            | 一般消費財・サービス |
| PETROFAC LTD                 | 56               | 44                 | 8,068             | エネルギー      |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 66.49            | 180                | 32,891            | 金融         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 849              | 1,231              | 224,802           | エネルギー      |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 533.81           | 779                | 142,319           | エネルギー      |
| MEGGITT PLC                  | 177              | 64                 | 11,726            | 資本財・サービス   |
| G4S PLC                      | 346              | 74                 | 13,622            | 資本財・サービス   |
| COBHAM PLC                   | 256              | 73                 | 13,374            | 資本財・サービス   |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 46               | 77                 | 14,070            | 金融         |
| INVESTEC PLC                 | 123              | 57                 | 10,545            | 金融         |
| ANTOFAGASTA PLC              | 86               | 35                 | 6,517             | 素材         |
| STANDARD LIFE PLC            | 424.63           | 160                | 29,256            | 金融         |
| EXPERIAN PLC                 | 209.54           | 244                | 44,692            | 資本財・サービス   |
| イギリス・ポンド<br>通 貨 計            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 62,896.69<br>108銘柄 | 33,705<br>< 7.9%> |            |
| (イスラエル)                      | 百株               | 千イスラエル・シェケル        | 千円                |            |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 564              | 464                | 14,628            | 電気通信サービス   |
| ISRAEL CHEMICALS LTD         | 140              | 233                | 7,357             | 素材         |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD  | 189              | 4,794              | 150,896           | ヘルスケア      |
| BANK HAPOLAIM BM             | 265              | 522                | 16,453            | 金融         |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 376              | 511                | 16,092            | 金融         |
| NICE SYSTEMS LTD             | 17               | 389                | 12,261            | 情報技術       |
| イスラエル・シェケル<br>通 貨 計          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,551<br>6銘柄       | 6,917<br>< 0.3%>  |            |
| (スイス)                        | 百株               | 千スイス・フラン           | 千円                |            |
| DUFREY AG-REG                | 9                | 106                | 13,131            | 一般消費財・サービス |
| UBS GROUP AG-REG             | 802              | 1,534              | 188,909           | 金融         |
| ADECCO SA-REG                | 37               | 249                | 30,751            | 資本財・サービス   |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 153.5            | 4,146              | 510,501           | ヘルスケア      |
| PARGESA HOLDING SA-BR        | 8                | 49                 | 6,131             | 金融         |
| SIKA AG-BR                   | 0.54             | 190                | 23,464            | 素材         |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 0.02             | 148                | 18,254            | 生活必需品      |
| ABB LTD-REG                  | 483              | 858                | 105,681           | 資本財・サービス   |
| ARYZTA AG                    | 21               | 100                | 12,364            | 生活必需品      |
| TRANSOCEAN LTD               | 84.5             | 109                | 13,452            | エネルギー      |
| SWISS RE AG                  | 78               | 768                | 94,600            | 金融         |
| NESTLE SA-REG                | 691.5            | 5,085              | 626,237           | 生活必需品      |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 3.5              | 126                | 15,589            | 金融         |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 10               | 167                | 20,624            | 資本財・サービス   |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 376.2            | 796                | 98,108            | 金融         |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 52               | 240                | 29,612            | 金融         |
| SULZER AG-REG                | 6.5              | 63                 | 7,771             | 資本財・サービス   |
| SGS SA-REG                   | 1.3              | 242                | 29,916            | 資本財・サービス   |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 7                | 238                | 29,408            | 一般消費財・サービス |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 33.32            | 836                | 102,977           | 金融         |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 12               | 154                | 18,971            | 金融         |
| NOVARTIS AG-REG              | 496.5            | 4,230              | 520,862           | ヘルスケア      |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 114.5            | 823                | 101,437           | 一般消費財・サービス |
| SWISSCOM AG-REG              | 5.5              | 272                | 33,508            | 電気通信サービス   |
| GEBERIT AG-REG               | 8                | 268                | 33,117            | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 株数                   | 2015年12月18日現在   |                      | 業種等        |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------|------------|
|                              |                      | 評価額             | 価額                   |            |
|                              |                      | 外貨建金額           | 邦貨換算金額               |            |
| GIVAUDAN-REG                 | 百株                   | 千スイス・フラン        | 千円                   | 素材         |
| 2.1                          | 379                  | 46,749          |                      |            |
| ACTELION LTD-REG             | 23                   | 312             | 38,515               | ヘルスケア      |
| SYNGENTA AG-REG              | 20.12                | 747             | 91,984               | 素材         |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 13                   | 162             | 20,040               | ヘルスケア      |
| LONZA GROUP AG-REG           | 13                   | 206             | 25,482               | ヘルスケア      |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 11                   | 72              | 8,946                | 一般消費財・サービス |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 95.4                 | 472             | 58,239               | 素材         |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 8                    | 213             | 26,330               | 金融         |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG   | 12.5                 | 169             | 20,870               | 資本財・サービス   |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 14                   | 106             | 13,169               | 金融         |
| スイス・フラン<br>通貨計               | 株数、金額<br>通貨計 銘柄数<比率> | 3,706.5<br>35銘柄 | 3,035,718<br>< 3.9%> |            |
| (デンマーク)                      | 百株                   | 千デンマーク・クローネ     | 千円                   |            |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 428                  | 16,790          | 298,869              | ヘルスケア      |
| DANSKE BANK A/S              | 152.5                | 2,773           | 49,376               | 金融         |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 0.95                 | 848             | 15,109               | 資本財・サービス   |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 52                   | 2,490           | 44,336               | 資本財・サービス   |
| TDC A/S                      | 193                  | 665             | 11,848               | 電気通信サービス   |
| CARLSBERG AS-B               | 24.5                 | 1,489           | 26,514               | 生活必需品      |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 55                   | 1,823           | 32,453               | 素材         |
| COLOPLAST-B                  | 25                   | 1,345           | 23,941               | ヘルスケア      |
| DSV A/S                      | 42                   | 1,120           | 19,953               | 資本財・サービス   |
| WILLIAM DEMANT HOLDING       | 6.75                 | 452             | 8,056                | ヘルスケア      |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-B      | 1.6                  | 1,450           | 25,817               | 資本財・サービス   |
| PANDORA A/S                  | 25                   | 2,133           | 37,980               | 一般消費財・サービス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       | 20                   | 831             | 14,802               | 素材         |
| デンマーク・クローネ<br>通貨計            | 株数、金額<br>通貨計 銘柄数<比率> | 1,026.3<br>13銘柄 | 609,060<br>< 0.8%>   |            |
| (ノルウェー)                      | 百株                   | 千ノルウェー・クローネ     | 千円                   |            |
| NORSK HYDRO ASA              | 299                  | 898             | 12,560               | 素材         |
| DNB ASA                      | 211.5                | 2,301           | 32,169               | 金融         |
| ORKLA ASA                    | 190.5                | 1,327           | 18,562               | 生活必需品      |
| TELENOR ASA                  | 158                  | 2,393           | 33,463               | 電気通信サービス   |
| STATOIL ASA                  | 241.73               | 2,961           | 41,397               | エネルギー      |
| SCHIBSTED ASA-CL A           | 15                   | 437             | 6,114                | 一般消費財・サービス |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 37.6                 | 1,464           | 20,468               | 素材         |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 39.5                 | 559             | 7,824                | 金融         |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          | 18                   | 511             | 7,146                | 一般消費財・サービス |
| ノルウェー・クローネ<br>通貨計            | 株数、金額<br>通貨計 銘柄数<比率> | 1,210.83<br>9銘柄 | 179,709<br>< 0.2%>   |            |
| (スウェーデン)                     | 百株                   | 千スウェーデン・クローネ    | 千円                   |            |
| ICA GRUPPEN AB               | 13                   | 400             | 5,741                | 生活必需品      |
| ERICSSON LM-B SHS            | 655.3                | 5,170           | 74,038               | 情報技術       |
| VOLVO AB-B SHS               | 324                  | 2,556           | 36,607               | 資本財・サービス   |
| MILICOM INTL CELLULAR-SDR    | 15                   | 736             | 10,553               | 電気通信サービス   |
| SKF AB-B SHARES              | 86.5                 | 1,189           | 17,031               | 資本財・サービス   |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 54.5                 | 1,116           | 15,991               | 一般消費財・サービス |
| NORDEA BANK AB               | 654.5                | 6,060           | 86,788               | 金融         |
| SWEDISH MATCH AB             | 45.5                 | 1,331           | 19,064               | 生活必需品      |
| TELE2 AB-B SHS               | 89.5                 | 754             | 10,804               | 電気通信サービス   |
| GETINGE AB-B SHS             | 47                   | 1,007           | 14,429               | ヘルスケア      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 320.5                | 2,820           | 40,388               | 金融         |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 321                  | 3,611           | 51,713               | 金融         |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 199                  | 3,717           | 53,232               | 金融         |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 208                  | 6,271           | 89,803               | 一般消費財・サービス |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 124                  | 3,056           | 43,770               | 生活必需品      |

| 銘柄                           | 株数                   | 2015年12月18日現在    |                      | 業種等        |
|------------------------------|----------------------|------------------|----------------------|------------|
|                              |                      | 評価額              | 価額                   |            |
|                              |                      | 外貨建金額            | 邦貨換算金額               |            |
| SKANSKA AB-B SHS             | 82.5                 | 1,348            | 19,315               | 資本財・サービス   |
| SANDVIK AB                   | 223.5                | 1,680            | 24,067               | 資本財・サービス   |
| INVESTOR AB-B SHS            | 101                  | 3,146            | 45,052               | 金融         |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 144                  | 2,999            | 42,953               | 資本財・サービス   |
| SECURITAS AB-B SHS           | 92                   | 1,185            | 16,981               | 資本財・サービス   |
| TELIASONERA AB               | 558                  | 2,373            | 33,991               | 電気通信サービス   |
| ALFA LAVAL AB                | 70                   | 1,078            | 15,446               | 資本財・サービス   |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 83                   | 1,627            | 23,307               | 資本財・サービス   |
| ASSA ABLOY AB-B              | 211                  | 3,808            | 54,538               | 資本財・サービス   |
| LUNDIN PETROLEUM AB          | 64                   | 795              | 11,391               | エネルギー      |
| BOLIDEN AB                   | 60                   | 820              | 11,745               | 素材         |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | 125.5                | 714              | 10,234               | 一般消費財・サービス |
| INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS | 53                   | 1,355            | 19,414               | 金融         |
| HEXAGON AB-B SHS             | 55.5                 | 1,743            | 24,963               | 情報技術       |
| スウェーデン・クローネ<br>通貨計           | 株数、金額<br>通貨計 銘柄数<比率> | 5,080.3<br>29銘柄  | 923,364<br>< 1.2%>   |            |
| (ユーロ (アイルランド))               | 百株                   | 千ユーロ             | 千円                   |            |
| BANK OF IRELAND              | 6,618                | 222              | 29,536               | 金融         |
| KERRY GROUP PLC-A            | 34                   | 258              | 34,368               | 生活必需品      |
| CRH PLC                      | 175                  | 463              | 61,588               | 素材         |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率>     | 6,827<br>3銘柄     | 125,493<br>< 0.2%>   |            |
| (ユーロ (オランダ))                 | 百株                   | 千ユーロ             | 千円                   |            |
| QIAGEN N.V.                  | 48.5                 | 120              | 16,054               | ヘルスケア      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 204.76               | 494              | 65,643               | 資本財・サービス   |
| NN GROUP NV                  | 48                   | 154              | 20,472               | 金融         |
| UNILEVER NV-CVA              | 351.5                | 1,411            | 187,506              | 生活必需品      |
| HEINEKEN NV                  | 51                   | 406              | 53,937               | 生活必需品      |
| RELX NV                      | 214.19               | 330              | 43,956               | 一般消費財・サービス |
| AEGON NV                     | 407.44               | 208              | 27,687               | 金融         |
| KONINKLIJKE AHOLD NV         | 192.93               | 383              | 50,920               | 生活必需品      |
| AKZO NOBEL                   | 55                   | 345              | 45,901               | 素材         |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 38                   | 175              | 23,365               | 素材         |
| WOLTERS KLUWER               | 69                   | 212              | 28,219               | 一般消費財・サービス |
| BOSKALIS WESTMINSTER         | 21                   | 78               | 10,373               | 資本財・サービス   |
| ING GROEP NV-CVA             | 847.5                | 1,058            | 140,604              | 金融         |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 684.5                | 238              | 31,631               | 電気通信サービス   |
| ASML HOLDING NV              | 74.3                 | 607              | 80,671               | 情報技術       |
| TNT EXPRESS NV               | 101.95               | 78               | 10,454               | 資本財・サービス   |
| VOPAK                        | 20                   | 74               | 9,829                | エネルギー      |
| RANDSTAD HOLDING NV          | 26.5                 | 151              | 20,099               | 資本財・サービス   |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 23                   | 164              | 21,846               | 生活必需品      |
| GEMALTO                      | 17                   | 90               | 12,065               | 情報技術       |
| OCI NV                       | 23                   | 52               | 6,964                | 素材         |
| ALTICE NV - A                | 57                   | 74               | 9,876                | 一般消費財・サービス |
| ALTICE NV - B                | 19                   | 25               | 3,349                | 一般消費財・サービス |
| AIRBUS GROUP SE              | 128                  | 833              | 110,735              | 資本財・サービス   |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 209                  | 134              | 17,822               | 資本財・サービス   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 193.5                | 249              | 33,104               | 一般消費財・サービス |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率>     | 4,125.57<br>26銘柄 | 1,083,094<br>< 1.4%> |            |
| (ユーロ (ベルギー))                 | 百株                   | 千ユーロ             | 千円                   |            |
| UCB SA                       | 27.5                 | 226              | 30,051               | ヘルスケア      |
| KBC GROEP NV                 | 54.5                 | 313              | 41,669               | 金融         |
| COLRUYT SA                   | 20                   | 96               | 12,751               | 生活必需品      |
| DELHAUYT GROUP               | 23                   | 209              | 27,847               | 生活必需品      |

# 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                            | 株数               | 2015年12月18日現在 |                    | 業種等        |
|-------------------------------|------------------|---------------|--------------------|------------|
|                               |                  | 評価額           | 価額                 |            |
|                               |                  | 外貨建金額         | 邦貨換算金額             |            |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA   | 百株 17            | 千ユーロ 129      | 千円 17,218          | 金融         |
| SOLVAY SA                     | 12.5             | 120           | 15,989             | 素材         |
| UMICORE                       | 29.5             | 111           | 14,794             | 素材         |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV    | 174              | 2,020         | 268,335            | 生活必需品      |
| AGEAS                         | 47.9             | 205           | 27,257             | 金融         |
| PROXIMUS                      | 35               | 105           | 13,947             | 電気通信サービス   |
| 国小計                           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 440.9<br>10銘柄 | 469,860<br>< 0.6%> |            |
| ユーロ (ルクセンブルグ)                 | 百株 10            | 千ユーロ 76       | 千円 10,219          | 一般消費財・サービス |
| RTL GROUP                     | 213              | 73            | 9,746              | 素材         |
| ARCELOMITTAL                  | 69.5             | 174           | 23,125             | 一般消費財・サービス |
| SES                           | 105.5            | 113           | 15,106             | エネルギー      |
| TENARIS SA                    |                  |               |                    |            |
| 国小計                           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 398<br>4銘柄    | 58,198<br>< 0.1%>  |            |
| ユーロ (フランス)                    | 百株 23            | 千ユーロ 86       | 千円 11,465          | 一般消費財・サービス |
| NUMERICABLE-SFR               | 471              | 1,973         | 262,138            | エネルギー      |
| TOTAL SA                      | 40               | 352           | 46,777             | 一般消費財・サービス |
| MICHELIN (CGDE)               | 75.48            | 799           | 106,225            | 素材         |
| AIR LIQUIDE SA                | 16               | 253           | 33,653             | 一般消費財・サービス |
| KERING                        | 123              | 657           | 87,343             | 資本財・サービス   |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE         | 42.5             | 152           | 20,227             | 資本財・サービス   |
| BOUYGUES SA                   | 231.5            | 1,233         | 163,836            | 金融         |
| BNP PARIBAS                   | 93.5             | 150           | 20,045             | 一般消費財・サービス |
| PEUGEOT SA                    | 201.5            | 105           | 14,059             | 金融         |
| NATIXIS                       | 22.5             | 159           | 21,204             | 資本財・サービス   |
| THALES SA                     | 126              | 795           | 105,641            | 生活必需品      |
| DANONE                        | 121              | 329           | 43,765             | 生活必需品      |
| CARREFOUR SA                  | 63.75            | 112           | 14,907             | 公益事業       |
| SUEZ ENVIRONNEMENT CO         | 250.41           | 486           | 64,611             | 一般消費財・サービス |
| VIVENDI                       | 55               | 884           | 117,511            | 生活必需品      |
| L'OREAL                       | 105              | 416           | 55,370             | 資本財・サービス   |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN     | 57.17            | 300           | 39,905             | 資本財・サービス   |
| LEGRAND SA                    | 602              | 212           | 28,291             | 情報技術       |
| ALCATEL-LUCENT                | 13               | 56            | 7,483              | 生活必需品      |
| CASINO GUICHARD PERRACHON     | 47.17            | 499           | 66,383             | 生活必需品      |
| PERNOD RICARD SA              | 6                | 92            | 12,261             | 資本財・サービス   |
| SOCIETE BIC SA                | 10.24            | 64            | 8,571              | 金融         |
| EURAZEO                       | 60.5             | 71            | 9,526              | 資本財・サービス   |
| REXEL SA                      | 158              | 682           | 90,643             | 金融         |
| SOCIETE GENERALE SA           | 60.5             | 900           | 119,659            | 一般消費財・サービス |
| LYNCH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 44               | 177           | 23,550             | 一般消費財・サービス |
| ACCOR SA                      | 35               | 302           | 40,177             | 情報技術       |
| CAP GEMINI                    | 16.5             | 230           | 30,563             | 一般消費財・サービス |
| VALEO SA                      | 41               | 247           | 32,872             | 一般消費財・サービス |
| PUBLICIS GROUPE               | 60.5             | 112           | 14,899             | 資本財・サービス   |
| BUREAU VERITAS SA             | 20.5             | 188           | 25,024             | 一般消費財・サービス |
| SODEXO                        | 12               | 142           | 18,888             | 情報技術       |
| INGENICO GROUP                | 42               | 93            | 12,468             | 資本財・サービス   |
| ZODIAC AEROSPACE              | 44.5             | 517           | 68,803             | ヘルスケア      |
| ESSILOR INTERNATIONAL         | 429              | 1,077         | 143,115            | 金融         |
| AXA SA                        | 12               | 193           | 25,766             | 一般消費財・サービス |
| CHRISTIAN DIOR SE             | 26.5             | 71            | 9,544              | 一般消費財・サービス |
| LAGARDERE SCA                 | 22               | 101           | 13,457             | エネルギー      |
| TECHNIP SA                    | 47.5             | 81            | 10,852             | 資本財・サービス   |
| EDENRED                       | 41.5             | 379           | 50,394             | 一般消費財・サービス |
| RENAULT SA                    |                  |               |                    |            |

| 銘柄                           | 株数               | 2015年12月18日現在   |                      | 業種等        |
|------------------------------|------------------|-----------------|----------------------|------------|
|                              |                  | 評価額             | 価額                   |            |
|                              |                  | 外貨建金額           | 邦貨換算金額               |            |
| HERMES INTERNATIONAL         | 百株 5.7           | 千ユーロ 181        | 千円 24,163            | 一般消費財・サービス |
| ATOS SE                      | 18               | 142             | 18,874               | 情報技術       |
| DASSAULT SYSTEMES SA         | 28               | 209             | 27,797               | 情報技術       |
| WENDEL                       | 6                | 65              | 8,639                | 金融         |
| ORANGE                       | 433              | 677             | 90,011               | 電気通信サービス   |
| ALSTOM                       | 46.5             | 126             | 16,812               | 資本財・サービス   |
| CNP ASSURANCES               | 37.5             | 45              | 6,027                | 金融         |
| SANOFI                       | 254.25           | 2,018           | 268,149              | ヘルスケア      |
| VINCI SA                     | 103.5            | 612             | 81,332               | 資本財・サービス   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 93.5             | 206             | 27,434               | 公益事業       |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 221              | 235             | 31,263               | 金融         |
| ENGIE                        | 316.73           | 515             | 68,491               | 公益事業       |
| IMERYS SA                    | 9                | 55              | 7,389                | 素材         |
| EDF                          | 55.5             | 71              | 9,513                | 公益事業       |
| SAFRAN SA                    | 63.5             | 410             | 54,462               | 資本財・サービス   |
| ILIAD SA                     | 6                | 129             | 17,230               | 電気通信サービス   |
| ARKEMA                       | 15.5             | 101             | 13,450               | 素材         |
| ADP                          | 7.5              | 80              | 10,664               | 資本財・サービス   |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS      | 40.5             | 113             | 15,105               | 一般消費財・サービス |
| SCOR SE                      | 34               | 118             | 15,759               | 金融         |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR  | 104.5            | 118             | 15,712               | 資本財・サービス   |
| BOLLORE                      | 166              | 70              | 9,366                | 資本財・サービス   |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 6,035.9<br>63銘柄 | 2,929,545<br>< 3.8%> |            |
| ユーロ (ドイツ)                    | 百株 180.5         | 千ユーロ 2,140      | 千円 284,353           | ヘルスケア      |
| BAYER AG-REG                 | 30               | 92              | 12,249               | 素材         |
| EVONIK INDUSTRIES AG         | 299.5            | 655             | 87,024               | 金融         |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 229.85           | 219             | 29,120               | 金融         |
| COMMERZBANK AG               | 8                | 111             | 14,786               | 一般消費財・サービス |
| VOLKSWAGEN AG                | 35.5             | 464             | 61,701               | 一般消費財・サービス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 8.5              | 78              | 10,396               | 資本財・サービス   |
| MAN SE                       | 173              | 1,558           | 206,977              | 資本財・サービス   |
| SIEMENS AG-REG               | 445              | 382             | 50,810               | 公益事業       |
| E.ON SE                      | 72.5             | 715             | 95,069               | 一般消費財・サービス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 42               | 158             | 21,068               | 資本財・サービス   |
| GEA GROUP AG                 | 19.1             | 75              | 9,978                | 資本財・サービス   |
| OSRAM LIGHT AG               | 24.5             | 546             | 72,620               | 一般消費財・サービス |
| CONTINENTAL AG               | 201              | 1,434           | 190,576              | 素材         |
| BASF SE                      | 40.5             | 537             | 71,387               | 素材         |
| LINDE AG                     | 44               | 103             | 13,772               | 金融         |
| K+S AG-REG                   | 98.5             | 1,607           | 213,461              | 金融         |
| ALLIANZ SE-REG               | 78               | 134             | 17,903               | 素材         |
| THYSENKRUPP AG               | 39               | 401             | 53,331               | 生活必需品      |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 108              | 120             | 16,038               | 公益事業       |
| RWWE AG                      | 50.5             | 71              | 9,484                | 資本財・サービス   |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 9                | 53              | 7,046                | 資本財・サービス   |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 34               | 166             | 22,118               | 資本財・サービス   |
| BRENNTAG AG                  | 84               | 551             | 73,228               | ヘルスケア      |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 27               | 137             | 18,326               | 情報技術       |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 214.92           | 1,567           | 208,199              | 情報技術       |
| SAP SE                       | 36.5             | 678             | 90,081               | 金融         |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 31               | 224             | 29,816               | 素材         |
| HEIDELBERGCEMENT AG          | 34               | 165             | 22,043               | 一般消費財・サービス |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PREF  | 21.5             | 182             | 24,226               | 生活必需品      |
| BEIERSDORF AG                | 29               | 258             | 34,287               | ヘルスケア      |
| MERCK KGAA                   | 45.7             | 416             | 55,270               | 一般消費財・サービス |
| ADIDAS AG                    |                  |                 |                      |            |

| 銘柄                                | 2015年12月18日現在    |                  |                                | 業 種 等                         |
|-----------------------------------|------------------|------------------|--------------------------------|-------------------------------|
|                                   | 株 数              | 評 価 額            | 外貨建金額 邦貨換算金額                   |                               |
| HENKEL AG & CO KGAA               | 百株 22            | 千ユーロ 192         | 千円 25,634                      | 生活必需品                         |
| METRO AG                          | 37               | 108              | 14,350                         | 生活必需品                         |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG           | 694              | 1,159            | 153,993                        | 電気通信サービス                      |
| FRESenius MEDICAL CARE AG &       | 48.5             | 380              | 50,571                         | ヘルスケア                         |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES      | 210.5            | 1,653            | 219,659                        | 一般消費財・サービス                    |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 247.5            | 334              | 44,496                         | 情報技術                          |
| HANNOVER RUECK SE                 | 14               | 153              | 20,446                         | 金融                            |
| DEUTSCHE POST AG-REG              | 212              | 551              | 73,244                         | 資本財・サービス                      |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 41.5             | 324              | 43,134                         | 金融                            |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE           | 47.5             | 227              | 30,168                         | 一般消費財・サービス                    |
| LANXESS AG                        | 19.5             | 84               | 11,202                         | 素材                            |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR             | 76.5             | 191              | 25,490                         | 金融                            |
| SYMRISE AG                        | 28               | 173              | 23,022                         | 素材                            |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG      | 5.5              | 59               | 7,890                          | 一般消費財・サービス                    |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 128              | 65               | 8,674                          | 電気通信サービス                      |
| HUGO BOSS AG -ORD                 | 14               | 107              | 14,302                         | 一般消費財・サービス                    |
| VONOVIA SE                        | 104              | 293              | 39,018                         | 金融                            |
| 国 小 計                             | 株数、金額<br>総額数<比率> | 4,744.07<br>49銘柄 | 22,073<br>2,932,056<br>< 3.8%> |                               |
| ユーロ (ポルトガル)                       | 百株 60            | 千ユーロ 73          | 千円 9,731                       | 生活必需品                         |
| JERONIMO MARTINS                  | 495              | 156              | 20,770                         | 公益事業                          |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA       | 103.5            | 103              | 13,809                         | エネルギー                         |
| 国 小 計                             | 株数、金額<br>総額数<比率> | 658.5<br>3銘柄     | 333<br>44,311<br>< 0.1%>       |                               |
| ユーロ (スペイン)                        | 百株 969.27        | 千ユーロ 1,041       | 千円 138,339                     | 電気通信サービス                      |
| TELEFONICA SA                     | 68.5             | 129              | 17,137                         | 公益事業                          |
| ENDESA SA                         | 404.73           | 131              | 17,429                         | 金融                            |
| BANCO POPULAR ESPANOL             | 1,371.12         | 977              | 129,873                        | 金融                            |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA      | 1,162.34         | 764              | 101,575                        | 公益事業                          |
| IBERDROLA SA                      | 1,077.16         | 184              | 24,495                         | 金融                            |
| BANCO DE SABADELL SA              | 131              | 88               | 11,766                         | 金融                            |
| BANKINTER SA                      | 223              | 239              | 31,857                         | エネルギー                         |
| REPSOL SA                         | 33.5             | 141              | 18,858                         | ヘルスケア                         |
| GRIFOLS SA                        | 3,121.5          | 1,494            | 198,482                        | 金融                            |
| BANCO SANTANDER SA                | 101              | 141              | 18,802                         | 資本財・サービス                      |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA       | 96               | 382              | 50,745                         | 情報技術                          |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS       | 74.5             | 144              | 19,183                         | 公益事業                          |
| GAS NATURAL SDG SA                | 214.5            | 51               | 6,860                          | 金融                            |
| MAPFRE SA                         | 538              | 195              | 26,033                         | 金融                            |
| CAIXABANK S.A                     | 45.5             | 49               | 6,527                          | 資本財・サービス                      |
| ZARDOYA OTIS SA                   | 180              | 148              | 19,718                         | 資本財・サービス                      |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI      | 37.76            | 101              | 13,499                         | 資本財・サービス                      |
| ACS ACTIVIDADES CON Y SERV        | 14.5             | 159              | 21,205                         | 資本財・サービス                      |
| AENA SA                           | 239              | 790              | 105,001                        | 一般消費財・サービス                    |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL        | 47               | 128              | 17,021                         | 公益事業                          |
| ENAGAS SA                         | 25               | 198              | 26,390                         | 公益事業                          |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA      | 98               | 206              | 27,408                         | 資本財・サービス                      |
| FERROVIAL SA                      | 187              | 103              | 13,736                         | 生活必需品                         |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL       | 1,084.22         | 124              | 16,561                         | 金融                            |
| BANKIA SA                         | 国 小 計            | 株数、金額<br>総額数<比率> | 11,544.1<br>25銘柄               | 8,119<br>1,078,511<br>< 1.4%> |
| ユーロ (イタリア)                        | 百株 217.5         | 千ユーロ 49          | 千円 6,633                       | 金融                            |
| UNIPOLSAI SPA                     | 83               | 105              | 14,045                         | 金融                            |
| BANCO POPOLARE SC                 | 57               | 115              | 15,331                         | 資本財・サービス                      |
| PRYSMIAN SPA                      | 253.43           | 433              | 57,631                         | 金融                            |
| ASSICURAZIONI GENERALI            | 61               | 45               | 6,028                          | エネルギー                         |
| SAIPEM SPA                        | 146.15           | 128              | 17,102                         | 金融                            |
| MEDIOBANCA SPA                    |                  |                  |                                |                               |

| 銘柄                           | 2015年12月18日現在    |                      |                                 | 業 種 等                       |
|------------------------------|------------------|----------------------|---------------------------------|-----------------------------|
|                              | 株 数              | 評 価 額                | 外貨建金額 邦貨換算金額                    |                             |
| UNICREDIT SPA                | 百株 1,037.69      | 千ユーロ 540             | 千円 71,743                       | 金融                          |
| TELECOM ITALIA SPA           | 2,457.82         | 288                  | 38,360                          | 電気通信サービス                    |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 1,349.5          | 126                  | 16,867                          | 電気通信サービス                    |
| INTESA SANPAOLO              | 2,745.97         | 856                  | 113,801                         | 金融                          |
| ATLANTIA SPA                 | 89.07            | 218                  | 28,974                          | 資本財・サービス                    |
| ENI SPA                      | 544              | 748                  | 99,429                          | エネルギー                       |
| FINMECCANICA SPA             | 112.25           | 146                  | 19,413                          | 資本財・サービス                    |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 508.15           | 60                   | 8,099                           | 金融                          |
| ENEL SPA                     | 1,515            | 603                  | 80,213                          | 公益事業                        |
| SNAM SPA                     | 444              | 213                  | 28,308                          | 公益事業                        |
| LUXOTTICA GROUP SPA          | 37               | 223                  | 29,684                          | 一般消費財・サービス                  |
| UBI BANCA SPA                | 196              | 121                  | 16,115                          | 金融                          |
| TERNA SPA                    | 322              | 151                  | 20,093                          | 公益事業                        |
| ENEL GREEN POWER SPA         | 404              | 77                   | 10,287                          | 公益事業                        |
| EXOR SPA                     | 21               | 87                   | 11,567                          | 金融                          |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>総額数<比率> | 12,601.53<br>21銘柄    | 5,343<br>709,734<br>< 0.9%>     |                             |
| ユーロ (フィンランド)                 | 百株 113           | 千ユーロ 198             | 千円 26,342                       | 素材                          |
| UPM-KYMMENE OYJ              | 776.5            | 504                  | 66,991                          | 情報技術                        |
| NOKIA OYJ                    | 32               | 134                  | 17,856                          | 資本財・サービス                    |
| WARTSILA OYJ ABP             | 131              | 112                  | 14,964                          | 素材                          |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         | 30               | 61                   | 8,184                           | 資本財・サービス                    |
| METSO OYJ                    | 35.5             | 125                  | 16,645                          | 電気通信サービス                    |
| ELISA OYJ                    | 96.5             | 455                  | 60,552                          | 金融                          |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 94.5             | 125                  | 16,719                          | 公益事業                        |
| FORTUM OYJ                   | 66.5             | 261                  | 34,696                          | 資本財・サービス                    |
| KONE OYJ-B                   | 30               | 100                  | 13,329                          | 一般消費財・サービス                  |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           | 34.5             | 93                   | 12,418                          | エネルギー                       |
| NESTLE OYJ                   | 20.5             | 64                   | 8,604                           | ヘルスケア                       |
| ORION OYJ-CLASS B            | 国 小 計            | 株数、金額<br>総額数<比率>     | 1,460.5<br>12銘柄                 | 2,238<br>297,307<br>< 0.4%> |
| ユーロ (オーストリア)                 | 百株 35.5          | 千ユーロ 89              | 千円 11,946                       | エネルギー                       |
| OMV AG                       | 55.5             | 155                  | 20,619                          | 金融                          |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 28.5             | 76                   | 10,221                          | 素材                          |
| VOESTALPINE AG               | 24               | 33                   | 4,504                           | 金融                          |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 16               | 72                   | 9,690                           | 資本財・サービス                    |
| ANDRITZ AG                   | 国 小 計            | 株数、金額<br>総額数<比率>     | 159.5<br>5銘柄                    | 428<br>56,982<br>< 0.1%>    |
| ユーロ (その他)                    | 百株 137           | 千ユーロ 84              | 千円 11,235                       | 情報技術                        |
| STMICROELECTRONICS NV        | 137              | 84                   | 11,235                          | 情報技術                        |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>総額数<比率> | 137<br>1銘柄           | 84<br>< 0.0%>                   |                             |
| ユーロ通貨計                       | 株数、金額<br>総額数<比率> | 49,132.57<br>222銘柄   | 73,750<br>9,796,332<br>< 12.6%> |                             |
| ファンド合計                       | 株数、金額<br>総額数<比率> | 248,456.1<br>1,211銘柄 | 74,579,326<br>< 96.2%>          |                             |

(注1) 邦貨換算金額は、2015年12月18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。

(2) 外国投資信託証券

| 銘柄                           | 2015年12月18日現在     |                 |                     |
|------------------------------|-------------------|-----------------|---------------------|
|                              | □ 数               | 評価額             |                     |
|                              |                   | 外貨建金額           | 邦貨換算金額              |
| (アメリカ)                       | 千口                | 千アメリカ・ドル        | 千円                  |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 2,847             | 509             | 62,415              |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 6,587             | 1,274           | 156,099             |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 3.3               | 429             | 52,556              |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES    | 12.1              | 324             | 39,765              |
| VORNADO REALTY TRUST         | 3,627             | 360             | 44,173              |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 7.9               | 636             | 77,974              |
| EQUINIX INC                  | 1,158             | 339             | 41,618              |
| AMERICAN TOWER CORP          | 9.1               | 874             | 107,107             |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 16,093            | 253             | 31,046              |
| KIMCO REALTY CORP            | 8.7               | 228             | 27,931              |
| PLUM CREEK TIMBER CO         | 3.7               | 177             | 21,785              |
| VENTAS INC                   | 7                 | 383             | 46,995              |
| WEYERHAEUSER CO              | 11,094            | 339             | 41,636              |
| AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | 7.8               | 136             | 16,691              |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 7.2               | 616             | 75,545              |
| IRON MOUNTAIN INC            | 3.91              | 106             | 13,007              |
| VEREIT INC                   | 20.4              | 165             | 20,290              |
| PROLOGIS INC                 | 11,062            | 464             | 56,909              |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 1.8               | 135             | 16,608              |
| DUKE REALTY CORP             | 7.3               | 154             | 18,885              |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 1.4               | 334             | 40,921              |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 1.5               | 222             | 27,277              |
| WELLTOWER INC                | 7.4               | 488             | 59,833              |
| HCP INC                      | 9.7               | 361             | 44,246              |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 3.3               | 104             | 12,825              |
| MACERICH CO/THE              | 3                 | 239             | 29,342              |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 19.8              | 186             | 22,894              |
| REALTY INCOME CORP           | 4.8               | 244             | 29,985              |
| PUBLIC STORAGE               | 3.1               | 767             | 94,003              |
| REGENCY CENTERS CORP         | 2.1               | 142             | 17,422              |
| SL GREEN REALTY CORP         | 2.1               | 236             | 29,002              |
| UDR INC                      | 5.7               | 208             | 25,532              |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 2.8               | 206             | 25,335              |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 2.3               | 203             | 24,899              |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 221,678<br>34銘柄 | 1,452,569<br><1.9%> |
| (オーストラリア)                    | 千口                | 千オーストラリア・ドル     | 千円                  |
| SCENTRE GROUP                | 116,322           | 476             | 41,606              |
| DEXUS PROPERTY GROUP         | 23.95             | 184             | 16,130              |
| GPT GROUP                    | 40.06             | 190             | 16,635              |
| MIRVAC GROUP                 | 93.4              | 185             | 16,214              |
| STOCKLAND                    | 51.5              | 216             | 18,870              |
| WESTFIELD CORP               | 43,096            | 418             | 36,506              |
| GOODMAN GROUP                | 38.2              | 239             | 20,895              |
| VICINITY CENTRES             | 74,873            | 211             | 18,485              |
| オーストラリア・ドル<br>通貨計            | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 481,401<br>8銘柄  | 185,344<br><0.2%>   |

| 銘柄                           | 2015年12月18日現在     |                 |                     |
|------------------------------|-------------------|-----------------|---------------------|
|                              | □ 数               | 評価額             |                     |
|                              |                   | 外貨建金額           | 邦貨換算金額              |
| (香港)                         | 千口                | 千香港ドル           | 千円                  |
| LINK REIT                    | 49.5              | 2,267           | 35,820              |
| 香港ドル<br>通貨計                  | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 49.5<br>1銘柄     | 2,267<br><0.0%>     |
| (シンガポール)                     | 千口                | 千シンガポール・ドル      | 千円                  |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 48                | 108             | 9,320               |
| CAPITALAND MALL TRUST        | 63.2              | 121             | 10,526              |
| シンガポール・ドル<br>通貨計             | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 111.2<br>2銘柄    | 229<br><0.0%>       |
| (イギリス)                       | 千口                | 千イギリス・ポンド       | 千円                  |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 17.1              | 202             | 37,034              |
| SEGRO PLC                    | 16.75             | 71              | 13,103              |
| HAMMERSON PLC                | 17.4              | 105             | 19,175              |
| BRITISH LAND CO PLC          | 20.9              | 166             | 30,322              |
| INTU PROPERTIES PLC          | 21.1              | 67              | 12,241              |
| イギリス・ポンド<br>通貨計              | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 93.25<br>5銘柄    | 612<br><0.1%>       |
| ユーロ (フランス)                   | 千口                | 千ユーロ            | 千円                  |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 2.15              | 504             | 66,998              |
| ICADE                        | 0.75              | 45              | 6,095               |
| GECINA SA                    | 0.75              | 85              | 11,317              |
| KLEPIERRE                    | 4.15              | 171             | 22,782              |
| FONCIERE DES REGIONS         | 0.75              | 61              | 8,175               |
| 国小計                          | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 8.55<br>5銘柄     | 868<br><0.1%>       |
| ユーロ通貨計                       | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 8.55<br>5銘柄     | 868<br><0.1%>       |
| 合計                           | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 965,579<br>55銘柄 | 1,920,827<br><2.5%> |

(注1) 邦貨換算金額は、2015年12月18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) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

| 銘柄別                 | 2015年12月18日現在 |          |
|---------------------|---------------|----------|
|                     | 買 建 額         | 売 建 額    |
|                     | 買 建 額         | 売 建 額    |
| 外国 S & P 500 (アメリカ) | 百万円<br>992    | 百万円<br>- |

(注1) 外貨建の評価額は、2015年12月18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) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴ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（2015年12月18日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を34～35ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄  
投資信託証券

(2014年12月19日から2015年12月18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    |
|                 |   | 千口     | 千円        | 円       |                 |   | 千口    | 千円      | 円       |
| ジャパンリアルエステイト    |   | 5,358  | 3,015,771 | 562,853 | 日本ビルファンド        |   | 1,213 | 704,897 | 581,118 |
| 日本ビルファンド        |   | 4,766  | 2,703,352 | 567,216 | ジャパンリアルエステイト    |   | 1,09  | 629,789 | 577,788 |
| 日本リテールファンド      |   | 10,269 | 2,412,252 | 234,906 | 日本リテールファンド      |   | 1,791 | 447,447 | 249,831 |
| 積水ハウス・リート投資     |   | 15,602 | 2,161,101 | 138,514 | 日本プロロジスリート      |   | 1,484 | 375,469 | 253,011 |
| ケネディクス商業リート     |   | 6,922  | 1,851,526 | 267,484 | ユナイテッド・アーバン投資法人 |   | 1,791 | 326,977 | 182,567 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 |   | 10,722 | 1,827,924 | 170,483 | アドバンス・レジデンス     |   | 1,115 | 323,027 | 289,710 |
| オリックス不動産投資      |   | 10,826 | 1,799,333 | 166,204 | オリックス不動産投資      |   | 1,619 | 279,886 | 172,876 |
| 日本リート投資法人       |   | 5,168  | 1,594,375 | 308,509 | 日本プライムリアルティ     |   | 0,681 | 274,471 | 403,041 |
| 日本プライムリアルティ     |   | 3,687  | 1,481,365 | 401,780 | 森トラスト総合リート      |   | 1,134 | 267,899 | 236,242 |
| 大和証券オフィス投資法人    |   | 2,306  | 1,403,704 | 608,718 | 大和証券オフィス投資法人    |   | 0,363 | 233,669 | 643,717 |

(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、2015年12月18日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（89,610,737千口）の内容です。

(1) 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   ア   ン   ド   名  | 2015年12月18日現在 |        |           |     | フ   ア   ン   ド   名 | 2015年12月18日現在 |        |            |     |
|--------------------|---------------|--------|-----------|-----|-------------------|---------------|--------|------------|-----|
|                    | 口             | 数      | 評 価 額     | 比 率 |                   | 口             | 数      | 評 価 額      | 比 率 |
| 不動産投信              |               | 千口     | 千円        | %   |                   |               | 千口     | 千円         | %   |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 |               | 9,387  | 3,961,314 | 1.9 | 日本リート投資法人         |               | 7,59   | 2,234,496  | 1.1 |
| MCUBS MidCity投資法人  |               | 5,154  | 1,909,557 | 0.9 | インベスコ・オフィス・Jリート   |               | 10,504 | 1,076,660  | 0.5 |
| 森ヒルズリート            |               | 30,417 | 4,665,967 | 2.3 | 日本ヘルスケア投資法        |               | 1,413  | 244,731    | 0.1 |
| 産業ファンド             |               | 6,83   | 3,940,910 | 1.9 | 積水ハウス・リート投資       |               | 15,382 | 1,991,969  | 1.0 |
| 大和ハウスリート           |               | 6,794  | 3,267,914 | 1.6 | トーセイ・リート投資法人      |               | 3,059  | 349,031    | 0.2 |
| アドバンス・レジデンス        |               | 25,185 | 6,570,766 | 3.2 | ケネディクス商業リート       |               | 6,882  | 1,723,941  | 0.8 |
| ケネディクスレジデンシャル      |               | 6,763  | 2,021,460 | 1.0 | ヘルスケア&メディカル投資     |               | 2,334  | 253,705    | 0.1 |
| A P I 投資法人         |               | 11,536 | 6,021,792 | 2.9 | サムティ・レジデンシャル      |               | 3,164  | 272,420    | 0.1 |
| G L P 投資法人         |               | 50,25  | 5,773,725 | 2.8 | ジャパン・シニアリビング      |               | 1,642  | 235,462    | 0.1 |
| コンフォリア・レジデンシャル     |               | 9,179  | 2,076,289 | 1.0 | 野村不動産マスターF        |               | 72,106 | 10,751,079 | 5.2 |
| 日本プロロジスリート         |               | 33,53  | 7,232,421 | 3.5 | 日本ビルファンド          |               | 27,355 | 16,002,675 | 7.8 |
| 星野リゾート・リート         |               | 1,488  | 1,819,824 | 0.9 | ジャパンリアルエステイト      |               | 25,365 | 14,660,970 | 7.1 |
| S I A不動産投資         |               | 1,455  | 673,665   | 0.3 | 日本リテールファンド        |               | 49,444 | 11,574,840 | 5.6 |
| イオンリート投資           |               | 21,121 | 2,923,146 | 1.4 | オリックス不動産投資        |               | 44,959 | 7,063,058  | 3.4 |
| ヒューリックリート投資法       |               | 15,13  | 2,449,547 | 1.2 | 日本プライムリアルティ       |               | 16,913 | 7,128,829  | 3.5 |

| フ   ァ   ン   ド   名      | 2015年12月18日現在 |           |             |         |
|------------------------|---------------|-----------|-------------|---------|
|                        | □   数         | 評   価   額 | 比           | 率       |
|                        | 千□            | 千円        |             | %       |
| プレミアム投資法人              | 25.514        | 3,110,156 |             | 1.5     |
| 東急リアル・エステート            | 18.939        | 2,884,409 |             | 1.4     |
| グローバル・ワン不動産投資法人        | 3.755         | 1,627,792 |             | 0.8     |
| ユナイテッド・アーバン投資法人        | 53.303        | 8,581,783 |             | 4.2     |
| 森トラスト総合リート             | 25.573        | 5,357,543 |             | 2.6     |
| インヴィンシブル投資法人           | 61.872        | 4,287,729 |             | 2.1     |
| フロンティア不動産投資            | 9.609         | 4,708,410 |             | 2.3     |
| 平和不動産リート               | 19.534        | 1,640,856 |             | 0.8     |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人      | 17.048        | 3,905,696 |             | 1.9     |
| 福岡リート投資法人              | 14.472        | 2,956,629 |             | 1.4     |
| ケネディクス・オフィス投資法人        | 7.844         | 4,580,896 |             | 2.2     |
| 礒水ハウス・ＳＩ   レジデンシャル投資法人 | 19.724        | 2,136,109 |             | 1.0     |
| いちごオフィスリート投資法人         | 27.439        | 2,304,876 |             | 1.1     |
| 大和証券オフィス投資法人           | 9.377         | 5,963,772 |             | 2.9     |
| 阪急リート投資法人              | 11.575        | 1,495,490 |             | 0.7     |
| スターツプロシード投資法人          | 3.367         | 566,329   |             | 0.3     |
| トップリート投資法人             | 3.41          | 1,573,715 |             | 0.8     |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人      | 14.486        | 3,575,144 |             | 1.7     |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人       | 60.913        | 5,713,639 |             | 2.8     |
| 日本賃貸住宅投資法人             | 31.773        | 2,646,690 |             | 1.3     |
| ジャパンエクセレント投資法人         | 24.496        | 3,395,145 |             | 1.6     |
| 合   計                  | □ 数、金 額       | 986.354   | 203,884,987 |         |
|                        | 銘柄数<比率>       | 51銘柄      |             | <99.1%> |

(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。

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

| 銘                      柄                      別 |        | 2015年12月18日現在               |                             |
|-------------------------------------------------|--------|-----------------------------|-----------------------------|
|                                                 |        | 買            建            額 | 売            建            額 |
| 国内                                              | 東証ＲＥＩＴ | 百万円                         | 百万円                         |
|                                                 |        | 1,656                       | －                           |

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040）が投資対象としている「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ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（2015年12月18日）現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を36～40ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄  
投資信託証券

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

| 買                               |   |     |        | 付      |                                    |   |      | 売      |        |    |   | 付  |    |      |    |
|---------------------------------|---|-----|--------|--------|------------------------------------|---|------|--------|--------|----|---|----|----|------|----|
| 銘柄                              | 柄 | 口数  | 金額     | 平均単価   | 銘柄                                 | 柄 | 口数   | 金額     | 平均単価   | 銘柄 | 柄 | 口数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 |
|                                 |   | 千口  | 千円     | 円      |                                    |   | 千口   | 千円     | 円      |    |   | 千口 | 千円 | 円    |    |
| SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）  |   | 2   | 46,120 | 23,060 | CORIO NV（オランダ）                     |   | 1.95 | 11,416 | 5,854  |    |   |    |    |      |    |
| WELLTOWER INC（アメリカ）             |   | 2.9 | 25,700 | 8,862  | SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）     |   | 0.5  | 11,096 | 22,193 |    |   |    |    |      |    |
| PUBLIC STORAGE（アメリカ）            |   | 1   | 24,146 | 24,146 | PUBLIC STORAGE（アメリカ）               |   | 0.3  | 7,103  | 23,676 |    |   |    |    |      |    |
| VENTAS INC（アメリカ）                |   | 2.6 | 22,411 | 8,619  | WELLTOWER INC（アメリカ）                |   | 0.7  | 5,877  | 8,396  |    |   |    |    |      |    |
| EQUITY RESIDENTIAL（アメリカ）        |   | 2.3 | 21,138 | 9,190  | GENERAL GROWTH PROPERTIES（アメリカ）    |   | 1.8  | 5,747  | 3,192  |    |   |    |    |      |    |
| PROLOGIS INC（アメリカ）              |   | 4   | 20,298 | 5,074  | KLEPIERRE（フランス）                    |   | 1.05 | 5,694  | 5,423  |    |   |    |    |      |    |
| UNIBAIL-RODAMCO SE（フランス）        |   | 0.6 | 19,199 | 31,999 | EQUITY RESIDENTIAL（アメリカ）           |   | 0.6  | 5,416  | 9,027  |    |   |    |    |      |    |
| KLEPIERRE（フランス）                 |   | 3.5 | 18,979 | 5,422  | PROLOGIS INC（アメリカ）                 |   | 1.1  | 5,310  | 4,827  |    |   |    |    |      |    |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC（アメリカ） |   | 0.9 | 18,577 | 20,641 | ASSOCIATED ESTATES REALTY CP（アメリカ） |   | 1.4  | 4,881  | 3,487  |    |   |    |    |      |    |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE（アメリカ）  |   | 8.5 | 17,989 | 2,116  | UNIBAIL-RODAMCO SE（フランス）           |   | 0.15 | 4,834  | 32,229 |    |   |    |    |      |    |

(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、2015年12月18日現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド（1,288,622千口）の内容です。

(1) 外国株式

| 銘柄                    | 柄                | 2015年12月18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     |     |
| RMR GROUP INC/THE - A |                  | 1.56          | 2           | 275    | 金融  |
| ファンド合計                | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1.56<br>1銘柄   | 2<br><0.0%> | 275    |     |

(注1) 邦貨換算金額は、2015年12月18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。

(2) 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                       | 口数     | 2015年12月18日現在 |         |  | 比率  |
|-----------------------------|--------|---------------|---------|--|-----|
|                             |        | 評価額           |         |  |     |
|                             |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |  |     |
| 不動産ファンド<br>(アメリカ)           | 千口     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |  | %   |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST     | 1.6    | 45            | 5,546   |  | 0.2 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 2      | 20            | 2,476   |  | 0.1 |
| URBAN EDGE PROPERTIES       | 2.082  | 47            | 5,840   |  | 0.2 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC  | 2.5    | 39            | 4,810   |  | 0.2 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC   | 3.1    | 554           | 67,962  |  | 2.4 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC    | 7.047  | 1,363         | 167,000 |  | 6.0 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST INC | 1.25   | 30            | 3,771   |  | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC       | 3.5    | 455           | 55,741  |  | 2.0 |
| BIOMED REALTY TRUST INC     | 4.6    | 108           | 13,291  |  | 0.5 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 3.555  | 140           | 17,213  |  | 0.6 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES   | 13.177 | 353           | 43,304  |  | 1.6 |
| VORNADO REALTY TRUST        | 3.964  | 394           | 48,278  |  | 1.7 |

| ファンド名                        | 2015年12月18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     | %   |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I | 3.8           | 38       | 4,663  | 0.2 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 0.3           | 5        | 644    | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES  | 0.5           | 8        | 1,020  | 0.0 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL         | 0.5           | 6        | 780    | 0.0 |
| ROUSE PROPERTIES INC         | 0.861         | 12       | 1,560  | 0.1 |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC  | 1.869         | 57       | 7,003  | 0.3 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A    | 0.9           | 38       | 4,774  | 0.2 |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 8.2           | 660      | 80,936 | 2.9 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC   | 3.5           | 72       | 8,865  | 0.3 |
| EPR PROPERTIES               | 1.4           | 80       | 9,845  | 0.4 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH  | 0.4           | 4        | 561    | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC         | 0.3           | 3        | 428    | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC         | 3.8           | 32       | 4,016  | 0.1 |
| CHATHAM LODGING TRUST        | 0.9           | 18       | 2,307  | 0.1 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST     | 1.3           | 33       | 4,149  | 0.1 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 1.2           | 63       | 7,772  | 0.3 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 2.3           | 41       | 5,062  | 0.2 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN | 0.613         | 8        | 1,098  | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 17            | 267      | 32,796 | 1.2 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 3.5           | 56       | 6,970  | 0.2 |
| CHAMBERS STREET PROPERTIES   | 5.3           | 41       | 5,024  | 0.2 |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY     | 1.5           | 48       | 5,883  | 0.2 |
| CORESITE REALTY CORP         | 0.7           | 40       | 4,923  | 0.2 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 1.7           | 47       | 5,863  | 0.2 |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES INC | 1.3           | 8        | 1,076  | 0.0 |
| RLJ LODGING TRUST            | 2.9           | 66       | 8,131  | 0.3 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST      | 2             | 32       | 4,022  | 0.1 |
| AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT | 0.7           | 12       | 1,572  | 0.1 |
| ARMADA HOFFER PROPERTIES IN  | 0.6           | 6        | 793    | 0.0 |
| CYRUSONE INC                 | 1.5           | 54       | 6,623  | 0.2 |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 0.8           | 12       | 1,529  | 0.1 |
| KIMCO REALTY CORP            | 9.4           | 246      | 30,178 | 1.1 |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 2.85          | 76       | 9,362  | 0.3 |
| WHITESTONE REIT              | 0.5           | 6        | 736    | 0.0 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 2.1           | 57       | 7,096  | 0.3 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 3.4           | 63       | 7,725  | 0.3 |
| STARWOOD WAYPOINT RESIDE     | 0.9           | 20       | 2,474  | 0.1 |
| WVP GLIMCHER INC             | 4.06          | 42       | 5,256  | 0.2 |
| CORRECTIONS CORP OF AMERICA  | 2.624         | 66       | 8,186  | 0.3 |
| STORE CAPITAL CORP           | 1.5           | 34       | 4,216  | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC  | 1.9           | 23       | 2,827  | 0.1 |
| SOVRAN SELF STORAGE INC      | 0.8           | 84       | 10,334 | 0.4 |
| SELECT INCOME REIT           | 1.4           | 27       | 3,364  | 0.1 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC    | 0.9           | 35       | 4,325  | 0.2 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 0.582         | 4        | 546    | 0.0 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 0.5           | 6        | 759    | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A  | 2.7           | 49       | 6,042  | 0.2 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 1.3           | 21       | 2,603  | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC  | 2.8           | 65       | 7,970  | 0.3 |
| STAG INDUSTRIAL INC          | 1.5           | 28       | 3,492  | 0.1 |
| VENTAS INC                   | 7.579         | 415      | 50,882 | 1.8 |

| ファンド名                        | 2015年12月18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     | %   |
| CARETRUST REIT INC           | 1.003         | 11       | 1,395  | 0.1 |
| NEW YORK REIT INC            | 3.6           | 41       | 5,066  | 0.2 |
| GEO GROUP INC/THE            | 1.7           | 45       | 5,620  | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 3.8           | 95       | 11,711 | 0.4 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 1.6           | 25       | 3,084  | 0.1 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC   | 1.5           | 29       | 3,625  | 0.1 |
| UMH PROPERTIES INC           | 0.6           | 6        | 751    | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC            | 4.3           | 116      | 14,305 | 0.5 |
| TERRENO REALTY CORP          | 1             | 22       | 2,774  | 0.1 |
| VEREIT INC                   | 20.508        | 166      | 20,397 | 0.7 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC    | 9.9           | 99       | 12,162 | 0.4 |
| SUN COMMUNITIES INC          | 1.3           | 90       | 11,070 | 0.4 |
| ACADIA REALTY TRUST          | 1.611         | 53       | 6,604  | 0.2 |
| ALEXANDER'S INC              | 0.1           | 38       | 4,762  | 0.2 |
| PROLOGIS INC                 | 11.846        | 497      | 60,942 | 2.2 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 1.6           | 145      | 17,807 | 0.6 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST      | 4             | 52       | 6,389  | 0.2 |
| SAUL CENTERS INC             | 0.3           | 15       | 1,956  | 0.1 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | 3.445         | 44       | 5,422  | 0.2 |
| MACK-CALI REALTY CORP        | 2             | 46       | 5,644  | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 2             | 150      | 18,454 | 0.7 |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 4.558         | 42       | 5,236  | 0.2 |
| DDR CORP                     | 6.856         | 114      | 14,058 | 0.5 |
| DUKE REALTY CORP             | 7.8           | 164      | 20,178 | 0.7 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC     | 0.7           | 39       | 4,799  | 0.2 |
| EQUITY ONE INC               | 1.7           | 45       | 5,549  | 0.2 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 1.467         | 350      | 42,880 | 1.5 |
| FELCOR LODGING TRUST INC     | 2.9           | 21       | 2,632  | 0.1 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 2.5           | 55       | 6,736  | 0.2 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 1.6           | 237      | 29,095 | 1.0 |
| GETTY REALTY CORP            | 0.6           | 10       | 1,294  | 0.0 |
| WELLTOWER INC                | 8             | 528      | 64,684 | 2.3 |
| HCP INC                      | 10.5          | 391      | 47,896 | 1.7 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 2.2           | 94       | 11,625 | 0.4 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 3.4           | 90       | 11,082 | 0.4 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 2.3           | 63       | 7,806  | 0.3 |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 2.875         | 78       | 9,666  | 0.3 |
| KILROY REALTY CORP           | 2.1           | 134      | 16,467 | 0.6 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES     | 2.6           | 68       | 8,344  | 0.3 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 3.4           | 107      | 13,214 | 0.5 |
| LTC PROPERTIES INC           | 0.8           | 33       | 4,146  | 0.1 |
| LEXINGTON REALTY TRUST       | 4.8           | 39       | 4,809  | 0.2 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 1.724         | 155      | 19,079 | 0.7 |
| MACERICH CO/THE              | 3             | 239      | 29,342 | 1.1 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 1.8           | 118      | 14,481 | 0.5 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC    | 0.8           | 48       | 5,964  | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 3.1           | 121      | 14,930 | 0.5 |
| REALTY INCOME CORP           | 5.617         | 286      | 35,089 | 1.3 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES  | 2.1           | 46       | 5,700  | 0.2 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST  | 1.6           | 35       | 4,301  | 0.2 |
| PARKWAY PROPERTIES INC       | 1.8           | 28       | 3,514  | 0.1 |

| ファンド名                        | 2015年12月18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        | %       |
| POST PROPERTIES INC          | 1.2             | 70       | 8,623     | 0.3     |
| PUBLIC STORAGE               | 3.3             | 816      | 100,067   | 3.6     |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA     | 0.4             | 34       | 4,259     | 0.2     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 2.1             | 142      | 17,422    | 0.6     |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES  | 1.8             | 29       | 3,651     | 0.1     |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 2.2             | 73       | 8,970     | 0.3     |
| SL GREEN REALTY CORP         | 2.3             | 259      | 31,764    | 1.1     |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST    | 5.4             | 76       | 9,418     | 0.3     |
| TAUBMAN CENTERS INC          | 1.4             | 105      | 12,900    | 0.5     |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A     | 0.6             | 11       | 1,463     | 0.1     |
| UDR INC                      | 5.9             | 215      | 26,428    | 0.9     |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.3             | 15       | 1,844     | 0.1     |
| WP CAREY INC                 | 2.2             | 134      | 16,430    | 0.6     |
| WASHINGTON REIT              | 1.5             | 41       | 5,109     | 0.2     |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS  | 2.6             | 89       | 11,003    | 0.4     |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | 1.8             | 11       | 1,464     | 0.1     |
| AGREE REALTY CORP            | 0.4             | 13       | 1,669     | 0.1     |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 3.75            | 129      | 15,810    | 0.6     |
| INLAND REAL ESTATE CORP      | 1.9             | 20       | 2,492     | 0.1     |
| CUBESMART                    | 3.9             | 118      | 14,503    | 0.5     |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 4.681           | 63       | 7,774     | 0.3     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 3.3             | 243      | 29,859    | 1.1     |
| CEDAR REALTY TRUST INC       | 1.5             | 10       | 1,321     | 0.0     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 2.8             | 247      | 30,311    | 1.1     |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST   | 1.2             | 13       | 1,663     | 0.1     |
| WINTHROP REALTY TRUST        | 0.8             | 10       | 1,298     | 0.0     |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST     | 1.075           | 24       | 2,974     | 0.1     |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST  | 2.8             | 20       | 2,551     | 0.1     |
| KITE REALTY GROUP TRUST      | 1.85            | 48       | 5,891     | 0.2     |
| MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 1.4             | 14       | 1,819     | 0.1     |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | 0.3             | 6        | 808       | 0.0     |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES  | 2.5             | 102      | 12,524    | 0.4     |
| EDUCATION REALTY TRUST INC   | 1.3             | 48       | 5,990     | 0.2     |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP    | 0.5             | 7        | 901       | 0.0     |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO   | 4.442           | 45       | 5,538     | 0.2     |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE     | 4.25            | 71       | 8,792     | 0.3     |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 1.349           | 14       | 1,779     | 0.1     |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 5.4             | 61       | 7,533     | 0.3     |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 1.9             | 19       | 2,348     | 0.1     |
| DOUGLAS EMMETT INC           | 3.2             | 96       | 11,876    | 0.4     |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC     | 2               | 75       | 9,235     | 0.3     |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 5.3             | 77       | 9,517     | 0.3     |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | 441.52<br>156銘柄 | 16,136   | 1,976,501 | <70.8%> |
| (カナダ)                        | 千口              | 千カナダ・ドル  | 千円        | %       |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 1.5             | 19       | 1,684     | 0.1     |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 1.2             | 10       | 882       | 0.0     |
| SLATE RETAIL REIT            | 0.3             | 4        | 364       | 0.0     |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 0.7             | 5        | 513       | 0.0     |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO | 0.3             | 7        | 694       | 0.0     |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 0.5             | 19       | 1,697     | 0.1     |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 0.6             | 4        | 371       | 0.0     |

| ファンド名                        | 2015年12月18日現在  |             |        |         |
|------------------------------|----------------|-------------|--------|---------|
|                              | 口数             | 評価額         |        | 比率      |
|                              |                | 外貨建金額       | 邦貨換算金額 |         |
|                              | 千口             | 千カナダ・ドル     | 千円     | %       |
| ONEREIT                      | 1              | 3           | 283    | 0.0     |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 0.8            | 5           | 456    | 0.0     |
| CHOICE PROPERTIES REIT       | 0.9            | 10          | 925    | 0.0     |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE  | 1.9            | 8           | 705    | 0.0     |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 0.4            | 4           | 368    | 0.0     |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ES | 0.7            | 10          | 961    | 0.0     |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 0.7            | 9           | 804    | 0.0     |
| PLAZA RETAIL REIT            | 1              | 4           | 408    | 0.0     |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | 1.4            | 43          | 3,804  | 0.1     |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 1.4            | 38          | 3,345  | 0.1     |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 0.8            | 33          | 2,933  | 0.1     |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 1.79           | 26          | 2,308  | 0.1     |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 3.066          | 62          | 5,452  | 0.2     |
| INNVEST REAL ESTATE INVESTME | 1.4            | 7           | 641    | 0.0     |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS  | 0.7            | 9           | 817    | 0.0     |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 3.6            | 89          | 7,887  | 0.3     |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 1.2            | 21          | 1,846  | 0.1     |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 0.5            | 24          | 2,112  | 0.1     |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 0.5            | 8           | 732    | 0.0     |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 0.8            | 10          | 900    | 0.0     |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 0.9            | 29          | 2,578  | 0.1     |
| カナダ・ドル<br>通貨計                | 30.556<br>28銘柄 | 529         | 46,481 | < 1.7%> |
| (オーストラリア)                    | 千口             | 千オーストラリア・ドル | 千円     | %       |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST   | 4.5            | 9           | 863    | 0.0     |
| GALILEO JAPAN TRUST          | 2.5            | 4           | 410    | 0.0     |
| CROMWELL PROPERTY GROUP      | 27.5           | 28          | 2,495  | 0.1     |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 16.5           | 35          | 3,094  | 0.1     |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 3.5            | 10          | 949    | 0.0     |
| NATIONAL STORAGE REIT        | 6.5            | 10          | 898    | 0.0     |
| INDUSTRIA REIT               | 2              | 4           | 366    | 0.0     |
| GDI PROPERTY GROUP           | 10             | 8           | 776    | 0.0     |
| 360 CAPITAL OFFICE FUND      | 1              | 2           | 181    | 0.0     |
| SCENTRE GROUP                | 120.5          | 494         | 43,100 | 1.5     |
| ARENA REIT                   | 4.5            | 7           | 667    | 0.0     |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS   | 3              | 7           | 685    | 0.0     |
| BWP TRUST                    | 11             | 35          | 3,070  | 0.1     |
| DEXUS PROPERTY GROUP         | 21.509         | 166         | 14,486 | 0.5     |
| GPT GROUP                    | 40.5           | 192         | 16,818 | 0.6     |
| INVESTA OFFICE FUND          | 14             | 56          | 4,970  | 0.2     |
| CHARTER HALL RETAIL REIT     | 7.5            | 31          | 2,780  | 0.1     |
| MIRVAC GROUP                 | 82.5           | 164         | 14,322 | 0.5     |
| STOCKLAND                    | 54             | 226         | 19,786 | 0.7     |
| WESTFIELD CORP               | 43             | 417         | 36,425 | 1.3     |
| ABACUS PROPERTY GROUP        | 6              | 18          | 1,601  | 0.1     |
| GOODMAN GROUP                | 35.5           | 222         | 19,418 | 0.7     |
| VICINITY CENTRES             | 73.77          | 208         | 18,213 | 0.7     |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP   | 1              | 5           | 449    | 0.0     |
| CHARTER HALL GROUP           | 6.95           | 32          | 2,801  | 0.1     |
| ALE PROPERTY GROUP           | 4              | 15          | 1,336  | 0.0     |
| ASPEN GROUP                  | 1.5            | 1           | 164    | 0.0     |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP    | 3.083          | 8           | 782    | 0.0     |

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

| ファンド名                         | 2015年12月18日現在      |                       |                |          |
|-------------------------------|--------------------|-----------------------|----------------|----------|
|                               | 口数                 | 評価額                   |                | 比率       |
|                               |                    | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額         |          |
| 360 CAPITAL GROUP LTD         | 千口<br>5.5          | オーストラリア・ドル<br>613,312 | 千円<br>5<br>477 | %<br>0.0 |
| オーストラリア・ドル<br>通貨計             | 口数、金額<br>29銘柄数<比率> | 2,434                 | 212,396        | < 7.6%>  |
| (香港)                          | 千口                 | 千香港ドル                 | 千円             | %        |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN  | 24                 | 99                    | 1,566          | 0.1      |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST   | 22                 | 82                    | 1,310          | 0.0      |
| FORTUNE REIT                  | 31                 | 237                   | 3,756          | 0.1      |
| PROSPERITY REIT               | 28                 | 78                    | 1,238          | 0.0      |
| LINK REIT                     | 52                 | 2,381                 | 37,629         | 1.3      |
| NEW CENTURY REIT              | 10                 | 28                    | 450            | 0.0      |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN  | 15                 | 44                    | 701            | 0.0      |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT  | 18                 | 34                    | 548            | 0.0      |
| CHAMPION REIT                 | 50                 | 192                   | 3,033          | 0.1      |
| 香港ドル<br>通貨計                   | 口数、金額<br>9銘柄数<比率>  | 250<br>3,179          | 50,235         | < 1.8%>  |
| (シンガポール)                      | 千口                 | 千シンガポール・ドル            | 千円             | %        |
| KEPPEL DC REIT                | 18.9               | 18                    | 1,639          | 0.1      |
| FIRST REAL ESTATE INVIT TRUST | 11.8               | 13                    | 1,201          | 0.0      |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMM  | 39.7               | 36                    | 3,134          | 0.1      |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL   | 12                 | 16                    | 1,398          | 0.1      |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST     | 12.3               | 9                     | 785            | 0.0      |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST   | 44.8               | 60                    | 5,200          | 0.2      |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT  | 46.2               | 103                   | 8,970          | 0.3      |
| CAPITALAND MALL TRUST         | 60.1               | 115                   | 10,010         | 0.4      |
| SUNTEC REIT                   | 57.2               | 89                    | 7,700          | 0.3      |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST     | 33.6               | 34                    | 2,943          | 0.1      |
| KEPPEL REIT                   | 39                 | 36                    | 3,130          | 0.1      |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST      | 12.26              | 15                    | 1,343          | 0.0      |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST        | 19                 | 22                    | 1,910          | 0.1      |
| CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST    | 23.579             | 13                    | 1,180          | 0.0      |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS        | 14.8               | 19                    | 1,654          | 0.1      |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST     | 12.2               | 22                    | 1,926          | 0.1      |
| STARHILL GLOBAL REIT          | 29                 | 21                    | 1,851          | 0.1      |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS  | 14.8               | 21                    | 1,890          | 0.1      |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE       | 8.3                | 18                    | 1,625          | 0.1      |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL  | 37.2               | 11                    | 979            | 0.0      |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST    | 26.68              | 41                    | 3,568          | 0.1      |
| CACHE LOGISTICS TRUST         | 18.9               | 16                    | 1,451          | 0.1      |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST    | 29.2               | 38                    | 3,288          | 0.1      |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST    | 18.2               | 11                    | 1,005          | 0.0      |
| SPH REIT                      | 17.1               | 16                    | 1,409          | 0.1      |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI  | 14.3               | 10                    | 894            | 0.0      |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT  | 13                 | 9                     | 796            | 0.0      |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST    | 16.7               | 11                    | 958            | 0.0      |
| OUUE HOSPITALITY TRUST        | 15.9               | 11                    | 1,029          | 0.0      |
| OUUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 10.15              | 6                     | 582            | 0.0      |
| シンガポール・ドル<br>通貨計              | 口数、金額<br>30銘柄数<比率> | 726,869<br>874        | 75,461         | < 2.7%>  |
| (ニュージーランド)                    | 千口                 | 千ニュージーランド・ドル          | 千円             | %        |
| STRIDE PROPERTY LTD           | 8                  | 17                    | 1,409          | 0.1      |
| ARGOSY PROPERTY LTD           | 18.5               | 20                    | 1,713          | 0.1      |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD       | 28.5               | 38                    | 3,153          | 0.1      |

| ファンド名                        | 2015年12月18日現在      |                   |             |          |
|------------------------------|--------------------|-------------------|-------------|----------|
|                              | 口数                 | 評価額               |             | 比率       |
|                              |                    | 外貨建金額             | 邦貨換算金額      |          |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD    | 千口<br>9.208        | ニュージーランド・ドル<br>14 | 千円<br>1,203 | %<br>0.0 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 6                  | 11                | 919         | 0.0      |
| GOODMAN PROPERTY TRUST       | 22.5               | 27                | 2,277       | 0.1      |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 22.5               | 27                | 2,250       | 0.1      |
| ニュージーランド・ドル<br>通貨計           | 口数、金額<br>7銘柄数<比率>  | 115,208<br>157    | 12,928      | < 0.5%>  |
| (イギリス)                       | 千口                 | 千イギリス・ポンド         | 千円          | %        |
| ASSURA PLC                   | 36.1               | 19                | 3,605       | 0.1      |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 8                  | 8                 | 1,639       | 0.1      |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC   | 21.75              | 11                | 2,017       | 0.1      |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 18.1               | 214               | 39,200      | 1.4      |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC        | 16                 | 18                | 3,389       | 0.1      |
| SEGRO PLC                    | 16.75              | 71                | 13,103      | 0.5      |
| HAMMERSON PLC                | 17.7               | 106               | 19,506      | 0.7      |
| BRITISH LAND CO PLC          | 23.15              | 183               | 33,586      | 1.2      |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC   | 7.75               | 65                | 11,994      | 0.4      |
| INTU PROPERTIES PLC          | 18.45              | 58                | 10,703      | 0.4      |
| DERWENT LONDON PLC           | 2.5                | 92                | 16,832      | 0.6      |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES    | 9.4                | 9                 | 1,793       | 0.1      |
| WORKSPACE GROUP PLC          | 2.65               | 25                | 4,655       | 0.2      |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC       | 4.5                | 15                | 2,905       | 0.1      |
| SHAFTESBURY PLC              | 6.3                | 57                | 10,515      | 0.4      |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD     | 1.95               | 5                 | 943         | 0.0      |
| BIG YELLOW GROUP PLC         | 3.3                | 26                | 4,848       | 0.2      |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC    | 14                 | 22                | 4,131       | 0.1      |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 11.15              | 6                 | 1,225       | 0.0      |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC      | 15.3               | 19                | 3,573       | 0.1      |
| イギリス・ポンド<br>通貨計              | 口数、金額<br>20銘柄数<比率> | 254.8<br>1,041    | 190,170     | < 6.8%>  |
| (イスラエル)                      | 千口                 | 千イスラエル・シェケル       | 千円          | %        |
| REIT 1 LTD                   | 3.1                | 32                | 1,011       | 0.0      |
| イスラエル・シェケル<br>通貨計            | 口数、金額<br>1銘柄数<比率>  | 3.1<br>32         | 1,011       | < 0.0%>  |
| ユーロ (アイルランド)                 | 千口                 | 千ユーロ              | 千円          | %        |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 7.3                | 8                 | 1,110       | 0.0      |
| GREEN REIT PLC               | 14.9               | 23                | 3,136       | 0.1      |
| HIBERNIA REIT PLC            | 14.85              | 20                | 2,761       | 0.1      |
| 国小計                          | 口数、金額<br>3銘柄数<比率>  | 37.05<br>52       | 7,008       | < 0.3%>  |
| ユーロ (オランダ)                   | 千口                 | 千ユーロ              | 千円          | %        |
| WERELDHAVE NV                | 0.9                | 45                | 6,102       | 0.2      |
| EUROCOMMERCIAL PROPRIETIE-CV | 1.1                | 43                | 5,809       | 0.2      |
| NSI NV                       | 2.904              | 11                | 1,512       | 0.1      |
| VASTNED RETAIL NV            | 0.45               | 18                | 2,496       | 0.1      |
| 国小計                          | 口数、金額<br>4銘柄数<比率>  | 5.354<br>119      | 15,920      | < 0.6%>  |
| ユーロ (ベルギー)                   | 千口                 | 千ユーロ              | 千円          | %        |
| AEDIFICA                     | 0.306              | 18                | 2,435       | 0.1      |
| COFINIMMO                    | 0.45               | 43                | 5,826       | 0.2      |
| BEFIMMO                      | 0.45               | 24                | 3,276       | 0.1      |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 0.2                | 4                 | 620         | 0.0      |
| RETAIL ESTATES               | 0.1                | 7                 | 1,027       | 0.0      |

| フ ァ ン ド 名                    | 2015年12月18日現在    |                    |                  |          |
|------------------------------|------------------|--------------------|------------------|----------|
|                              | 口 数              | 評 価 額              |                  | 比 率      |
|                              |                  | 外貨建金額              | 邦貨換算金額           |          |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 千口<br>0.3        | 千ユーロ<br>22         | 千円<br>3,051      | %<br>0.1 |
| WERELDHAVE BELGIUM NV        | 0.05             | 5                  | 688              | 0.0      |
| 国 小 計                        | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,856<br>7銘柄       | 127<br>16,925    | < 0.6%>  |
| ユーロ（フランス）                    | 千口               | 千ユーロ               | 千円               | %        |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 2.2              | 516                | 68,556           | 2.5      |
| ICADE                        | 0.8              | 48                 | 6,502            | 0.2      |
| ANF IMMOBILIER               | 0.2              | 4                  | 569              | 0.0      |
| ALTAREA                      | 0.05             | 8                  | 1,182            | 0.0      |
| FONCIERE DES MURS            | 0.2              | 5                  | 676              | 0.0      |
| GECINA SA                    | 0.8              | 90                 | 12,071           | 0.4      |
| KLEPIERRE                    | 4.25             | 175                | 23,331           | 0.8      |
| FONCIERE DES REGIONS         | 1                | 82                 | 10,900           | 0.4      |
| AFFINE                       | 0.15             | 2                  | 320              | 0.0      |
| MERCIALYS                    | 0.4              | 7                  | 1,037            | 0.0      |
| 国 小 計                        | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 10.05<br>10銘柄      | 942<br>125,147   | < 4.5%>  |
| ユーロ（ドイツ）                     | 千口               | 千ユーロ               | 千円               | %        |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG       | 2.3              | 27                 | 3,678            | 0.1      |
| HAMBORNER REIT AG            | 1.334            | 12                 | 1,676            | 0.1      |
| 国 小 計                        | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 3.634<br>2銘柄       | 40<br>5,354      | < 0.2%>  |
| ユーロ（スペイン）                    | 千口               | 千ユーロ               | 千円               | %        |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 1.3              | 12                 | 1,674            | 0.1      |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA  | 1.25             | 16                 | 2,191            | 0.1      |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA  | 6.925            | 83                 | 11,153           | 0.4      |
| 国 小 計                        | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 9.475<br>3銘柄       | 113<br>15,019    | < 0.5%>  |
| ユーロ（イタリア）                    | 千口               | 千ユーロ               | 千円               | %        |
| BENI STABILI SPA             | 23.35            | 16                 | 2,233            | 0.1      |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 6.65             | 5                  | 790              | 0.0      |
| 国 小 計                        | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 30<br>2銘柄          | 22<br>3,023      | < 0.1%>  |
| ユーロ通貨計                       | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 97.419<br>31銘柄     | 1,418<br>188,400 | < 6.8%>  |
| 合 計                          | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 2,532.784<br>311銘柄 | —<br>2,753,587   | <98.7%>  |

(注1) 邦貨換算金額は、2015年12月18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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040）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（2015年12月18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41～43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

(2014年12月19日から2015年12月18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  | 272,605 | 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 | 307  | 10年国債 1.3% 2020/3/20   | 124,664 |
| 122 | 5年国債 0.1% 2019/12/20  | 185,373 | 123  | 5年国債 0.1% 2020/3/20    | 105,076 |
| 338 | 10年国債 0.4% 2025/3/20  | 175,597 | 378  | 東北電力 3.85% 2016/4/25   | 104,021 |
| 339 | 10年国債 0.4% 2025/6/20  | 174,164 | 95   | 5年国債 0.6% 2016/3/20    | 102,751 |
| 349 | 2年国債 0.1% 2017/2/15   | 170,261 | 293  | 大阪府公債 2.1% 2016/8/30   | 102,156 |
| 154 | 20年国債 1.2% 2035/9/20  | 143,301 | 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、2015年12月18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）（12,066,650千円）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）

| 2015年12月18日現在 |            |            |         |                 |                   |         |         |
|---------------|------------|------------|---------|-----------------|-------------------|---------|---------|
| 区 分           | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 組 入 比 率 | うちＢＢ格<br>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          | 9,356,000  | 10,296,201 | 69.3    | －               | 55.5              | 13.6    | 0.3     |
| 地方債証券         | 1,710,800  | 1,769,070  | 11.9    | －               | 2.1               | 6.3     | 3.5     |
| 特殊債券(除く金融債券)  | 1,250,000  | 1,290,164  | 8.7     | －               | 0.7               | 4.9     | 3.1     |
| 金融債券          | 100,000    | 100,282    | 0.7     | －               | －                 | －       | 0.7     |
| 普通社債券         | 1,103,000  | 1,125,479  | 7.6     | －               | 0.7               | 4.8     | 2.0     |
| 合 計           | 13,519,800 | 14,581,197 | 98.2    | －               | 59.0              | 29.6    | 9.6     |

(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。





<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040）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（2015年12月18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44～59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

(2014年12月19日から2015年12月18日まで)

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

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

■組入資産明細表

下記は、2015年12月18日現在における外国債券インデックスマザーファンド（57,214,334千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

| 2015年12月18日現在 |                        |                        |                  |           |                     |                   |           |          |
|---------------|------------------------|------------------------|------------------|-----------|---------------------|-------------------|-----------|----------|
| 区 分           | 額 面 金 額                | 評 価                    |                  | 組 入 比 率   | う ち B B 格<br>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<br>554,707    | 千アメリカ・ドル<br>569,247    | 千円<br>69,727,092 | %<br>42.6 | %<br>—              | %<br>17.0         | %<br>16.3 | %<br>9.3 |
| カナダ           | 千カナダ・ドル<br>32,010      | 千カナダ・ドル<br>36,255      | 3,182,527        | 1.9       | —                   | 1.0               | 0.6       | 0.4      |
| オーストラリア       | 千オーストラリア・ドル<br>29,734  | 千オーストラリア・ドル<br>32,304  | 2,818,233        | 1.7       | —                   | 1.0               | 0.5       | 0.2      |
| シンガポール        | 千シンガポール・ドル<br>6,609    | 千シンガポール・ドル<br>6,835    | 589,906          | 0.4       | —                   | 0.2               | 0.1       | 0.0      |
| イギリス          | 千イギリス・ポンド<br>62,315    | 千イギリス・ポンド<br>74,073    | 13,526,608       | 8.3       | —                   | 6.0               | 1.8       | 0.5      |
| スイス           | 千スイス・フラン<br>3,343      | 千スイス・フラン<br>3,993      | 491,767          | 0.3       | —                   | 0.1               | 0.1       | 0.0      |
| デンマーク         | 千デンマーク・クローネ<br>44,278  | 千デンマーク・クローネ<br>56,434  | 1,004,541        | 0.6       | —                   | 0.4               | 0.1       | 0.1      |
| ノルウェー         | 千ノルウェー・クローネ<br>29,462  | 千ノルウェー・クローネ<br>32,202  | 450,195          | 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<br>44,965 | 千スウェーデン・クローネ<br>51,758 | 741,184          | 0.5       | —                   | 0.2               | 0.2       | 0.0      |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2015年12月18日現在   |                        |                        |                 |          |                     |                   |          |          |
|-----------------|------------------------|------------------------|-----------------|----------|---------------------|-------------------|----------|----------|
| 区 分             | 額 面 金 額                | 評 価 額                  |                 | 組 入 比 率  | う ち B B 格<br>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  |
| メキシコ            | 千メキシコ・ペソ<br>210,935    | 千メキシコ・ペソ<br>232,344    | 千円<br>1,670,553 | %<br>1.0 | %<br>－              | %<br>0.6          | %<br>0.2 | %<br>0.2 |
| マレーシア           | 千マレーシア・リンギット<br>25,641 | 千マレーシア・リンギット<br>25,611 | 725,583         | 0.4      | －                   | 0.2               | 0.2      | 0.1      |
| 南アフリカ           | 千南アフリカ・ランド<br>95,336   | 千南アフリカ・ランド<br>83,517   | 672,312         | 0.4      | －                   | 0.3               | 0.0      | 0.0      |
| ポーランド           | 千ポーランド・ズロチ<br>26,649   | 千ポーランド・ズロチ<br>28,713   | 886,658         | 0.5      | －                   | 0.3               | 0.2      | 0.1      |
| ユーロ<br>(アイルランド) | 千ユーロ<br>7,988          | 千ユーロ<br>9,490          | 1,260,577       | 0.8      | －                   | 0.4               | 0.4      | 0.0      |
| ユーロ<br>(オランダ)   | 千ユーロ<br>25,708         | 千ユーロ<br>30,059         | 3,992,831       | 2.4      | －                   | 1.4               | 0.8      | 0.3      |
| ユーロ<br>(ベルギー)   | 千ユーロ<br>24,815         | 千ユーロ<br>30,533         | 4,055,792       | 2.5      | －                   | 1.7               | 0.5      | 0.2      |
| ユーロ<br>(フランス)   | 千ユーロ<br>97,512         | 千ユーロ<br>116,379        | 15,458,651      | 9.5      | －                   | 5.8               | 2.7      | 0.9      |
| ユーロ<br>(ドイツ)    | 千ユーロ<br>77,793         | 千ユーロ<br>91,524         | 12,157,191      | 7.4      | －                   | 4.3               | 2.2      | 1.0      |
| ユーロ<br>(スペイン)   | 千ユーロ<br>55,244         | 千ユーロ<br>65,367         | 8,682,765       | 5.3      | －                   | 3.1               | 1.6      | 0.6      |
| ユーロ<br>(イタリア)   | 千ユーロ<br>99,068         | 千ユーロ<br>119,357        | 15,854,260      | 9.7      | －                   | 6.1               | 2.7      | 0.9      |
| ユーロ<br>(フィンランド) | 千ユーロ<br>6,284          | 千ユーロ<br>7,077          | 940,049         | 0.6      | －                   | 0.4               | 0.1      | 0.1      |
| ユーロ<br>(オーストリア) | 千ユーロ<br>15,323         | 千ユーロ<br>18,577         | 2,467,712       | 1.5      | －                   | 0.9               | 0.4      | 0.1      |
| ユーロ<br>(小計)     | 409,735                | 488,367                | 64,869,830      | 39.7     | －                   | 24.1              | 11.5     | 4.0      |
| 合 計             | －                      | －                      | 161,356,997     | 98.7     | －                   | 51.7              | 32.0     | 15.0     |

(注1) 邦貨換算金額は、2015年12月18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)

| 2015年12月18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   |            |
| アメリカ          | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | %<br>4.6250 | 千アメリカ・ドル<br>2,039 | 千アメリカ・ドル<br>2,128 | 千円<br>260,673 | 2017/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.5000      | 1,795             | 1,885             | 230,922       | 2017/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.7500      | 2,401             | 2,551             | 312,511       | 2017/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.2500      | 1,686             | 1,788             | 219,093       | 2017/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.5000      | 3,839             | 4,034             | 494,169       | 2018/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.8750      | 2,960             | 3,153             | 386,289       | 2018/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.0000      | 3,173             | 3,407             | 417,429       | 2018/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.7500      | 2,488             | 2,666             | 326,587       | 2018/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.7500      | 3,161             | 3,297             | 403,886       | 2019/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.1250      | 3,096             | 3,269             | 400,530       | 2019/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.6250      | 2,621             | 2,820             | 345,500       | 2019/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.3750      | 4,020             | 4,302             | 526,952       | 2019/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.7500      | 1,134             | 1,155             | 141,496       | 2016/11/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.2500      | 3,154             | 3,234             | 396,169       | 2016/12/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.1250      | 2,884             | 2,957             | 362,311       | 2017/01/31 |

| 2015年12月18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 | 3.6250 | 5,630    | 6,084     | 745,326     | 2020/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,687    | 2,755     | 337,536     | 2017/02/28 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.2500 | 4,635    | 4,774     | 584,835     | 2017/03/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 1,653    | 1,702     | 208,556     | 2017/04/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 3,073    | 3,308     | 405,286     | 2020/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 2,835    | 2,908     | 356,305     | 2017/05/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,468    | 3,548     | 434,667     | 2017/06/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,773    | 1,812     | 222,067     | 2017/07/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,854    | 2,969     | 363,758     | 2020/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,903    | 2,945     | 360,851     | 2017/08/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,831    | 2,873     | 351,970     | 2017/09/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,372    | 2,408     | 295,049     | 2017/10/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 4,509    | 4,691     | 574,615     | 2020/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 883      | 903       | 110,625     | 2017/11/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 924      | 955       | 117,022     | 2017/12/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 255      | 263       | 32,240      | 2018/01/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 4,076    | 4,439     | 543,774     | 2021/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 1,234    | 1,277     | 156,530     | 2018/02/28 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 1,300    | 1,350     | 165,474     | 2018/03/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 260      | 268       | 32,940      | 2018/04/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 3,417    | 3,640     | 445,946     | 2021/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,322    | 1,360     | 166,592     | 2018/05/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 1,065    | 1,096     | 134,354     | 2018/06/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 1,341    | 1,377     | 168,699     | 2018/07/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,534    | 2,568     | 314,632     | 2021/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,444    | 3,466     | 424,656     | 2018/08/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,835    | 2,843     | 348,342     | 2018/09/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 1,320    | 1,337     | 163,890     | 2018/10/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,353    | 1,359     | 166,517     | 2021/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 223      | 223       | 27,342      | 2016/11/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,165    | 2,169     | 265,729     | 2018/11/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 3,410    | 3,412     | 418,045     | 2016/12/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,861    | 1,862     | 228,175     | 2018/12/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,970    | 2,972     | 364,064     | 2017/01/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,426    | 1,421     | 174,069     | 2019/01/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 3,224    | 3,235     | 396,278     | 2022/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,408    | 2,409     | 295,103     | 2017/02/28 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,843    | 1,841     | 225,588     | 2019/02/28 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 3,856    | 3,861     | 473,039     | 2017/03/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 300      | 300       | 36,857      | 2019/03/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,375    | 2,374     | 290,809     | 2017/04/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 559      | 555       | 68,070      | 2019/04/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,459    | 2,423     | 296,883     | 2022/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 3,485    | 3,469     | 424,956     | 2017/05/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,385    | 2,358     | 288,872     | 2019/05/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 3,906    | 3,893     | 476,929     | 2017/06/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,368    | 1,346     | 164,875     | 2019/06/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.5000 | 5,660    | 5,617     | 688,114     | 2017/07/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,784    | 1,744     | 213,740     | 2019/07/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,543    | 2,482     | 304,069     | 2022/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 6,410    | 6,368     | 780,096     | 2017/08/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,872    | 1,837     | 225,125     | 2019/08/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.6250 | 4,974    | 4,939     | 605,097     | 2017/09/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,215    | 2,170     | 265,878     | 2019/09/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,648    | 2,634     | 322,692     | 2017/10/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 884      | 874       | 107,087     | 2019/10/31 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2015年12月18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 | 1.6250 | 3,168    | 3,082     | 377,617     | 2022/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.6250 | 2,336    | 2,316     | 283,753     | 2017/11/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,353    | 1,323     | 162,089     | 2019/11/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.7500 | 1,913    | 1,900     | 232,811     | 2017/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.1250 | 894      | 877       | 107,516     | 2019/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.8750 | 2,153    | 2,142     | 262,473     | 2018/01/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.3750 | 1,366    | 1,352     | 165,725     | 2020/01/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 3,850    | 3,835     | 469,851     | 2023/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.7500 | 3,447    | 3,419     | 418,807     | 2018/02/28 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.2500 | 1,968    | 1,937     | 237,311     | 2020/02/29 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.7500 | 2,315    | 2,294     | 281,071     | 2018/03/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.1250 | 1,160    | 1,134     | 138,990     | 2020/03/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.7500 | 4,685    | 4,574     | 560,276     | 2023/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.6250 | 4,218    | 4,163     | 510,039     | 2018/04/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.1250 | 1,451    | 1,418     | 173,774     | 2020/04/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.0000 | 3,407    | 3,389     | 415,236     | 2018/05/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.3750 | 2,461    | 2,427     | 297,302     | 2020/05/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.3750 | 1,693    | 1,700     | 208,306     | 2018/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.8750 | 2,131    | 2,148     | 263,135     | 2020/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 2,827    | 2,862     | 350,580     | 2020/07/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.3750 | 1,697    | 1,704     | 208,726     | 2018/07/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.5000 | 4,468    | 4,595     | 562,932     | 2023/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.1250 | 1,993    | 2,027     | 248,336     | 2020/08/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,885    | 1,908     | 233,761     | 2020/09/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.2500 | 3,611    | 3,606     | 441,758     | 2018/10/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,345    | 2,343     | 287,058     | 2020/10/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.7500 | 3,821    | 3,999     | 489,896     | 2023/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.2500 | 2,638    | 2,633     | 322,559     | 2018/11/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 2,501    | 2,528     | 309,695     | 2020/11/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.6250 | 144      | 143       | 17,615      | 2016/12/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.5000 | 2,026    | 2,035     | 249,346     | 2018/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.3750 | 2,006    | 2,064     | 252,855     | 2020/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.7500 | 2,168    | 2,166     | 265,422     | 2017/01/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.7500 | 5,229    | 5,464     | 669,322     | 2024/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.5000 | 2,185    | 2,194     | 268,748     | 2019/01/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.1250 | 1,647    | 1,673     | 204,954     | 2021/01/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.6250 | 2,190    | 2,184     | 267,611     | 2017/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.5000 | 2,373    | 2,381     | 291,665     | 2019/02/28 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,734    | 1,750     | 214,370     | 2021/02/28 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.7500 | 1,182    | 1,180     | 144,584     | 2017/03/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.6250 | 2,383    | 2,398     | 293,808     | 2019/03/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,821    | 2,881     | 352,966     | 2021/03/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.8750 | 1,485    | 1,484     | 181,846     | 2017/04/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.5000 | 5,412    | 5,546     | 679,382     | 2024/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.6250 | 2,975    | 2,992     | 366,568     | 2019/04/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.8750 | 2,237    | 2,235     | 273,870     | 2017/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,407    | 2,458     | 301,142     | 2021/04/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.5000 | 2,241    | 2,244     | 274,906     | 2019/05/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 2,732    | 2,754     | 337,386     | 2021/05/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.8750 | 753      | 752       | 92,129      | 2017/06/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.6250 | 2,885    | 2,900     | 355,288     | 2019/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.1250 | 3,485    | 3,534     | 432,977     | 2021/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 8.7500 | 1,527    | 1,694     | 207,609     | 2017/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 8.8750 | 904      | 1,115     | 136,665     | 2019/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 8.1250 | 724      | 895       | 109,654     | 2019/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 8.7500 | 642      | 844       | 103,409     | 2020/08/15 |  |

| 2015年12月18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 | 8.0000 | 2,106    | 2,823     | 345,790     | 2021/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 6.2500 | 654      | 847       | 103,790     | 2023/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 6.0000 | 855      | 1,146     | 140,418     | 2026/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 6.5000 | 630      | 885       | 108,512     | 2026/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 6.1250 | 709      | 987       | 120,911     | 2027/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 5.5000 | 700      | 937       | 114,788     | 2028/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 5.2500 | 438      | 576       | 70,554      | 2028/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 5.2500 | 473      | 624       | 76,436      | 2029/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 6.2500 | 964      | 1,409     | 172,645     | 2030/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 5.3750 | 1,241    | 1,699     | 208,110     | 2031/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,926    | 2,507     | 307,131     | 2036/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 5.0000 | 547      | 761       | 93,231      | 2037/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.3750 | 548      | 701       | 85,971      | 2038/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,019    | 1,328     | 162,671     | 2038/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.5000 | 255      | 286       | 35,102      | 2039/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.2500 | 694      | 870       | 106,584     | 2039/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.5000 | 760      | 987       | 120,910     | 2039/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.3750 | 810      | 1,033     | 126,617     | 2039/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.6250 | 1,307    | 1,727     | 211,611     | 2040/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.3750 | 1,478    | 1,888     | 231,278     | 2040/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.8750 | 1,591    | 1,888     | 231,314     | 2040/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,677    | 2,104     | 257,796     | 2040/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,754    | 2,366     | 289,882     | 2041/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 4.3750 | 1,365    | 1,748     | 214,210     | 2041/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,367    | 1,594     | 195,333     | 2041/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.1250 | 1,450    | 1,521     | 186,338     | 2041/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.1250 | 2,377    | 2,491     | 305,122     | 2042/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.0000 | 2,353    | 2,403     | 294,456     | 2042/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,731    | 1,680     | 205,783     | 2042/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.7500 | 3,984    | 3,857     | 472,520     | 2042/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.1250 | 2,026    | 2,109     | 258,361     | 2043/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.8750 | 3,998    | 3,962     | 485,351     | 2043/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.6250 | 3,314    | 3,792     | 464,601     | 2043/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.7500 | 3,581    | 4,191     | 513,476     | 2043/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.6250 | 3,617    | 4,136     | 506,663     | 2044/02/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.3750 | 2,993    | 3,263     | 399,776     | 2044/05/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.8750 | 2,583    | 2,579     | 315,907     | 2017/07/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.6250 | 3,326    | 3,341     | 409,340     | 2019/07/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,834    | 2,893     | 354,402     | 2021/07/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.3750 | 5,662    | 5,738     | 702,908     | 2024/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.1250 | 3,729    | 3,872     | 474,355     | 2044/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.8750 | 1,818    | 1,814     | 222,241     | 2017/08/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.6250 | 1,189    | 1,193     | 146,208     | 2019/08/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,301    | 1,309     | 160,342     | 2021/08/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,187    | 2,186     | 267,874     | 2017/09/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.7500 | 3,404    | 3,430     | 420,179     | 2019/09/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.1250 | 3,625    | 3,668     | 449,398     | 2021/09/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.8750 | 1,466    | 1,461     | 179,044     | 2017/10/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.5000 | 3,190    | 3,182     | 389,766     | 2019/10/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 2,163    | 2,172     | 266,146     | 2021/10/31 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.2500 | 5,921    | 5,935     | 727,076     | 2024/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.0000 | 3,227    | 3,266     | 400,089     | 2044/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.8750 | 1,593    | 1,588     | 194,523     | 2017/11/15 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.8750 | 2,886    | 2,879     | 352,689     | 2021/11/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.5000 | 4,325    | 4,312     | 528,254     | 2019/11/30 |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 0.5000 | 444      | 442       | 54,255      | 2016/11/30 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2015年12月18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  |            |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.0000 | % 千アメリカ・ドル<br>717 | 千アメリカ・ドル<br>716 | 千円<br>87,732 | 2017/12/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.1250 | 3,169             | 3,201           | 392,141      | 2021/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.6250 | 2,204             | 2,206           | 270,262      | 2019/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.6250 | 1,544             | 1,541           | 188,820      | 2016/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.8750 | 1,547             | 1,540           | 188,669      | 2018/01/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.2500 | 3,963             | 3,904           | 478,219      | 2020/01/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.5000 | 2,386             | 2,377           | 291,232      | 2017/01/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.5000 | 2,427             | 2,362           | 289,339      | 2022/01/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.0000 | 6,275             | 6,151           | 753,552      | 2025/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.5000 | 3,763             | 3,430           | 420,202      | 2045/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,961             | 1,956           | 239,592      | 2018/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.3750 | 2,788             | 2,758           | 337,926      | 2020/02/29 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.5000 | 970               | 966             | 118,336      | 2017/02/28 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.7500 | 1,809             | 1,785           | 218,743      | 2022/02/28 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,081             | 2,074           | 254,154      | 2018/03/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.3750 | 2,792             | 2,759           | 338,035      | 2020/03/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.5000 | 2,159             | 2,148           | 263,226      | 2017/03/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.7500 | 2,083             | 2,063           | 252,702      | 2018/04/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,891             | 2,851           | 349,302      | 2022/03/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,180             | 2,169           | 265,786      | 2018/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.1250 | 6,188             | 6,126           | 750,441      | 2025/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.0000 | 4,035             | 4,080           | 499,767      | 2045/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.3750 | 2,607             | 2,574           | 315,314      | 2020/04/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,612             | 2,574           | 315,368      | 2022/04/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.5000 | 2,323             | 2,310           | 283,064      | 2017/04/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.8750 | 2,826             | 2,804           | 343,505      | 2022/05/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.5000 | 3,013             | 2,990           | 366,349      | 2020/05/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.1250 | 2,196             | 2,191           | 268,428      | 2018/06/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.6250 | 3,001             | 2,992           | 366,500      | 2020/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.6250 | 2,313             | 2,301           | 281,911      | 2017/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.1250 | 2,021             | 2,035           | 249,309      | 2022/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.8750 | 2,189             | 2,169           | 265,773      | 2018/07/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.6250 | 3,135             | 3,123           | 382,654      | 2020/07/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.6250 | 1,374             | 1,366           | 167,387      | 2017/07/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.0000 | 2,179             | 2,177           | 266,676      | 2022/07/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.0000 | 6,143             | 6,011           | 736,345      | 2025/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.8750 | 3,573             | 3,525           | 431,875      | 2045/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.0000 | 14                | 13              | 1,703        | 2018/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.8750 | 2,445             | 2,420           | 296,538      | 2022/08/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.3750 | 2,868             | 2,825           | 346,112      | 2020/08/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,179             | 2,163           | 264,975      | 2018/09/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,472             | 2,427           | 297,305      | 2022/09/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.3750 | 2,876             | 2,830           | 346,665      | 2020/09/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.8750 | 2,057             | 2,033           | 249,134      | 2018/10/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,002             | 2,004           | 245,511      | 2025/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.3750 | 3,116             | 3,064           | 375,323      | 2020/10/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.0000 | 1,401             | 1,418           | 173,806      | 2045/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.8750 | 2,558             | 2,530           | 309,948      | 2022/10/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.2500 | 2,138             | 2,134           | 261,422      | 2018/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.8750 | 2,277             | 2,271           | 278,220      | 2017/11/30 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額                         | 233銘柄   |        | 554,707           | 569,247         | 69,727,092   |            |  |
| カナダ           | Canada Government International Bond | 国 債 証 券 | 2.7500 | 千カナダ・ドル<br>285    | 千カナダ・ドル<br>337  | 29,598       | 2064/12/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 8.0000 | 386               | 641             | 56,281       | 2027/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 5.7500 | 983               | 1,441           | 126,540      | 2029/06/01 |  |

| 2015年12月18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 | 5.7500 | 1,017       | 1,573       | 138,081     | 2033/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 5.0000 | 1,386       | 2,066       | 181,413     | 2037/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,747       | 1,834       | 161,040     | 2017/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 4.2500 | 969         | 1,056       | 92,701      | 2018/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 3.7500 | 2,199       | 2,433       | 213,574     | 2019/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,413       | 1,915       | 168,152     | 2041/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,476       | 1,655       | 145,328     | 2020/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 3.2500 | 956         | 1,074       | 94,328      | 2021/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,461       | 1,612       | 141,514     | 2022/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,491       | 1,927       | 169,227     | 2045/12/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,327       | 1,342       | 117,871     | 2017/03/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.5000 | 780         | 792         | 69,594      | 2017/09/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,625       | 1,656       | 145,401     | 2023/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.2500 | 1,265       | 1,285       | 112,799     | 2018/03/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.2500 | 1,021       | 1,039       | 91,278      | 2018/09/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 2.5000 | 1,105       | 1,207       | 105,975     | 2024/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,463       | 1,479       | 129,845     | 2017/02/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.7500 | 853         | 883         | 77,593      | 2019/03/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.7500 | 827         | 859         | 75,489      | 2019/09/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.2500 | 975         | 986         | 86,585      | 2017/08/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 2.7500 | 455         | 514         | 45,150      | 2048/12/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,047       | 1,121       | 98,472      | 2025/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.5000 | 829         | 856         | 75,206      | 2020/03/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.2500 | 98          | 99          | 8,732       | 2018/02/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,018       | 1,014       | 89,048      | 2017/05/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 0.7500 | 649         | 648         | 56,886      | 2020/09/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.5000 | 505         | 501         | 44,034      | 2026/06/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 0.2500 | 36          | 35          | 3,143       | 2017/11/01 |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 0.7500 | 363         | 360         | 31,633      | 2021/03/01 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額               | 32銘柄    |        | 32,010      | 36,255      | 3,182,527   |            |
| 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       | 1,815       | 158,347     | 2017/02/15 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.2500 | 2,506       | 2,748       | 239,814     | 2019/03/15 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.7500 | 2,050       | 2,399       | 209,305     | 2021/05/15 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.5000 | 2,459       | 2,689       | 234,623     | 2020/04/15 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.7500 | 1,882       | 2,245       | 195,929     | 2022/07/15 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.5000 | 2,063       | 2,206       | 192,457     | 2018/01/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.5000 | 1,918       | 2,279       | 198,904     | 2023/04/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,385       | 1,432       | 124,953     | 2017/07/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,662       | 1,944       | 169,624     | 2027/04/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 2,173       | 2,167       | 189,121     | 2024/04/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 964         | 975         | 85,136      | 2029/04/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 2,148       | 2,219       | 193,637     | 2025/04/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.5000 | 958         | 1,108       | 96,719      | 2033/04/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 671         | 691         | 60,366      | 2018/10/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,956       | 2,189       | 191,031     | 2026/04/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,029       | 1,050       | 91,631      | 2019/10/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 763         | 796         | 69,510      | 2037/04/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 354         | 319         | 27,895      | 2035/06/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 654         | 636         | 55,569      | 2020/11/21 |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 402         | 385         | 33,654      | 2039/06/21 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額               | 20銘柄    |        | 29,734      | 32,304      | 2,818,233   |            |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2015年12月18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 |            |  |
| シンガポール        | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 4.0000 | %千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | 千円          |            |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 3.2500 | 391         | 420        | 36,301      | 2018/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 3.5000 | 696         | 739        | 63,860      | 2020/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 3.1250 | 442         | 481        | 41,520      | 2027/03/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.5000 | 438         | 463        | 39,972      | 2022/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 3.0000 | 599         | 621        | 53,606      | 2019/06/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.3750 | 768         | 804        | 69,393      | 2024/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.8750 | 580         | 591        | 51,050      | 2017/04/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.2500 | 279         | 281        | 24,312      | 2030/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.7500 | 307         | 310        | 26,759      | 2021/06/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 0.5000 | 370         | 359        | 31,034      | 2042/04/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.7500 | 272         | 268        | 23,175      | 2018/04/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.7500 | 151         | 155        | 13,409      | 2023/07/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 3.3750 | 173         | 186        | 16,064      | 2033/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.8750 | 435         | 443        | 38,253      | 2029/07/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 1.6250 | 70          | 70         | 6,062       | 2019/10/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.3750 | 224         | 221        | 19,136      | 2025/06/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 2.0000 | 224         | 225        | 19,481      | 2020/07/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT | 国 債 証 券 | 1.3750 | 190         | 191        | 16,511      | 2017/10/01 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額         | 18銘柄    |        | 6,609       | 6,835      | 589,906     |            |  |
| イギリス          | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 2.0000 | 千イギリス・ポンド   | 千イギリス・ポンド  |             |            |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 2.0000 | 2,380       | 2,461      | 449,475     | 2020/07/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,821       | 1,844      | 336,888     | 2025/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 2.5000 | 554         | 558        | 101,955     | 2021/01/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 8.7500 | 412         | 418        | 76,363      | 2065/07/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 8.0000 | 595         | 678        | 123,896     | 2017/08/25 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 6.0000 | 1,102       | 1,491      | 272,453     | 2021/06/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 949         | 1,381      | 252,198     | 2028/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 5.0000 | 1,840       | 2,325      | 424,707     | 2032/06/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,662       | 2,124      | 387,870     | 2025/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,912       | 2,445      | 446,633     | 2036/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,457       | 2,018      | 368,550     | 2038/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,724       | 1,986      | 362,672     | 2020/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,708       | 2,495      | 455,776     | 2055/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,666       | 2,271      | 414,784     | 2046/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,232       | 1,527      | 278,924     | 2027/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 5.0000 | 1,604       | 1,759      | 321,347     | 2018/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,666       | 2,292      | 418,587     | 2042/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,800       | 2,380      | 434,670     | 2030/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,773       | 2,479      | 452,756     | 2049/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,820       | 2,030      | 370,836     | 2019/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,246       | 1,619      | 295,677     | 2039/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,391       | 1,608      | 293,788     | 2022/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,870       | 2,453      | 448,022     | 2034/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,428       | 1,571      | 286,895     | 2019/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,144       | 1,625      | 296,896     | 2060/01/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,795       | 2,006      | 366,496     | 2020/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,657       | 2,171      | 396,446     | 2040/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,843       | 2,087      | 381,244     | 2021/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 1.7500 | 1,010       | 1,024      | 187,073     | 2017/01/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,182       | 1,540      | 281,246     | 2052/07/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,392       | 2,408      | 439,817     | 2017/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,242       | 2,276      | 415,634     | 2022/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 3.2500 | 2,012       | 2,275      | 415,578     | 2044/01/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 1.2500 | 2,854       | 2,887      | 527,214     | 2018/07/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt  | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,167       | 2,261      | 413,048     | 2023/09/07 |  |

| 2015年12月18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 |            |
|               | United Kingdom Gilt       |      | 国 債 証 券 | %       | 千イギリス・ポンド    | 千イギリス・ポンド    | 千円          |            |
|               | United Kingdom Gilt       |      | 国 債 証 券 | 3.5000  | 1,506        | 1,975        | 360,703     | 2068/07/22 |
|               | United Kingdom Gilt       |      | 国 債 証 券 | 1.7500  | 1,781        | 1,825        | 333,294     | 2019/07/22 |
|               | United Kingdom Gilt       |      | 国 債 証 券 | 2.7500  | 2,012        | 2,172        | 396,767     | 2024/09/07 |
|               | United Kingdom Gilt       |      | 国 債 証 券 | 3.5000  | 1,106        | 1,311        | 239,411     | 2045/01/22 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数 額                   | 39銘柄 |         |         | 62,315       | 74,073       | 13,526,608  |            |
|               |                           |      |         |         |              |              |             |            |
| スイス           | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 | 4.0000  | 千スイス・フラン     | 千スイス・フラン     |             |            |
|               | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 | 4.0000  | 420          | 554          | 68,280      | 2023/02/11 |
|               | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 | 4.0000  | 506          | 751          | 92,551      | 2028/04/08 |
|               | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 | 4.2500  | 495          | 532          | 65,598      | 2017/06/05 |
|               | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 | 3.0000  | 568          | 614          | 75,641      | 2018/01/08 |
|               | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 | 3.0000  | 527          | 597          | 73,547      | 2019/05/12 |
|               | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 | 2.2500  | 457          | 520          | 64,035      | 2020/07/06 |
|               | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 | 2.0000  | 370          | 423          | 52,112      | 2021/04/28 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数 額                   | 7銘柄  |         |         | 3,343        | 3,993        | 491,767     |            |
|               |                           |      |         |         |              |              |             |            |
| デンマーク         | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 | 7.0000  | 千デンマーク・クローネ  | 千デンマーク・クローネ  |             |            |
|               | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 | 4.0000  | 1,864        | 2,906        | 51,730      | 2024/11/10 |
|               | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 | 4.0000  | 6,576        | 7,132        | 126,962     | 2017/11/15 |
|               | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 | 4.5000  | 11,932       | 19,388       | 345,107     | 2039/11/15 |
|               | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 | 4.0000  | 8,601        | 9,981        | 177,677     | 2019/11/15 |
|               | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 | 3.0000  | 6,150        | 7,149        | 127,262     | 2021/11/15 |
|               | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 | 1.5000  | 5,846        | 6,287        | 111,919     | 2023/11/15 |
|               | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 | 1.7500  | 3,309        | 3,588        | 63,881      | 2025/11/15 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数 額                   | 7銘柄  |         |         | 44,278       | 56,434       | 1,004,541   |            |
|               |                           |      |         |         |              |              |             |            |
| ノルウェー         | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 4.2500  | 千ノルウェー・クローネ  | 千ノルウェー・クローネ  |             |            |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 4.5000  | 5,755        | 6,046        | 84,536      | 2017/05/19 |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 3.7500  | 5,075        | 5,724        | 80,025      | 2019/05/22 |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 2.0000  | 6,698        | 7,660        | 107,099     | 2021/05/25 |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 3.0000  | 5,149        | 5,413        | 75,682      | 2023/05/24 |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 3.0000  | 4,095        | 4,606        | 64,393      | 2024/03/14 |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 1.7500  | 2,690        | 2,750        | 38,457      | 2025/03/13 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数 額                   | 6銘柄  |         |         | 29,462       | 32,202       | 450,195     |            |
|               |                           |      |         |         |              |              |             |            |
| スウェーデン        | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 | 5.0000  | 千スウェーデン・クローネ | 千スウェーデン・クローネ |             |            |
|               | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 | 3.7500  | 6,055        | 7,466        | 106,919     | 2020/12/01 |
|               | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 | 4.2500  | 5,175        | 5,534        | 79,260      | 2017/08/12 |
|               | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 | 3.5000  | 10,220       | 11,675       | 167,195     | 2019/03/12 |
|               | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 | 3.5000  | 4,475        | 5,621        | 80,498      | 2039/03/30 |
|               | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 | 3.5000  | 7,555        | 8,955        | 128,240     | 2022/06/01 |
|               | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 | 1.5000  | 6,725        | 7,094        | 101,597     | 2023/11/13 |
|               | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 | 2.5000  | 4,760        | 5,410        | 77,473      | 2025/05/12 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数 額                   | 7銘柄  |         |         | 44,965       | 51,758       | 741,184     |            |
|               |                           |      |         |         |              |              |             |            |
| メキシコ          | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 5.0000  | 千メキシコ・ペソ     | 千メキシコ・ペソ     |             |            |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 5.7500  | 8,802        | 8,756        | 62,958      | 2019/12/11 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 8.0000  | 2,298        | 2,204        | 15,849      | 2026/03/05 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 10.0000 | 8,233        | 9,229        | 66,362      | 2023/12/07 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 7.5000  | 20,222       | 25,572       | 183,868     | 2024/12/05 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 7.5000  | 8,568        | 9,280        | 66,728      | 2027/06/03 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 7.2500  | 12,639       | 13,103       | 94,213      | 2016/12/15 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 7.7500  | 13,756       | 14,753       | 106,078     | 2017/12/14 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 10.0000 | 6,874        | 9,223        | 66,317      | 2036/11/20 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 8.5000  | 8,844        | 10,304       | 74,091      | 2029/05/31 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 | 8.5000  | 18,570       | 20,497       | 147,376     | 2018/12/13 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2015年12月18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 |            |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | %       | 千メキシコ・ペソ     | 千メキシコ・ペソ     | 千円          |            |  |
|               |                          |         | 8.5000  | 9,694        | 11,389       | 81,888      | 2038/11/18 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 8.0000  | 12,728       | 14,160       | 101,814     | 2020/06/11 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 6.5000  | 13,441       | 14,020       | 100,804     | 2021/06/10 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 7.7500  | 17,015       | 18,698       | 134,445     | 2031/05/29 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 6.5000  | 14,299       | 14,743       | 106,008     | 2022/06/09 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 7.7500  | 9,654        | 10,574       | 76,031      | 2042/11/13 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 5.0000  | 9,290        | 9,459        | 68,012      | 2017/06/15 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 4.7500  | 13,133       | 13,213       | 95,004      | 2018/06/14 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 7.7500  | 2,875        | 3,157        | 22,701      | 2034/11/23 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数 額                  | 19銘柄    |         | 210,935      | 232,344      | 1,670,553   |            |  |
| マレーシア         | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.2400  | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット |             |            |  |
|               |                          |         |         | 1,210        | 1,234        | 34,982      | 2018/02/07 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 5.7340  | 1,417        | 1,512        | 42,848      | 2019/07/30 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.8140  | 1,015        | 1,031        | 29,223      | 2017/02/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.5020  | 573          | 518          | 14,685      | 2027/05/31 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 5.2480  | 738          | 783          | 22,206      | 2028/09/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.3780  | 1,603        | 1,647        | 46,683      | 2019/11/29 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.0120  | 1,427        | 1,454        | 41,198      | 2017/09/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.4980  | 578          | 571          | 16,191      | 2030/04/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.1600  | 1,916        | 1,926        | 54,578      | 2021/07/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.3920  | 1,514        | 1,517        | 43,003      | 2026/04/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.5800  | 1,595        | 1,606        | 45,516      | 2018/09/28 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.4180  | 875          | 834          | 23,630      | 2022/08/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.8920  | 731          | 693          | 19,648      | 2027/03/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.1270  | 618          | 581          | 16,485      | 2032/04/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.3140  | 399          | 403          | 11,422      | 2017/10/31 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.4920  | 444          | 439          | 12,457      | 2020/03/31 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.2600  | 533          | 533          | 15,122      | 2018/03/01 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.4800  | 401          | 382          | 10,826      | 2023/03/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.8440  | 477          | 428          | 12,130      | 2033/04/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.7330  | 586          | 541          | 15,328      | 2028/06/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.8890  | 656          | 658          | 18,655      | 2020/07/31 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.9350  | 400          | 407          | 11,546      | 2043/09/30 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.1810  | 1,057        | 1,048        | 29,705      | 2024/07/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.3940  | 340          | 343          | 9,731       | 2017/03/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.0480  | 857          | 857          | 24,282      | 2021/09/30 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.6540  | 648          | 648          | 18,365      | 2019/10/31 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.9550  | 404          | 392          | 11,128      | 2025/09/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.6590  | 700          | 697          | 19,755      | 2020/10/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.7950  | 1,161        | 1,138        | 32,253      | 2022/09/30 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.7590  | 768          | 776          | 21,987      | 2019/03/15 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数 額                  | 30銘柄    |         | 25,641       | 25,611       | 725,583     |            |  |
| 南アフリカ         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.2500  | 千南アフリカ・ランド   | 千南アフリカ・ランド   |             |            |  |
|               |                          |         |         | 5,462        | 5,469        | 44,029      | 2017/09/15 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.0000  | 4,178        | 4,118        | 33,152      | 2018/12/21 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 7.2500  | 5,768        | 5,459        | 43,947      | 2020/01/15 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 10.5000 | 13,703       | 14,722       | 118,516     | 2026/12/21 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 6.2500  | 7,612        | 5,133        | 41,321      | 2036/03/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 6.7500  | 7,086        | 6,419        | 51,678      | 2021/03/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 6.5000  | 9,804        | 6,670        | 53,694      | 2041/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 7.0000  | 8,999        | 6,976        | 56,160      | 2031/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 7.7500  | 2,839        | 2,615        | 21,050      | 2023/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.7500  | 8,752        | 7,633        | 61,446      | 2048/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.5000  | 6,321        | 5,456        | 43,922      | 2037/01/31 |  |

| 2015年12月18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 |            |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国 債 証 券 | %      | 千南アフリカ・ランド  | 千南アフリカ・ランド  | 千円          |            |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国 債 証 券 | 8.0000 | 3,801       | 3,281       | 26,419      | 2030/01/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国 債 証 券 | 8.7500 | 2,902       | 2,530       | 20,368      | 2044/01/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国 債 証 券 | 8.2500 | 4,943       | 4,228       | 34,036      | 2032/03/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国 債 証 券 | 8.8750 | 3,166       | 2,803       | 22,567      | 2035/02/28 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額                | 15銘柄    |        | 95,336      | 83,517      | 672,312     |            |  |
| ポーランド         | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 5.7500 | 2,309       | 2,742       | 84,678      | 2022/09/23 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 5.2500 | 2,029       | 2,155       | 66,562      | 2017/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 5.5000 | 1,912       | 2,143       | 66,204      | 2019/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | —      | 812         | 790         | 24,395      | 2017/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 1.5000 | 782         | 754         | 23,303      | 2020/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 2.5000 | 601         | 568         | 17,561      | 2026/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,227       | 1,197       | 36,988      | 2021/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 5.7500 | 627         | 794         | 24,528      | 2029/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 5.2500 | 2,256       | 2,545       | 78,600      | 2020/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 5.7500 | 2,284       | 2,685       | 82,943      | 2021/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,177       | 1,224       | 37,801      | 2017/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 4.0000 | 3,083       | 3,335       | 102,985     | 2023/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,720       | 1,794       | 55,402      | 2018/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,099       | 2,132       | 65,843      | 2018/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,840       | 1,908       | 58,945      | 2019/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond      | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,891       | 1,940       | 59,913      | 2025/07/25 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額                | 16銘柄    |        | 26,649      | 28,713      | 886,658     |            |  |
| ユーロ (アイルランド)  | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 4.5000 | 千ユーロ<br>759 | 千ユーロ<br>857 | 113,908     | 2018/10/18 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 4.4000 | 684         | 789         | 104,851     | 2019/06/18 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 5.9000 | 570         | 697         | 92,631      | 2019/10/18 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 5.4000 | 1,131       | 1,556       | 206,734     | 2025/03/13 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 5.0000 | 765         | 941         | 125,057     | 2020/10/18 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 5.5000 | 169         | 186         | 24,787      | 2017/10/18 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 3.9000 | 504         | 618         | 82,133      | 2023/03/20 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 3.4000 | 847         | 1,013       | 134,613     | 2024/03/18 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 2.4000 | 761         | 837         | 111,311     | 2030/05/15 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 0.8000 | 372         | 380         | 50,517      | 2022/03/15 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 2.0000 | 391         | 381         | 50,624      | 2045/02/18 |  |
|               | IRISH TREASURY              | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,035       | 1,230       | 163,407     | 2020/04/18 |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額                | 12銘柄    |        | 7,988       | 9,490       | 1,260,577   |            |  |
| ユーロ (オランダ)    | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 7.5000 | 千ユーロ<br>214 | 千ユーロ<br>321 | 42,733      | 2023/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.5000 | 1,239       | 1,881       | 249,965     | 2028/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,195       | 1,778       | 236,253     | 2037/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 991         | 1,228       | 163,232     | 2023/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,405       | 1,511       | 200,804     | 2017/07/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 2,093       | 2,323       | 308,675     | 2018/07/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,347       | 1,549       | 205,785     | 2019/07/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,146       | 1,332       | 176,965     | 2020/07/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,349       | 2,043       | 271,428     | 2042/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,463       | 1,720       | 228,559     | 2021/07/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 1,465       | 1,509       | 200,554     | 2017/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,438       | 1,627       | 216,180     | 2022/07/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 968         | 1,153       | 153,206     | 2033/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.2500 | 1,477       | 1,524       | 202,495     | 2018/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 1,385       | 1,523       | 202,305     | 2023/07/15 |  |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2015年12月18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  |            |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.2500 | 千ユーロ<br>575   | 千ユーロ<br>601   | 千円<br>79,901 | 2019/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 317           | 320           | 42,578       | 2017/04/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 955           | 1,249         | 165,925      | 2047/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,620         | 1,810         | 240,492      | 2024/07/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,374         | 1,395         | 185,308      | 2020/01/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | —      | 749           | 753           | 100,137      | 2018/04/15 |  |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.2500 | 943           | 898           | 119,342      | 2025/07/15 |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数 額<br>22銘柄             |         |        | 25,708        | 30,059        | 3,992,831    |            |  |
| ユーロ（ベルギー）     | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 0.8000 | 千ユーロ<br>1,163 | 千ユーロ<br>1,150 | 152,814      | 2025/06/22 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 1.0000 | 349           | 323           | 42,910       | 2031/06/22 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 1.9000 | 358           | 361           | 48,061       | 2038/06/22 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 5.5000 | 1,706         | 2,537         | 337,013      | 2028/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 5.5000 | 810           | 894           | 118,750      | 2017/09/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 5.0000 | 1,704         | 2,641         | 350,823      | 2035/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,377         | 1,696         | 225,282      | 2022/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.0000 | 209           | 220           | 29,302       | 2017/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.0000 | 966           | 1,060         | 140,925      | 2018/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,121         | 1,276         | 169,538      | 2019/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,636         | 1,927         | 256,036      | 2020/09/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,396         | 2,083         | 276,736      | 2041/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,656         | 2,044         | 271,509      | 2021/09/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,202         | 1,272         | 168,981      | 2017/06/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.5000 | 801           | 1,076         | 143,013      | 2026/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,316         | 1,657         | 220,118      | 2022/09/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 4.0000 | 777           | 1,052         | 139,755      | 2032/03/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 3.0000 | 1,123         | 1,255         | 166,813      | 2019/09/28 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,338         | 1,506         | 200,091      | 2023/06/22 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 1.2500 | 1,052         | 1,092         | 145,164      | 2018/06/22 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 3.7500 | 753           | 1,062         | 141,078      | 2045/06/22 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 2.6000 | 1,505         | 1,738         | 230,935      | 2024/06/22 |  |
|               | Belgium Government Bond     | 国 債 証 券 | 3.0000 | 497           | 603           | 80,133       | 2034/06/22 |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数 額<br>23銘柄             |         |        | 24,815        | 30,533        | 4,055,792    |            |  |
| ユーロ（フランス）     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 8.5000 | 千ユーロ<br>653   | 千ユーロ<br>869   | 115,524      | 2019/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 8.5000 | 1,285         | 2,035         | 270,384      | 2023/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 6.0000 | 2,225         | 3,311         | 439,903      | 2025/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 5.5000 | 2,623         | 3,981         | 528,831      | 2029/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 5.7500 | 2,507         | 4,092         | 543,650      | 2032/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.7500 | 2,113         | 3,204         | 425,669      | 2035/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.2500 | 3,075         | 3,530         | 468,964      | 2019/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,721         | 2,639         | 350,670      | 2055/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 3.7500 | 3,230         | 3,855         | 512,124      | 2021/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.0000 | 2,222         | 3,156         | 419,308      | 2038/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 3.7500 | 3,288         | 3,468         | 460,735      | 2017/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.2500 | 3,397         | 4,362         | 579,474      | 2023/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.2500 | 3,148         | 3,413         | 453,440      | 2017/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.0000 | 2,931         | 3,225         | 428,471      | 2018/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.2500 | 2,467         | 2,781         | 369,524      | 2018/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.5000 | 2,365         | 3,655         | 485,589      | 2041/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 3.7500 | 3,263         | 3,746         | 497,636      | 2019/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 3.5000 | 3,590         | 4,138         | 549,728      | 2020/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,017         | 1,582         | 210,225      | 2060/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国 債 証 券 | 3.5000 | 3,146         | 3,930         | 522,103      | 2026/04/25 |  |

| 2015年12月18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   |            |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 千ユーロ<br>3,113 | 千ユーロ<br>3,478 | 千円<br>462,086 | 2020/10/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 3,760         | 4,425         | 587,821       | 2021/10/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.0000 | 3,480         | 4,072         | 540,978       | 2022/04/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 3,099         | 3,637         | 483,133       | 2027/10/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,940         | 2,184         | 290,210       | 2022/10/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,114         | 2,178         | 289,358       | 2018/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 788           | 1,023         | 135,956       | 2045/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,747         | 2,995         | 397,920       | 2023/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,659         | 2,753         | 365,729       | 2018/11/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,486         | 2,807         | 372,912       | 2024/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,764         | 1,832         | 243,377       | 2019/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,787         | 3,186         | 423,264       | 2030/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,799         | 3,037         | 403,452       | 2024/11/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 2,322         | 2,373         | 315,272       | 2019/11/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 2,792         | 2,702         | 358,971       | 2025/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | —      | 1,870         | 1,868         | 248,198       | 2020/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | —      | 113           | 113           | 15,099        | 2018/02/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,099         | 1,105         | 146,797       | 2025/11/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.2500 | 729           | 735           | 97,632        | 2020/11/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.5000 | 602           | 603           | 80,111        | 2031/05/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,315         | 2,371         | 315,026       | 2017/02/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,868         | 1,907         | 253,374       | 2017/07/25 |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額           | 42銘柄    |        | 97,512        | 116,379       | 15,458,651    |            |
| ユーロ (ドイツ)     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 6.2500 | 千ユーロ<br>774   | 千ユーロ<br>1,136 | 151,001       | 2024/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 6.5000 | 1,067         | 1,750         | 232,494       | 2027/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.6250 | 1,362         | 2,119         | 281,473       | 2028/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,113         | 1,634         | 217,096       | 2028/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 6.2500 | 951           | 1,622         | 215,465       | 2030/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.5000 | 1,304         | 2,122         | 281,989       | 2031/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,775         | 2,841         | 377,423       | 2034/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 2,071         | 3,121         | 414,652       | 2037/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 2,185         | 2,278         | 302,719       | 2017/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,225         | 1,962         | 260,729       | 2039/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2500 | 2,099         | 2,248         | 298,605       | 2017/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,798         | 1,958         | 260,110       | 2018/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2500 | 2,211         | 2,469         | 328,022       | 2018/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,399         | 2,414         | 320,726       | 2040/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 2,682         | 3,012         | 400,172       | 2019/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.5000 | 2,481         | 2,810         | 373,374       | 2019/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 2,075         | 2,363         | 313,922       | 2020/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.0000 | 2,247         | 2,565         | 340,765       | 2020/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,374         | 1,968         | 261,525       | 2042/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,444         | 1,604         | 213,102       | 2020/09/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,333         | 2,633         | 349,840       | 2021/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,674         | 1,975         | 262,341       | 2021/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,415         | 1,595         | 211,941       | 2021/09/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,707         | 1,906         | 253,274       | 2022/01/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,222         | 2,458         | 326,552       | 2022/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 1,376         | 1,757         | 233,486       | 2044/07/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,644         | 1,793         | 238,216       | 2022/09/04 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,410         | 1,538         | 204,352       | 2023/02/15 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,817         | 1,983         | 263,459       | 2023/05/15 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.0000 | 1,707         | 1,929         | 256,260       | 2023/08/15 |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 1,291         | 1,435         | 190,713       | 2024/02/15 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2015年12月18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 |            |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 2.5000 | 1,204   | 1,542     | 204,836     | 2046/08/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,705   | 1,861     | 247,251     | 2024/05/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 1.0000 | 2,142   | 2,243     | 297,939     | 2024/08/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.5000 | 1,379   | 1,374     | 182,527     | 2025/02/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,549   | 1,606     | 213,376     | 2025/08/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | －      | 485     | 486       | 64,658      | 2016/12/16 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | －      | 492     | 493       | 65,617      | 2017/03/10 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | －      | 795     | 799       | 106,136     | 2017/06/16 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | －      | 307     | 308       | 41,023      | 2017/09/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.7500 | 1,717   | 1,738     | 230,970     | 2017/02/24 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.5000 | 1,848   | 1,867     | 248,108     | 2017/04/07 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.5000 | 1,811   | 1,838     | 244,218     | 2017/10/13 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.5000 | 890     | 906       | 120,371     | 2018/02/23 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,392   | 1,410     | 187,388     | 2018/04/13 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,209   | 1,253     | 166,533     | 2018/10/12 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,674   | 1,742     | 231,427     | 2019/02/22 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.5000 | 1,113   | 1,141     | 151,617     | 2019/04/12 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,151   | 1,171     | 155,671     | 2019/10/11 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | －      | 1,731   | 1,742     | 231,416     | 2020/04/17 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国 債 証 券 | 0.2500 | 966     | 980       | 130,287     | 2020/10/16 |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額            | 51銘柄    |        | 77,793  | 91,524    | 12,157,191  |            |  |
| ユーロ (スペイン)    | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 6.0000 | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 2,108   | 3,044     | 404,370     | 2029/01/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.6000 | 1,735   | 1,747     | 232,130     | 2017/10/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.9500 | 1,745   | 1,737     | 230,856     | 2025/04/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.2500 | 527     | 508       | 67,512      | 2030/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.1500 | 12      | 12        | 1,595       | 2018/04/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.1500 | 1,642   | 1,703     | 226,261     | 2025/10/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.7500 | 609     | 621       | 82,558      | 2020/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.5000 | 1,679   | 2,460     | 326,869     | 2032/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2000 | 1,654   | 1,797     | 238,762     | 2017/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2000 | 1,494   | 1,869     | 248,351     | 2037/01/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.9000 | 2,135   | 2,224     | 295,460     | 2017/01/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.1000 | 1,228   | 1,695     | 225,203     | 2040/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.8000 | 2,206   | 2,427     | 322,424     | 2018/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.6000 | 1,777   | 2,229     | 296,124     | 2024/01/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.3000 | 2,382   | 2,737     | 363,582     | 2019/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.7000 | 1,775   | 2,032     | 270,028     | 2019/10/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,173   | 1,581     | 210,087     | 2041/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.6500 | 2,101   | 2,403     | 319,206     | 2020/04/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.8500 | 1,789   | 2,256     | 299,681     | 2025/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.5000 | 1,681   | 2,008     | 266,848     | 2020/10/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.9000 | 2,515   | 3,128     | 415,496     | 2021/04/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.8500 | 1,265   | 1,759     | 233,652     | 2026/07/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,978   | 2,543     | 337,912     | 2022/01/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.4000 | 2,000   | 2,182     | 289,850     | 2018/01/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.4000 | 1,758   | 2,251     | 299,076     | 2023/01/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.1500 | 1,350   | 1,650     | 219,199     | 2023/10/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,270   | 1,703     | 226,298     | 2028/10/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.1500 | 1,564   | 1,719     | 228,406     | 2018/10/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.1000 | 1,049   | 1,520     | 201,928     | 2044/10/31 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,488   | 1,528     | 203,074     | 2017/04/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.8000 | 1,836   | 1,981     | 263,142     | 2019/04/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,970   | 2,315     | 307,599     | 2024/04/30 |  |
|               | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,849   | 2,019     | 268,316     | 2024/10/31 |  |

| 2015年12月18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   |            |
|               |              | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | %<br>1.4000 | 千ユーロ<br>1,900 | 千ユーロ<br>1,964 | 千円<br>260,894 | 2020/01/31 |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額 | 34銘柄                              |         |             | 55,244        | 65,367        | 8,682,765     |            |
| ユーロ (イタリア)    |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 9.0000      | 1,106         | 1,741         | 231,387       | 2023/11/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 7.2500      | 1,110         | 1,718         | 228,215       | 2026/11/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 6.5000      | 2,722         | 4,063         | 539,738       | 2027/11/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 2.5000      | 1,814         | 1,965         | 261,027       | 2024/12/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 0.7500      | 1,743         | 1,765         | 234,520       | 2018/01/15 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.0500      | 1,445         | 1,478         | 196,342       | 2019/12/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 3.2500      | 1,129         | 1,273         | 169,115       | 2046/09/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.3500      | 1,229         | 1,256         | 166,947       | 2022/04/15 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.5000      | 1,193         | 1,190         | 158,157       | 2025/06/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.6500      | 577           | 547           | 72,775        | 2032/03/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 0.2500      | 128           | 128           | 17,031        | 2018/05/15 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 0.7000      | 1,211         | 1,219         | 161,931       | 2020/05/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 2.0000      | 357           | 369           | 49,089        | 2025/12/01 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.4500      | 964           | 988           | 131,304       | 2022/09/15 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 0.3000      | 371           | 372           | 49,437        | 2018/10/15 |
|               |              | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 0.6500      | 374           | 373           | 49,671        | 2020/11/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.2500      | 2,654         | 3,693         | 490,641       | 2029/11/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 6.0000      | 3,118         | 4,708         | 625,445       | 2031/05/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.7500      | 1,455         | 2,187         | 290,543       | 2033/02/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.2500      | 2,528         | 2,739         | 363,843       | 2017/08/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.2500      | 2,074         | 2,329         | 309,437       | 2019/02/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000      | 1,921         | 2,236         | 297,054       | 2020/02/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000      | 1,908         | 2,684         | 356,647       | 2034/08/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.0000      | 2,390         | 2,999         | 398,442       | 2037/02/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.7500      | 2,734         | 3,170         | 421,189       | 2021/08/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.0000      | 1,413         | 1,475         | 195,994       | 2017/02/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000      | 2,480         | 2,707         | 359,632       | 2018/02/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000      | 1,674         | 2,404         | 319,416       | 2039/08/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500      | 1,953         | 2,452         | 325,736       | 2023/08/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000      | 2,187         | 2,433         | 323,203       | 2018/08/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000      | 2,708         | 3,069         | 407,752       | 2019/03/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.2500      | 2,531         | 2,887         | 383,505       | 2019/09/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000      | 2,118         | 2,747         | 364,932       | 2025/03/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000      | 1,893         | 2,718         | 361,035       | 2040/09/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.2500      | 2,560         | 2,960         | 393,292       | 2020/03/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.0000      | 2,214         | 2,562         | 340,380       | 2020/09/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000      | 2,070         | 2,626         | 348,836       | 2026/03/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.7500      | 2,144         | 2,474         | 328,733       | 2021/03/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500      | 2,281         | 2,774         | 368,493       | 2021/09/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000      | 2,012         | 2,499         | 332,044       | 2022/03/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500      | 2,315         | 2,462         | 327,083       | 2017/05/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.5000      | 1,657         | 2,131         | 283,071       | 2022/09/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500      | 1,490         | 1,590         | 211,274       | 2017/06/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.5000      | 1,910         | 2,462         | 327,061       | 2022/11/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.5000      | 1,295         | 1,377         | 182,908       | 2017/11/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500      | 1,810         | 2,387         | 317,119       | 2028/09/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000      | 1,594         | 1,964         | 260,888       | 2023/05/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.5000      | 2,341         | 2,531         | 336,313       | 2018/06/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500      | 1,434         | 2,041         | 271,162       | 2044/09/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000      | 2,194         | 2,723         | 361,820       | 2024/03/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.5000      | 2,111         | 2,314         | 307,418       | 2018/12/01 |
|               |              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.7500      | 1,095         | 1,266         | 168,220       | 2021/05/01 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 2015年12月18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  |            |  |
|               | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 1.5000 | 千ユーロ<br>318 | 千ユーロ<br>322 | 千円<br>42,898 | 2016/12/15 |  |
|               | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 2.5000 | 1,100       | 1,179       | 156,660      | 2019/05/01 |  |
|               | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,901       | 2,253       | 299,277      | 2024/09/01 |  |
|               | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,066       | 1,262       | 167,710      | 2030/03/01 |  |
|               | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 1.1500 | 905         | 919         | 122,194      | 2017/05/15 |  |
|               | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 2.1500 | 1,593       | 1,706       | 226,651      | 2021/12/15 |  |
|               | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 1.5000 | 446         | 463         | 61,595       | 2019/08/01 |  |
|               | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 |        |             |             |              |            |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数 額<br>金                      | 59銘柄    |        | 99,068      | 119,357     | 15,854,260   |            |  |
| ユーロ（フィンランド）   | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 0.3750 | 千ユーロ<br>232 | 千ユーロ<br>236 | 31,378       | 2020/09/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 0.7500 | 248         | 228         | 30,338       | 2031/04/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 0.8750 | 279         | 278         | 37,018       | 2025/09/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.8750 | 474         | 508         | 67,573       | 2017/09/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 4.3750 | 447         | 519         | 68,962       | 2019/07/04 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 4.0000 | 667         | 863         | 114,638      | 2025/07/04 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.3750 | 527         | 605         | 80,426       | 2020/04/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.5000 | 459         | 542         | 72,080       | 2021/04/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.8750 | 163         | 167         | 22,291       | 2017/04/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 2.7500 | 389         | 464         | 61,688       | 2028/07/04 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.6250 | 612         | 666         | 88,522       | 2022/09/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.5000 | 446         | 479         | 63,741       | 2023/04/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 2.6250 | 387         | 486         | 64,652       | 2042/07/04 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.1250 | 425         | 441         | 58,594       | 2018/09/15 |  |
|               | Finland Government Bond           | 国 債 証 券 | 2.0000 | 529         | 588         | 78,141       | 2024/04/15 |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数 額<br>金                      | 15銘柄    |        | 6,284       | 7,077       | 940,049      |            |  |
| ユーロ（オーストリア）   | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 0.2500 | 千ユーロ<br>347 | 千ユーロ<br>352 | 46,822       | 2019/10/18 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.2000 | 462         | 477         | 63,365       | 2025/10/20 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 6.2500 | 985         | 1,550       | 205,904      | 2027/07/15 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 4.6500 | 1,066       | 1,175       | 156,090      | 2018/01/15 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.9000 | 1,248       | 1,474       | 195,902      | 2020/07/15 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,212       | 1,448       | 192,337      | 2021/09/15 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 4.1500 | 1,218       | 1,800       | 239,198      | 2037/03/15 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 4.3000 | 711         | 767         | 102,003      | 2017/09/15 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 4.3500 | 989         | 1,135       | 150,798      | 2019/03/15 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 4.8500 | 675         | 937         | 124,554      | 2026/03/15 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.2000 | 907         | 944         | 125,421      | 2017/02/20 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.6500 | 797         | 969         | 128,730      | 2022/04/20 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.4000 | 872         | 1,055       | 140,174      | 2022/11/22 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.8000 | 318         | 522         | 69,420       | 2062/01/26 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.9500 | 738         | 793         | 105,449      | 2019/06/18 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.1500 | 563         | 756         | 100,546      | 2044/06/20 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.7500 | 675         | 740         | 98,402       | 2023/10/20 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 2.4000 | 301         | 347         | 46,160       | 2034/05/23 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.1500 | 307         | 319         | 42,404       | 2018/10/19 |  |
|               | Austria Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.6500 | 932         | 1,008       | 134,024      | 2024/10/21 |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数 額<br>金                      | 20銘柄    |        | 15,323      | 18,577      | 2,467,712    |            |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数 額<br>金                      | 278銘柄   |        | 409,735     | 488,367     | 64,869,830   |            |  |
| 合 計           | 銘 柄 数 額<br>金                      | 727銘柄   |        |             |             | 161,356,997  |            |  |

(注1) 邦貨換算金額は、2015年12月18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ある。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# トピックス・インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第27期（決算日 2015年9月24日）

（計算期間 2014年9月20日～2015年9月24日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの第27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     | わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。                                                                                                                                       |
| 主 要 投 資 対 象 | 東京証券取引所第1部上場株式（上場予定を含みます。）                                                                                                                                                               |
| 運 用 方 法     | 投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。<br>イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。<br>ロ. ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。<br>ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。 |
| 株 式 組 入 制 限 | 無制限                                                                                                                                                                                      |

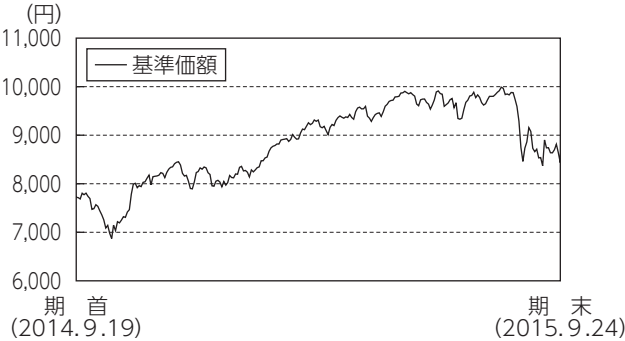
## 大和投資信託

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 |       | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 先 物 比 率 |
|-----------------|---------|------|-----------|-------|-------------|-------------|
|                 | 円       | 騰落率  | (ベンチマーク)  | 騰落率   |             |             |
| (期首)2014年 9月19日 | 7,721   | —    | 1,331.91  | —     | 99.7        | 0.2         |
| 9 月 末           | 7,741   | 0.3  | 1,326.29  | △ 0.4 | 98.9        | 1.0         |
| 10 月 末          | 7,786   | 0.8  | 1,333.64  | 0.1   | 98.3        | 1.6         |
| 11 月 末          | 8,234   | 6.6  | 1,410.34  | 5.9   | 99.1        | 1.1         |
| 12 月 末          | 8,227   | 6.6  | 1,407.51  | 5.7   | 99.2        | 0.7         |
| 2015年 1 月 末     | 8,273   | 7.1  | 1,415.07  | 6.2   | 99.5        | 0.4         |
| 2 月 末           | 8,912   | 15.4 | 1,523.85  | 14.4  | 99.5        | 0.5         |
| 3 月 末           | 9,096   | 17.8 | 1,543.11  | 15.9  | 98.6        | 1.3         |
| 4 月 末           | 9,391   | 21.6 | 1,592.79  | 19.6  | 98.8        | 1.2         |
| 5 月 末           | 9,874   | 27.9 | 1,673.65  | 25.7  | 98.6        | 1.4         |
| 6 月 末           | 9,628   | 24.7 | 1,630.40  | 22.4  | 99.4        | 0.4         |
| 7 月 末           | 9,799   | 26.9 | 1,659.52  | 24.6  | 99.5        | 0.4         |
| 8 月 末           | 9,079   | 17.6 | 1,537.05  | 15.4  | 98.6        | 1.6         |
| (期末)2015年 9月24日 | 8,429   | 9.2  | 1,426.97  | 7.1   | 99.1        | 0.9         |

(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：7,721円 期末：8,429円 騰落率：9.2%

【基準価額の主な変動要因】

T O P I X の動きをほぼ反映して、基準価額は値上がりしました。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首から2014年10月中旬にかけて、世界経済の不透明感の強まりやエボラ出血熱の感染拡大懸念、2大臣辞任による国内政治不安などにより下落しました。10月下旬以降は、日銀の追加金融緩和やG P I F（年金積立金管理運用独立行政法人）の国内株式運用比率引上げ決定、円安の大幅な進行などを受けて、株価は急速に上昇しました。12月から2015年1月前半にかけては、原油価格急落によるロシア経済不安やギリシャ情勢の混迷によるユーロ安などが警戒され株価も一時下落しましたが、1月後半以降は、E C B（欧州中央銀行）による量的金融緩和の決定や国内景気の持ち直し、良好な株式需給関係、さらなる円安の進行などを受けて、株価は大きく上昇しました。6月からは、ギリシャ支援協定の

難航によりギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念が一時高まったことや、中国株式市況の急落を受け中国経済への不安が高まったこと、さらには世界経済減速懸念も台頭したことから日本株式市況も弱含みになり、8月中旬以降は急落しました。その後は一進一退の推移で期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、T O P I X に連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま

○株式組入比率

株式を中心に組入れ、T O P I X 先物取引も利用して、株式への実質投資比率を高位に維持します。

○ポートフォリオ

T O P I X への連動をめざしたポートフォリオを構築します。

◆ポートフォリオについて

株式を中心に、一部T O P I X 先物取引も利用し、株式組入比率（株式先物を含む。）につきま

して、期を通じておおむね100%程度を維持しました。  
株式ポートフォリオは、最適化の手法（株価変動を数的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがT O P I X と同じように変動するよう、銘柄、株数を決定するシステム的な手法）を用いて構築しています。

期中、資金変動への対応、新規上場等のT O P I X の構成の変化への対応のため、随時、株式の売買を行ないました。

当期末の組入銘柄数は、1,395銘柄となっております。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（T O P I X ）の騰落率は7.1%となりました。一方、当ファンドの騰落率は9.2%となりました。

- ・保有している株式の配当金について、ベンチマークが配当落ちしていることに対して、ファンドには配当金が計上されているため、ベンチマークとかい離しました。
- ・その他、ファンドで組入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とT O P I X の騰落率との差異、先物取引の影響、売買コスト等がかい離の要因として挙げられます。

《今後の運用方針》

引き続き当ファンドの運用の基本方針に基づき、T O P I X に連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま

■1万口当りの費用の明細

| 項 目     | 当 期 |
|---------|-----|
| 売買委託手数料 | 1円  |
| (株式)    | (0) |
| (先物)    | (1) |
| 有価証券取引税 | —   |
| その他費用   | 0   |
| (その他)   | (0) |
| 合 計     | 1   |

(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

(2014年9月20日から2015年9月24日まで)

|    | 買 付                        |                        | 売 付              |                  |
|----|----------------------------|------------------------|------------------|------------------|
|    | 株 数                        | 金 額                    | 株 数              | 金 額              |
| 国内 | 千株<br>5,069.6<br>(553,574) | 千円<br>5,046,428<br>( ) | 千株<br>16,172.374 | 千円<br>20,565,891 |

(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) 先物取引の種類別取引状況

(2014年9月20日から2015年9月24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<br>株式先物取引 | 百万円<br>20,314 | 百万円<br>19,662 | 百万円<br>－ | 百万円<br>－ |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2014年9月20日から2015年9月24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      |
| リクルートホールディングス |   | 93.2  | 371,006 | 3,980 | トヨタ自動車        |   | 123.2 | 935,561 | 7,593  |
| ソニー           |   | 77.5  | 199,304 | 2,571 | 三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ |   | 623.6 | 468,526 | 751    |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ |   | 239.4 | 151,607 | 633   | 三井住友フィナンシャルＧ  |   | 67    | 314,027 | 4,686  |
| ソフトバンクグループ    |   | 19.5  | 149,422 | 7,662 | 本田技研          |   | 80.7  | 312,931 | 3,877  |
| 日本たばこ産業       |   | 27.1  | 127,477 | 4,703 | ソフトバンクグループ    |   | 40.8  | 303,878 | 7,447  |
| ＫＤＤＩ          |   | 17.6  | 108,103 | 6,142 | キャノン          |   | 75.9  | 295,454 | 3,892  |
| みずほフィナンシャルＧ   |   | 459.9 | 92,918  | 202   | ファナック         |   | 14.1  | 290,996 | 20,638 |
| りそなホールディングス   |   | 126   | 76,864  | 610   | 日本電信電話        |   | 39.3  | 266,586 | 6,783  |
| ブリヂストン        |   | 15.9  | 72,861  | 4,582 | アステラス製薬       |   | 122   | 221,545 | 1,815  |
| オリックス         |   | 48.2  | 65,405  | 1,356 | ＮＴＴドコモ        |   | 100.9 | 213,705 | 2,117  |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。















■投資信託財産の構成

2015年9月24日現在

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 株式           | 118,758,337 | 96.2  |
| コール・ローン等、その他 | 4,714,797   | 3.8   |
| 投資信託財産総額     | 123,473,135 | 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9月24日現在

| 項 目            |   | 当 期 末            |
|----------------|---|------------------|
| (A) 資産         |   | 124,074,935,077円 |
| コール・ローン等       |   | 4,664,731,002    |
| 株式(評価額)        |   | 118,758,337,490  |
| 未収配当金          |   | 40,051,378       |
| その他未収収益        |   | 2,515,207        |
| 差入委託証拠金        |   | 609,300,000      |
| (B) 負債         |   | 4,260,440,842    |
| 未払金            |   | 32,554,942       |
| 未払解約金          |   | 143,570,000      |
| 未払利息           |   | 69,678           |
| 差入委託証拠金代用有価証券  |   | 601,800,000      |
| 受入担保金          |   | 3,482,446,222    |
| (C) 純資産総額(A－B) |   | 119,814,494,235  |
| 元本             |   | 142,153,807,198  |
| 次期繰越損益金        | △ | 22,339,312,963   |
| (D) 受益権総口数     |   | 142,153,807,198口 |
| 1万口当り基準価額(C／D) |   | 8,429円           |

\* 期首における元本額は161,808,534,912円、当期中における追加設定元本額は12,903,751,665円、同解約元本額は32,558,479,379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、適格機関投資家専用投信1号1,618,607,015円、トピックス・インデックスファンド5,744,762,276円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A 17,175,998,458円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2 170,200,403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) 198,413,303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) 3,181,299,008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) 137,014,215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) 4,394,989,483円、D－I's T O P I Xインデックス34,875,286円、D Cダイワ日本株式インデックス61,215,051,338円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 1,801,818,709円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 1,986,282,004円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 1,921,388,073円、年金ダイワ日本株式インデックス3,422,270,287円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 22,817,675円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 52,296,241円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 9,665,813円、ダイワ世界分散バランスファンド1 5 V A 2,096,047円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A 9,923,710円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A (国内株式型) 11,343,637円、ダイワ世界分散バランスファンド2 5 V A 61,045,462円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A 345,855,208円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A (国内株式型) 178,770,646円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 1,665,241,660円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 246,389,207円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 15,785,324,182円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 440,197,235円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 748,217,502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) 1,290,283,588円、ダイワ国内バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専用) 213,508,064円、ダイワ国内バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家専用) 311,238,151円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X 670,751,158円、ダイワライフスタイル2 5 188,525,615円、ダイワライフスタイル5 0 588,516,300円、ダイワライフスタイル7 5 460,639,542円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド) 15,848,190,697円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,429円です。

\* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は22,339,312,963円です。

■損益の状況

当期 自2014年9月20日 至2015年9月24日

| 項 目                      |   | 当 期             |
|--------------------------|---|-----------------|
| (A) 配当等収益                |   | 2,442,576,281円  |
| 受取配当金                    |   | 2,367,602,873   |
| 受取利息                     |   | 3,220,818       |
| その他収益金                   |   | 73,209,795      |
| 支払利息                     | △ | 1,457,205       |
| (B) 有価証券売買損益             |   | 9,722,566,601   |
| 売買益                      |   | 16,385,632,084  |
| 売買損                      | △ | 6,663,065,483   |
| (C) 先物取引等損益              |   | 116,344,179     |
| 取引益                      |   | 351,849,767     |
| 取引損                      | △ | 235,505,588     |
| (D) その他費用                | △ | 353,555         |
| (E) 当期損益金(A + B + C + D) |   | 12,281,133,506  |
| (F) 前期繰越損益金              | △ | 36,883,267,683  |
| (G) 解約差損益金               |   | 3,947,464,679   |
| (H) 追加信託差損益金             | △ | 1,684,643,465   |
| (I) 合計(E + F + G + H)    |   | △22,339,312,963 |
| 次期繰越損益金(I)               |   | △22,339,312,963 |

(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。

# 外国株式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）

外国株式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MSCIコクサイ指数（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 | 外国の株式（預託証券を含みます。）                                                                                                             |
| 運 用 方 法     | ①主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（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。<br>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 | 無制限                                                                                                                           |

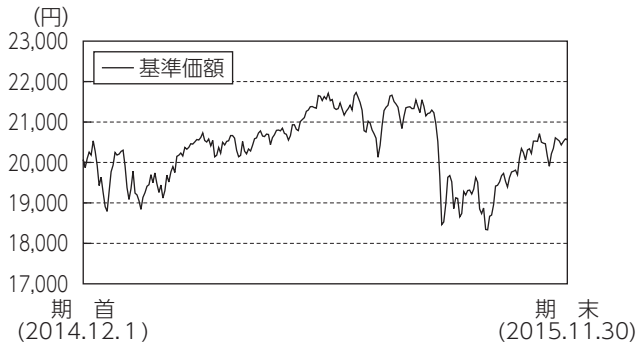
## 大和投資信託

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コクサイ<br>指 数 (円ベース) |          | 株式組入<br>比 率 | 株式先物<br>比 率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|-----------------|---------|----------|------------------------|----------|-------------|-------------|--------------------|
|                 | 円       | 騰落率<br>% | ベンチマーク                 | 騰落率<br>% | %           | %           | %                  |
| (期首)2014年12月1日  | 20,069  |          | 14,956                 | —        | 96.4        | 1.4         | 2.1                |
| 12月末            | 20,305  | 1.2      | 15,102                 | 1.0      | 96.3        | 1.4         | 2.2                |
| 2015年1月末        | 19,442  | △3.1     | 14,448                 | △3.4     | 96.1        | 1.4         | 2.4                |
| 2月末             | 20,555  | 2.4      | 15,239                 | 1.9      | 96.4        | 1.4         | 2.2                |
| 3月末             | 20,520  | 2.2      | 15,169                 | 1.4      | 96.3        | 1.4         | 2.3                |
| 4月末             | 20,718  | 3.2      | 15,304                 | 2.3      | 96.5        | 1.4         | 2.2                |
| 5月末             | 21,636  | 7.8      | 15,896                 | 6.3      | 96.3        | 1.4         | 2.1                |
| 6月末             | 20,786  | 3.6      | 15,247                 | 1.9      | 96.2        | 1.4         | 2.2                |
| 7月末             | 21,370  | 6.5      | 15,664                 | 4.7      | 96.0        | 1.5         | 2.3                |
| 8月末             | 19,677  | △2.0     | 14,387                 | △3.8     | 96.2        | 1.4         | 2.4                |
| 9月末             | 18,335  | △8.6     | 13,380                 | △10.5    | 96.0        | 1.5         | 2.5                |
| 10月末            | 20,338  | 1.3      | 14,821                 | △0.9     | 96.2        | 1.3         | 2.4                |
| (期末)2015年11月30日 | 20,561  | 2.5      | 14,973                 | 0.1      | 96.2        | 1.3         | 2.4                |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIコクサイ指数(円ベース)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(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コクサイ指数(米ドルベース)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：20,069円 期末：20,561円 騰落率：2.5%

【基準価額の主な変動要因】

外国株式市況と為替相場の動向を反映した結果、MSCIコクサイ指数(円ベース)は期首比で若干の上昇にとどまりましたが、ファンドには株式等の配当金が計上されているため、基準価額は上昇しました。

株式市況と為替相場の推移について、くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○外国株式市況

米国・欧州を中心とする外国株式市況は、期首より、ギリシャの政治不安などから不安定な展開となりましたが、原油価格の下落に歯止めがかかったことなどが好感され上昇に転じ、その後はECB(欧州中央銀行)の量的金融緩和の発表やウクライナ問題をめぐる関係国の停戦合意などを背景に、2015年7月末までおおむね堅調に推移しました。8月に入ると、中国での人民元の事実上の切下げを受けて中国株が大幅に下落し、世界の金融市場に動揺が広がったことなどをを受けて急落しました。しかし10月以降は、米国を中心とした企業の業績発表がおおむね好調であったことや、ECBの追加金融緩和への期待が高まったことなどをを受けて上昇し、期を通じてはやや下落して期末を迎えました。

○為替相場

米ドル円が為替相場は、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。

◆前期における「今後の運用方針」

今後の運用にあたりましても、MSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に、S&P500先物取引も一部利用し、株式組入比率(リート、株式先物を含む。)につきましても、期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とMSCIコクサイ指数(円ベース)との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

ポートフォリオは、MSCIコクサイ指数採用銘柄を中心に、期末では22カ国、1,256銘柄の構成となっています。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク(MSCIコクサイ指数(円ベース))の騰落率は0.1%となりました。一方、当ファンドの騰落率は2.5%となりました。

ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。

その他、ファンドで組入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買手数料・保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

今後の運用にあたりましても、MSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目      |  | 当 期  |  |
|----------|--|------|--|
| 売買委託手数料  |  | 1円   |  |
| (株式)     |  | ( 1) |  |
| (先物)     |  | ( 0) |  |
| (投資信託証券) |  | ( 0) |  |
| 有価証券取引税  |  | 1    |  |
| (株式)     |  | ( 1) |  |
| (投資信託証券) |  | ( 0) |  |
| その他費用    |  | 14   |  |
| (保管費用)   |  | (14) |  |
| (その他)    |  | ( 0) |  |
| 合 計      |  | 16   |  |

(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

(2014年12月 2 日から2015年11月30日まで)

|   |          | 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     |
|   |          | ( 3,327<br>1,351.82)   | ( 17,997<br>△ 5,203) | 6,097.59 | 32,156       |
|   | カナダ      | 百株                     | 千カナダ・ドル              | 百株       | 千カナダ・ドル      |
|   |          | (△ 424.5<br>59.13)     | ( 1,502<br>△ 588)    | 935      | 2,230        |
|   | オーストラリア  | 百株                     | 千オーストラリア・ドル          | 百株       | 千オーストラリア・ドル  |
|   |          | ( 1,487<br>511.73)     | ( 1,045<br>△ 216)    | 762      | 1,017        |
|   | 香港       | 百株                     | 千香港ドル                | 百株       | 千香港ドル        |
|   |          | ( 234<br>579.74)       | ( 1,507<br>△ 2)      | 861      | 4,297        |
|   | シンガポール   | 百株                     | 千シンガポール・ドル           | 百株       | 千シンガポール・ドル   |
|   |          | ( 145<br>—)            | ( 92<br>△ 2)         | 336      | 228          |
| 国 | ニュージーランド | 百株                     | 千ニュージーランド・ドル         | 百株       | 千ニュージーランド・ドル |
|   |          | ( 130<br>—)            | ( 67<br>—)           | —        | —            |
|   | イギリス     | 百株                     | 千イギリス・ポンド            | 百株       | 千イギリス・ポンド    |
|   |          | ( 3,751<br>△ 2,111.05) | ( 2,131<br>△ 92)     | 4,454.82 | 2,667        |
|   | イスラエル    | 百株                     | 千イスラエル・シェケル          | 百株       | 千イスラエル・シェケル  |
|   |          | ( —<br>—)              | ( —<br>—)            | 8        | 178          |
|   | スイス      | 百株                     | 千スイス・フラン             | 百株       | 千スイス・フラン     |
|   |          | ( 212.5<br>4.4)        | ( 1,236<br>△ 305)    | 269.6    | 1,670        |
|   | デンマーク    | 百株                     | 千デンマーク・クローネ          | 百株       | 千デンマーク・クローネ  |
|   |          | ( 39.5<br>—)           | ( 1,191<br>—)        | 59       | 2,004        |
|   | ノルウェー    | 百株                     | 千ノルウェー・クローネ          | 百株       | 千ノルウェー・クローネ  |
|   |          | ( —<br>—)              | ( —<br>—)            | 183      | 1,456        |

|   |                  | 買 付                    |                   | 売 付      |              |
|---|------------------|------------------------|-------------------|----------|--------------|
|   |                  | 株 数                    | 金 額               | 株 数      | 金 額          |
| 外 | スウェーデン           | 百株                     | 千スウェーデン・クローネ      | 百株       | 千スウェーデン・クローネ |
|   |                  | ( 127.5<br>362)        | ( 2,009<br>△ 136) | 367      | 4,978        |
|   | ユーロ<br>(アイルランド)  | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( 18<br>—)             | ( 44<br>—)        | 11       | 36           |
|   | ユーロ<br>(オランダ)    | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( 131.5<br>150.92)     | ( 331<br>97)      | 289      | 580          |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)    | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( 7.5<br>—)            | ( 54<br>—)        | 25       | 172          |
|   | ユーロ<br>(ルクセンブルグ) | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | (△ 6.5<br>19)          | (△ 28<br>109)     | 18       | 51           |
| 国 | ユーロ<br>(フランス)    | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( 395<br>4.18)         | ( 1,164<br>△ 16)  | 398      | 1,592        |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)     | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( 409<br>—)            | ( 1,131<br>△ 48)  | 326.5    | 1,515        |
|   | ユーロ<br>(ポルトガル)   | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( —<br>—)              | ( —<br>—)         | 95       | 34           |
|   | ユーロ<br>(スペイン)    | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | (△ 1,435<br>398.56)    | (△ 1,096<br>45)   | 393      | 361          |
|   | ユーロ<br>(イタリア)    | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | (△ 1,126<br>915.04)    | (△ 268<br>46)     | 582.95   | 308          |
|   | ユーロ<br>(フィンランド)  | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( —<br>—)              | ( —<br>—)         | 110      | 169          |
|   | ユーロ<br>(オーストリア)  | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( —<br>—)              | ( —<br>—)         | 322      | 113          |
|   | ユーロ<br>(その他)     | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | ( —<br>—)              | ( —<br>—)         | 22.5     | 15           |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計)  | 百株                     | 千ユーロ              | 百株       | 千ユーロ         |
|   |                  | (△ 3,528.5<br>1,177.5) | (△ 4,121<br>168)  | 2,592.95 | 4,951        |
|   |                  |                        |                   |          |              |
|   |                  |                        |                   |          |              |

(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

(2014年12月2日から2015年11月30日まで)

|     |                 | 買 付                     |                             | 売 付                   |                            |
|-----|-----------------|-------------------------|-----------------------------|-----------------------|----------------------------|
|     |                 | 口 数                     | 金 額                         | 口 数                   | 金 額                        |
| 外 国 | アメリカ            | 千口<br>6.2<br>( 26.801)  | 千アメリカ・ドル<br>458<br>(1,377)  | 千口<br>19.949<br>( - ) | 千アメリカ・ドル<br>753<br>( - )   |
|     | オーストラリア         | 千口<br>34.1<br>(△11.627) | 千オーストラリア・ドル<br>128<br>( - ) | 千口<br>15.1<br>( - )   | 千オーストラリア・ドル<br>95<br>( - ) |
|     | 香港              | 千口<br>3<br>( - )        | 千香港ドル<br>158<br>( - )       | 千口<br>6.5<br>( - )    | 千香港ドル<br>307<br>( - )      |
|     | シンガポール          | 千口<br>-<br>( - )        | 千シンガポール・ドル<br>-<br>(△ 0)    | 千口<br>15.8<br>( - )   | 千シンガポール・ドル<br>34<br>( - )  |
|     | イギリス            | 千口<br>1<br>( - )        | 千イギリス・ポンド<br>12<br>( - )    | 千口<br>3<br>( - )      | 千イギリス・ポンド<br>33<br>( - )   |
|     | ユーロ<br>(オランダ)   | 千口<br>-<br>( - )        | 千ユーロ<br>-<br>( - )          | 千口<br>2,024<br>( - )  | 千ユーロ<br>88<br>( - )        |
|     | ユーロ<br>(フランス)   | 千口<br>1.25<br>( - )     | 千ユーロ<br>70<br>(△ 1)         | 千口<br>0.7<br>( - )    | 千ユーロ<br>62<br>( - )        |
| 国   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 千口<br>1.25<br>( - )     | 千ユーロ<br>70<br>(△ 1)         | 千口<br>2,724<br>( - )  | 千ユーロ<br>151<br>( - )       |

(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

(2014年12月2日から2015年11月30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      |
| KINDER MORGAN INC (アメリカ)    |   | 19.5 | 94,951 | 4,869  | APPLE INC (アメリカ)           |   | 14.6 | 220,266 | 15,086 |
| APPLE INC (アメリカ)            |   | 4.6  | 63,867 | 13,884 | GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ) |   | 32.7 | 111,975 | 3,424  |
| FACEBOOK INC-A (アメリカ)       |   | 3.8  | 41,268 | 10,860 | EXXON MOBIL CORP (アメリカ)    |   | 8    | 85,171  | 10,646 |
| VONOVIA SE (ドイツ)            |   | 10.4 | 40,934 | 3,935  | MICROSOFT CORP (アメリカ)      |   | 12.9 | 73,099  | 5,666  |
| BANCO SANTANDER SA (スペイン)   |   | 46.6 | 38,143 | 818    | JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)   |   | 4.8  | 59,101  | 12,312 |
| EXXON MOBIL CORP (アメリカ)     |   | 3.7  | 35,849 | 9,689  | WELLS FARGO & CO (アメリカ)    |   | 8.3  | 55,950  | 6,741  |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG (スイス) |   | 4.1  | 35,275 | 8,603  | JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ) |   | 6.4  | 50,749  | 7,929  |
| GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)  |   | 11.9 | 35,085 | 2,948  | PFIZER INC (アメリカ)          |   | 11.3 | 47,416  | 4,196  |
| INCYTE CORP (アメリカ)          |   | 3.6  | 34,030 | 9,453  | NESTLE SA-REG (スイス)        |   | 5.15 | 47,156  | 9,156  |
| ALPHABET INC-CL C (アメリカ)    |   | 0.45 | 33,929 | 75,399 | INTEL CORP (アメリカ)          |   | 11.3 | 45,882  | 4,060  |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2014年12月2日から2015年11月30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    |
| 外 国   |        | 百万円<br>4,748 | 百万円<br>4,956 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |
|       | 株式先物取引 |              |              |          |          |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックスマザーファンド

## ■組入資産明細表

### (1) 外国株式

| 銘柄                           | 期 首    | 当      | 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      |            |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | —      | 15     | 278      | 34,250  | 情報技術       |
| JARDEN CORP                  | —      | 40     | 187      | 23,006  | 一般消費財・サービス |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 12     | 13     | 194      | 23,857  | ヘルスケア      |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | —      | 38     | 119      | 14,631  | 金融         |
| AVON PRODUCTS INC            | 107    | —      | —        | —       | 生活必需品      |
| ABBOTT LABORATORIES          | 329    | 317    | 1,439    | 176,837 | ヘルスケア      |
| ALCOA INC                    | 257    | 273    | 254      | 31,249  | 素材         |
| VERISK ANALYTICS INC         | 33     | 33     | 247      | 30,349  | 資本財・サービス   |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 92     | 87     | 385      | 47,357  | 一般消費財・サービス |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 69     | 66     | 362      | 44,551  | 情報技術       |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 63.29  | 60.29  | 390      | 47,923  | 情報技術       |
| QORVO INC                    | —      | 32     | 184      | 22,602  | 情報技術       |
| AFLAC INC                    | 101    | 91     | 594      | 72,983  | 金融         |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 29     | 29     | 165      | 20,319  | 一般消費財・サービス |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 32     | —      | —        | —       | その他        |
| ADOBE SYSTEMS INC            | 104    | 107    | 986      | 121,127 | 情報技術       |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 11     | 50     | 225      | 27,702  | 素材         |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 25     | 25     | 131      | 16,120  | 一般消費財・サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    | 68     | 68     | 113      | 13,947  | 金融         |
| DIAMOND OFFSHORE DRILLING    | 20     | —      | —        | —       | エネルギー      |
| GARMIN LTD                   | 26     | 26     | 97       | 11,968  | 一般消費財・サービス |
| AETNA INC                    | 79.79  | 74.79  | 778      | 95,586  | ヘルスケア      |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 47     | 43     | 592      | 72,828  | 素材         |
| ALTERA CORP                  | 72     | 65     | 343      | 42,167  | 情報技術       |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 165    | 158    | 1,644    | 201,934 | 資本財・サービス   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | 37.51  | 37.51  | 209      | 25,766  | 情報技術       |
| VR BERKLEY CORP              | 24     | 21     | 116      | 14,361  | 金融         |
| AUTOZONE INC                 | 7      | 6.7    | 526      | 64,676  | 一般消費財・サービス |
| DOLLAR TREE INC              | 47     | 47.21  | 354      | 43,533  | 一般消費財・サービス |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 24     | 24     | 151      | 18,555  | 公益事業       |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 36     | 33     | 233      | 28,675  | 素材         |
| DR HORTON INC                | 65.66  | 71.66  | 234      | 28,841  | 一般消費財・サービス |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 21     | 21     | 76       | 9,378   | エネルギー      |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC   | 33     | 30     | 183      | 22,516  | ヘルスケア      |
| AUTODESK INC                 | 52     | 48     | 302      | 37,170  | 情報技術       |
| MOODY'S CORP                 | 44     | 39     | 404      | 49,715  | 金融         |
| DEVON ENERGY CORP            | 85     | 82     | 367      | 45,189  | エネルギー      |
| ALBEMARLE CORP               | 22     | 24     | 127      | 15,655  | 素材         |
| CONSOL ENERGY INC            | 54     | —      | —        | —       | エネルギー      |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 25     | 25     | 149      | 18,386  | 公益事業       |
| CITIGROUP INC                | 661.23 | 643.23 | 3,486    | 428,267 | 金融         |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 106    | 101    | 875      | 107,537 | 情報技術       |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 111    | 105    | 587      | 72,140  | 公益事業       |
| NETSUITE INC                 | 6      | 8      | 68       | 8,438   | 情報技術       |
| ALLEGHANY CORP               | 4      | 3.5    | 178      | 21,903  | 金融         |
| DUN & BRADSTREET CORP        | 9      | 7.5    | 81       | 10,035  | 資本財・サービス   |
| HESS CORP                    | 64     | 57     | 336      | 41,367  | エネルギー      |
| COVIDIEN PLC                 | 99.25  | —      | —        | —       | その他        |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I | 38     | 36     | 267      | 32,860  | ヘルスケア      |
| DANAHER CORP                 | 140    | 131    | 1,268    | 155,826 | 資本財・サービス   |
| AVNET INC                    | 34     | 28     | 127      | 15,654  | 情報技術       |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 25.7   | 23.7   | 616      | 75,748  | 金融         |

| 銘柄                           | 期 首    |        | 当 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        |            |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 38     | 38     | 340      | 41,855    | 一般消費財・サービス |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 143    | 134    | 488      | 60,005    | 生活必需品      |
| BUNGE LTD                    | 33     | 31     | 207      | 25,513    | 生活必需品      |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 93.25  | 88.25  | 594      | 72,988    | 情報技術       |
| APPLE INC                    | 1,311  | 1,211  | 14,266   | 1,752,247 | 情報技術       |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 102    | 94     | 534      | 65,633    | 金融         |
| BOEING CO/THE                | 149    | 139    | 2,042    | 250,872   | 資本財・サービス   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 35.15  | 32.15  | 196      | 24,118    | 金融         |
| MEADWESTVACO CORP            | 38     | —      | —        | —         | その他        |
| SPECTRA ENERGY CORP          | 146.96 | 140.96 | 375      | 46,103    | エネルギー      |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 43     | 44.37  | 671      | 82,445    | ヘルスケア      |
| CDK GLOBAL INC               | —      | 29     | 141      | 17,417    | 情報技術       |
| NISOURCE INC                 | 71     | —      | —        | —         | 公益事業       |
| JOY GLOBAL INC               | 27     | —      | —        | —         | 資本財・サービス   |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP      | —      | 67     | 129      | 15,873    | エネルギー      |
| CH. ROBINSON WORLDWIDE INC   | 34     | 31     | 213      | 26,217    | 資本財・サービス   |
| CR BARD INC                  | 17     | 16     | 299      | 36,820    | ヘルスケア      |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 250.71 | 240.71 | 1,056    | 129,726   | 金融         |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 902.54 | 871.54 | 3,941    | 484,153   | 電気通信サービス   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 249    | 248    | 3,338    | 410,074   | 金融         |
| ANSYS INC                    | 21     | 19     | 177      | 21,856    | 情報技術       |
| H&R BLOCK INC                | 62     | 51     | 187      | 23,007    | 一般消費財・サービス |
| BB&T CORP                    | 162    | 168    | 649      | 79,770    | 金融         |
| HOSPIRA INC                  | 36.2   | —      | —        | —         | その他        |
| BROADCOM CORP-CL A           | 116.5  | 116.5  | 636      | 78,153    | 情報技術       |
| BAKER HUGHES INC             | 97.23  | 92.23  | 486      | 59,787    | エネルギー      |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 364    | 356    | 2,415    | 296,666   | ヘルスケア      |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO    | 14     | 13     | 107      | 13,153    | 生活必需品      |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 827.2  | 781.2  | 5,247    | 644,475   | 金融         |
| LEGG MASON INC               | 26.5   | 21.5   | 93       | 11,499    | 金融         |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 59     | 56     | 425      | 52,237    | 金融         |
| CIGNA CORP                   | 59     | 55.5   | 750      | 92,227    | ヘルスケア      |
| LKQ CORP                     | 68     | 68     | 204      | 25,113    | 一般消費財・サービス |
| COMPUTER SCIENCES CORP       | 34     | —      | —        | —         | 情報技術       |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD     | 13     | 10     | 111      | 13,639    | 金融         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 221.42 | 221.42 | 109      | 13,488    | 電気通信サービス   |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 27     | 25     | 266      | 32,703    | 生活必需品      |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 41.6   | 39.6   | 449      | 55,207    | 金融         |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 70     | 65     | 422      | 51,899    | 一般消費財・サービス |
| SERVICENOW INC               | 30     | 30     | 261      | 32,162    | 情報技術       |
| CATERPILLAR INC              | 133    | 121    | 861      | 105,841   | 資本財・サービス   |
| GENWORTH FINANCIAL INC-CL A  | 114    | —      | —        | —         | 金融         |
| CMS ENERGY CORP              | 60     | 60     | 211      | 25,917    | 公益事業       |
| HERBALIFE LTD                | 22     | —      | —        | —         | 生活必需品      |
| MOSAIC CO/THE                | 73     | 68     | 211      | 25,932    | 素材         |
| DELTA AIR LINES INC          | 44     | 44     | 207      | 25,474    | 資本財・サービス   |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO    | 46     | 44     | 360      | 44,318    | 生活必需品      |
| CORNING INC                  | 294    | 266    | 499      | 61,289    | 情報技術       |
| CISCO SYSTEMS INC            | 1,131  | 1,083  | 2,958    | 363,394   | 情報技術       |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS    | 197    | 192    | 1,288    | 158,207   | 素材         |
| ISIS PHARMACEUTICALS INC     | —      | 26     | 162      | 19,945    | ヘルスケア      |
| MORGAN STANLEY               | 317    | 317    | 1,070    | 131,518   | 金融         |









| 銘柄                           | 期 首    | 当 期 末  |                   | 業 種 等     |              |
|------------------------------|--------|--------|-------------------|-----------|--------------|
|                              | 株 数    | 株 数    | 評 価 額             |           |              |
|                              |        |        | 外貨建金額<br>千アメリカ・ドル |           | 邦貨換算金額<br>千円 |
| CERNER CORP                  | 70     | 66     | 393               | 48,320    | ヘルスケア        |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 18     | 18     | 215               | 26,495    | 素材           |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 37     | 34     | 261               | 32,091    | 情報技術         |
| INTEL CORP                   | 1,087  | 1,004  | 3,459             | 424,930   | 情報技術         |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP   | 45     | 41     | 278               | 34,262    | エネルギー        |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 96     | 88     | 203               | 25,020    | 一般消費財・サービス   |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 99     | 92     | 419               | 51,468    | 金融           |
| CREE INC                     | 28     | —      | —                 | —         | 情報技術         |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 83     | 70     | 652               | 80,127    | 資本財・サービス     |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 553    | 553    | 228               | 28,084    | 一般消費財・サービス   |
| ILLUMINA INC                 | 29     | 30     | 556               | 68,371    | ヘルスケア        |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 119    | 119    | 62                | 7,687     | エネルギー        |
| SEALED AIR CORP              | 44     | 44     | 199               | 24,464    | 素材           |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 8      | 8      | 415               | 51,018    | ヘルスケア        |
| SNAP-ON INC                  | —      | 12     | 206               | 25,314    | 資本財・サービス     |
| CALPINE CORP                 | 82     | 72     | 104               | 12,795    | 公益事業         |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 61     | 43     | 130               | 15,991    | 一般消費財・サービス   |
| CARMAX INC                   | 49     | 46     | 264               | 32,435    | 一般消費財・サービス   |
| COMERICA INC                 | 40     | 40     | 185               | 22,790    | 金融           |
| CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV  | 23     | 23     | 96                | 11,889    | 資本財・サービス     |
| DUKE ENERGY CORP             | 158.28 | 148.28 | 1,001             | 122,947   | 公益事業         |
| TARGET CORP                  | 136    | 130    | 954               | 117,258   | 一般消費財・サービス   |
| DOVER CORP                   | 37     | 35     | 227               | 27,980    | 資本財・サービス     |
| VW GRAINGER INC              | 14     | 13     | 259               | 31,877    | 資本財・サービス     |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 30     | 26     | 113               | 13,881    | 資本財・サービス     |
| JOHNSON CONTROLS INC         | 148    | 142    | 648               | 79,702    | 一般消費財・サービス   |
| CINTAS CORP                  | 23     | 21     | 193               | 23,731    | 資本財・サービス     |
| CA INC                       | 76.05  | 71.05  | 200               | 24,608    | 情報技術         |
| CONAGRA FOODS INC            | 96     | 90     | 374               | 46,039    | 生活必需品        |
| CLOROX COMPANY               | 28     | 28     | 351               | 43,162    | 生活必需品        |
| ENTERGY CORP                 | 40     | 38     | 251               | 30,882    | 公益事業         |
| MICROSOFT CORP               | 1,710  | 1,614  | 8,704             | 1,069,062 | 情報技術         |
| INCYTE CORP                  | —      | 34     | 396               | 48,753    | ヘルスケア        |
| CVS HEALTH CORP              | 250.74 | 239.74 | 2,268             | 278,636   | 生活必需品        |
| MEDTRONIC PLC                | 211    | 301.88 | 2,308             | 283,489   | ヘルスケア        |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 242    | 230    | 357               | 43,954    | 情報技術         |
| BLACKROCK INC                | 29     | 26     | 931               | 114,445   | 金融           |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 91     | 91     | 154               | 19,000    | 公益事業         |
| HASBRO INC                   | 26     | 24     | 180               | 22,216    | 一般消費財・サービス   |
| KELLOGG CO                   | 59     | 56     | 387               | 47,643    | 生活必需品        |
| KEYCORP                      | 202    | 184    | 241               | 29,694    | 金融           |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 24     | 24     | 221               | 27,195    | 資本財・サービス     |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 364.11 | 347.11 | 1,541             | 189,371   | 生活必需品        |
| KOHL'S CORP                  | 46     | 44     | 211               | 25,977    | 一般消費財・サービス   |
| COOPER COS INC/THE           | —      | 10     | 146               | 18,049    | ヘルスケア        |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 100    | 100    | 161               | 19,847    | 金融           |
| APACHE CORP                  | 86.1   | 81.1   | 400               | 49,225    | エネルギー        |
| ACE LTD                      | 74     | 70     | 805               | 98,921    | 金融           |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 23     | 20     | 113               | 13,944    | 情報技術         |
| ALLSTATE CORP                | 97     | 89     | 559               | 68,690    | 金融           |
| EBAY INC                     | 245    | 237    | 689               | 84,705    | 情報技術         |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | —      | 234    | 823               | 101,106   | 情報技術         |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 35     | 32     | 228               | 28,006    | 素材           |
| XILINX INC                   | 62     | 56     | 275               | 33,860    | 情報技術         |

| 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                 | 千円                 |            |            |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO  | 163.1          | 155.1              | 1,329              | 163,310    | ヘルスケア      |
| DISH NETWORK CORP-A         | 50             | 47                 | 296                | 36,407     | 一般消費財・サービス |
| YAHOO! INC                  | 210            | 193                | 635                | 78,081     | 情報技術       |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 52             | 49                 | 417                | 51,329     | 生活必需品      |
| TOLL BROTHERS INC           | 38             | 38                 | 143                | 17,683     | 一般消費財・サービス |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD      | 60             | 54                 | 122                | 15,055     | 情報技術       |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP      | 53             | 53                 | 240                | 29,598     | 情報技術       |
| LENNAR CORP-A               | 39             | 39                 | 202                | 24,888     | 一般消費財・サービス |
| LEAR CORP                   | —              | 17                 | 213                | 26,270     | 一般消費財・サービス |
| E*TRADE FINANCIAL CORP      | —              | 57                 | 172                | 21,205     | 金融         |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC   | 98             | 83                 | 133                | 16,392     | 資本財・サービス   |
| NOBLE CORP PLC              | 60             | —                  | —                  | —          | エネルギー      |
| PROGRESSIVE CORP            | 130            | 128                | 398                | 48,923     | 金融         |
| PRAXAIR INC                 | 64             | 62                 | 706                | 86,740     | 素材         |
| PACCAR INC                  | 80.37          | 76.37              | 395                | 48,624     | 資本財・サービス   |
| PETSMART INC                | 21             | —                  | —                  | —          | その他        |
| PVH CORP                    | 19             | 17                 | 158                | 19,432     | 一般消費財・サービス |
| EMC CORP/MA                 | 438            | 411                | 1,043              | 128,216    | 情報技術       |
| BIOGEN INC                  | 52.3           | 50.3               | 1,474              | 181,140    | ヘルスケア      |
| STARBUCKS CORP              | 165            | 321                | 1,995              | 245,146    | 一般消費財・サービス |
| PERRIGO CO PLC              | 29             | 31                 | 466                | 57,297     | ヘルスケア      |
| EVERSOURCE ENERGY           | 71.8           | 66.8               | 337                | 41,456     | 公益事業       |
| INTUIT INC                  | 59             | 57                 | 571                | 70,133     | 情報技術       |
| BORGWARNER INC              | 52             | 48                 | 205                | 25,220     | 一般消費財・サービス |
| BEST BUY CO INC             | 65             | 65                 | 204                | 25,131     | 一般消費財・サービス |
| BALL CORP                   | 31             | 28                 | 193                | 23,732     | 素材         |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 289.47         | 288.47             | 528                | 64,942     | ヘルスケア      |
| BED BATH & BEYOND INC       | 46             | 36                 | 199                | 24,508     | 一般消費財・サービス |
| XL GROUP PLC                | 64             | 63                 | 239                | 29,418     | 金融         |
| ELECTRONIC ARTS INC         | 69             | 68                 | 468                | 57,526     | 情報技術       |
| VULCAN MATERIALS CO         | 29             | 29                 | 301                | 37,038     | 素材         |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC  | 52             | 52                 | 691                | 84,980     | ヘルスケア      |
| VF CORP                     | 75             | 71                 | 463                | 56,969     | 一般消費財・サービス |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING | 109.71         | 94.71              | 480                | 59,033     | 一般消費財・サービス |
| VIACOM INC-CLASS B          | 84.71          | 72.71              | 371                | 45,687     | 一般消費財・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC       | 14             | 13                 | 250                | 30,769     | 一般消費財・サービス |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC   | 60             | 60                 | 126                | 15,504     | 情報技術       |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC  | 24             | 22                 | 177                | 21,832     | ヘルスケア      |
| CARNIVAL CORP               | 86             | 87                 | 442                | 54,324     | 一般消費財・サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A        | 466.7          | 452.7              | 2,788              | 342,444    | 一般消費財・サービス |
| COMCAST CORP-SPECIAL CL A   | 93             | 84                 | 517                | 63,593     | 一般消費財・サービス |
| アメリカ・ドル<br>通貨計              | 株数・金額<br>587銘柄 | 67,034.73<br>585銘柄 | 400,797<br><61.6%> | 49,225,948 |            |
| (カナダ)                       | 百株             | 百株                 | 千カナダ・ドル            | 千円         |            |
| IMPERIAL OIL LTD            | 66             | 66                 | 279                | 25,680     | エネルギー      |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC  | —              | 4                  | 227                | 20,860     | 情報技術       |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD      | —              | 30                 | 76                 | 7,010      | エネルギー      |
| RESTAURANT BRANDS INTERN    | —              | 43.87              | 216                | 19,860     | 一般消費財・サービス |
| SILVER WHEATON CORP         | 79             | 90                 | 152                | 14,027     | 素材         |
| INTACT FINANCIAL CORP       | 29             | 29                 | 256                | 23,539     | 金融         |
| BCE INC                     | 62.3           | 34.3               | 195                | 17,986     | 電気通信サービス   |
| FRANCO-NEVADA CORP          | 35             | 35                 | 220                | 20,271     | 素材         |
| SUNCOR ENERGY INC           | 330.8          | 318.8              | 1,156              | 106,164    | エネルギー      |
| METRO INC                   | 20             | 55                 | 213                | 19,562     | 生活必需品      |



| 銘柄                           |                  | 期 首               |                   | 当 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                | 千オーストラリア・ドル                    | 千円      |            |
| NEWCREST MINING LTD          |                  | 176               | 176               | 199                            | 17,602  | 素材         |
| INCITEC PIVOT LTD            |                  | 456               | 456               | 172                            | 15,229  | 素材         |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL |                  | 366               | 370               | 2,964                          | 261,226 | 金融         |
| CALTEX AUSTRALIA LTD         |                  | 38                | 60                | 205                            | 18,108  | エネルギー      |
| ORICA LTD                    |                  | 83                | 83                | 131                            | 11,592  | 素材         |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      |                  | 288               | 306               | 382                            | 33,678  | 金融         |
| CIMIC GROUP LTD              |                  | 29                | 29                | 73                             | 6,490   | 資本財・サービス   |
| WOOLWORTHS LTD               |                  | 283               | 281               | 667                            | 58,833  | 生活必需品      |
| COCA-COLA AMATIL LTD         |                  | 137               | 137               | 127                            | 11,227  | 生活必需品      |
| TABCORP HOLDINGS LTD         |                  | 205               | 205               | 94                             | 8,309   | 一般消費財・サービス |
| CROWN RESORTS LTD            |                  | 106               | 106               | 122                            | 10,760  | 一般消費財・サービス |
| QANTAS AIRWAYS LTD           |                  | 155               | 145.54            | 55                             | 4,847   | 資本財・サービス   |
| TELSTRA CORP LTD             |                  | 984               | 936               | 505                            | 44,539  | 電気通信サービス   |
| AMP LTD                      |                  | 665               | 665               | 385                            | 33,987  | 金融         |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  |                  | 114               | 114               | 186                            | 16,434  | 素材         |
| MACQUARIE GROUP LTD          |                  | 64.84             | 64.84             | 528                            | 46,566  | 金融         |
| CSL LTD                      |                  | 108               | 103               | 1,026                          | 90,445  | ヘルスケア      |
| WESFARMERS LTD               |                  | 252.45            | 244.45            | 936                            | 82,544  | 生活必需品      |
| COCHLEAR LTD                 |                  | 17                | 17                | 159                            | 14,050  | ヘルスケア      |
| SUNCORP GROUP LTD            |                  | 287               | 287               | 386                            | 34,066  | 金融         |
| BORAL LTD                    |                  | 227               | 227               | 128                            | 11,361  | 素材         |
| ASX LTD                      |                  | 50                | 42                | 174                            | 15,340  | 金融         |
| COMPUTERSHARE LTD            |                  | 139               | 139               | 161                            | 14,208  | 情報技術       |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD   |                  | 140               | 140               | 56                             | 5,008   | 一般消費財・サービス |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    |                  | 498               | 511               | 285                            | 25,171  | 金融         |
| SONIC HEALTHCARE LTD         |                  | 95                | 95                | 191                            | 16,868  | ヘルスケア      |
| TRANSURBAN GROUP             |                  | 418               | 424               | 445                            | 39,268  | 資本財・サービス   |
| TRANSURBAN GROUP-RIGHTS      |                  | —                 | 23.55             | 1                              | 136     | その他        |
| ILUKA RESOURCES LTD          |                  | 120               | 120               | 72                             | 6,365   | 素材         |
| TOLL HOLDINGS LTD            |                  | 188               | —                 | —                              | —       | その他        |
| SYDNEY AIRPORT               |                  | 251               | 251               | 164                            | 14,487  | 資本財・サービス   |
| WORLEYPARSONS LTD            |                  | 61                | —                 | —                              | —       | エネルギー      |
| TATTS GROUP LTD              |                  | 369               | 369               | 154                            | 13,624  | 一般消費財・サービス |
| AGL ENERGY LTD               |                  | 140               | 152               | 254                            | 22,395  | 公益事業       |
| BRAMBLES LTD                 |                  | 349               | 349               | 380                            | 33,521  | 資本財・サービス   |
| APA GROUP                    |                  | 217               | 242               | 219                            | 19,363  | 公益事業       |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       |                  | 29                | 29                | 192                            | 16,996  | ヘルスケア      |
| ALS LTD                      |                  | 95                | —                 | —                              | —       | 資本財・サービス   |
| オーストラリア・ドル<br>通 貨 計          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 14,292.63<br>56銘柄 | 15,529.36<br>54銘柄 | 22,009<br>1,939,513<br>< 2.4%> |         |            |
| (香港)                         |                  | 百株                | 百株                | 千香港ドル                          | 千円      |            |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    |                  | 320               | 300               | 2,083                          | 33,023  | 公益事業       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L |                  | 520               | 520               | 1,193                          | 18,915  | 一般消費財・サービス |
| MTR CORP                     |                  | 375               | 320               | 1,152                          | 18,259  | 資本財・サービス   |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      |                  | 370               | 380               | 3,659                          | 58,001  | 金融         |
| SINO LAND CO                 |                  | 880               | 880               | 997                            | 15,817  | 金融         |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    |                  | 310               | 586.69            | 5,937                          | 94,106  | 資本財・サービス   |
| WHARF HOLDINGS LTD           |                  | 340               | 290               | 1,293                          | 20,500  | 金融         |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     |                  | 145               | 125               | 1,065                          | 16,880  | 金融         |
| CLP HOLDINGS LTD             |                  | 425               | 410               | 2,681                          | 42,500  | 公益事業       |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS       |                  | 410               | 330               | 450                            | 7,134   | 資本財・サービス   |
| HUTCHISON WHAMPOA LTD        |                  | 483               | —                 | —                              | —       | その他        |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   |                  | 234.6             | 258.06            | 1,238                          | 19,633  | 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                       |            |
|                              | 百株               | 百株                | 千香港ドル             | 千円                           |            |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 1,439.03         | 1,494.93          | 2,311             | 36,631                       | 公益事業       |
| HANG SENG BANK LTD           | 169              | 168               | 2,365             | 37,492                       | 金融         |
| WHEELLOCK & CO LTD           | 250              | 250               | 856               | 13,571                       | 金融         |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 1,130            | 1,130             | 870               | 13,791                       | 金融         |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 244              | 245               | 4,993             | 79,140                       | 金融         |
| LI & FUNG LTD                | 1,320            | 1,320             | 703               | 11,151                       | 一般消費財・サービス |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 520              | 520               | 952               | 15,099                       | 金融         |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY       | 65               | 65                | 389               | 6,166                        | 情報技術       |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG     | 210              | 210               | 568               | 9,003                        | 一般消費財・サービス |
| NWS HOLDINGS LTD             | 465              | 465               | 488               | 7,738                        | 資本財・サービス   |
| KERRY PROPERTIES LTD         | 225              | 180               | 399               | 6,333                        | 金融         |
| BANK OF EAST ASIA            | 290.4            | 290.4             | 807               | 12,795                       | 金融         |
| SJM HOLDINGS LTD             | 470              | 470               | 268               | 4,253                        | 一般消費財・サービス |
| SWIRE PROPERTIES LTD         | 300              | 300               | 691               | 10,960                       | 金融         |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | —                | 596.69            | 3,031             | 48,044                       | 金融         |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE   | 150              | 150               | 1,023             | 16,214                       | 公益事業       |
| AIA GROUP LTD                | 2,700            | 2,628             | 12,220            | 193,690                      | 金融         |
| SANDS CHINA LTD              | 540              | 540               | 1,412             | 22,381                       | 一般消費財・サービス |
| SHANGRI-LA ASIA LTD          | 420              | 300               | 212               | 3,361                        | 一般消費財・サービス |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 315              | 315               | 989               | 15,677                       | 一般消費財・サービス |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD       | 200              | 200               | 201               | 3,195                        | 一般消費財・サービス |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 815              | 825               | 1,992             | 31,579                       | 金融         |
| SINOCOM SOFTWARE GROUP-PRL   | 60               | —                 | —                 | —                            | その他        |
| WYNN MACAU LTD               | 380              | 380               | 364               | 5,770                        | 一般消費財・サービス |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 570              | 570               | 554               | 8,781                        | 電気通信サービス   |
| 香 港 ド ル<br>通 貨 計             | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 18,060.03<br>36銘柄 | 18,012.77<br>35銘柄 | 60,416<br>957,597<br>< 1.2%> |            |
| (シンガポール)                     | 百株               | 百株                | 千シンガポール・<br>ドル    | 千円                           |            |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 290              | 290               | 557               | 48,439                       | 金融         |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 390              | 385               | 639               | 55,512                       | 金融         |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 164.7            | 124.7             | 128               | 11,134                       | 資本財・サービス   |
| KEPPEL CORP LTD              | 315              | 315               | 208               | 18,085                       | 資本財・サービス   |
| UOL GROUP LTD                | 164              | 132               | 79                | 6,948                        | 金融         |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        | 140              | 112               | 82                | 7,150                        | 金融         |
| CAPITALAND LTD               | 590              | 590               | 179               | 15,579                       | 金融         |
| SEMBCORP MARINE LTD          | 250              | 250               | 52                | 4,538                        | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 410              | 410               | 164               | 14,245                       | 一般消費財・サービス |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 30               | 30                | 96                | 8,375                        | 一般消費財・サービス |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 650              | 670               | 581               | 50,514                       | 金融         |
| GENTING SINGAPORE PLC        | 1,530            | 1,530             | 114               | 9,967                        | 一般消費財・サービス |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 1,784.5          | 1,750.5           | 665               | 57,778                       | 電気通信サービス   |
| NOBLE GROUP LTD              | 1,151.81         | 1,151.81          | 46                | 4,001                        | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 480              | 350               | 101               | 8,785                        | 資本財・サービス   |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | 290              | 290               | 97                | 8,438                        | 資本財・サービス   |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 2,194            | 2,194             | 77                | 6,765                        | 生活必需品      |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 190              | 190               | 142               | 12,394                       | 金融         |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       | 410              | 468               | 137               | 11,910                       | 資本財・サービス   |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 560              | 560               | 162               | 14,106                       | 生活必需品      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 690              | 690               | 138               | 11,986                       | 金融         |
| シンガポール・ドル<br>通 貨 計           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 12,674.01<br>21銘柄 | 12,483.01<br>21銘柄 | 4,451<br>386,656<br>< 0.5%>  |            |





外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株数               | 期首               | 期末               |                   | 業種等        |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|------------|
|                              |                  | 株数               | 評価額              |                   |            |
|                              |                  |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額            |            |
|                              | 百株               | 百株               | 千スウェーデン・<br>クロネ  | 千円                |            |
| SANDVIK AB                   | 237.5            | 223.5            | 1,963            | 27,547            | 資本財・サービス   |
| INVESTOR AB-B SHS            | 104              | 101              | 3,337            | 46,818            | 金融         |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 151              | 144              | 3,345            | 46,932            | 資本財・サービス   |
| SECURITAS AB-B SHS           | 92               | 92               | 1,214            | 17,038            | 資本財・サービス   |
| TELIASONERA AB               | 540.5            | 558              | 2,388            | 33,507            | 電気通信サービス   |
| ALFA LAVAL AB                | 70               | 70               | 1,118            | 15,693            | 資本財・サービス   |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 89               | 83               | 1,782            | 25,013            | 資本財・サービス   |
| ASSA ABLOY AB-B              | 74               | 211              | 3,871            | 54,322            | 資本財・サービス   |
| LUNDIN PETROLEUM AB          | 64               | 64               | 865              | 12,139            | エネルギー      |
| BOLIDEN AB                   | 79               | 60               | 940              | 13,199            | 素材         |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | 125.5            | 125.5            | 704              | 9,877             | 一般消費財・サービス |
| INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS | 53               | 53               | 1,403            | 19,690            | 金融         |
| HEXAGON AB-B SHS             | 55.5             | 55.5             | 1,746            | 24,496            | 情報技術       |
| スウェーデン・クロネ<br>通貨計            | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 4,957.8<br>29銘柄  | 5,080.3<br>29銘柄  | 68,069<br>< 1.2%> | 955,009    |
| ユーロ (アイルランド)                 | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円                |            |
| BANK OF IRELAND              | 6,618            | 6,618            | 234              | 30,513            | 金融         |
| KERRY GROUP PLC-A            | 36               | 34               | 254              | 33,009            | 生活必需品      |
| CRH PLC                      | 166              | 175              | 487              | 63,300            | 素材         |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 6,820<br>3銘柄     | 6,827<br>3銘柄     | 976<br>< 0.2%>    | 126,823    |
| ユーロ (オランダ)                   | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円                |            |
| QIAGEN N.V.                  | 53.5             | 48.5             | 122              | 15,877            | ヘルスケア      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 218.76           | 204.76           | 528              | 68,653            | 資本財・サービス   |
| NN GROUP NV                  | —                | 48               | 157              | 20,451            | 金融         |
| UNILEVER NV-CVA              | 366.5            | 351.5            | 1,487            | 193,202           | 生活必需品      |
| HEINEKEN NV                  | 52.5             | 51               | 433              | 56,283            | 生活必需品      |
| RELX NV                      | 159.27           | 214.19           | 351              | 45,637            | 一般消費財・サービス |
| AEGON NV                     | 407.44           | 407.44           | 236              | 30,692            | 金融         |
| KONINKLIJKE AHOLD NV         | 212.43           | 192.93           | 397              | 51,644            | 生活必需品      |
| AKZO NOBEL                   | 55               | 55               | 364              | 47,353            | 素材         |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 40.5             | 38               | 181              | 23,618            | 素材         |
| WOLTERS KLUWER               | 69               | 69               | 226              | 29,439            | 一般消費財・サービス |
| BOSKALIS WESTMINSTER         | 21               | 21               | 89               | 11,571            | 資本財・サービス   |
| ING GROEP NV-CVA             | 867.5            | 847.5            | 1,116            | 145,021           | 金融         |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 735.5            | 684.5            | 246              | 31,996            | 電気通信サービス   |
| ASML HOLDING NV              | 78.8             | 74.3             | 648              | 84,283            | 情報技術       |
| TNT EXPRESS NV               | 101.95           | 101.95           | 78               | 10,187            | 資本財・サービス   |
| VOPAK                        | 20               | 20               | 81               | 10,578            | エネルギー      |
| RANDSTAD HOLDING NV          | 29.5             | 26.5             | 155              | 20,200            | 資本財・サービス   |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 23               | 23               | 171              | 22,254            | 生活必需品      |
| GEMALTO                      | 19               | 17               | 101              | 13,174            | 情報技術       |
| OCI NV                       | 23               | 23               | 53               | 7,011             | 素材         |
| DELTA LLOYD NV               | 44               | —                | —                | —                 | 金融         |
| ALTICE NV - A                | —                | 57               | 82               | 10,749            | 一般消費財・サービス |
| ALTICE NV - B                | —                | 19               | 28               | 3,665             | 一般消費財・サービス |
| AIRBUS GROUP SE              | 131.5            | 128              | 869              | 112,964           | 資本財・サービス   |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 209              | 209              | 142              | 18,553            | 資本財・サービス   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 193.5            | 193.5            | 261              | 33,927            | 一般消費財・サービス |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 4,132.15<br>24銘柄 | 4,125.57<br>26銘柄 | 8,615<br>< 1.4%>  | 1,118,993  |

| 銘柄                               |  | 期 首              |               | 当 期 末         |                  | 業 種 等      |
|----------------------------------|--|------------------|---------------|---------------|------------------|------------|
|                                  |  | 株 数              | 株 数           | 評 価 額         | 業 種 等            |            |
|                                  |  |                  |               | 外貨建金額         | 邦貨換算金額           |            |
| ユーロ（ベルギー）                        |  | 百株               | 百株            | 千ユーロ          | 千円               |            |
| UCB SA                           |  | 28               | 27.5          | 228           | 29,684           | ヘルスケア      |
| KBC GROEP NV                     |  | 55.5             | 54.5          | 307           | 39,993           | 金融         |
| COLRUYT SA                       |  | 25               | 20            | 93            | 12,193           | 生活必需品      |
| DELHAIZE GROUP                   |  | 23               | 23            | 217           | 28,289           | 生活必需品      |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA      |  | 18.5             | 17            | 131           | 17,113           | 金融         |
| SOLVAY SA                        |  | 13.5             | 12.5          | 134           | 17,428           | 素材         |
| UMICORE                          |  | 29.5             | 29.5          | 114           | 14,866           | 素材         |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV       |  | 178.5            | 174           | 2,134         | 277,178          | 生活必需品      |
| AGEAS                            |  | 51.9             | 47.9          | 197           | 25,703           | 金融         |
| PROXIMUS                         |  | 35               | 35            | 110           | 14,389           | 電気通信サービス   |
| 国 小 計                            |  | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 458.4<br>10銘柄 | 440.9<br>10銘柄 | 3,671<br>< 0.6%> | 476,839    |
| ユーロ（ルクセンブルグ）                     |  | 百株               | 百株            | 千ユーロ          | 千円               |            |
| RTL GROUP                        |  | 10               | 10            | 83            | 10,831           | 一般消費財・サービス |
| ARCELORMITTAL                    |  | 224              | 213           | 97            | 12,662           | 素材         |
| ALTICE SA                        |  | 20.5             | —             | —             | —                | その他        |
| SES                              |  | 68.5             | 69.5          | 184           | 24,015           | 一般消費財・サービス |
| TENARIS SA                       |  | 105.5            | 105.5         | 127           | 16,593           | エネルギー      |
| 国 小 計                            |  | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 428.5<br>5銘柄  | 398<br>4銘柄    | 493<br>< 0.1%>   | 64,102     |
| ユーロ（フランス）                        |  | 百株               | 百株            | 千ユーロ          | 千円               |            |
| NUMERICABLE-SFR                  |  | —                | 23            | 93            | 12,092           | 一般消費財・サービス |
| TOTAL SA                         |  | 478              | 471           | 2,195         | 285,190          | エネルギー      |
| MICHELIN (CGDE)                  |  | 41.5             | 40            | 379           | 49,276           | 一般消費財・サービス |
| AIR LIQUIDE SA                   |  | 77.48            | 75.48         | 875           | 113,718          | 素材         |
| KERING                           |  | 19               | 16            | 258           | 33,633           | 一般消費財・サービス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE            |  | 117              | 123           | 724           | 94,158           | 資本財・サービス   |
| BOUYGUES SA                      |  | 37.5             | 42.5          | 150           | 19,540           | 資本財・サービス   |
| LAFARGE SA                       |  | 42               | —             | —             | —                | 素材         |
| BNP PARIBAS                      |  | 235.5            | 231.5         | 1,296         | 168,436          | 金融         |
| PEUGEOT SA                       |  | 92.5             | 93.5          | 152           | 19,855           | 一般消費財・サービス |
| NATIXIS                          |  | 215.5            | 201.5         | 114           | 14,817           | 金融         |
| THALES SA                        |  | 22.5             | 22.5          | 157           | 20,473           | 資本財・サービス   |
| DANONE                           |  | 129              | 126           | 819           | 106,404          | 生活必需品      |
| CARREFOUR SA                     |  | 140.5            | 121           | 355           | 46,117           | 生活必需品      |
| SUEZ ENVIRONNEMENT CO            |  | 80.75            | 63.75         | 114           | 14,924           | 公益事業       |
| VIVENDI                          |  | 272.41           | 250.41        | 502           | 65,225           | 一般消費財・サービス |
| L'OREAL                          |  | 56.5             | 55            | 928           | 120,544          | 生活必需品      |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN        |  | 100              | 105           | 433           | 56,315           | 資本財・サービス   |
| LEGRAND SA                       |  | 59.17            | 57.17         | 313           | 40,682           | 資本財・サービス   |
| ALCATEL-LUCENT                   |  | 630              | 602           | 223           | 28,999           | 情報技術       |
| CASINO GUICHARD PERRACHON        |  | 13               | 13            | 69            | 9,087            | 生活必需品      |
| PERNOD RICARD SA                 |  | 46.67            | 47.17         | 508           | 66,043           | 生活必需品      |
| SOCIETE BIC SA                   |  | —                | 6             | 92            | 12,074           | 資本財・サービス   |
| EURAZEO                          |  | 9.76             | 10.24         | 64            | 8,370            | 金融         |
| REXEL SA                         |  | 60.5             | 60.5          | 77            | 10,069           | 資本財・サービス   |
| SOCIETE GENERALE SA              |  | 162              | 158           | 707           | 91,954           | 金融         |
| LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON |  | 62               | 60.5          | 943           | 122,541          | 一般消費財・サービス |
| ACCOR SA                         |  | 38               | 44            | 173           | 22,530           | 一般消費財・サービス |
| CAP GEMINI                       |  | 32.5             | 35            | 297           | 38,666           | 情報技術       |
| VALEO SA                         |  | 16.5             | 16.5          | 239           | 31,073           | 一般消費財・サービス |
| PUBLICIS GROUPE                  |  | 41               | 41            | 244           | 31,705           | 一般消費財・サービス |
| VALLOUREC SA                     |  | 26.5             | —             | —             | —                | 資本財・サービス   |

| 銘柄                          | 株数               | 期首株数             | 期末              |                                | 業種等        |
|-----------------------------|------------------|------------------|-----------------|--------------------------------|------------|
|                             |                  |                  | 評価額             | 外貨建金額                          |            |
|                             |                  |                  |                 |                                |            |
| BUREAU VERITAS SA           | 56               | 60.5             | 118             | 15,350                         | 資本財・サービス   |
| SODEXO                      | 22               | 20.5             | 190             | 24,719                         | 一般消費財・サービス |
| INGENICO GROUP              | —                | 12               | 140             | 18,289                         | 情報技術       |
| ZODIAC AEROSPACE            | 42               | 42               | 105             | 13,672                         | 資本財・サービス   |
| ESSILOR INTERNATIONAL       | 46               | 44.5             | 548             | 71,292                         | ヘルスケア      |
| AXA SA                      | 406.5            | 429              | 1,095           | 142,332                        | 金融         |
| CHRISTIAN DIOR SE           | 12               | 12               | 205             | 26,635                         | 一般消費財・サービス |
| LAGARDERE SCA               | 38               | 26.5             | 73              | 9,568                          | 一般消費財・サービス |
| TECHNIP SA                  | 23.5             | 22               | 108             | 14,115                         | エネルギー      |
| EDENRED                     | 47.5             | 47.5             | 92              | 12,008                         | 資本財・サービス   |
| RENAULT SA                  | 43               | 41.5             | 390             | 50,709                         | 一般消費財・サービス |
| HERMES INTERNATIONAL        | —                | 5.7              | 188             | 24,511                         | 一般消費財・サービス |
| ATOS SE                     | 18               | 18               | 137             | 17,809                         | 情報技術       |
| DASSAULT SYSTEMES SA        | 28               | 28               | 210             | 27,289                         | 情報技術       |
| WENDEL                      | 11               | 6                | 67              | 8,727                          | 金融         |
| ORANGE                      | 419              | 433              | 719             | 93,467                         | 電気通信サービス   |
| ALSTOM                      | 49.5             | 46.5             | 135             | 17,538                         | 資本財・サービス   |
| CNP ASSURANCES              | 51.5             | 37.5             | 49              | 6,404                          | 金融         |
| SANOFI                      | 264.25           | 254.25           | 2,131           | 276,823                        | ヘルスケア      |
| VINCI SA                    | 109.5            | 103.5            | 642             | 83,491                         | 資本財・サービス   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT        | 93.5             | 93.5             | 214             | 27,797                         | 公益事業       |
| CREDIT AGRICOLE SA          | 230              | 221              | 251             | 32,707                         | 金融         |
| ENGIE                       | 319.73           | 316.73           | 515             | 67,011                         | 公益事業       |
| IMERYS SA                   | 11               | 9                | 57              | 7,430                          | 素材         |
| EDF                         | 55.5             | 55.5             | 78              | 10,225                         | 公益事業       |
| SAFRAN SA                   | 61               | 63.5             | 437             | 56,816                         | 資本財・サービス   |
| ILIAD SA                    | 6                | 6                | 126             | 16,399                         | 電気通信サービス   |
| ARKEMA                      | 15.5             | 15.5             | 103             | 13,405                         | 素材         |
| ADP                         | 9.5              | 7.5              | 79              | 10,364                         | 資本財・サービス   |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS     | 40.5             | 40.5             | 113             | 14,804                         | 一般消費財・サービス |
| SCOR SE                     | 45.5             | 34               | 125             | 16,341                         | 金融         |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR | 104.5            | 104.5            | 125             | 16,361                         | 資本財・サービス   |
| BOLLORE                     | —                | 166              | 72              | 9,402                          | 資本財・サービス   |
| 国小計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 6,034.72<br>60銘柄 | 6,035.9<br>63銘柄 | 23,162<br>3,008,353<br>< 3.8%> |            |
| ユーロ (ドイツ)                   | 百株               | 百株               | 千ユーロ            | 千円                             |            |
| BAYER AG-REG                | 183.5            | 180.5            | 2,270           | 294,917                        | ヘルスケア      |
| EVONIK INDUSTRIES AG        | —                | 30               | 99              | 12,863                         | 素材         |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 311              | 299.5            | 718             | 93,338                         | 金融         |
| COMMERZBANK AG              | 216.85           | 229.85           | 237             | 30,852                         | 金融         |
| VOLKSWAGEN AG               | 7.5              | 8                | 107             | 13,949                         | 一般消費財・サービス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF          | 36.5             | 35.5             | 439             | 57,104                         | 一般消費財・サービス |
| MAN SE                      | 10.5             | 8.5              | 79              | 10,367                         | 資本財・サービス   |
| SIEMENS AG-REG              | 179.5            | 173              | 1,675           | 217,659                        | 資本財・サービス   |
| E.ON SE                     | 449              | 445              | 400             | 52,040                         | 公益事業       |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 75               | 72.5             | 735             | 95,575                         | 一般消費財・サービス |
| GEA GROUP AG                | 44               | 42               | 160             | 20,813                         | 資本財・サービス   |
| OSRAM LICHT AG              | 24.1             | 19.1             | 74              | 9,707                          | 資本財・サービス   |
| CONTINENTAL AG              | 25.5             | 24.5             | 552             | 71,771                         | 一般消費財・サービス |
| BASF SE                     | 207.5            | 201              | 1,565           | 203,312                        | 素材         |
| LINDE AG                    | 42               | 40.5             | 681             | 88,528                         | 素材         |
| K+S AG-REG                  | 44               | 44               | 116             | 15,084                         | 素材         |
| ALLIANZ SE-REG              | 101.5            | 98.5             | 1,647           | 214,029                        | 金融         |
| THYSSENKRUPP AG             | 107.5            | 78               | 154             | 20,094                         | 素材         |

| 銘柄                           | 期 首<br>株 数       | 当 期 末<br>株 数     | 評 価 額            |                                | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|--------------------------------|------------|
|                              |                  |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                         |            |
|                              |                  |                  |                  |                                |            |
|                              | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円                             |            |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 41               | 39               | 423              | 54,958                         | 生活必需品      |
| RWE AG                       | 108              | 108              | 117              | 15,247                         | 公益事業       |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 67.5             | 50.5             | 67               | 8,772                          | 資本財・サービス   |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 11               | 9                | 51               | 6,697                          | 資本財・サービス   |
| BRENNTAG AG                  | 37.5             | 34               | 173              | 22,490                         | 資本財・サービス   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 86               | 84               | 584              | 75,922                         | ヘルスケア      |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 33               | 27               | 135              | 17,572                         | 情報技術       |
| SAP SE                       | 210.42           | 214.92           | 1,602            | 208,069                        | 情報技術       |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 39               | 36.5             | 689              | 89,574                         | 金融         |
| HEIDELBERGCEMENT AG          | 34               | 31               | 231              | 30,092                         | 素材         |
| PORSCHE AUTOMOBIL HDG-PHF    | 34               | 34               | 163              | 21,238                         | 一般消費財・サービス |
| BEIERSDORF AG                | 24.5             | 21.5             | 190              | 24,799                         | 生活必需品      |
| CELESIO AG                   | 14.5             | —                | —                | —                              | ヘルスケア      |
| MERCK KGAA                   | 29               | 29               | 279              | 36,305                         | ヘルスケア      |
| ADIDAS AG                    | 48.7             | 45.7             | 408              | 53,105                         | 一般消費財・サービス |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 26.5             | 22               | 203              | 26,484                         | 生活必需品      |
| METRO AG                     | 37               | 37               | 116              | 15,130                         | 生活必需品      |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 713.5            | 694              | 1,213            | 157,558                        | 電気通信サービス   |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 48.5             | 48.5             | 382              | 49,706                         | ヘルスケア      |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 218              | 210.5            | 1,735            | 225,416                        | 一般消費財・サービス |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 269              | 247.5            | 336              | 43,717                         | 情報技術       |
| HANNOVER RUECK SE            | 14               | 14               | 154              | 20,083                         | 金融         |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 221.5            | 212              | 584              | 75,871                         | 資本財・サービス   |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 42.5             | 41.5             | 335              | 43,578                         | 金融         |
| PROSIEBSAT.1 MEDIA SE        | 52               | 47.5             | 235              | 30,596                         | 一般消費財・サービス |
| LANXESS AG                   | 22.5             | 19.5             | 92               | 12,004                         | 素材         |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR        | 70.5             | 76.5             | 197              | 25,604                         | 金融         |
| SYMRIS AG                    | 28               | 28               | 175              | 22,743                         | 素材         |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG | 6.5              | 5.5              | 63               | 8,275                          | 一般消費財・サービス |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | —                | 128              | 68               | 8,957                          | 電気通信サービス   |
| HUGO BOSS AG -ORD            | 8                | 14               | 114              | 14,835                         | 一般消費財・サービス |
| VONOVIA SE                   | —                | 104              | 315              | 40,921                         | 金融         |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 4,661.57<br>47銘柄 | 4,744.07<br>49銘柄 | 23,162<br>3,008,341<br>< 3.8%> |            |
| ユーロ (ポルトガル)                  | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円                             |            |
| JERONIMO MARTINS             | 60               | 60               | 77               | 10,044                         | 生活必需品      |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 590              | 495              | 160              | 20,817                         | 公益事業       |
| GALP ENERGIA SGPS SA         | 103.5            | 103.5            | 102              | 13,294                         | エネルギー      |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 753.5<br>3銘柄     | 658.5<br>3銘柄     | 339<br>44,156<br>< 0.1%>       |            |
| ユーロ (スペイン)                   | 百株               | 百株               | 千ユーロ             | 千円                             |            |
| TELEFONICA SA                | 921.77           | 969.27           | 1,127            | 146,471                        | 電気通信サービス   |
| CAIXABANK SA-RTS             | 402              | —                | —                | —                              | その他        |
| ENDESA SA                    | —                | 68.5             | 133              | 17,299                         | 公益事業       |
| BANCO POPULAR ESPANOL        | 404.73           | 404.73           | 134              | 17,430                         | 金融         |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 1,317.12         | 1,371.12         | 1,072            | 139,241                        | 金融         |
| IBERDROLA SA                 | 1,148.34         | 1,162.34         | 774              | 100,633                        | 公益事業       |
| BANCO DE SABADELL SA         | 805.72           | 1,077.16         | 184              | 23,979                         | 金融         |
| BANKINTER SA                 | —                | 131              | 88               | 11,496                         | 金融         |
| REPSOL SA                    | 229.5            | 223              | 274              | 35,711                         | エネルギー      |
| GRIFOLS SA                   | 33.5             | 33.5             | 150              | 19,492                         | ヘルスケア      |
| BANCO SANTANDER SA           | 2,765.5          | 3,121.5          | 1,597            | 207,453                        | 金融         |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA  | 93               | 101              | 146              | 19,040                         | 資本財・サービス   |
| AMADEUS IT HOLDING SAA SHS   | 85.5             | 96               | 359              | 46,713                         | 情報技術       |

外国株式インデックスマザーファンド

| 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                | 千ユーロ           | 千円                   |            |
| GAS NATURAL SDG SA           |                  | 80                | 74.5              | 152            | 19,787               | 公益事業       |
| MAPFRE SA                    |                  | 214.5             | 214.5             | 55             | 7,226                | 金融         |
| CAIXABANK S.A                |                  | 402               | 538               | 185            | 24,100               | 金融         |
| ZARDOYA OTIS SA              |                  | 45.5              | 45.5              | 50             | 6,565                | 資本財・サービス   |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI |                  | 228               | 180               | 144            | 18,772               | 資本財・サービス   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  |                  | 42.76             | 37.76             | 116            | 15,156               | 資本財・サービス   |
| AENA SA                      |                  | —                 | 14.5              | 151            | 19,614               | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL   |                  | 240               | 239               | 799            | 103,879              | 一般消費財・サービス |
| ENAGAS SA                    |                  | 47                | 47                | 133            | 17,354               | 公益事業       |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA |                  | 25                | 25                | 203            | 26,375               | 公益事業       |
| FERROVIAL SA                 |                  | 98                | 98                | 219            | 28,523               | 資本財・サービス   |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL  |                  | 187               | 187               | 109            | 14,273               | 生活必需品      |
| BANKIA SA                    |                  | 1,084.22          | 1,084.22          | 125            | 16,349               | 金融         |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 10,900.66<br>23銘柄 | 11,544.1<br>25銘柄  | 8,492<br>----- | 1,102,944<br>< 1.4%> |            |
| ユーロ (イタリア)                   |                  | 百株                | 百株                | 千ユーロ           | 千円                   |            |
| UNIPOLSAI SPA                |                  | 217.5             | 217.5             | 52             | 6,836                | 金融         |
| BANCO POPOLARE SC            |                  | 83                | 83                | 112            | 14,671               | 金融         |
| PRYSMIAN SPA                 |                  | 57                | 57                | 117            | 15,235               | 資本財・サービス   |
| ASSICURAZIONI GENERALI       |                  | 262.43            | 253.43            | 451            | 58,622               | 金融         |
| SAIPEM SPA                   |                  | 61                | 61                | 49             | 6,441                | エネルギー      |
| MEDIOBANCA SPA               |                  | 146.15            | 146.15            | 132            | 17,150               | 金融         |
| UNICREDIT SPA                |                  | 975.69            | 1,037.69          | 575            | 74,732               | 金融         |
| TELECOM ITALIA SPA           |                  | 2,299.82          | 2,457.82          | 302            | 39,328               | 電気通信サービス   |
| TELECOM ITALIA-RSP           |                  | 1,349.5           | 1,349.5           | 147            | 19,192               | 電気通信サービス   |
| INTESA SANPAOLO              |                  | 2,597.97          | 2,745.97          | 882            | 114,626              | 金融         |
| ATLANTIA SPA                 |                  | 94.07             | 89.07             | 220            | 28,654               | 資本財・サービス   |
| ENI SPA                      |                  | 572.5             | 544               | 832            | 108,172              | エネルギー      |
| FINMECCANICA SPA             |                  | 112.25            | 112.25            | 153            | 19,987               | 資本財・サービス   |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA |                  | 963.19            | 508.15            | 75             | 9,833                | 金融         |
| ENEL SPA                     |                  | 1,483             | 1,515             | 629            | 81,737               | 公益事業       |
| SNAM SPA                     |                  | 467               | 444               | 214            | 27,853               | 公益事業       |
| LUXOTTICA GROUP SPA          |                  | 37                | 37                | 231            | 30,106               | 一般消費財・サービス |
| UBI BANCA SPA                |                  | 196               | 196               | 125            | 16,304               | 金融         |
| TERNA SPA                    |                  | 347               | 322               | 149            | 19,446               | 公益事業       |
| PIRELLI & C.                 |                  | 76.45             | —                 | —              | —                    | その他        |
| ENEL GREEN POWER SPA         |                  | 554               | 404               | 80             | 10,441               | 公益事業       |
| EXOR SPA                     |                  | 21                | 21                | 87             | 11,343               | 金融         |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12,973.52<br>22銘柄 | 12,601.53<br>21銘柄 | 5,626<br>----- | 730,720<br>< 0.9%>   |            |
| ユーロ (フィンランド)                 |                  | 百株                | 百株                | 千ユーロ           | 千円                   |            |
| UPM-KYMMENE OYJ              |                  | 118.5             | 113               | 202            | 26,300               | 素材         |
| NOKIA OYJ                    |                  | 841.5             | 776.5             | 529            | 68,730               | 情報技術       |
| WARTSILA OYJ ABP             |                  | 34.5              | 32                | 135            | 17,555               | 資本財・サービス   |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         |                  | 131               | 131               | 121            | 15,746               | 素材         |
| METSO OYJ                    |                  | 37.5              | 30                | 69             | 9,086                | 資本財・サービス   |
| ELISA OYJ                    |                  | 45.5              | 35.5              | 124            | 16,225               | 電気通信サービス   |
| SAMPO OYJ-A SHS              |                  | 99.5              | 96.5              | 451            | 58,656               | 金融         |
| FORTUM OYJ                   |                  | 99.5              | 94.5              | 131            | 17,072               | 公益事業       |
| KONE OYJ-B                   |                  | 69.5              | 66.5              | 267            | 34,746               | 資本財・サービス   |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           |                  | 30                | 30                | 108            | 14,081               | 一般消費財・サービス |
| NESTE OYJ                    |                  | 43                | 34.5              | 90             | 11,744               | エネルギー      |

| 銘 柄                          |                  | 期 首                  |                       | 期 末        |                        | 業 種 等    |
|------------------------------|------------------|----------------------|-----------------------|------------|------------------------|----------|
|                              |                  | 株 数                  | 株 数                   | 評 価 額      | 外貨建金額<br>邦貨換算金額        |          |
| ORION OYJ-CLASS B            |                  | 百株<br>20.5           | 百株<br>20.5            | 千ユーロ<br>67 | 千円<br>8,709            | ヘルスケア    |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,570.5<br>12銘柄      | 1,460.5<br>12銘柄       | 2,299      | 298,655<br>< 0.4%>     |          |
| ユーロ (オーストリア)                 |                  | 百株                   | 百株                    | 千ユーロ       | 千円                     |          |
| IMMOFINANZ AG                |                  | 312                  | —                     | —          | —                      | 金融       |
| OMV AG                       |                  | 35.5                 | 35.5                  | 94         | 12,276                 | エネルギー    |
| ERSTE GROUP BANK AG          |                  | 55.5                 | 55.5                  | 155        | 20,241                 | 金融       |
| VOESTALPINE AG               |                  | 28.5                 | 28.5                  | 88         | 11,487                 | 素材       |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA |                  | 24                   | 24                    | 35         | 4,646                  | 金融       |
| ANDRITZ AG                   |                  | 16                   | 16                    | 79         | 10,342                 | 資本財・サービス |
| VIENNA INSURANCE GROUP AG    |                  | 10                   | —                     | —          | —                      | 金融       |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 481.5<br>7銘柄         | 159.5<br>5銘柄          | 454        | 58,993<br>< 0.1%>      |          |
| ユーロ (その他)                    |                  | 百株                   | 百株                    | 千ユーロ       | 千円                     |          |
| STMICROELECTRONICS NV        |                  | 159.5                | 137                   | 94         | 12,215                 | 情報技術     |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 159.5<br>1銘柄         | 137<br>1銘柄            | 94         | 12,215<br>< 0.0%>      |          |
| ユーロ通貨計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 49,374.52<br>217銘柄   | 49,132.57<br>222銘柄    | 77,387     | 10,051,140<br>< 12.6%> |          |
| ファンド合計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 287,670.9<br>1,200銘柄 | 283,613.45<br>1,201銘柄 | —          | 76,810,694<br>< 96.2%> |          |

(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。

(2) 外国投資信託証券

| 銘柄                           | 期 首                         |                             | 当 期                        |                               | 期 末 |     |
|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|-------------------------------|-----|-----|
|                              | 口 数                         | 口 数                         | 評 価 額                      |                               | 口 数 | 口 数 |
|                              |                             |                             | 外貨建金額                      | 邦貨換算金額                        |     |     |
| (アメリカ)                       | 千口                          | 千口                          | 千アメリカ・ドル                   | 千円                            |     |     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 2.847                       | 2.847                       | 519                        | 63,762                        |     |     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 6.887                       | 6.587                       | 1,251                      | 153,712                       |     |     |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 3.4                         | 3.3                         | 415                        | 50,995                        |     |     |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES    | 12.3                        | 12.1                        | 313                        | 38,490                        |     |     |
| VORNADO REALTY TRUST         | 3.827                       | 3.627                       | 353                        | 43,455                        |     |     |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 7.7                         | 7.9                         | 637                        | 78,252                        |     |     |
| EQUINIX INC                  | —                           | 1.158                       | 344                        | 42,347                        |     |     |
| AMERICAN TOWER CORP          | 8.7                         | 9.1                         | 907                        | 111,408                       |     |     |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 17.093                      | 16.093                      | 267                        | 32,850                        |     |     |
| KIMCO REALTY CORP            | 9.4                         | 8.7                         | 229                        | 28,187                        |     |     |
| PLUM CREEK TIMBER CO         | 4                           | 3.7                         | 188                        | 23,212                        |     |     |
| RAYONIER INC                 | 3                           | —                           | —                          | —                             |     |     |
| VENTAS INC                   | 6.6                         | 7                           | 375                        | 46,142                        |     |     |
| WEYERHAEUSER CO              | —                           | 11.094                      | 359                        | 44,106                        |     |     |
| AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | 7.8                         | 7.8                         | 140                        | 17,253                        |     |     |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | —                           | 7.2                         | 619                        | 76,112                        |     |     |
| IRON MOUNTAIN INC            | 3.91                        | 3.91                        | 109                        | 13,475                        |     |     |
| VEREIT INC                   | 20.4                        | 20.4                        | 169                        | 20,871                        |     |     |
| PROLOGIS INC                 | 11.162                      | 11.062                      | 482                        | 59,236                        |     |     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 2                           | 1.8                         | 139                        | 17,182                        |     |     |
| DUKE REALTY CORP             | 8                           | 7.3                         | 148                        | 18,263                        |     |     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 1.4                         | 1.4                         | 327                        | 40,206                        |     |     |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 1.5                         | 1.5                         | 221                        | 27,247                        |     |     |
| WELLTOWER INC                | 7.1                         | 7.4                         | 467                        | 57,431                        |     |     |
| HCP INC                      | 10.2                        | 9.7                         | 346                        | 42,578                        |     |     |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 3.3                         | 3.3                         | 112                        | 13,845                        |     |     |
| MACERICH CO/THE              | 3.2                         | 3                           | 238                        | 29,244                        |     |     |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 21.4                        | 19.8                        | 191                        | 23,540                        |     |     |
| REALTY INCOME CORP           | 5.2                         | 4.8                         | 240                        | 29,494                        |     |     |
| PUBLIC STORAGE               | 3.3                         | 3.1                         | 746                        | 91,682                        |     |     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 2.1                         | 2.1                         | 143                        | 17,567                        |     |     |
| SL GREEN REALTY CORP         | 2.1                         | 2.1                         | 249                        | 30,672                        |     |     |
| UDR INC                      | 5.7                         | 5.7                         | 215                        | 26,406                        |     |     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 3.1                         | 2.8                         | 202                        | 24,818                        |     |     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | —                           | 2.3                         | 193                        | 23,709                        |     |     |
| アメリカ・ドル<br>通 貨 計             | 208.626<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 221.678<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 11,869<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,457,764<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> |     |     |
| (オーストラリア)                    | 千口                          | 千口                          | 千オーストラリア・ドル                | 千円                            |     |     |
| SCENTRE GROUP                | 117.222                     | 116.322                     | 472                        | 41,616                        |     |     |
| NOVION PROPERTY GROUP        | 65.5                        | —                           | —                          | —                             |     |     |
| DEXUS PROPERTY GROUP         | 23.95                       | 23.95                       | 185                        | 16,313                        |     |     |
| GPT GROUP                    | 35.96                       | 40.06                       | 187                        | 16,520                        |     |     |
| MIRVAC GROUP                 | 93.4                        | 93.4                        | 176                        | 15,514                        |     |     |
| STOCKLAND                    | 51.5                        | 51.5                        | 206                        | 18,198                        |     |     |
| WESTFIELD CORP               | 45.596                      | 43.096                      | 413                        | 36,457                        |     |     |
| GOODMAN GROUP                | 40.9                        | 38.2                        | 234                        | 20,634                        |     |     |
| VICINITY CENTRES             | —                           | 74.873                      | 205                        | 18,143                        |     |     |
| オーストラリア・ドル<br>通 貨 計          | 474.028<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 481.401<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 2,081<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>  | 183,399<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   |     |     |
| (香港)                         | 千口                          | 千口                          | 千香港ドル                      | 千円                            |     |     |
| LINK REIT                    | 53                          | 49.5                        | 2,333                      | 36,992                        |     |     |
| 香港ドル<br>通 貨 計                | 53<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>      | 49.5<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>    | 2,333<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>  | 36,992<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>    |     |     |

| 銘柄                           | 期 首              |                             | 当 期                         |                         | 期 末                           |        |
|------------------------------|------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------|-------------------------------|--------|
|                              | 口 数              | 口 数                         | 評 価 額                       |                         | 口 数                           | 口 数    |
|                              |                  |                             | 外貨建金額                       | 邦貨換算金額                  |                               |        |
| (シンガポール)                     | 千口               | 千口                          | 千シンガポール・ドル                  | 千円                      |                               |        |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 48               | 48                          | 113                         | 9,839                   |                               |        |
| CAPITALAND MALL TRUST        | 79               | 63.2                        | 118                         | 10,292                  |                               |        |
| シンガポール・ドル<br>通 貨 計           | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 127<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>     | 111.2<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | 231<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 20,132<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>    | <0.0%> |
| (イギリス)                       | 千口               | 千口                          | 千イギリス・ポンド                   | 千円                      |                               |        |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 18               | 17.1                        | 210                         | 38,921                  |                               |        |
| SEGRO PLC                    | 16.75            | 16.75                       | 73                          | 13,481                  |                               |        |
| HAMMERSON PLC                | 17.4             | 17.4                        | 105                         | 19,561                  |                               |        |
| BRITISH LAND CO PLC          | 22               | 20.9                        | 174                         | 32,196                  |                               |        |
| INTU PROPERTIES PLC          | 21.1             | 21.1                        | 68                          | 12,592                  |                               |        |
| イギリス・ポンド<br>通 貨 計            | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 95.25<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | 93.25<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | 632<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 116,753<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | <0.1%> |
| ユーロ (オランダ)                   | 千口               | 千口                          | 千ユーロ                        | 千円                      |                               |        |
| CORIO NV                     | 2.024            | —                           | —                           | —                       |                               |        |
| 国 小 計                        | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 2.024<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | —<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>       | —<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | <—><br>口数、金額<br>銘柄数<比率>       | <—>    |
| ユーロ (フランス)                   | 千口               | 千口                          | 千ユーロ                        | 千円                      |                               |        |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 2.15             | 2.15                        | 525                         | 68,260                  |                               |        |
| ICADE                        | 0.95             | 0.75                        | 50                          | 6,536                   |                               |        |
| GECINA SA                    | 0.75             | 0.75                        | 85                          | 11,148                  |                               |        |
| KLEPIERRE                    | 3.2              | 4.15                        | 176                         | 22,861                  |                               |        |
| FONCIERE DES REGIONS         | 0.95             | 0.75                        | 62                          | 8,129                   |                               |        |
| 国 小 計                        | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | .8<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>      | 8.55<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>    | 900<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 116,937<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | <0.1%> |
| ユーロ通貨計                       | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 10.024<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>  | 8.55<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>    | 900<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 116,937<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | <0.1%> |
| 合 計                          | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 967.928<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | 965.579<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | —<br>口数、金額<br>銘柄数<比率>   | 1,931,978<br>口数、金額<br>銘柄数<比率> | <2.4%> |

(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) 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    |
| 外国 S & P 500 (アメリカ) | 百万円<br>1,026 | 百万円<br>— |

(注1) 外貨建の評価額は、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) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年11月30日現在

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 株式           | 76,810,694 | 96.0  |
| 投資信託証券       | 1,931,978  | 2.4   |
| コール・ローン等、その他 | 1,277,254  | 1.6   |
| 投資信託財産総額     | 80,019,928 | 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香港ドル＝15.85円、1シンガポール・ドル＝86.86円、1ニュージーランド・ドル＝80.03円、1イギリス・ポンド＝184.60円、1イスラエル・シェケル＝31.62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ユーロ＝129.88円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産（79,842,874千円）の投資信託財産総額（80,019,928千円）に対する比率は、99.8%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         | 80,019,928,487円 |
| コール・ローン等       | 416,459,194     |
| 株式(評価額)        | 76,810,694,854  |
| 投資信託証券(評価額)    | 1,931,978,847   |
| 未収入金           | 277,630,394     |
| 未収配当金          | 161,785,867     |
| 差入委託証拠金        | 421,379,331     |
| (B) 負債         | 142,019,000     |
| 未払解約金          | 142,019,000     |
| (C) 純資産総額(A－B) | 79,877,909,487  |
| 元本             | 38,848,551,378  |
| 次期繰越損益金        | 41,029,358,109  |
| (D) 受益権総口数     | 38,848,551,378口 |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 20,561円         |

\* 期首における元本額は41,132,911,173円、当期中における追加設定元本額は4,000,470,289円、同解約元本額は6,284,830,084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、ダイワ外国株式インデックスV A 873,124,109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）45,226,330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）595,884,678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）58,755,519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）1,929,753,813円、D－I's 外国株式インデックス1,475,423円、D Cダイワ外国株式インデックス20,429,635,387円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 425,329,034円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 623,913,204円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 492,714,343円、大和D C海外株式インデックスファンド1,412,182,749円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 7,435,419円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 13,012,768円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 2,933,748円、ダイワ世界分散バランスファンド1 5 V A 333,864円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A 1,499,345円、ダイワ世界分散バランスファンド2 5 V A 19,846,533円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A 163,351,857円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 2,172,615,062円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 532,843,230円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 5,407,208,212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）246,505,874円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式258,796,304円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,989,938,104円、ダイワライフスタイル2 5 21,679,584円、ダイワライフスタイル5 0 68,533,539円、ダイワライフスタイル7 5 54,023,346円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,561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                | 1,814,552,584円  |
| 受取配当金                    | 1,804,095,583   |
| 受取利息                     | 356,234         |
| その他収益金                   | 10,166,149      |
| 支払利息                     | △ 65,382        |
| (B) 有価証券売買損益             | 387,676,875     |
| 売買益                      | 8,479,630,535   |
| 売買損                      | △ 8,091,953,660 |
| (C) 先物取引等損益              | 32,992,584      |
| 取引益                      | 144,909,177     |
| 取引損                      | △ 111,916,593   |
| (D) その他費用                | △ 55,471,855    |
| (E) 当期損益金(A + B + C + D) | 2,179,750,188   |
| (F) 前期繰越損益金              | 41,415,417,526  |
| (G) 解約差損益金               | △ 6,574,906,516 |
| (H) 追加信託差損益金             | 4,009,096,911   |
| (I) 合計(E + F + G + H)    | 41,029,358,109  |
| 次期繰越損益金(I)               | 41,029,358,109  |

(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マザーファンド

## 運用報告書 第23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Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンドの第23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       | 東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果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。）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                                                                                  |
| 運用方法       | ①東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②投資成果を「東証ＲＥＩＴ指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証ＲＥＩＴ指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。 |
| 投資信託証券組入制限 | 無制限                                                                                                                                    |

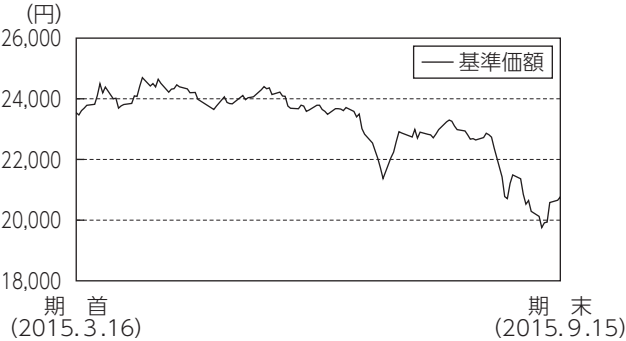
## 大和投資信託

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) |       | 投資信託証券組入比率 |
|----------------|---------|-------|----------------|-------|------------|
|                | 円       | 騰 落 率 | (ベンチマーク)       | 騰 落 率 | %          |
| (期首)2015年3月16日 | 23,542  | % -   | 3,176.82       | % -   | 98.9       |
| 3月末            | 24,018  | 2.0   | 3,241.62       | 2.0   | 98.8       |
| 4月末            | 24,209  | 2.8   | 3,267.36       | 2.9   | 98.9       |
| 5月末            | 24,141  | 2.5   | 3,257.97       | 2.6   | 99.1       |
| 6月末            | 23,404  | △ 0.6 | 3,157.69       | △ 0.6 | 99.2       |
| 7月末            | 22,983  | △ 2.4 | 3,100.40       | △ 2.4 | 99.1       |
| 8月末            | 21,364  | △ 9.3 | 2,881.06       | △ 9.3 | 98.3       |
| (期末)2015年9月15日 | 20,767  | △11.8 | 2,799.25       | △11.9 | 98.8       |

(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：23,542円 期末：20,767円 騰落率：△11.8%

【基準価額の主な変動要因】

わが国のリート市場全体の中長期的な動きを捉える投資成果をめざした運用を行なった結果、リート市況の下落を反映して、基準価額は値下がりしました。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は、期首より、不安定な長期金利動向の影響を受けて方向感の定まらない相場展開で始まりました。2015年6月以降は、ギリシャ支援協議の先行き不透明感などを受けて市況は軟調に推移し、7月に入ると、ギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念の高まりや中国株式市況の急落など市場環境が悪化する中で、大口とみられる売りをきっかけに国内リート市況は一時的に大幅下落しました。その後は、ギリシャ情勢や中国株式市場が落ち着きを見せると国内リート市況も持ち直しましたが、米国の早期利上げ観測の高まりや需給悪化要因となる公募増資が増加することに対する懸念などを背景に、上値が重い展開となりました。8月中旬以降は、中国経済の減速をはじめとする世界的な景気変調への警戒感が強まり国内リート市況も急落しましたが、国内株式市況の反発などを受けてやや持ち直し、期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

引き続き、当ファンドの運用の基本方針に基づき、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を継続します。

◆ポートフォリオについて

東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。組入比率については、期を通じて97～100%程度としました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の騰落率は△11.9%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△11.8%となりました。

・ポートフォリオ構成銘柄の配当落ちなどにより、実質的な組入比率が100%をやや下回る水準で推移したことが上昇局面ではマイナス要因に、下落局面ではプラス要因になりました。

・ポートフォリオの騰落率と東証ＲＥＩＴ指数の騰落率の違い、信託報酬、売買コスト等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。

《今後の運用方針》

引き続き、当ファンドの運用の基本方針に基づき、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

■1万口当りの費用の明細

| 項 目                 | 当 期       |
|---------------------|-----------|
| 売買委託手数料<br>(投資信託証券) | 0円<br>(0) |
| 有価証券取引税             | —         |
| その他費用               | —         |
| 合計                  | 0         |

(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                      |
| 国内 | 千口<br>169.279 | 千円<br>35,632,397 | 千口<br>6.298<br>( - ) | 千円<br>1,345,777<br>( - ) |

(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3月17日から2015年9月15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       |
| ジャパンリアルエステイト    |   | 4.263  |   | 2,404,764 | 564,101 | 日本ビルファンド         |   | 0.236 |   | 123,138 | 521,771 |
| 日本ビルファンド        |   | 3.584  |   | 2,029,422 | 566,245 | ジャパンリアルエステイト     |   | 0.218 |   | 114,229 | 523,989 |
| 日本リートリアルファンド    |   | 8.117  |   | 1,914,540 | 235,868 | 日本プロロジスリート       |   | 0.287 |   | 61,360  | 213,800 |
| オリックス不動産投資      |   | 8.607  |   | 1,447,870 | 168,220 | アドバンス・レジデンス      |   | 0.216 |   | 54,099  | 250,462 |
| ケネディクス商業リート     |   | 4.905  |   | 1,369,166 | 279,136 | 森トラスト総合リート       |   | 0.22  |   | 46,639  | 211,999 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 |   | 6.71   |   | 1,205,556 | 179,665 | ＡＰＩ投資法人          |   | 0.046 |   | 43,149  | 938,035 |
| 日本プライムリアルティ     |   | 2.955  |   | 1,192,707 | 403,623 | フロンティア不動産投資      |   | 0.082 |   | 39,191  | 477,945 |
| 大和証券オフィス投資法人    |   | 1.9    |   | 1,160,588 | 610,836 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 |   | 0.523 |   | 39,139  | 74,836  |
| ＧＬＰ投資法人         |   | 9.196  |   | 1,091,310 | 118,672 | NMF 投資法人         |   | 0.277 |   | 37,849  | 136,641 |
| インヴィンシブル投資法人    |   | 16.463 |   | 1,071,322 | 65,074  | 日本プライムリアルティ      |   | 0.104 |   | 37,696  | 362,469 |

(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 |
|                    |        | 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 | 9.034  |    | 3,505,192  | 2.0 |
| MCUBS MidCity投資法人  | 4.96   |    | 1,436,912  | 0.8 |
| 森ビルズリート            | 29.274 |    | 3,896,369  | 2.2 |
| 野村不レジデンシャル         | 2.998  |    | 1,801,798  | 1.0 |
| 産業ファンド             | 6.574  |    | 3,224,547  | 1.8 |
| 大和ハウスリート           | 6.539  |    | 2,671,181  | 1.5 |
| アドバンス・レジデンス        | 24.239 |    | 5,822,207  | 3.3 |
| ケネディクスレジデンシャル      | 6.509  |    | 1,754,175  | 1.0 |
| ＡＰＩ投資法人            | 5.167  |    | 4,867,314  | 2.7 |
| ＧＬＰ投資法人            | 47.965 |    | 5,300,132  | 3.0 |
| コンフォリア・レジデンシャル     | 8.834  |    | 1,833,055  | 1.0 |
| 日本プロロジスリート         | 32.271 |    | 6,696,232  | 3.7 |
| NMF 投資法人           | 31.049 |    | 4,222,664  | 2.4 |
| 星野リゾート・リート         | 0.926  |    | 964,892    | 0.5 |
| ＳＩＡ不動産投資           | 1.4    |    | 617,400    | 0.3 |
| イオンリート投資           | 20.327 |    | 2,640,477  | 1.5 |
| ヒューリックリート投資法       | 14.562 |    | 2,082,366  | 1.2 |
| 日本リート投資法人          | 7.305  |    | 1,794,838  | 1.0 |
| インベスコ・オフィス・Jリート    | 10.11  |    | 901,812    | 0.5 |
| 日本ヘルスケア投資法         | 1.134  |    | 220,109    | 0.1 |
| 積水ハウス・リート投資        | 14.804 |    | 1,748,352  | 1.0 |
| トーセイ・リート投資法人       | 1.79   |    | 206,924    | 0.1 |
| ケネディクス商業リート        | 4.89   |    | 1,121,277  | 0.6 |
| ヘルスケア&メディカル投資      | 2.247  |    | 224,700    | 0.1 |
| サムティ・レジデンシャル       | 3.046  |    | 237,283    | 0.1 |
| ジャパン・シニアリビング       | 1.58   |    | 240,002    | 0.1 |
| 日本ビルファンド           | 26.327 |    | 14,163,926 | 7.9 |
| ジャパンリアルエステイト       | 24.413 |    | 12,816,825 | 7.2 |
| 日本リートリアルファンド       | 47.526 |    | 10,351,162 | 5.8 |
| オリックス不動産投資         | 42.994 |    | 6,431,902  | 3.6 |
| 日本プライムリアルティ        | 16.277 |    | 5,900,412  | 3.3 |
| プレミアム投資法人          | 4.911  |    | 2,705,961  | 1.5 |
| 東急リアル・エステート        | 18.228 |    | 2,520,932  | 1.4 |
| グローバル・ワン不動産投資法人    | 3.613  |    | 1,237,452  | 0.7 |
| 野村不動産オフィスF         | 6.946  |    | 3,386,175  | 1.9 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人    | 49.591 |    | 7,225,408  | 4.0 |

| フ ァ ン ド 名             | 当 期 末   |         |             |         |
|-----------------------|---------|---------|-------------|---------|
|                       | 口       | 数       | 評 価 額       | 比 率     |
|                       |         | 千口      | 千円          | %       |
| 森トラスト総合リート            | 24.612  |         | 5,121,757   | 2.9     |
| インヴィンシブル投資法人          | 59.548  |         | 3,948,032   | 2.2     |
| フロンティア不動産投資           | 9.248   |         | 4,217,088   | 2.4     |
| 平和不動産リート              | 17.735  |         | 1,461,364   | 0.8     |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人     | 15.566  |         | 3,228,388   | 1.8     |
| 福岡リート投資法人             | 13.928  |         | 2,385,866   | 1.3     |
| ケネディクス・オフィス投資法人       | 7.549   |         | 4,068,911   | 2.3     |
| 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 | 18.983  |         | 1,909,689   | 1.1     |
| いちごオフィスリート投資法人        | 26.408  |         | 2,152,252   | 1.2     |
| 大和証券オフィス投資法人          | 9.024   |         | 5,035,392   | 2.8     |
| 阪急リート投資法人             | 11.141  |         | 1,300,154   | 0.7     |
| スターツプロシード投資法人         | 3.24    |         | 525,528     | 0.3     |
| トップリート投資法人            | 3.282   |         | 1,493,310   | 0.8     |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人     | 13.942  |         | 3,159,257   | 1.8     |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人      | 58.625  |         | 4,426,187   | 2.5     |
| 日本賃貸住宅投資法人            | 30.58   |         | 2,305,732   | 1.3     |
| ジャパンエクセレント投資法人        | 23.576  |         | 2,954,072   | 1.7     |
| 合 計                   | 口 数、金 額 | 887,347 | 176,465,356 |         |
|                       | 銘柄数<比率> | 53 銘柄   |             | <98.8%> |

※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、日本ヘルスケア投資法人、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、サムティ・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、日本リートリアルファンド、オリックス不動産投資、日本プライムリアルティ、プレミアム投資法人、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、いちご不動産投資法人、大和証券オフィス投資法人、スターツプロシード投資法人、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9月15日現在

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 投資信託証券       | 176,465,356 | 98.3  |
| コール・ローン等、その他 | 3,081,240   | 1.7   |
| 投資信託財産総額     | 179,546,597 | 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9月15日現在

| 項 目            | 当 期 末            |
|----------------|------------------|
| (A) 資産         | 179,546,597,590円 |
| コール・ローン等       | 686,908,406      |
| 投資信託証券(評価額)    | 176,465,356,900  |
| 未収入金           | 826,527,300      |
| 未収配当金          | 1,567,804,984    |
| (B) 負債         | 892,000,000      |
| 未払解約金          | 892,000,000      |
| (C) 純資産総額(A－B) | 178,654,597,590  |
| 元本             | 86,028,771,777   |
| 次期繰越損益金        | 92,625,825,813   |
| (D) 受益権総口数     | 86,028,771,777口  |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 20,767円          |

\* 期首における元本額は72,518,182,295円、当期中における追加設定元本額は14,912,697,891円、同解約元本額は1,402,108,409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Ｊ－ＲＥＩＴオープン9,544,052,512円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）72,985,805,161円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）520,511,045円、ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン2,162,621,351円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 3,413,845円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 4,546,724円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 784,977円、ダイワ・インデックスセレクトＪ－ＲＥＩＴ807,036,162円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,767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       | 2,897,932,333円  |
| 受取配当金           | 2,897,543,594   |
| 受取利息            | 388,518         |
| その他収益金          | 221             |
| (B) 有価証券売買損益    | △26,654,084,791 |
| 売買益             | 432,972,103     |
| 売買損             | △27,087,056,894 |
| (C) 当期損益金(A＋B)  | △23,756,152,458 |
| (D) 前期繰越損益金     | 98,205,106,753  |
| (E) 解約差損益金      | △ 1,707,964,591 |
| (F) 追加信託差損益金    | 19,884,836,109  |
| (G) 合計(C＋D＋E＋F) | 92,625,825,813  |
| 次期繰越損益金(G)      | 92,625,825,813  |

(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インデックス・マザーファンド

## 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・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの第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                | S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果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「不動産投資信託証券」といいます。）                                                                                                      |
| 運 用 方 法                | ①主として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に投資し、ベンチマーク（S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。<br>③保有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<br>組 入 制 限 | 無制限                                                                                                                                                                                                         |

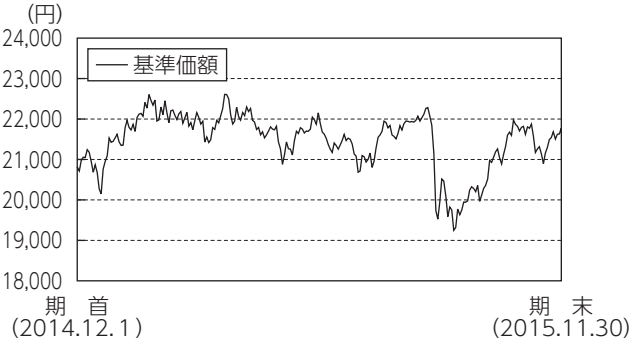
## 大和投資信託

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<br>(除く日本) (円ベース) |          | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|------------------|-------------|----------|--------------------------------------|----------|--------------------|
|                  | 騰 落 率       | (ベンチマーク) | 騰 落 率                                | (ベンチマーク) |                    |
| (期首)2014年12月 1 日 | 円<br>20,818 | %<br>—   | 23,146                               | %<br>—   | %<br>99.3          |
| 12月末             | 21,620      | 3.9      | 24,100                               | 4.1      | 98.7               |
| 2015年 1 月末       | 22,470      | 7.9      | 25,019                               | 8.1      | 98.8               |
| 2 月末             | 21,734      | 4.4      | 24,277                               | 4.9      | 98.9               |
| 3 月末             | 22,293      | 7.1      | 24,843                               | 7.3      | 99.2               |
| 4 月末             | 21,432      | 2.9      | 23,953                               | 3.5      | 98.8               |
| 5 月末             | 21,986      | 5.6      | 24,649                               | 6.5      | 99.3               |
| 6 月末             | 20,684      | △0.6     | 23,160                               | 0.1      | 98.3               |
| 7 月末             | 21,728      | 4.4      | 24,371                               | 5.3      | 99.0               |
| 8 月末             | 20,468      | △1.7     | 22,886                               | △1.1     | 99.0               |
| 9 月末             | 20,116      | △3.4     | 22,519                               | △2.7     | 98.9               |
| 10 月末            | 21,818      | 4.8      | 24,493                               | 5.8      | 98.7               |
| (期末)2015年11月30日  | 21,774      | 4.6      | 24,431                               | 5.6      | 98.9               |

(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) (円ベース) は、S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、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。同指数は、S & P グローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのリート制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。  
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

《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：20,818円 期末：21,774円 騰落率：4.6%

【基準価額の主な変動要因】

欧州リート市況の上昇や為替相場で米ドルなどが対円で上昇したことから、ベンチマークである S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) が上昇し、当ファンドの基準価額は上がりました。  
なお、ベンチマークの動きについては「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は、期を通じて欧州が上昇しました。  
米国では、期首から2015年1月まで、長期金利の低下が続く不動産賃料の上昇も見込めたことや、決算発表が市場予想を上回るリートが多かったことが好感されて、リート市況は堅調に推移しま

した。しかし2月に入ると、景気回復期待の高まりを受けて長期金利が上昇したことから、下落に転じました。3月以降も F R B (米国連邦準備制度理事会) 議長が年内の利上げを示唆するなど長期金利上昇に対する警戒感が根強いことから上値が重い展開が続く、8月には中国株式市況の急落からのリスク回避の動きが強まったことで、米国でもリートは一時急落しました。9月以降は、景気指標の悪化は嫌気されたものの、結果として短期的に利上げ観測が後退したことが好材料となり10月まで上昇基調でしたが、期末にかけては上値が重い展開となりました。

欧州では、期首から、金利低下による資金調達コストの改善などでリート決算が堅調だったことから、上昇基調でした。その後も、E C B (欧州中央銀行) の量的緩和の決定を受けて資産価格の上昇や景気改善が期待されたことから、大幅に上昇しました。しかし2015年4月には、ギリシャの債務交渉の展開が見えないことからリスク回避の動きが強まり下落に転じました。7月以降は、一時、中国株の急落局面での下落はあったものの E C B がさらなる金融緩和を示唆し、英国不動産市場のオフィス需要がなお根強いことなども好感され、堅調に推移して期末を迎えました。

オーストラリアでも、R B A (オーストラリア準備銀行) の利下げ観測が強まったことで期首から上昇しました。2015年2月以降は、中国経済に対する懸念や資源価格の下落が悪材料となったものの、低金利を背景とした不動産価格の値上がりなどの好材料もあり、結果として小動きで期末を迎えました。

アジアでは、期首から、香港やシンガポールのオフィス需要が根強いことや、中国人民銀行の予想外の利下げから不動産関連に資金が流入したことで上昇しました。しかし2015年2月以降は、中国経済に対する懸念や6月中旬からの中国株式市況の下落が悪材料となり、下落しました。9月からは、中国政府の景気対策等が好感されて下げ止まって期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は、通貨によってまちまちの展開でした。

米ドルは、期首から、日銀のサプライズ的な量的緩和の拡大を受けた米ドル高で始まりました。2015年6月には一時125円台をつけたましたが、その後はリスク回避の動きが強まったことから円高となりました。10月中旬からは、米国の利上げが近いという見方が強まり再び米ドル高が進み、期末を迎えました。

ユーロは、2015年に入り、E C B が量的緩和を開始した影響で3月まで一気にユーロ安が進んだ影響が大きく、期を通じては円高ユーロ安となりました。英ポンドは期を通じて小動きでした。

オーストラリア・ドルは、資源価格の下落や R B A の利下げなどがあり、ほぼ円高オーストラリア・ドル安基調で期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークである S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) に連動する投資成果をめざして運用を行います。リートの組入比率は、期を通じて原則として97%以上で運用を行います。また、保有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。

◆ポートフォリオについて

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) との連動性を維持するような運用を行ないました。

具体的には、S & P 先進国 R E I T 指数採用銘柄全銘柄に投資しました。期末では、15カ国、312銘柄となっております。

◆ベンチマークとの差異について

期を通じて、リート組入比率を基本的に97～99%台で推移させました。その結果、ベンチマークの上昇に対しマイナスのかい離が発生しました。

また、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

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》

今後の運用につきましては、引続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。リーートの組入比率は、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないます。また、保有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。

S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S&P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's®および S & P®は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■1万口当りの費用の明細

| 項 目                      | 当 期               |
|--------------------------|-------------------|
| 売買委託手数料<br>(投資信託証券)      | 6円<br>(6)         |
| 有価証券取引税<br>(投資信託証券)      | 4<br>(4)          |
| その他費用<br>(保管費用)<br>(その他) | 81<br>(78)<br>(3) |
| 合 計                      | 90                |

(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

(2014年12月2日から2015年11月30日まで)

|   |                  | 買付                          |                              | 売付                   |                             |
|---|------------------|-----------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------------|
|   |                  | 口数                          | 金額                           | 口数                   | 金額                          |
| 外 | アメリカ             | 千口<br>164.4<br>(△ 12.096)   | 千アメリカ・ドル<br>5,716<br>(△ 106) | 千口<br>25.5<br>( - )  | 千アメリカ・ドル<br>1,008<br>( - )  |
|   | カナダ              | 千口<br>11.9<br>( - )         | 千カナダ・ドル<br>228<br>( - )      | 千口<br>4.2<br>( - )   | 千カナダ・ドル<br>85<br>( - )      |
|   | オーストラリア          | 千口<br>182.236<br>(△ 24.797) | 千オーストラリア・ドル<br>690<br>(△ 0)  | 千口<br>30.35<br>( - ) | 千オーストラリア・ドル<br>125<br>( - ) |
|   | 香港               | 千口<br>69<br>( - )           | 千香港ドル<br>869<br>( - )        | 千口<br>9<br>( - )     | 千香港ドル<br>78<br>( - )        |
|   | シンガポール           | 千口<br>210.9<br>( 3.15)      | 千シンガポール・ドル<br>281<br>(△ 2)   | 千口<br>5<br>( - )     | 千シンガポール・ドル<br>8<br>( - )    |
|   | ニュージーランド         | 千口<br>62<br>( 0.708)        | 千ニュージーランド・ドル<br>78<br>( 1)   | 千口<br>-<br>( - )     | 千ニュージーランド・ドル<br>-<br>( - )  |
|   | イギリス             | 千口<br>97.55<br>( 11.4)      | 千イギリス・ポンド<br>328<br>( 2)     | 千口<br>8.7<br>( - )   | 千イギリス・ポンド<br>53<br>( - )    |
|   | イスラエル            | 千口<br>0.7<br>( - )          | 千イスラエル・シェケル<br>7<br>( - )    | 千口<br>-<br>( - )     | 千イスラエル・シェケル<br>-<br>( - )   |
|   | ユーロ<br>(アイルランド)  | 千口<br>13.037<br>( - )       | 千ユーロ<br>15<br>( - )          | 千口<br>-<br>( - )     | 千ユーロ<br>-<br>( - )          |
|   | ユーロ<br>(オランダ)    | 千口<br>2.98<br>( - )         | 千ユーロ<br>71<br>(△ 2)          | 千口<br>2.15<br>( - )  | 千ユーロ<br>93<br>( - )         |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)    | 千口<br>0.997<br>( 0.056)     | 千ユーロ<br>64<br>( 2)           | 千口<br>0.15<br>( - )  | 千ユーロ<br>11<br>( - )         |
|   | ユーロ<br>(フランス)    | 千口<br>5.655<br>( - )        | 千ユーロ<br>390<br>(△ 1)         | 千口<br>2.1<br>( - )   | 千ユーロ<br>105<br>( - )        |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)     | 千口<br>1.7<br>( 0.334)       | 千ユーロ<br>18<br>( 1)           | 千口<br>0.25<br>( - )  | 千ユーロ<br>2<br>( - )          |
|   | ユーロ<br>(スペイン)    | 千口<br>5.4<br>( 1.375)       | 千ユーロ<br>55<br>( 6)           | 千口<br>0.75<br>( - )  | 千ユーロ<br>8<br>( - )          |
| 国 | ユーロ<br>(イタリア)    | 千口<br>10.5<br>( - )         | 千ユーロ<br>7<br>( - )           | 千口<br>-<br>( - )     | 千ユーロ<br>-<br>( - )          |
|   | ユーロ<br>(ユーロ 通貨計) | 千口<br>40.269<br>( 1.765)    | 千ユーロ<br>623<br>( 6)          | 千口<br>5.4<br>( - )   | 千ユーロ<br>221<br>( - )        |

(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  
投資信託証券

(2014年12月2日から2015年11月30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      |
| SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)  |   | 2.1  | 48,186 | 22,946 | CORIO NV (オランダ)                     |   | 1.95 | 11,416 | 5,854  |
| WELLTOWER INC (アメリカ)             |   | 3    | 26,862 | 8,954  | SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)     |   | 0.5  | 11,096 | 22,193 |
| PUBLIC STORAGE (アメリカ)            |   | 1.1  | 26,376 | 23,978 | PUBLIC STORAGE (アメリカ)               |   | 0.3  | 7,103  | 23,676 |
| VENTAS INC (アメリカ)                |   | 2.7  | 23,710 | 8,781  | GENERAL GROWTH PROPERTIES (アメリカ)    |   | 1.8  | 5,747  | 3,192  |
| EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)        |   | 2.5  | 22,729 | 9,091  | KLEPIERRE (フランス)                    |   | 1.05 | 5,694  | 5,423  |
| UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)        |   | 0.7  | 22,266 | 31,809 | EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)           |   | 0.6  | 5,416  | 9,027  |
| PROLOGIS INC (アメリカ)              |   | 4.2  | 21,320 | 5,076  | WELLTOWER INC (アメリカ)                |   | 0.6  | 5,098  | 8,496  |
| KLEPIERRE (フランス)                 |   | 3.55 | 19,203 | 5,409  | ASSOCIATED ESTATES REALTY CP (アメリカ) |   | 1.4  | 4,881  | 3,487  |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ) |   | 0.9  | 18,356 | 20,396 | UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)           |   | 0.15 | 4,834  | 32,229 |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE (アメリカ)  |   | 8.3  | 17,598 | 2,120  | PROLOGIS INC (アメリカ)                 |   | 1    | 4,787  | 4,787  |

(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外貨建ファンドの明細

| ファンド名                        | 当 期 末  |          |         |     |
|------------------------------|--------|----------|---------|-----|
|                              | 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<br>(アメリカ)            | 千口     | 千アメリカ・ドル | 千円      | %   |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST      | 1.6    | 51       | 6,374   | 0.2 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP  | 1.8    | 16       | 2,062   | 0.1 |
| URBAN EDGE PROPERTIES        | 2.082  | 50       | 6,216   | 0.2 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC   | 2.5    | 42       | 5,167   | 0.2 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 3      | 547      | 67,188  | 2.4 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 6.947  | 1,319    | 162,113 | 5.9 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST INC  | 1.25   | 30       | 3,690   | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 3.4    | 427      | 52,540  | 1.9 |
| BIOMED REALTY TRUST INC      | 4.5    | 105      | 12,960  | 0.5 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A   | 3.455  | 132      | 16,303  | 0.6 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES    | 13.077 | 338      | 41,598  | 1.5 |
| VORNADO REALTY TRUST         | 3.964  | 386      | 47,493  | 1.7 |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I | 3.6    | 36       | 4,496   | 0.2 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 0.3    | 5        | 673     | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES  | 0.5    | 8        | 999     | 0.0 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL         | 0.5    | 6        | 811     | 0.0 |
| ROUSE PROPERTIES INC         | 0.861  | 14       | 1,731   | 0.1 |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC  | 1.869  | 59       | 7,366   | 0.3 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A    | 0.8    | 34       | 4,252   | 0.2 |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 8.1    | 653      | 80,234  | 2.9 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC   | 3.6    | 69       | 8,586   | 0.3 |
| EPR PROPERTIES               | 1.3    | 73       | 8,984   | 0.3 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH  | 0.4    | 4        | 556     | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC         | 0.3    | 3        | 428     | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC         | 3.8    | 33       | 4,135   | 0.1 |
| CHATHAM LODGING TRUST        | 0.9    | 20       | 2,512   | 0.1 |

| ファンド名                        | 当 期 末 |          |        |     |
|------------------------------|-------|----------|--------|-----|
|                              | 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     | %   |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST     | 1.3   | 35       | 4,376  | 0.2 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 1.1   | 60       | 7,413  | 0.3 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 2.2   | 40       | 4,993  | 0.2 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN | 0.613 | 8        | 1,075  | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 16.8  | 279      | 34,293 | 1.2 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 3.5   | 58       | 7,157  | 0.3 |
| CHAMBERS STREET PROPERTIES   | 5.3   | 40       | 4,921  | 0.2 |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY     | 1.5   | 49       | 6,077  | 0.2 |
| CORESITE REALTY CORP         | 0.6   | 35       | 4,377  | 0.2 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 1.6   | 46       | 5,675  | 0.2 |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES INC | 1.3   | 8        | 1,056  | 0.0 |
| RLJ LODGING TRUST            | 2.9   | 71       | 8,740  | 0.3 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST      | 1.9   | 30       | 3,768  | 0.1 |
| AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT | 0.7   | 11       | 1,436  | 0.1 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 0.6   | 6        | 843    | 0.0 |
| CYRUSONE INC                 | 1.5   | 54       | 6,670  | 0.2 |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 0.8   | 12       | 1,524  | 0.1 |
| KIMCO REALTY CORP            | 9.2   | 242      | 29,807 | 1.1 |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 2.85  | 74       | 9,128  | 0.3 |
| WHITESTONE REIT              | 0.5   | 6        | 757    | 0.0 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 2     | 54       | 6,688  | 0.2 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 3.4   | 66       | 8,209  | 0.3 |
| STARWOOD WAYPOINT RESIDE     | 0.8   | 18       | 2,318  | 0.1 |
| WVP GLIMCHER INC             | 4.06  | 44       | 5,470  | 0.2 |
| CORRECTIONS CORP OF AMERICA  | 2.624 | 68       | 8,392  | 0.3 |
| STORE CAPITAL CORP           | 1.1   | 25       | 3,093  | 0.1 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC  | 1.9   | 25       | 3,143  | 0.1 |

| ファンド名                        | 当 期 末  |          |        |     |
|------------------------------|--------|----------|--------|-----|
|                              | 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     | %   |
| SOVRAN SELF STORAGE INC      | 0.8    | 80       | 9,920  | 0.4 |
| SELECT INCOME REIT           | 1.4    | 28       | 3,511  | 0.1 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC    | 0.9    | 36       | 4,448  | 0.2 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 0.582  | 4        | 560    | 0.0 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNA  | 0.5    | 5        | 698    | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A  | 2.5    | 46       | 5,680  | 0.2 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 1.2    | 19       | 2,455  | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC  | 2.8    | 70       | 8,642  | 0.3 |
| STAG INDUSTRIAL INC          | 1.5    | 30       | 3,761  | 0.1 |
| VENTAS INC                   | 7.379  | 396      | 48,640 | 1.8 |
| CARETRUST REIT INC           | 1.003  | 11       | 1,360  | 0.0 |
| NEW YORK REIT INC            | 3.6    | 41       | 5,128  | 0.2 |
| GEO GROUP INC/THE            | 1.7    | 50       | 6,197  | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 3.8    | 96       | 11,793 | 0.4 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 1.6    | 27       | 3,326  | 0.1 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC   | 1.5    | 30       | 3,723  | 0.1 |
| UMH PROPERTIES INC           | 0.4    | 3        | 476    | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC            | 4.3    | 120      | 14,819 | 0.5 |
| TERRENO REALTY CORP          | 1      | 23       | 2,871  | 0.1 |
| VEREIT INC                   | 20.208 | 168      | 20,674 | 0.7 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC    | 9.9    | 97       | 12,025 | 0.4 |
| SUN COMMUNITIES INC          | 1.2    | 80       | 9,938  | 0.4 |
| ACADIA REALTY TRUST          | 1.511  | 51       | 6,285  | 0.2 |
| ALEXANDER'S INC              | 0.1    | 39       | 4,863  | 0.2 |
| PROLOGIS INC                 | 11.746 | 512      | 62,899 | 2.3 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 1.6    | 147      | 18,171 | 0.7 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST      | 4      | 55       | 6,774  | 0.2 |
| SAUL CENTERS INC             | 0.3    | 16       | 2,054  | 0.1 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | 3.245  | 43       | 5,356  | 0.2 |
| MACK-CALI REALTY CORP        | 2      | 48       | 5,922  | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 1.9    | 147      | 18,136 | 0.7 |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 4.558  | 44       | 5,424  | 0.2 |
| DDR CORP                     | 6.756  | 116      | 14,296 | 0.5 |
| DUKE REALTY CORP             | 7.7    | 156      | 19,264 | 0.7 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC     | 0.7    | 41       | 5,051  | 0.2 |
| EQUITY ONE INC               | 1.6    | 44       | 5,413  | 0.2 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 1.467  | 343      | 42,130 | 1.5 |
| FELCOR LODGING TRUST INC     | 2.9    | 23       | 2,895  | 0.1 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 2.5    | 57       | 7,006  | 0.3 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 1.5    | 221      | 27,247 | 1.0 |
| GETTY REALTY CORP            | 0.6    | 10       | 1,235  | 0.0 |
| WELLTOWER INC                | 7.9    | 499      | 61,311 | 2.2 |
| HCP INC                      | 10.3   | 368      | 45,212 | 1.6 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 2.1    | 92       | 11,394 | 0.4 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 3.4    | 94       | 11,646 | 0.4 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 2.2    | 59       | 7,327  | 0.3 |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 2.875  | 80       | 9,869  | 0.4 |
| KILROY REALTY CORP           | 2.1    | 142      | 17,469 | 0.6 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES     | 2.5    | 71       | 8,729  | 0.3 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 3.3    | 112      | 13,845 | 0.5 |
| LTC PROPERTIES INC           | 0.8    | 34       | 4,199  | 0.2 |
| LEXINGTON REALTY TRUST       | 4.6    | 40       | 4,920  | 0.2 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 1.724  | 154      | 18,929 | 0.7 |

| ファンド名                        | 当 期 末           |                 |                     |         |
|------------------------------|-----------------|-----------------|---------------------|---------|
|                              | 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                  | %       |
| MACERICH CO/THE              | 3               | 238             | 29,244              | 1.1     |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 1.8             | 112             | 13,808              | 0.5     |
| NATL HEALTH INVESTORS INC    | 0.8             | 48              | 5,966               | 0.2     |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 3               | 115             | 14,226              | 0.5     |
| REALTY INCOME CORP           | 5.617           | 281             | 34,514              | 1.2     |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES  | 2.1             | 47              | 5,803               | 0.2     |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST  | 1.5             | 32              | 4,034               | 0.1     |
| PARKWAY PROPERTIES INC       | 1.8             | 30              | 3,771               | 0.1     |
| POST PROPERTIES INC          | 1.2             | 71              | 8,819               | 0.3     |
| PUBLIC STORAGE               | 3.3             | 794             | 97,597              | 3.5     |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA     | 0.4             | 35              | 4,341               | 0.2     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 2.1             | 143             | 17,567              | 0.6     |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES  | 1.8             | 30              | 3,751               | 0.1     |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 2.1             | 70              | 8,694               | 0.3     |
| SL GREEN REALTY CORP         | 2.2             | 261             | 32,132              | 1.2     |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST    | 5.2             | 74              | 9,190               | 0.3     |
| TAUBMAN CENTERS INC          | 1.4             | 102             | 12,548              | 0.5     |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A     | 0.6             | 12              | 1,496               | 0.1     |
| UDR INC                      | 5.8             | 218             | 26,870              | 1.0     |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.3             | 15              | 1,950               | 0.1     |
| WP CAREY INC                 | 2.2             | 136             | 16,812              | 0.6     |
| WASHINGTON REIT              | 1.5             | 41              | 5,090               | 0.2     |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS  | 2.5             | 88              | 10,817              | 0.4     |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | 1.8             | 12              | 1,512               | 0.1     |
| AGREE REALTY CORP            | 0.4             | 13              | 1,654               | 0.1     |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 3.65            | 126             | 15,506              | 0.6     |
| INLAND REAL ESTATE CORP      | 1.9             | 18              | 2,263               | 0.1     |
| STRATEGIC HOTELS & RESORTS I | 6               | 84              | 10,434              | 0.4     |
| CUBESMART                    | 3.7             | 108             | 13,319              | 0.5     |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 4.681           | 68              | 8,399               | 0.3     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 3.3             | 238             | 29,250              | 1.1     |
| CEDAR REALTY TRUST INC       | 1.5             | 11              | 1,355               | 0.0     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 2.7             | 226             | 27,832              | 1.0     |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST   | 1.2             | 13              | 1,712               | 0.1     |
| WINTHROP REALTY TRUST        | 0.8             | 10              | 1,339               | 0.0     |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST     | 1.075           | 25              | 3,135               | 0.1     |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST  | 2.8             | 22              | 2,799               | 0.1     |
| KITE REALTY GROUP TRUST      | 1.85            | 50              | 6,150               | 0.2     |
| MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 1.4             | 14              | 1,810               | 0.1     |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | 0.3             | 6               | 840                 | 0.0     |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES  | 2.5             | 101             | 12,450              | 0.4     |
| EDUCATION REALTY TRUST INC   | 1.1             | 40              | 4,983               | 0.2     |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP    | 0.5             | 7               | 900                 | 0.0     |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO   | 4.442           | 49              | 6,050               | 0.2     |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE     | 4.05            | 73              | 9,077               | 0.3     |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 1.349           | 14              | 1,789               | 0.1     |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 5.2             | 62              | 7,689               | 0.3     |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 1.9             | 20              | 2,473               | 0.1     |
| DOUGLAS EMMETT INC           | 3.1             | 96              | 11,856              | 0.4     |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC     | 2               | 76              | 9,454               | 0.3     |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 5.3             | 81              | 10,011              | 0.4     |
| アメリカ・ドル通貨計                   | 口数・金額<br>銘柄数・比率 | 440.02<br>157銘柄 | 15,974<br>1,961,946 | <70.8%> |

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

| ファンド名                        | 当 期 末            |                |               |         |
|------------------------------|------------------|----------------|---------------|---------|
|                              | 口数               | 評価額            |               | 比率      |
|                              |                  | 外貨建金額          | 邦貨換算金額        |         |
| (カナダ)                        | 千口               | 千カナダ・ドル        | 千円            | %       |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 1.5              | 20             | 1,849         | 0.1     |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 1.2              | 9              | 916           | 0.0     |
| SLATE RETAIL REIT            | 0.3              | 4              | 387           | 0.0     |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 0.7              | 6              | 567           | 0.0     |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO | 0.3              | 8              | 742           | 0.0     |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 0.5              | 20             | 1,881         | 0.1     |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 0.8              | 6              | 583           | 0.0     |
| ONEREIT                      | 1                | 3              | 303           | 0.0     |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 0.8              | 5              | 503           | 0.0     |
| CHOICE PROPERTIES REIT       | 0.9              | 10             | 971           | 0.0     |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE  | 1.9              | 8              | 783           | 0.0     |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 0.4              | 4              | 397           | 0.0     |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ES | 0.7              | 11             | 1,021         | 0.0     |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 0.7              | 9              | 840           | 0.0     |
| PLAZA RETAIL REIT            | 1                | 4              | 417           | 0.0     |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | 1.4              | 45             | 4,131         | 0.1     |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 1.4              | 37             | 3,411         | 0.1     |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 0.8              | 33             | 3,101         | 0.1     |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 1.79             | 26             | 2,466         | 0.1     |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 3.066            | 65             | 6,005         | 0.2     |
| INNVEST REAL ESTATE INVESTME | 1.4              | 7              | 728           | 0.0     |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS  | 0.7              | 9              | 909           | 0.0     |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 3.5              | 88             | 8,118         | 0.3     |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 1.2              | 21             | 2,004         | 0.1     |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 0.5              | 24             | 2,204         | 0.1     |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 0.4              | 7              | 673           | 0.0     |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 0.8              | 10             | 958           | 0.0     |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 0.9              | 29             | 2,703         | 0.1     |
| カナダ・ドル通貨計                    | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 30,556<br>28銘柄 | 540<br>49,584 | < 1.8%> |
| (オーストラリア)                    | 千口               | 千オーストラリア・ドル    | 千円            | %       |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST   | 4.5              | 9              | 864           | 0.0     |
| GALILEO JAPAN TRUST          | 2.5              | 4              | 414           | 0.0     |
| CROMWELL PROPERTY GROUP      | 27.5             | 28             | 2,471         | 0.1     |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 15.5             | 32             | 2,840         | 0.1     |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 3.5              | 10             | 934           | 0.0     |
| NATIONAL STORAGE REIT        | 6.5              | 9              | 870           | 0.0     |
| INDUSTRIA REIT               | 2                | 4              | 370           | 0.0     |
| GDI PROPERTY GROUP           | 10               | 8              | 788           | 0.0     |
| 360 CAPITAL OFFICE FUND      | 1                | 2              | 176           | 0.0     |
| SCENTRE GROUP                | 119              | 483            | 42,574        | 1.5     |
| ARENA REIT                   | 4.5              | 7              | 664           | 0.0     |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS   | 3                | 7              | 676           | 0.0     |
| BWP TRUST                    | 10.5             | 33             | 2,951         | 0.1     |
| DEXUS PROPERTY GROUP         | 21.509           | 166            | 14,651        | 0.5     |
| GPT GROUP                    | 39.5             | 184            | 16,289        | 0.6     |
| INVESTA OFFICE FUND          | 13.5             | 51             | 4,568         | 0.2     |
| CHARTER HALL RETAIL REIT     | 7.5              | 30             | 2,689         | 0.1     |
| MIRVAC GROUP                 | 81.5             | 153            | 13,537        | 0.5     |
| STOCKLAND                    | 52.5             | 210            | 18,551        | 0.7     |
| WESTFIELD CORP               | 42.5             | 408            | 35,952        | 1.3     |
| ABACUS PROPERTY GROUP        | 6                | 17             | 1,570         | 0.1     |
| GOODMAN GROUP                | 35               | 214            | 18,906        | 0.7     |

| ファンド名                         | 当 期 末            |                 |                  |         |
|-------------------------------|------------------|-----------------|------------------|---------|
|                               | 口数               | 評価額             |                  | 比率      |
|                               |                  | 外貨建金額           | 邦貨換算金額           |         |
|                               | 千口               | 千オーストラリア・ドル     | 千円               | %       |
| VICINITY CENTRES              | 72.27            | 198             | 17,513           | 0.6     |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP    | 1                | 5               | 458              | 0.0     |
| CHARTER HALL GROUP            | 6.95             | 31              | 2,768            | 0.1     |
| ALE PROPERTY GROUP            | 4                | 15              | 1,342            | 0.0     |
| ASPEN GROUP                   | 1.5              | 2               | 183              | 0.0     |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP     | 3.083            | 8               | 730              | 0.0     |
| 360 CAPITAL GROUP LTD         | 5.5              | 5               | 474              | 0.0     |
| オーストラリア・ドル通貨計                 | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 603.812<br>29銘柄 | 2,346<br>206,788 | < 7.5%> |
| (香港)                          | 千口               | 千香港ドル           | 千円               | %       |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN  | 24               | 98              | 1,559            | 0.1     |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST   | 22               | 84              | 1,335            | 0.0     |
| FORTUNE REIT                  | 29               | 226             | 3,585            | 0.1     |
| PROSPERITY REIT               | 28               | 79              | 1,255            | 0.0     |
| LINK REIT                     | 51               | 2,404           | 38,113           | 1.4     |
| NEW CENTURY REIT              | 10               | 28              | 458              | 0.0     |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN  | 15               | 46              | 732              | 0.0     |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT  | 18               | 35              | 556              | 0.0     |
| CHAMPION REIT                 | 47               | 186             | 2,950            | 0.1     |
| 香港・ドル通貨計                      | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 244<br>9銘柄      | 3,189<br>50,546  | < 1.8%> |
| (シンガポール)                      | 千口               | 千シンガポール・ドル      | 千円               | %       |
| KEPPEL DC REIT                | 18.9             | 19              | 1,723            | 0.1     |
| FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST | 11.8             | 14              | 1,219            | 0.0     |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMM  | 39.7             | 36              | 3,189            | 0.1     |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL   | 12               | 16              | 1,407            | 0.1     |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST     | 12.3             | 8               | 779              | 0.0     |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST   | 44.8             | 58              | 5,058            | 0.2     |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT  | 45.2             | 106             | 9,265            | 0.3     |
| CAPITALAND MALL TRUST         | 57.4             | 107             | 9,348            | 0.3     |
| SUNTEC REIT                   | 56.1             | 84              | 7,382            | 0.3     |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST     | 32               | 32              | 2,807            | 0.1     |
| KEPPEL REIT                   | 37.2             | 34              | 3,021            | 0.1     |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST      | 12.26            | 15              | 1,368            | 0.0     |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST        | 19               | 22              | 1,955            | 0.1     |
| CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST    | 23.579           | 14              | 1,218            | 0.0     |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS        | 14.8             | 19              | 1,716            | 0.1     |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST     | 12.2             | 22              | 1,981            | 0.1     |
| STARHILL GLOBAL REIT          | 29               | 21              | 1,901            | 0.1     |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS  | 14.8             | 21              | 1,857            | 0.1     |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE       | 8.3              | 18              | 1,629            | 0.1     |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL  | 37.2             | 11              | 1,001            | 0.0     |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST    | 25.38            | 38              | 3,361            | 0.1     |
| CACHE LOGISTICS TRUST         | 15               | 13              | 1,198            | 0.0     |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST    | 29.2             | 37              | 3,246            | 0.1     |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST    | 18.2             | 11              | 972              | 0.0     |
| SPH REIT                      | 17.1             | 15              | 1,373            | 0.0     |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI  | 14.3             | 11              | 968              | 0.0     |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT  | 13               | 9               | 824              | 0.0     |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST    | 16.7             | 10              | 906              | 0.0     |
| OUE HOSPITALITY TRUST         | 15.9             | 12              | 1,077            | 0.0     |
| OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I  | 10.15            | 6               | 603              | 0.0     |
| シンガポール・ドル通貨計                  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 713.469<br>30銘柄 | 856<br>74,368    | < 2.7%> |

| ファンド名                        | 当 期 末               |                  |     |         |
|------------------------------|---------------------|------------------|-----|---------|
|                              | 口 数                 | 評 価 額            | 比 率 |         |
|                              |                     | 外貨建金額 邦貨換算金額     |     |         |
| (ニュージーランド)                   | 千口                  | 千円               |     | %       |
| STRIDE PROPERTY LTD          | 8                   | 16 1,338         | 0.0 |         |
| ARGOSY PROPERTY LTD          | 16.5                | 18 1,518         | 0.1 |         |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD      | 27                  | 37 3,003         | 0.1 |         |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD    | 9.208               | 14 1,134         | 0.0 |         |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 6                   | 11 917           | 0.0 |         |
| GOODMAN PROPERTY TRUST       | 22.5                | 28 2,241         | 0.1 |         |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 22.5                | 27 2,232         | 0.1 |         |
| ニュージーランド・<br>ドル 通 貨 計        | 111,708<br>7銘柄数<比率> | 154<br>12,386    |     | < 0.4%> |
| (イギリス)                       | 千口                  | 千円               |     | %       |
| ASSURA PLC                   | 36.1                | 20 3,698         | 0.1 |         |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 6                   | 6 1,231          | 0.0 |         |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC   | 21.75               | 11 2,127         | 0.1 |         |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 17.9                | 220 40,742       | 1.5 |         |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC        | 16                  | 18 3,491         | 0.1 |         |
| SEGRE PLC                    | 16.45               | 71 13,239        | 0.5 |         |
| HAMMERSON PLC                | 17.5                | 106 19,673       | 0.7 |         |
| BRITISH LAND CO PLC          | 22.85               | 190 35,200       | 1.3 |         |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC   | 7.65                | 66 12,271        | 0.4 |         |
| INTU PROPERTIES PLC          | 18.15               | 58 10,832        | 0.4 |         |
| DERWENT LONDON PLC           | 2.45                | 91 16,969        | 0.6 |         |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES    | 9.4                 | 9 1,842          | 0.1 |         |
| WORKSPACE GROUP PLC          | 2.55                | 24 4,443         | 0.2 |         |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC       | 4.5                 | 15 2,945         | 0.1 |         |
| SHAFTESBURY PLC              | 6.15                | 57 10,535        | 0.4 |         |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD     | 1.95                | 5 984            | 0.0 |         |
| BIG YELLOW GROUP PLC         | 3.3                 | 25 4,769         | 0.2 |         |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC    | 14                  | 23 4,264         | 0.2 |         |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 11.15               | 6 1,224          | 0.0 |         |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC      | 14.7                | 18 3,473         | 0.1 |         |
| イギリス・<br>ポンド通貨計              | 250.5<br>20銘柄数<比率>  | 1,050<br>193,963 |     | < 7.0%> |
| (イスラエル)                      | 千口                  | 千円               |     | %       |
| REIT 1 LTD                   | 3.1                 | 32 1,026         | 0.0 |         |
| イスラエル・<br>シケル通貨計             | 3.1<br>1銘柄数<比率>     | 32<br>1,026      |     | < 0.0%> |
| (ユーロ (アイルランド))               | 千口                  | 千ユーロ             |     | %       |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 7.3                 | 8 1,052          | 0.0 |         |
| GREEN REIT PLC               | 14.9                | 22 2,980         | 0.1 |         |
| HIBERNIA REIT PLC            | 14.85               | 20 2,700         | 0.1 |         |
| 国 小 計                        | 37.05<br>3銘柄数<比率>   | 51<br>6,732      |     | < 0.2%> |
| (ユーロ (オランダ))                 | 千口                  | 千ユーロ             |     | %       |
| WERELDHAVE NV                | 0.9                 | 47 6,225         | 0.2 |         |
| EUROCOMMERCIAL PROPRIETIE-CV | 1.05                | 42 5,458         | 0.2 |         |
| NSI NV                       | 2.904               | 11 1,465         | 0.1 |         |
| VASTNED RETAIL NV            | 0.4                 | 17 2,223         | 0.1 |         |
| 国 小 計                        | 5.254<br>4銘柄数<比率>   | 118<br>15,372    |     | < 0.6%> |
| (ユーロ (ベルギー))                 | 千口                  | 千ユーロ             |     | %       |
| AEDIFICA                     | 0.306               | 18 2,358         | 0.1 |         |
| COFINIMMO                    | 0.45                | 44 5,827         | 0.2 |         |

| ファンド名                         | 当 期 末                   |                  |     |         |
|-------------------------------|-------------------------|------------------|-----|---------|
|                               | 口 数                     | 評 価 額            | 比 率 |         |
|                               |                         | 外貨建金額 邦貨換算金額     |     |         |
|                               | 千口                      | 千ユーロ             | 千円  | %       |
| BEFIMMO                       | 0.45                    | 25 3,367         | 0.1 |         |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES  | 0.2                     | 4 597            | 0.0 |         |
| RETAIL ESTATES                | 0.1                     | 7 961            | 0.0 |         |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA        | 0.3                     | 22 2,948         | 0.1 |         |
| WERELDHAVE BELGIUM NV         | 0.05                    | 5 675            | 0.0 |         |
| 国 小 計                         | 1.856<br>7銘柄数<比率>       | 128<br>16,735    |     | < 0.6%> |
| (ユーロ (フランス))                  | 千口                      | 千ユーロ             | 千円  | %       |
| UNIBAIL-RODAMCO SE            | 2.2                     | 537 69,848       | 2.5 |         |
| ICADE                         | 0.8                     | 53 6,971         | 0.3 |         |
| ANF IMMOBILIER                | 0.2                     | 4 567            | 0.0 |         |
| ALTAREA                       | 0.05                    | 8 1,151          | 0.0 |         |
| FONCIERE DES MURS             | 0.2                     | 5 680            | 0.0 |         |
| GECINA SA                     | 0.8                     | 91 11,891        | 0.4 |         |
| KLEPIERRE                     | 4.2                     | 178 23,137       | 0.8 |         |
| FONCIERE DES REGIONS          | 0.95                    | 79 10,297        | 0.4 |         |
| AFFINE                        | 0.15                    | 2 325            | 0.0 |         |
| MERCIALYS                     | 0.4                     | 8 1,055          | 0.0 |         |
| 国 小 計                         | 9.95<br>10銘柄数<比率>       | 969<br>125,927   |     | < 4.5%> |
| (ユーロ (ドイツ))                   | 千口                      | 千ユーロ             | 千円  | %       |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG        | 2.3                     | 28 3,713         | 0.1 |         |
| HAMBORNER REIT AG             | 1.334                   | 12 1,684         | 0.1 |         |
| 国 小 計                         | 3.634<br>2銘柄数<比率>       | 41<br>5,397      |     | < 0.2%> |
| (ユーロ (スペイン))                  | 千口                      | 千ユーロ             | 千円  | %       |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM  | 1.3                     | 12 1,605         | 0.1 |         |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA   | 1.25                    | 16 2,094         | 0.1 |         |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA   | 6.775                   | 80 10,449        | 0.4 |         |
| 国 小 計                         | 9.325<br>3銘柄数<比率>       | 108<br>14,149    |     | < 0.5%> |
| (ユーロ (イタリア))                  | 千口                      | 千ユーロ             | 千円  | %       |
| BENI STABILI SPA              | 23.35                   | 16 2,147         | 0.1 |         |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZI | 6.65                    | 6 831            | 0.0 |         |
| 国 小 計                         | 30<br>2銘柄数<比率>          | 22<br>2,978      |     | < 0.1%> |
| ユーロ通貨計                        | 97.069<br>31銘柄数<比率>     | 1,442<br>187,294 |     | < 6.8%> |
| 合 計                           | 2,494.234<br>312銘柄数<比率> | -<br>2,737,905   |     | <98.9%> |

(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11月30日現在

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 投資信託証券       | 2,737,905 | 98.9  |
| コール・ローン等、その他 | 31,697    | 1.1   |
| 投資信託財産総額     | 2,769,603 | 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 香港ドル＝15.85円、1 シンガポール・ドル＝86.86円、1 ニュージーランド・ドル＝80.03円、1 イギリス・ポンド＝184.60円、1 イスラエル・シェケル＝31.62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（2,752,305千円）の投資信託財産総額（2,769,603千円）に対する比率は、99.4%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          | 2,769,603,344円 |
| コール・ローン等        | 24,514,688     |
| 投資信託証券(評価額)     | 2,737,905,656  |
| 未収入金            | 32,641         |
| 未収配当金           | 7,150,359      |
| (B) 負債          | －              |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 2,769,603,344  |
| 元本              | 1,271,978,733  |
| 次期繰越損益金         | 1,497,624,611  |
| (D) 受益権総口数      | 1,271,978,733口 |
| 1 万口当り基準価額(C／D) | 21,774円        |

\*期首における元本額は949,130,613円、当期中における追加設定元本額は454,055,882円、同解約元本額は131,207,762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、D－I’s グローバル R E I T インデックス1,578,795円、D Cダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド1,033,774,176円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 3,523,922円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 4,655,747円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 716,890円、ダイワ・インデックスセレクト グローバル R E I T 227,729,203円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は21,774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             | 94,739,915円   |
| 受取配当金                 | 94,698,257    |
| 受取利息                  | 21,656        |
| その他収益金                | 20,002        |
| (B) 有価証券売買損益          | 9,355,647     |
| 売買益                   | 217,422,773   |
| 売買損                   | △ 208,067,126 |
| (C) その他費用             | △ 9,776,512   |
| (D) 当期損益金(A + B + C)  | 94,319,050    |
| (E) 前期繰越損益金           | 1,026,804,681 |
| (F) 解約差損益金            | △ 148,510,238 |
| (G) 追加信託差損益金          | 525,011,118   |
| (H) 合計(D + E + F + G) | 1,497,624,611 |
| 次期繰越損益金(H)            | 1,497,624,611 |

(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NOMUR A－B P I 総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。              |
| 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（NOMUR A－B P I 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                                                   |

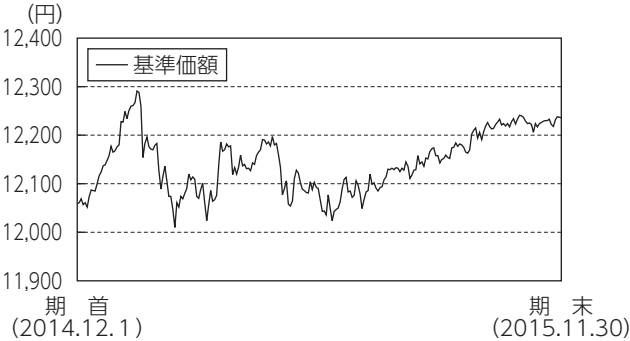
## 大和投資信託

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<br>総 合 指 数 |       | 公 社 債<br>組 入 比 率 | 債 券<br>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、金利は低値で推移しました。

◆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・流出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・流出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》

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行なってまいります。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・流出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<br>(－) |
|   | 地方債証券 | 521,686   | 305,775<br>(－)   |
|   | 特殊債券  | 306,511   | 302,126<br>(－)   |
| 内 | 社債券   | 401,127   | 607,108<br>(－)   |

(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                       |         | 売 付                        |         |
| 銘 柄                       | 金 額     | 銘 柄                        | 金 額     |
|                           | 千円      |                            | 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 | 182 北九州市債 1.79% 2016/12/20 | 101,816 |
| 340 10年国債 0.4% 2025/9/20  | 114,061 | 184 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）

| 区 分              | 当 期        |            |      | 末          |           |      |
|------------------|------------|------------|------|------------|-----------|------|
|                  | 額面金額       | 評 価 額      | 組入比率 | うちBB格以組入比率 | 残存期間別組入比率 |      |
|                  | 千円         | 千円         | %    | %          | 5年以上      | 2年以上 |
| 国債証券             | 8,937,000  | 9,796,404  | 67.4 | －          | 54.4      | 12.7 |
| 地方債証券            | 1,710,800  | 1,769,345  | 12.2 | －          | 2.1       | 6.4  |
| 特殊債券<br>(除く金融債券) | 1,250,000  | 1,290,663  | 8.9  | －          | 1.4       | 4.3  |
| 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  |
| 合 計              | 13,100,800 | 14,082,236 | 96.9 | －          | 58.7      | 28.4 |

(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）

| 当    |           | 期      |           | 末         |            |
|------|-----------|--------|-----------|-----------|------------|
| 区 分  | 銘 柄       | 年利率    | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償還年月日      |
| 国債証券 | 357 2年国債  | 0.1000 | 千円 45,096 | 千円 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 |



| 当   |           | 期      |         | 末      |            |
|-----|-----------|--------|---------|--------|------------|
| 区 分 | 銘 柄       | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額  | 償還年月日      |
|     |           | %      | 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 |

| 当               |             | 期      |           | 末         |            |
|-----------------|-------------|--------|-----------|-----------|------------|
| 区 分             | 銘 柄         | 年利率    | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償還年月日      |
|                 |             | %      | 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              | 銘柄数         | 224銘柄  |           |           |            |
| 小計              | 金 額         |        | 8,937,000 | 9,796,404 |            |
| 地方債証券           | 47 共同発行地方   | 1.8000 | 100,000   | 102,115   | 2017/02/24 |
|                 | 19-1 広島県公債  | 1.7800 | 110,800   | 113,594   | 2017/05/25 |
|                 | 648 東京都公債   | 1.8400 | 100,000   | 102,744   | 2017/06/20 |
|                 | 19-2 静岡県公債  | 1.9300 | 100,000   | 102,913   | 2017/06/28 |
|                 | 24-7 福岡県5年  | 0.1900 | 100,000   | 100,213   | 2017/11/27 |
|                 | 653 東京都公債   | 1.5400 | 100,000   | 102,999   | 2017/12/20 |
|                 | 24-6 京都市5年  | 0.1370 | 100,000   | 100,132   | 2018/03/28 |
|                 | 20-1 千葉市公債  | 1.5500 | 100,000   | 103,531   | 2018/04/25 |
|                 | 660 東京都公債   | 1.5800 | 100,000   | 103,851   | 2018/06/20 |
|                 | 20-6 北海道公債  | 1.7200 | 100,000   | 104,423   | 2018/08/29 |
|                 | 21-2 埼玉県公債  | 1.5700 | 100,000   | 105,154   | 2019/05/27 |
|                 | 76 共同発行地方   | 1.4000 | 100,000   | 104,749   | 2019/07/25 |
|                 | 21-6 大阪市公債  | 1.5700 | 100,000   | 105,796   | 2019/11/25 |
|                 | 21-35 兵庫県公債 | 1.4600 | 100,000   | 105,487   | 2020/01/22 |
|                 | 116 共同発行地方  | 0.8000 | 100,000   | 104,169   | 2022/11/25 |
|                 | 117 共同発行地方  | 0.7200 | 100,000   | 103,620   | 2022/12/22 |
|                 | 24-16 愛知県公債 | 0.7570 | 100,000   | 103,849   | 2023/01/31 |
| 種別              | 銘柄数         | 17銘柄   |           |           |            |
| 小計              | 金 額         |        | 1,710,800 | 1,769,345 |            |
| 特殊債券<br>(優<金額順) | 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 |

| 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<br>小計 | 銘柄数<br>金 額    | 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<br>小計 | 銘柄数<br>金 額    | 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UFJＢＫ | 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<br>小計 | 銘柄数<br>金 額    | 12銘柄   |            |            |            |
|          |               |        | 1,103,000  | 1,125,529  |            |
| 合計       | 銘柄数<br>金 額    | 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   |
|              | 千円         | %     |
| 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         | 94,720,690      |
| 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40VA3,024,230,544円、ダイワ世界バランスファンド60VA267,014,453円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA318,164,716円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA546,555,651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。

# ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第9期（決算日 2015年12月18日）

（計算期間 2014年12月19日～2015年12月18日）

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの第9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NOMUR A－B P I 総合短期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 | わが国の公社債等（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（NOMUR A－B P I 総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。 |
| 株 式 組 入 制 限 | 純資産総額の10%以下                                                             |

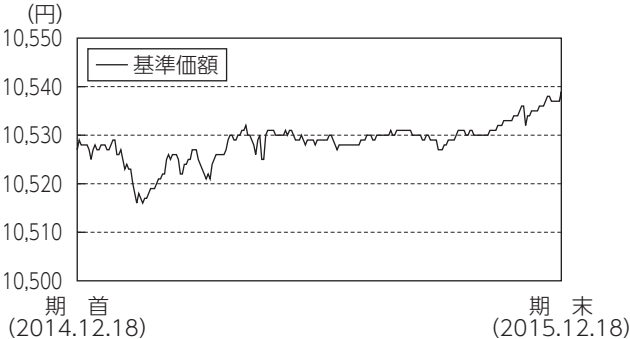
## 大和投資信託

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<br>総合短期指数<br>(ベンチマーク) |      | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 |
|-----------------|--------|------|----------------------------------|------|---------------|-------------|
|                 | 円      | 騰落率  |                                  | 騰落率  | %             | %           |
| (期首)2014年12月18日 | 10,527 | —    | 10,570                           | —    | 99.0          | —           |
| 12月末            | 10,525 | △0.0 | 10,571                           | 0.0  | 99.1          | —           |
| 2015年 1 月末      | 10,523 | △0.0 | 10,566                           | △0.0 | 94.3          | —           |
| 2 月末            | 10,525 | △0.0 | 10,566                           | △0.0 | 97.0          | —           |
| 3 月末            | 10,521 | △0.1 | 10,561                           | △0.1 | 97.4          | —           |
| 4 月末            | 10,529 | 0.0  | 10,570                           | 0.0  | 98.9          | —           |
| 5 月末            | 10,530 | 0.0  | 10,572                           | 0.0  | 99.0          | —           |
| 6 月末            | 10,530 | 0.0  | 10,570                           | 0.0  | 99.3          | —           |
| 7 月末            | 10,529 | 0.0  | 10,570                           | 0.0  | 95.7          | —           |
| 8 月末            | 10,530 | 0.0  | 10,571                           | 0.0  | 97.5          | —           |
| 9 月末            | 10,529 | 0.0  | 10,570                           | 0.0  | 98.9          | —           |
| 10 月末           | 10,531 | 0.0  | 10,571                           | 0.0  | 98.4          | —           |
| 11 月末           | 10,535 | 0.1  | 10,574                           | 0.0  | 97.8          | —           |
| (期末)2015年12月18日 | 10,539 | 0.1  | 10,580                           | 0.1  | 97.9          | —           |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) NOMURA-BPI総合短期指数は、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算出する、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、そのうち残存期間1～3年の部分の投資収益を表したものが総合短期指数です。  
NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負うものではありません。  
(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：10,527円 期末：10,539円 騰落率：0.1%

【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総合短期指数）の騰落率は0.1%となりました。同指数への連動をめざす当ファンドも上昇し、期末の基準価額は10,539円、騰落率はベンチマークと同等の0.1%となりました。

◆投資環境について

○国内短期債券市況

国内短期債券市況は、期首より、短期ゾーンの金利は上昇して始まりましたが、2015年1月半ば以降は、株価の上昇などを受けて上昇基調を強めました。その後、欧米の金利の低下などを受けて国内の短期ゾーンの金利も低下し、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などを背景に国内長期金利が低下基調で推移する中、短期ゾーンの金利は横ばい圏で推移しました。11月上旬以降は、短期国債がマイナス金利で取引される中、短期ゾーンの金利は低下基調を強めるかたちで推移し、期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後もベンチマーク（NOMURA-BPI総合短期指数）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98%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。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドとベンチマークとの騰落率の差異は0.0%とごくわずかなとなり、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。  
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。

■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19日から2015年12月18日まで)

|                    |       | 買 付 額   | 売 付 額              |
|--------------------|-------|---------|--------------------|
|                    |       | 千円      | 千円                 |
| 国<br><br><br><br>内 | 国債証券  | 727,358 | 614,690<br>(<br>ー) |
|                    | 地方債証券 | 105,190 | 203,810<br>(<br>ー) |
|                    | 特殊債券  | 251,025 | 280,845<br>(<br>ー) |
|                    | 社債券   | ー       | 403,655<br>(<br>ー) |
|                    |       |         |                    |

(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19日から2015年12月18日まで)

| 当                          |         | 期                             |         |
|----------------------------|---------|-------------------------------|---------|
| 買 付                        |         | 売 付                           |         |
| 銘 柄                        | 金 額     | 銘 柄                           | 金 額     |
|                            | 千円      |                               | 千円      |
| 111 5年国債 0.4% 2018/3/20    | 125,421 | 349 2年国債 0.1% 2017/2/15       | 125,186 |
| 349 2年国債 0.1% 2017/2/15    | 125,211 | 287 10年国債 1.9% 2017/6/20      | 110,430 |
| 116 5年国債 0.2% 2018/12/20   | 120,730 | 83 三菱東京UFJKB 2.06% 2016/4/13  | 102,165 |
| 115 5年国債 0.2% 2018/9/20    | 105,613 | 18-3 大阪市公債 2.1% 2016/7/27     | 101,971 |
| 20-2 北海道公債 1.88% 2018/5/30 | 105,190 | 18-1 愛知県公債 2% 2016/5/26       | 101,839 |
| い745 利付農林債 0.35% 2017/6/27 | 100,317 | 25 みずほコーポレート 0.755% 2016/4/20 | 100,684 |
| 357 2年国債 0.1% 2017/10/15   | 90,165  | 53 三井住友銀行 0.69% 2016/4/20     | 100,667 |
| 14 政保日本政策 0.4% 2016/11/22  | 80,422  | い728 利付農林債 0.55% 2016/1/27    | 100,465 |
| 343 2年国債 0.1% 2016/8/15    | 80,081  | 58 東芝 0.247% 2016/12/9        | 100,139 |
| 269 信金中金 0.4% 2017/4/27    | 70,285  | 163 利付商工債 0.2% 2016/8/26      | 100,102 |

(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）

| 区 分   | 当 期           |               |           | 末               |           |           |
|-------|---------------|---------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|
|       | 額面金額          | 評 価 額         | 組入比率      | うち8B格以下<br>組入比率 | 残存期間別組入比率 |           |
|       |               |               |           | 5年以上            | 2年以上      | 2年末満      |
| 国債証券  | 千円<br>776,000 | 千円<br>784,146 | %<br>72.5 | %<br>ー          | %<br>ー    | %<br>43.5 |
| 地方債証券 | 100,000       | 104,325       | 9.6       | ー               | ー         | 9.6       |
| 金融債券  | 170,000       | 170,540       | 15.8      | ー               | ー         | ー         |
| 合 計   | 1,046,000     | 1,059,012     | 97.9      | ー               | ー         | 53.2      |
|       |               |               |           |                 |           | 44.7      |

(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。

(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）

|          |            | 当 期    | 末            |              |            |
|----------|------------|--------|--------------|--------------|------------|
| 区 分      | 銘 柄        | 年利率    | 額面金額         | 評 価 額        | 償還年月日      |
| 国債証券     | 355 2年国債   | 0.1000 | 千円<br>20,000 | 千円<br>20,051 | 2017/08/15 |
|          | 106 5年国債   | 0.2000 | 120,000      | 120,523      | 2017/09/20 |
|          | 288 10年国債  | 1.7000 | 80,000       | 82,452       | 2017/09/20 |
|          | 357 2年国債   | 0.1000 | 90,000       | 90,252       | 2017/10/15 |
|          | 108 5年国債   | 0.1000 | 100,000      | 100,279      | 2017/12/20 |
|          | 289 10年国債  | 1.5000 | 76,000       | 78,336       | 2017/12/20 |
|          | 111 5年国債   | 0.4000 | 120,000      | 121,170      | 2018/03/20 |
|          | 115 5年国債   | 0.2000 | 50,000       | 50,309       | 2018/09/20 |
|          | 116 5年国債   | 0.2000 | 120,000      | 120,772      | 2018/12/20 |
|          |            |        |              |              |            |
| 種別<br>小計 | 銘柄数<br>金 額 | 9銘柄    | 776,000      | 784,146      |            |
| 地方債証券    | 20-2 北海道公債 | 1.8800 | 100,000      | 104,325      | 2018/05/30 |
| 種別<br>小計 | 銘柄数<br>金 額 | 1銘柄    | 100,000      | 104,325      |            |
| 金融債券     | 269 信金中金   | 0.4000 | 70,000       | 70,261       | 2017/04/27 |
|          | い745 利付農林債 | 0.3500 | 100,000      | 100,279      | 2017/06/27 |
| 種別<br>小計 | 銘柄数<br>金 額 | 2銘柄    | 170,000      | 170,540      |            |
| 合計       | 銘柄数<br>金 額 | 12銘柄   | 1,046,000    | 1,059,012    |            |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年12月18日現在

| 項 目          | 当 期             | 末         |
|--------------|-----------------|-----------|
|              | 評 価 額           | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>1,059,012 | %<br>97.9 |
| コール・ローン等、その他 | 22,248          | 2.1       |
| 投資信託財産総額     | 1,081,261       | 100.0     |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年12月18日現在

| 項 目            | 当 期 末          |
|----------------|----------------|
| (A) 資産         | 1,081,261,157円 |
| コール・ローン等       | 20,321,460     |
| 公社債(評価額)       | 1,059,012,990  |
| 未収利息           | 1,701,230      |
| 前払費用           | 225,477        |
| (B) 負債         | －              |
| (C) 純資産総額(A－B) | 1,081,261,157  |
| 元本             | 1,025,931,977  |
| 次期繰越損益金        | 55,329,180     |
| (D) 受益権総口数     | 1,025,931,977口 |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 10,539円        |

\* 期首における元本額は1,427,508,367円、当期中における追加設定元本額は37,655,165円、同解約元本額は439,231,555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、ダイワ世界分散バランスファンド1 5 V A 3,280,317円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A 9,250,929円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A (国内株式型) 10,828,832円、ダイワ世界分散バランスファンド2 5 V A 126,372,713円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A 689,450,488円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A (国内株式型) 186,748,698円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,539円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月19日 至2015年12月18日

| 項 目             | 当 期         |
|-----------------|-------------|
| (A) 配当等収益       | 10,685,682円 |
| 受取利息            | 10,685,682  |
| (B) 有価証券売買損益    | △ 9,428,510 |
| 売買益             | 228,110     |
| 売買損             | △ 9,656,620 |
| (C) 当期損益金(A＋B)  | 1,257,172   |
| (D) 前期繰越損益金     | 75,279,618  |
| (E) 解約差損益金      | △23,194,445 |
| (F) 追加信託差損益金    | 1,986,835   |
| (G) 合計(C＋D＋E＋F) | 55,329,180  |
| 次期繰越損益金(G)      | 55,329,180  |

(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。

# 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。<br>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                                                                                                                      |

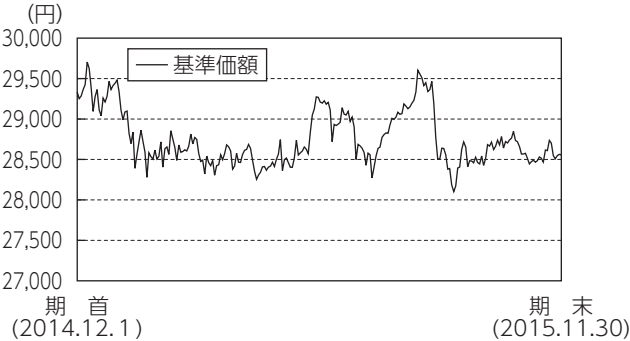
### 大和投資信託

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       | 騰落率 (ベンチマーク) | 円                               | 騰落率  |               |          |
| (期首)2014年12月1日  | 29,332  | % -          | 29,578                          | % -  | % 98.3        | % -      |
| 12月末            | 29,482  | 0.5          | 29,777                          | 0.7  | 98.1          | -        |
| 2015年1月末        | 28,616  | △2.4         | 28,834                          | △2.5 | 97.7          | -        |
| 2月末             | 28,692  | △2.2         | 28,968                          | △2.1 | 98.4          | -        |
| 3月末             | 28,576  | △2.6         | 28,754                          | △2.8 | 98.1          | -        |
| 4月末             | 28,566  | △2.6         | 28,847                          | △2.5 | 97.8          | -        |
| 5月末             | 29,123  | △0.7         | 29,436                          | △0.5 | 98.3          | -        |
| 6月末             | 28,687  | △2.2         | 28,937                          | △2.2 | 97.1          | -        |
| 7月末             | 29,067  | △0.9         | 29,371                          | △0.7 | 98.3          | -        |
| 8月末             | 28,636  | △2.4         | 28,829                          | △2.5 | 98.5          | -        |
| 9月末             | 28,543  | △2.7         | 28,749                          | △2.8 | 97.9          | -        |
| 10月末            | 28,568  | △2.6         | 28,838                          | △2.5 | 98.0          | -        |
| (期末)2015年11月30日 | 28,558  | △2.6         | 28,825                          | △2.5 | 98.3          | -        |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。  
(注3) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の原データに基づき、当ファンド設定日を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  
○債券市況  
・米国  
米国の国債金利はやや上昇しました。2015年1月のECB (欧州中央銀行) の国債購入策決定などを背景に、世界的に金利は低下しました。2月以降は、原油価格が底打ち傾向となる中でデ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  
米ドル円が為替相場は、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  
ユーロ円が為替相場は、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。

◆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<br>(保管費用) | 7<br>(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<br>141,828  | 千アメリカ・ドル<br>131,234<br>(—)  |
|   | カナダ     | 国債証券 | 千カナダ・ドル<br>7,415     | 千カナダ・ドル<br>9,498<br>(—)     |
|   | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル<br>6,297 | 千オーストラリア・ドル<br>2,948<br>(—) |
|   | シンガポール  | 国債証券 | 千シンガポール・ドル<br>1,286  | 千シンガポール・ドル<br>1,637<br>(—)  |
|   | イギリス    | 国債証券 | 千イギリス・ポンド<br>6,667   | 千イギリス・ポンド<br>9,319<br>(—)   |
|   | スイス     | 国債証券 | 千スイス・フラン<br>4,055    | 千スイス・フラン<br>4,763<br>(—)    |

|   |                 |      | 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<br>—      | 千デンマーク・クローネ<br>4,027<br>(—)  |
|   | ノルウェー           | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ<br>2,975  | 千ノルウェー・クローネ<br>457<br>(—)    |
|   | スウェーデン          | 国債証券 | 千スウェーデン・クローネ<br>4,701 | 千スウェーデン・クローネ<br>6,302<br>(—) |
|   | メキシコ            | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ<br>33,638    | 千メキシコ・ペソ<br>25,710<br>(—)    |
|   | マレーシア           | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット<br>3,812 | 千マレーシア・リンギット<br>3,667<br>(—) |
|   | 南アフリカ           | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド<br>19,001  | 千南アフリカ・ランド<br>11,492<br>(—)  |
|   | ポーランド           | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ<br>5,695   | 千ポーランド・ズロチ<br>9,153<br>(—)   |
|   | ユーロ<br>(アイルランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>1,550         | 千ユーロ<br>2,064<br>(—)         |
|   | ユーロ<br>(オランダ)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>4,770         | 千ユーロ<br>5,334<br>(—)         |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>3,574         | 千ユーロ<br>4,911<br>(—)         |
| 国 | ユーロ<br>(フランス)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>16,551        | 千ユーロ<br>14,322<br>(—)        |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)    | 国債証券 | 千ユーロ<br>13,028        | 千ユーロ<br>16,439<br>(—)        |
|   | ユーロ<br>(スペイン)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>10,909        | 千ユーロ<br>6,769<br>(—)         |
|   | ユーロ<br>(イタリア)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>17,383        | 千ユーロ<br>17,532<br>(—)        |
|   | ユーロ<br>(フィンランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>802           | 千ユーロ<br>1,782<br>(—)         |
|   | ユーロ<br>(オーストリア) | 国債証券 | 千ユーロ<br>1,964         | 千ユーロ<br>2,901<br>(—)         |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 国債証券 | 千ユーロ<br>70,535        | 千ユーロ<br>72,059<br>(—)        |

(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。

外国債券インデックスマザーファンド

■主要な売買銘柄  
公 社 債

(2014年12月2日から2015年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

| 作 成 期<br>区 分    | 額 面 金 額                | 当                      |                  |             | 期 末     |                     |                  |                |                    |
|-----------------|------------------------|------------------------|------------------|-------------|---------|---------------------|------------------|----------------|--------------------|
|                 |                        | 外 貨 建 金 額              | 評 価 額            | 邦 貨 換 算 金 額 | 組 入 比 率 | う ち B B 格<br>以下組入比率 | 残 存 期<br>5 年 以 上 | 間 別<br>2 年 以 上 | 組 入 比 率<br>2 年 未 満 |
| アメリカ            | 千アメリカ・ドル<br>552,013    | 千アメリカ・ドル<br>567,249    | 千円<br>69,669,622 | %<br>42.6   | %<br>—  | %<br>16.7           | %<br>16.1        | %<br>9.7       |                    |
| カナダ             | 千カナダ・ドル<br>32,341      | 千カナダ・ドル<br>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<br>29,120  | 千オーストラリア・ドル<br>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<br>6,609    | 千シンガポール・ドル<br>6,837    | 593,906          | 0.4         | —       | 0.2                 | 0.1              | 0.0            |                    |
| イギリス            | 千イギリス・ポンド<br>61,592    | 千イギリス・ポンド<br>73,782    | 13,620,299       | 8.3         | —       | 6.0                 | 1.9              | 0.5            |                    |
| スイス             | 千スイス・フラン<br>3,343      | 千スイス・フラン<br>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<br>48,572  | 千デンマーク・クローネ<br>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<br>28,682  | 千ノルウェー・クローネ<br>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<br>44,250 | 千スウェーデン・クローネ<br>51,786 | 726,564          | 0.4         | —       | 0.3                 | 0.1              | 0.0            |                    |
| メキシコ            | 千メキシコ・ペソ<br>203,967    | 千メキシコ・ペソ<br>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<br>24,905 | 千マレーシア・リンギット<br>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<br>95,336   | 千南アフリカ・ランド<br>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<br>24,821   | 千ポーランド・ズロチ<br>27,369   | 832,868          | 0.5         | —       | 0.2                 | 0.2              | 0.1            |                    |
| ユーロ<br>(アイルランド) | 千ユーロ<br>7,988          | 千ユーロ<br>9,576          | 1,243,799        | 0.8         | —       | 0.4                 | 0.4              | 0.0            |                    |
| ユーロ<br>(オランダ)   | 千ユーロ<br>25,606         | 千ユーロ<br>30,210         | 3,923,765        | 2.4         | —       | 1.4                 | 0.8              | 0.3            |                    |
| ユーロ<br>(ベルギー)   | 千ユーロ<br>24,569         | 千ユーロ<br>30,604         | 3,974,911        | 2.4         | —       | 1.7                 | 0.5              | 0.2            |                    |
| ユーロ<br>(フランス)   | 千ユーロ<br>97,396         | 千ユーロ<br>117,550        | 15,267,493       | 9.3         | —       | 5.7                 | 2.6              | 1.0            |                    |
| ユーロ<br>(ドイツ)    | 千ユーロ<br>77,160         | 千ユーロ<br>91,742         | 11,915,494       | 7.3         | —       | 4.2                 | 2.1              | 1.0            |                    |
| ユーロ<br>(スペイン)   | 千ユーロ<br>56,527         | 千ユーロ<br>67,542         | 8,772,406        | 5.4         | —       | 3.1                 | 1.6              | 0.7            |                    |
| ユーロ<br>(イタリア)   | 千ユーロ<br>99,157         | 千ユーロ<br>120,989        | 15,714,095       | 9.6         | —       | 6.0                 | 2.6              | 1.0            |                    |
| ユーロ<br>(フィンランド) | 千ユーロ<br>6,284          | 千ユーロ<br>7,155          | 929,311          | 0.6         | —       | 0.4                 | 0.1              | 0.1            |                    |

| 区 分             | 額 面 金 額        | 期 末            |                 |          |                     | 期 末               |          |          |          |
|-----------------|----------------|----------------|-----------------|----------|---------------------|-------------------|----------|----------|----------|
|                 |                | 評 価 額          |                 | 組 入 比 率  | う ち B B 格<br>以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 |          | 5 年 以 上  | 2 年 以 上  |
|                 |                | 外 貨 建 金 額      | 邦 貨 換 算 金 額     |          |                     | 5 年 以 上           | 2 年 以 上  |          |          |
| ユーロ<br>(オーストリア) | 千ユーロ<br>15,300 | 千ユーロ<br>18,722 | 千円<br>2,431,655 | %<br>1.5 | %<br>-              | %<br>0.9          | %<br>0.4 | %<br>0.1 | %<br>0.1 |
| ユーロ<br>(小計)     | 409,987        | 494,094        | 64,172,933      | 39.2     | -                   | 23.7              | 11.2     | 4.3      | 4.3      |
| 合 計             | -              | -              | 160,897,617     | 98.3     | -                   | 51.1              | 31.5     | 15.7     | 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)

| 当    |                                  | 期    |        |                   | 末                 |               |            | 償還年月日 |
|------|----------------------------------|------|--------|-------------------|-------------------|---------------|------------|-------|
| 区 分  | 銘 柄                              | 種 類  | 年 利 率  | 額 面 金 額           | 評 価               |               |            |       |
|      |                                  |      |        |                   | 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<br>2,336 | 千アメリカ・ドル<br>2,423 | 千円<br>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 |       |

外国債券インデックスマザーファンド

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

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



| 当       |                            | 期       |        |         | 末         |             |            |
|---------|----------------------------|---------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| 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 額                    |         |        | 32,341  | 36,282    | 3,330,391   |            |
| 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 額                    |         |        | 29,120  | 31,721    | 2,795,335   |            |
| 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 額                    |         |        | 6,609   | 6,837     | 593,906     |            |
| 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 |



| 当     |                          | 期                       |         | 未                     |                       | 償還年月日                 |                       |              |            |
|-------|--------------------------|-------------------------|---------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|--------------|------------|
| 区     | 銘                        | 柄                       | 種       | 年利                    | 率                     |                       | 額面金額                  | 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<br>4,760 | 千スウェーデン・クローネ<br>5,532 | 千円<br>77,624 | 2025/05/12 |
| 通貨小計  | 銘柄数<br>金額                | 7銘柄                     |         |                       |                       | 44,250                | 51,786                | 726,564      |            |
| メキシコ  | Mexican Bonos            | 国債証券                    | 5.0000  | 千メキシコ・ペソ<br>8,802     | 千メキシコ・ペソ<br>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<br>金額                | 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<br>1,210 | 千マレーシア・リンギット<br>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<br>金額                | 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<br>5,462   | 千南アフリカ・ランド<br>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            |              |            |

## 外国債券インデックスマザーファンド

|             |           | 当                           |      | 期      |       | 末     |            |            |           |        |       |
|-------------|-----------|-----------------------------|------|--------|-------|-------|------------|------------|-----------|--------|-------|
| 区           | 分         | 銘                           | 柄    | 種      | 類     | 年利率   | 額面金額       | 評価価額       | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
|             |           |                             |      |        |       | %     | 千南アフリカ・ランド | 千南アフリカ・ランド |           | 千円     |       |
|             |           | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国債証券 | 7.7500 | 2,839 | 2,748 | 23,468     | 2023/02/28 |           |        |       |
|             |           | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国債証券 | 8.7500 | 8,752 | 8,311 | 70,982     | 2048/02/28 |           |        |       |
|             |           | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国債証券 | 8.5000 | 6,321 | 5,920 | 50,560     | 2037/01/31 |           |        |       |
|             |           | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国債証券 | 8.0000 | 3,801 | 3,508 | 29,961     | 2030/01/31 |           |        |       |
|             |           | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国債証券 | 8.7500 | 2,902 | 2,754 | 23,525     | 2044/01/31 |           |        |       |
|             |           | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国債証券 | 8.2500 | 4,943 | 4,613 | 39,399     | 2032/03/31 |           |        |       |
|             |           | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA    | 国債証券 | 8.8750 | 3,166 | 3,083 | 26,333     | 2035/02/28 |           |        |       |
| 通貨小計        | 銘柄数<br>金額 | -----                       | 15銘柄 |        |       |       | 95,336     | 88,944     | 759,584   | -----  |       |
|             |           |                             |      |        |       |       | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ |           |        |       |
| ポーランド       |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 2,309 | 2,802 | 85,278     | 2022/09/23 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.2500 | 2,029 | 2,167 | 65,971     | 2017/10/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.5000 | 1,912 | 2,175 | 66,199     | 2019/10/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | -      | 812   | 791   | 24,089     | 2017/07/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 1.5000 | 782   | 766   | 23,327     | 2020/04/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 627   | 817   | 24,872     | 2029/04/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.2500 | 2,256 | 2,595 | 78,971     | 2020/10/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 2,284 | 2,732 | 83,141     | 2021/10/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 4.7500 | 1,177 | 1,228 | 37,384     | 2017/04/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 4.0000 | 3,083 | 3,415 | 103,929    | 2023/10/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 3.7500 | 1,720 | 1,805 | 54,955     | 2018/04/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 2,099 | 2,144 | 65,268     | 2018/07/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 3.2500 | 1,840 | 1,932 | 58,806     | 2019/07/25 |           |        |       |
|             |           | Poland Government Bond      | 国債証券 | 3.2500 | 1,891 | 1,993 | 60,672     | 2025/07/25 |           |        |       |
| 通貨小計        | 銘柄数<br>金額 | -----                       | 14銘柄 |        |       |       | 24,821     | 27,369     | 832,868   | -----  |       |
|             |           |                             |      |        |       |       | 千ユーロ       | 千ユーロ       |           |        |       |
| ユーロ（ 아일랜드 ） |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 4.5000 | 759   | 861   | 111,833    | 2018/10/18 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 4.4000 | 684   | 792   | 102,868    | 2019/06/18 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.9000 | 570   | 701   | 91,105     | 2019/10/18 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.4000 | 1,131 | 1,576 | 204,791    | 2025/03/13 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.0000 | 765   | 948   | 123,150    | 2020/10/18 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.5000 | 169   | 187   | 24,311     | 2017/10/18 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 3.9000 | 504   | 624   | 81,123     | 2023/03/20 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 3.4000 | 847   | 1,024 | 133,113    | 2024/03/18 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.4000 | 761   | 851   | 110,580    | 2030/05/15 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 0.8000 | 372   | 383   | 49,764     | 2022/03/15 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.0000 | 391   | 387   | 50,272     | 2045/02/18 |           |        |       |
|             |           | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 4.5000 | 1,035 | 1,238 | 160,883    | 2020/04/18 |           |        |       |
| 国小計         | 銘柄数<br>金額 | -----                       | 12銘柄 |        |       |       | 7,988      | 9,576      | 1,243,799 | -----  |       |
|             |           |                             |      |        |       |       | 千ユーロ       | 千ユーロ       |           |        |       |
| ユーロ（ オランダ ） |           | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.5000 | 214   | 325   | 42,231     |            |           |        |       |

| 当                      |         | 期                       |         |       | 未      |             |             |              |             |           |  |
|------------------------|---------|-------------------------|---------|-------|--------|-------------|-------------|--------------|-------------|-----------|--|
| 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 |           |  |
|                        |         | Belgium Government Bond | 国       | 債 証 券 | 1.9000 | 千ユーロ<br>358 | 千ユーロ<br>371 | 千円<br>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 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 額 | 43銘柄                    |         |       |        | 97,396      | 117,550     | 15,267,493   |             |           |  |







■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－I'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。