

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成28年2月22日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 白川 真
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山村 政 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成28年2月23日から平成29年2月21日まで） 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付也没有ありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

- ① 取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ② 申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。
- ③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

(7) 【申込期間】

平成28年2月23日から平成29年2月21日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

- ① 受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうもの
とします。
- ② ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日には、受益権の取得および換金の申込みの受付
は行ないません。
申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。
- ③ 委託会社の各営業日（※）の午後3時までには受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかか
る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎ
て行なわれる申込みは、翌営業日（※）の取扱いとなります。
（※）前②の申込受付中止日を除きます。
- ④ 当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、
収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取
扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異
なる場合があります。
- ⑤ 「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にし
たがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を
規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称
に読替えるものとします（以下同じ。）。
- ⑥ 取得申込金額に利息は付きません。
- ⑦ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の
振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に
記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

◆投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいま
す。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	債券
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券 公債））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし
	対象インデックス	その他の指数（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））

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

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「海外」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「債券」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「インデックス型」…目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「債券 公債」…目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
- ・「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの

- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
- ・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
- ・「その他の指数」…日経225、TOPIXにあてはまらないすべてのもの

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信		不動産投信	
	内外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式					
一般	年1回	グローバル (除く日本)			
大型株					
中小型株	年2回	日本			日経225
債券					
一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
公債		欧州			
社債	年6回 (隔月)	アジア			TOPIX
その他債券		オセアニア			
クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	中南米			
不動産投信		アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (シティ世界国債 インデックス(除く日本、 ヘッジなし・丹ベース))
その他資産 (投資信託証券) (債券 公債)	日々	中近東 (中東)			
資産複合 ()	その他 ()	エマージング			
資産配分固定型					
資産配分変更型					

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

<信託金の限度額>

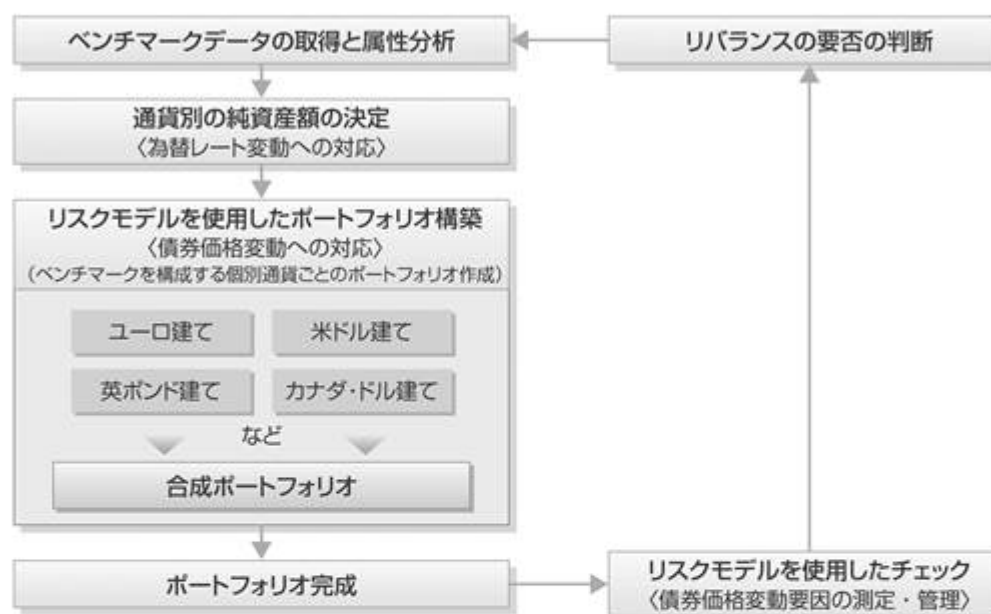
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1

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います。

運用プロセス



ベンチマークである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）の主な騰落要因は、為替レート変動と債券価格変動です。したがって、ファンドは、特に以下の3点に留意し運用します。

①為替レート変動への対応

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

②債券価格変動への対応

ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、リスクモデル^(注)を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

③債券価格変動要因の測定・管理

リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行なっています。

(注) リスクモデルでは、個別債券をキャッシュフロー（利金と償還金）ごとに分解し、ポートフォリオをキャッシュフローの集合体として分析するなどの手法を採用しています。その結果、ポートフォリオの効率的な複製を行なうこと、イールドカーブの変化などの債券価格変動要因がポートフォリオの価値に与える影響を測定・管理することなどができます。

■ 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）について

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。

ファンドの仕組み

●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、投資者のみなさまからお預かりした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。なお、ベビーファンドから外国の公社債への直接投資を行なうことができるものとします。



- ・保有実質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。
- ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、公社債およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

- ・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.の運用が行なわれないことがあります。

2 毎年11月30日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、利息等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、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。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- ・ 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れるわけではないこと
- ・ 基準価額の算出に使用する為替レートと、指数の算出に使用する為替レートの評価時点が異なること
- ・ 信託報酬等を負担することによる影響
- ・ 追加設定および解約に対応した公社債の約定価格と指数の算出に使用する価格の差
- ・ 債券先物取引等を利用した場合の指数との値動きの差、コストなど
- ・ 公社債および債券先物取引等の最低取引単位の影響
- ・ 公社債または債券先物取引等の流動性が低下した場合における売買対応の影響

(2) 【ファンドの沿革】

平成12年 4月28日 信託契約締結、当初自己設定、運用開始
平成12年12月 1日 ファンドの名称の変更（従来は「倶楽部外国債券インデックス」）

(注) 当ファンドの平成12年4月28日の当初自己設定および平成12年4月28日から平成13年2月28日までの継続申込期間に係る有価証券届出書は、＜ワールド投信倶楽部「倶楽部外国株式インデックス」ワールド投信倶楽部「倶楽部外国債券インデックス」＞有価証券届出書として平成12年4月12日に提出しております。

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
お取扱窓口	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
委託会社	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など

↑ ↓ ※1

↓運用指図 ↑↓※2

損益↑↓信託金（※3）

受託会社	三井住友信託銀行 株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・ サービス信託銀行株 式会社	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
------	--	--

損益↑↓投資

投資対象	外国の公社債 など (ファミリーファンド方式で運用を行ないます。)
------	--------------------------------------

(注) 「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

<委託会社の概況（平成27年12月末日現在）>

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成 7年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成 7年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)

・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券および外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ. 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。

ロ. 保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

ハ. 保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産およびマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

ニ. 運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、公社債およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(2) 【投資対象】

① 委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された外国債券インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新

株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券

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

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

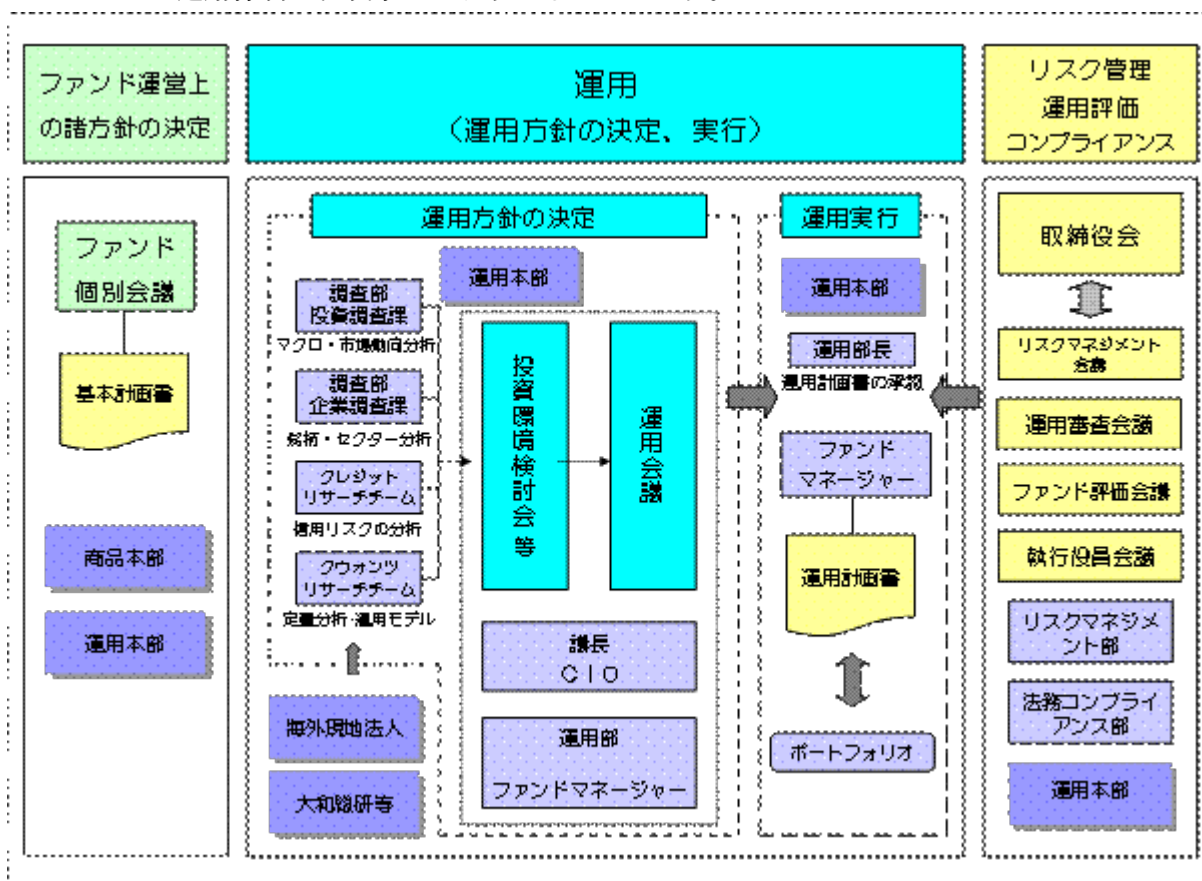
- ③ 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前②1.から4.までの金融商品により運用することの指図ができます。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ. 基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

二、運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

③ 職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ、CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ、Deputy-CIO（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ、インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

二、運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ、ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

イ、ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

ロ、運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ、リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

二、執行役員会議

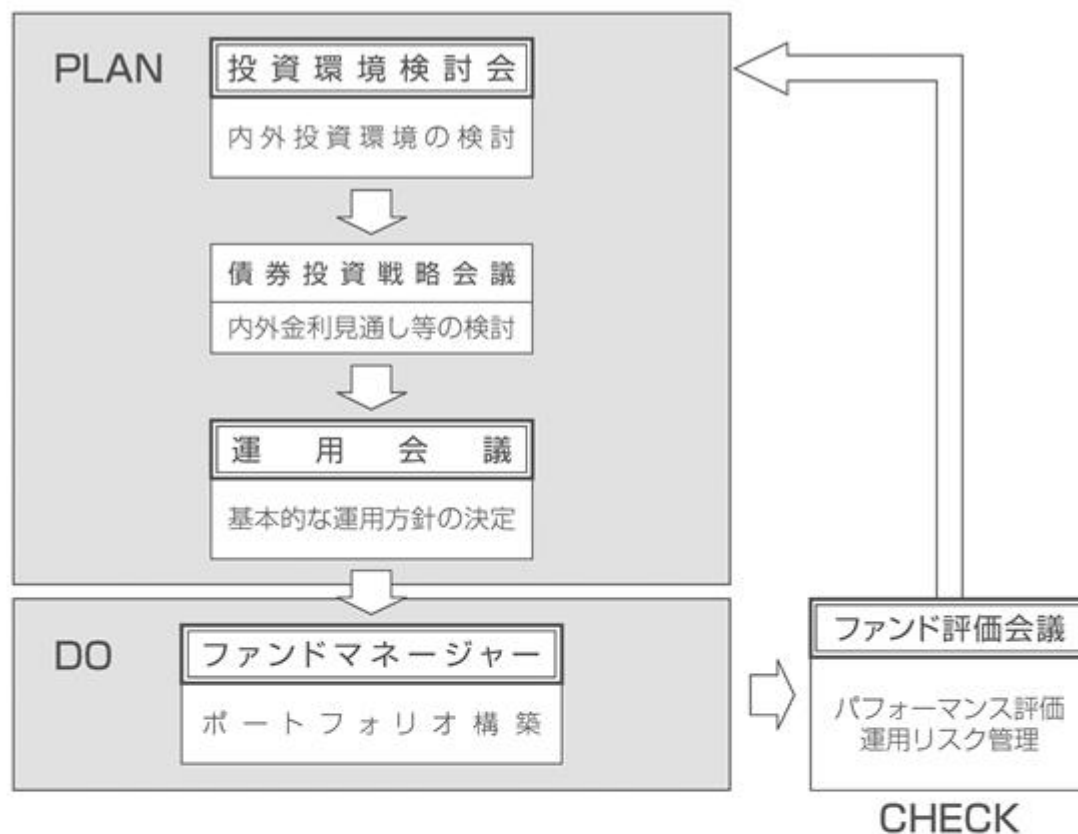
経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

⑤ 受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

※ 上記の運用体制は平成27年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

<運用プロセスについて>



PLAN

投資環境検討会では、主にマクロ分析を基に内外投資環境について検討します。債券投資戦略会議では、内外金利の動向について検討し、金利見通しを策定します。運用会議で、基本的な運用方針を決定し、これを踏まえてファンドマネージャーがファンドの運用方針を策定し、運用部長が承認します。

DO

ファンドマネージャーは、承認された運用方針に基づきポートフォリオを構築します。

CHECK

ファンド評価会議でパフォーマンス評価、ファンドの運用リスク分析を行ない、運用へフィードバックを行ないます。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配を行ないます。

- ① 分配対象額は、経費控除後の利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、利息等収益等を中心に分配します。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。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

- イ. 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。
- ロ. 委託会社は、信託財産に属する株式および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式および株式を組入可能な投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。
- ハ. 前ロ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式および株式を組入可能な投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

② 新株引受権証券等（信託約款）

- イ. 委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③ 投資信託証券（信託約款）

- イ. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

- イ. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ロ. 前イ.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとし、

⑤ 同一銘柄の株式等（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ハ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ニ. 前ハ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑥ 先物取引等（信託約款）

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

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

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

⑦ スワップ取引（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

ホ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ヘ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑧ 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ. 前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ヘ. 前ホ.においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ト. 金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

チ. 委託会社は、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑨ デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

⑩ 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑪ 有価証券の貸付け（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.および2.の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

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

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

ロ. 前イ.の1.および2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑫ 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

⑬ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

⑭ 外国為替予約取引（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ. 前イ.の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ、前ロ.においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

⑮ 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ、借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<参 考>マザーファンド（外国債券インデックスマザーファンド）の概要

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ、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。

ロ、保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

ハ、当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、
- ② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、公社債など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の変動要因については、次のとおりです。

① 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

② 債券先物取引の利用に伴うリスク

債券先物の価格は、金利の動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。ファンドで行なっている債券先物取引について損失が発生した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③ 外国為替予約取引の利用に伴うリスク

外国為替予約とは、将来あらかじめ定めた条件（時期、金額、為替レート等）で外貨の売買を行なう契約のことをいいます。買予約（外貨を買う契約）を行なっている場合、当該外貨の為替レートが

円安方向に変動すれば収益が発生し、円高方向に変動すれば損失が発生します（売予約を行なっている場合は逆の結果となります。）。

為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。ファンドで行なっている外国為替予約取引について損失が発生した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。また、取引の相手方の債務不履行により損失が発生することがあり、この場合基準価額が下落する要因となります。

④ 外国証券への投資に伴うリスク

イ. 為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入実質外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

なお、当ファンドにおいては、保有実質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原則として行ないません。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ. カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。

⑤ その他

イ. 解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ. ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

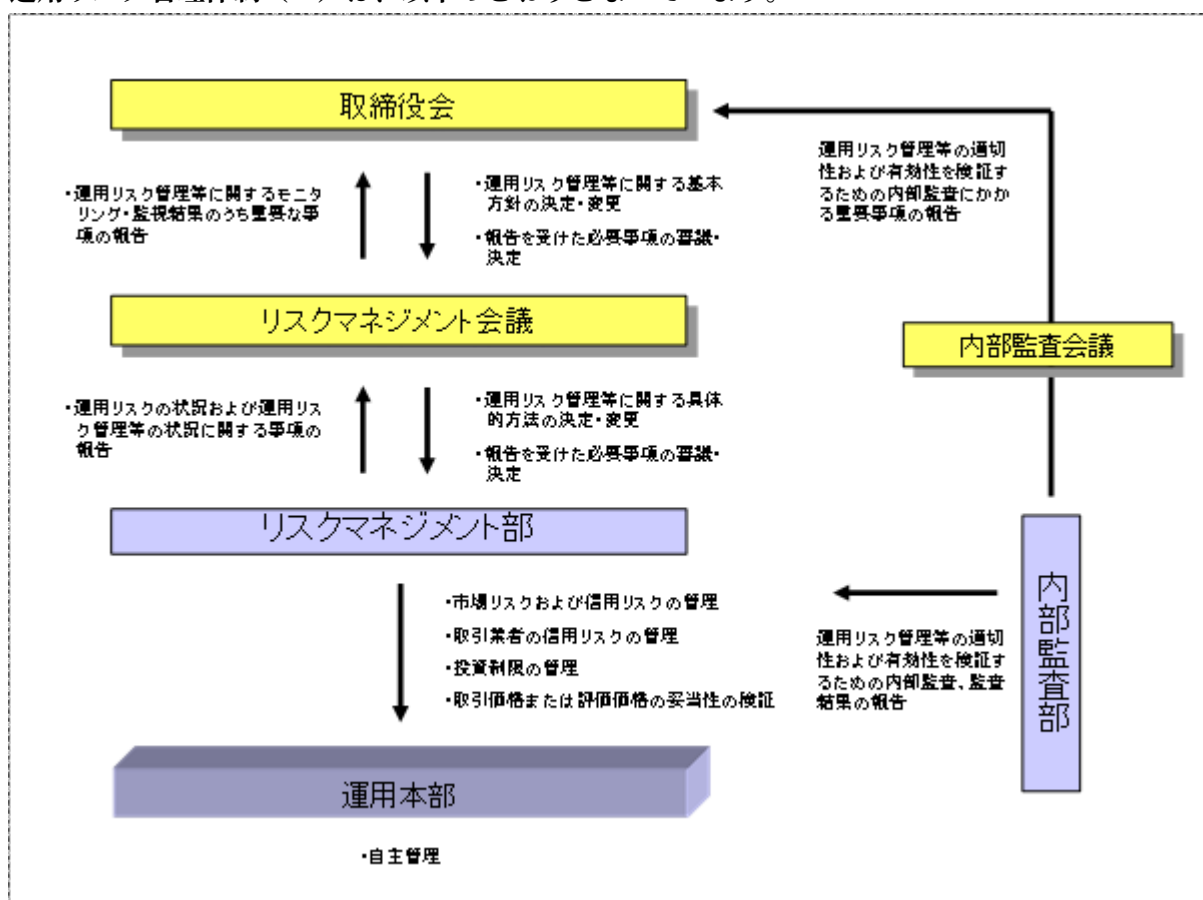
(3) その他の留意点

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

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、＜ファンドの特色＞の「●基準価額の動きに関する留意点」をご参照下さい。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※流動性リスクに対する管理体制

当社は、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

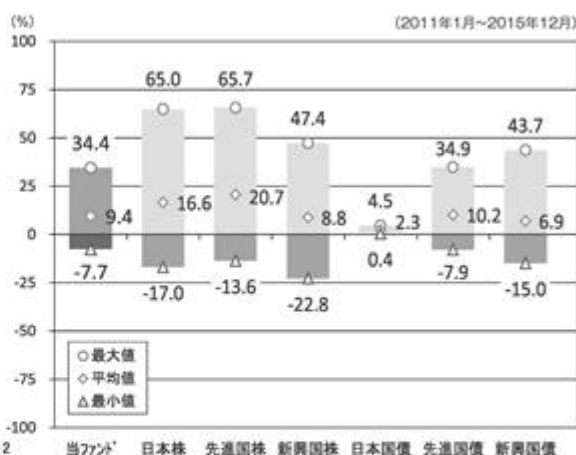
参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
 日本国債：NOMURA-BPI国債
 先進国国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
 新興国国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。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。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

- ① 取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせるにより知ることができます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金(解約)手数料】

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3) 【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.702%（税抜0.65%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.24% （税抜）	年率0.33% （税抜）	年率0.08% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

- ④ 前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、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：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

- ① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

- ④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（※）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ. 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ. 解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ. 損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する

など、一定の条件に該当する方が対象となります。また、当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

※平成28年1月から年間80万円の範囲で20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」の口座開設の申込受付が開始され、同年4月より投資可能となる予定です。

② 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収[※]され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

③ 受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、前②にかかわらず所得税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

<注1>個別元本について

① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2>収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

② 投資者が収益分配金を受取る際、イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（※）上記は、平成28年1月1日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成27年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	15,342,092,057	99.87
内 日本	15,342,092,057	99.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	19,572,003	0.13
純資産総額	15,361,664,060	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（平成27年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	5,449,734,320	2.8557 15,562,811,029	2.8152 15,342,092,057	99.87

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.87%
合計	99.87%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第7計算期間末 (平成18年11月30日)	3,756,522,251	3,756,522,251	1.9288	1.9288
第8計算期間末 (平成19年11月30日)	5,352,781,905	5,352,781,905	2.0291	2.0291
第9計算期間末 (平成20年12月1日)	5,245,325,890	5,245,325,890	1.6704	1.6704
第10計算期間末 (平成21年11月30日)	6,454,783,875	6,454,783,875	1.7612	1.7612
第11計算期間末 (平成22年11月30日)	6,916,479,400	6,916,479,400	1.6293	1.6293
第12計算期間末 (平成23年11月30日)	7,534,118,543	7,534,118,543	1.5727	1.5727
第13計算期間末 (平成24年11月30日)	9,368,614,281	9,368,614,281	1.7662	1.7662
第14計算期間末 (平成25年12月2日)	12,217,294,516	12,217,294,516	2.2305	2.2305
第15計算期間末 (平成26年12月1日)	15,587,666,365	15,587,666,365	2.6433	2.6433
平成26年12月末日	15,730,946,038	—	2.6553	—
平成27年1月末日	15,321,569,585	—	2.5758	—
2月末日	15,324,289,406	—	2.5812	—
3月末日	15,306,474,414	—	2.5692	—
4月末日	15,312,872,480	—	2.5668	—
5月末日	15,627,524,699	—	2.6153	—
6月末日	15,428,713,703	—	2.5745	—
7月末日	15,624,665,148	—	2.6070	—
8月末日	15,382,074,863	—	2.5669	—
9月末日	15,441,799,482	—	2.5571	—
10月末日	15,497,094,719	—	2.5578	—
第16計算期間末 (平成27年11月30日)	15,486,825,214	15,486,825,214	2.5554	2.5554
12月末日	15,361,664,060	—	2.5176	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第7計算期間	7.3
第8計算期間	5.2
第9計算期間	△17.7
第10計算期間	5.4
第11計算期間	△7.5
第12計算期間	△3.5
第13計算期間	12.3
第14計算期間	26.3
第15計算期間	18.5
第16計算期間	△3.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第7計算期間	817,842,157	282,876,222
第8計算期間	1,113,681,692	423,244,350
第9計算期間	1,010,865,369	508,775,452
第10計算期間	833,689,510	308,817,851
第11計算期間	951,135,069	370,944,123
第12計算期間	1,081,310,885	535,818,408
第13計算期間	947,446,316	433,580,029

第14計算期間	1,060,837,959	887,887,896
第15計算期間	1,098,653,065	678,964,549
第16計算期間	1,061,666,338	898,362,042

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成27年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	158,269,616,137	97.94
内 ユーロ	63,873,090,481	39.52
内 シンガポール	584,704,984	0.36
内 マレーシア	723,068,162	0.45
内 ノルウェー	445,574,527	0.28
内 スウェーデン	740,959,954	0.46
内 デンマーク	986,728,527	0.61
内 イギリス	13,124,351,696	8.12
内 スイス	483,155,537	0.30
内 ポーランド	896,187,348	0.55
内 カナダ	3,151,447,975	1.95
内 アメリカ	68,111,479,732	42.15
内 メキシコ	1,631,343,714	1.01
内 南アフリカ	653,737,067	0.40
内 オーストラリア	2,863,786,433	1.77
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,334,933,017	2.06
純資産総額	161,604,549,154	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）	1,177,692,340	0.73
内 日本	1,177,692,340	0.73

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（平成27年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,410,000	99.55 769,692,953	99.31 767,822,026	0.625000 2017/08/31	0.48
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,275,000	98.22 743,401,625	97.47 737,725,417	2.000000 2025/02/15	0.46
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	6,143,000	97.99 726,029,812	97.21 720,295,190	2.000000 2025/08/15	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,921,000	100.45 717,366,827	99.70 712,010,838	2.250000 2024/11/15	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,662,000	101.55 693,505,989	100.84 688,650,614	2.375000 2024/08/15	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,788,000	99.14 692,087,100	98.41 687,018,961	2.125000 2025/05/15	0.43
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,660,000	99.45 678,918,490	99.21 677,259,644	0.500000 2017/07/31	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,412,000	102.71 670,482,829	101.97 665,639,488	2.500000 2024/05/15	0.41
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,229,000	104.79 660,916,608	103.93 655,499,155	2.750000 2024/02/15	0.41
10	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証 券	3,118,000	153.70 631,490,067	150.61 618,815,071	6.000000 2031/05/01	0.38
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,974,000	99.53 597,124,539	99.25 595,432,781	0.625000 2017/09/30	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,635,000	103.35 577,782,717	102.88 575,160,879	3.250000 2017/03/31	0.36
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,397,000	130.13 582,500,358	127.97 572,840,661	4.250000 2023/10/25	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,509,000	104.42 567,873,235	103.75 564,224,133	2.625000 2020/11/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,280,000	108.53 560,290,040	107.74 556,175,840	3.625000 2020/02/15	0.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,468,000	103.21 556,226,814	102.36 551,640,899	2.500000 2023/08/15	0.34

17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,685,000	97.97 553,621,079	97.25 549,518,759	1.750000 2023/05/15	0.34
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,550,000	118.65 555,048,511	117.42 549,294,774	3.250000 2021/10/25	0.34
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,590,000	115.96 548,558,496	115.03 544,159,091	3.500000 2020/04/25	0.34
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,480,000	118.15 541,792,752	116.70 535,148,224	3.000000 2022/04/25	0.33
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,076,000	109.36 537,655,127	108.57 533,737,025	3.625000 2021/02/15	0.33
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,507,000	167.00 551,699,962	161.29 532,817,305	5.750000 2032/10/25	0.33
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,623,000	154.78 534,977,221	150.38 519,769,381	5.500000 2029/04/25	0.32
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,325,000	100.05 521,919,934	99.50 519,030,058	1.500000 2019/11/30	0.32
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,020,000	107.35 520,493,685	106.68 517,274,266	3.375000 2019/11/15	0.32
26	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証 券	2,854,000	101.25 516,616,096	101.02 515,442,548	1.250000 2018/07/22	0.32
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,146,000	126.99 526,435,038	124.23 514,993,502	3.500000 2026/04/25	0.32
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	3,230,000	120.24 511,762,001	119.07 506,807,817	3.750000 2021/04/25	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	4,218,000	98.96 503,442,157	98.61 501,697,202	0.625000 2018/04/30	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	3,581,000	115.41 498,478,155	114.67 495,303,658	3.750000 2043/11/15	0.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.94%
合計	97.94%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2016年1月	買建	850,000	156,484,637	151,937,500	0.09%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2016年1月	買建	282,000	3,997,406	3,900,060	0.00%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2016年1月	買建	252,000	7,668,259	7,839,720	0.00%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2016年1月	買建	746,000	10,658,979	10,734,940	0.01%
		米ドル買/円売 2016年1月	買建	3,420,000	418,285,008	412,417,800	0.26%
		スイス・フラン買/円売 2016年1月	買建	34,000	4,060,768	4,132,020	0.00%
		南アフリカ・ランド買/円売 2016年1月	買建	795,000	6,748,564	6,248,700	0.00%
		豪ドル買/円売 2016年1月	買建	280,000	24,936,156	24,606,400	0.02%
		カナダ・ドル買/円売 2016年1月	買建	587,000	53,546,628	51,162,920	0.03%
		ユーロ買/円売 2016年1月	買建	3,193,000	417,175,924	420,741,610	0.26%
		シンガポール・ドル買/円売 2016年1月	買建	59,000	5,128,268	5,035,650	0.00%
		メキシコ・ペソ買/円売 2016年1月	買建	10,069,000	71,941,249	70,281,620	0.04%
		デンマーク・クローネ買/円売 2016年1月	買建	490,000	8,549,961	8,653,400	0.01%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

2015年12月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	25,176円
純資産総額	153億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.5%
3カ月間	-1.5%
6カ月間	-2.2%
1年間	-5.2%
3年間	33.7%
5年間	60.7%
設定来	152.6%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 50円

決算期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期
	04年11月	05年11月	06年11月	07年11月	08年12月	09年11月	10年11月	11年11月	12年11月	13年12月	14年12月	15年11月
分配金	10円	10円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	727	97.8%	米ドル	42.6%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2017/08/31	0.5%
			ユーロ	40.3%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2025/02/15	0.5%
			英ポンド	8.3%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2025/08/15	0.4%
コール・ローン、その他		2.2%	カナダ・ドル	2.0%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2024/11/15	0.4%
合計	727	100.0%	豪ドル	1.8%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2024/08/15	0.4%
債券種別構成			メキシコ・ペソ	1.1%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2025/05/15	0.4%
国債		97.8%	デンマーク・クローネ	0.6%	AA	United States Treasury Note/Bond	2017/07/31	0.4%
			ポーランド・ズロチ	0.6%	A	United States Treasury Note/Bond	2024/05/15	0.4%
			日本円	0.5%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2024/02/15	0.4%
			その他	2.3%	BB	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2031/05/01	0.4%
合計		97.8%	合計	100.0%	合計	合計		4.3%

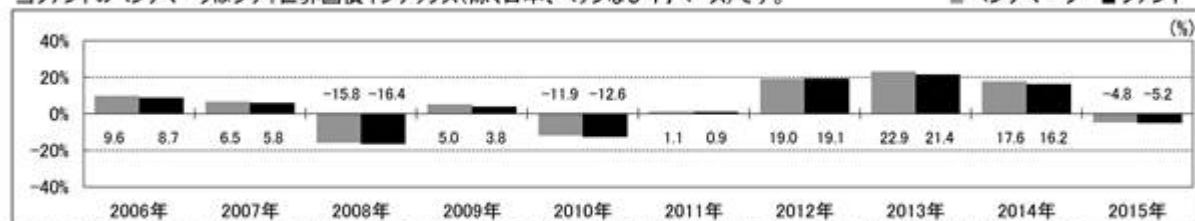
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

年間収益率の推移

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

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2015年は12月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日には、受益権の取得申込みの受付は行ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

2 【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日には、一部解約の実行の請求の受付けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて計算される価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。
- ・外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
 2. 価格情報会社の提供する価額

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
 2. 価格情報会社の提供する価額

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

- ① 信託の終了

1. 委託会社は、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
<http://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

② 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間（平成26年12月2日から平成27年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 平成26年12月1日現在	第16期 平成27年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	116,103,600	59,141,172
親投資信託受益証券	15,532,045,350	15,485,021,994
流動資産合計	15,648,148,950	15,544,163,166
資産合計	15,648,148,950	15,544,163,166
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,638,708	2,500,767
未払受託者報酬	5,942,959	6,672,172
未払委託者報酬	42,343,855	47,539,580
その他未払費用	557,063	625,433
流動負債合計	60,482,585	57,337,952
負債合計	60,482,585	57,337,952
純資産の部		
元本等		
元本	※1 5,897,146,587	※1 6,060,450,883
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,690,519,778	9,426,374,331
（分配準備積立金）	4,443,599,417	3,822,449,501
元本等合計	15,587,666,365	15,486,825,214
純資産合計	15,587,666,365	15,486,825,214
負債純資産合計	15,648,148,950	15,544,163,166

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	自 至	第15期 平成25年12月3日 平成26年12月1日	自 至	第16期 平成26年12月2日 平成27年11月30日
営業収益				
受取利息		24,782		27,835
有価証券売買等損益		2,490,643,586		△ 414,023,356
営業収益合計		2,490,668,368		△ 413,995,521
営業費用				
受託者報酬		11,295,707		13,291,407
委託者報酬		80,482,515		94,701,842
その他費用		1,067,959		1,245,898
営業費用合計		92,846,181		109,239,147
営業利益又は営業損失（△）		2,397,822,187		△ 523,234,668
経常利益又は経常損失（△）		2,397,822,187		△ 523,234,668
当期純利益又は当期純損失（△）		2,397,822,187		△ 523,234,668
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）		70,731,084		△ 50,108,633
期首剰余金又は期首欠損金（△）		6,739,836,445		9,690,519,778
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,462,671,873		1,681,486,140
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,462,671,873		1,681,486,140
剰余金減少額又は欠損金増加額		839,079,643		1,472,505,552
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		839,079,643		1,472,505,552
分配金		※1 ー		※1 ー
期末剰余金又は期末欠損金（△）		9,690,519,778		9,426,374,331

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第16期	
	自 平成26年12月2日	至 平成27年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成26年11月30日が休日のため、前計算期間末日を平成26年12月1日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	平成26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
1. ※1 期首元本額	5,477,458,071円	5,897,146,587円
期中追加設定元本額	1,098,653,065円	1,061,666,338円
期中一部解約元本額	678,964,549円	898,362,042円
2. 計算期間末日における受益権の総数	5,897,146,587口	6,060,450,883口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	自 平成25年12月3日 至 平成26年12月1日	自 平成26年12月2日 至 平成27年11月30日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（24,782円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（2,327,066,321円）、投資信託約款に規定される収益調整金（5,246,920,361円）及び分配準備積立金（2,116,508,314円）より分配対象額は9,690,519,778円（1万口当たり16,432.56円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,119,375,150円）及び分配準備積立金（3,822,449,501円）より分配対象額は9,941,824,651円（1万口当たり16,404.43円）であり、分配を行っておりません。
--------------------	---	--

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第16期 自 平成26年12月2日 至 平成27年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第16期
	平成27年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第15期 平成26年12月1日現在	第16期 平成27年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,467,022,592	△397,604,790
合計	2,467,022,592	△397,604,790

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第15期 平成26年12月1日現在	第16期 平成27年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第16期 自 平成26年12月2日 至 平成27年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第15期 平成26年12月1日現在	第16期 平成27年11月30日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6433円 (26,433円)	2.5554円 (25,554円)
---------------------------	----------------------	----------------------

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	5,422,306,182	15,485,021,994	
親投資信託受益証券 合計			15,485,021,994	
合計			15,485,021,994	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金	64,493,142	22,299,870
コール・ローン	949,466,688	1,424,967,456
国債証券	169,019,024,965	160,897,617,318
派生商品評価勘定	9,091,885	10,321,012
未収入金	2,413,443,236	—
未収利息	1,587,127,867	1,365,306,752
前払費用	35,206,343	28,126,154
流動資産合計	174,077,854,126	163,748,638,562
資産合計	174,077,854,126	163,748,638,562
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	634,842	14,453,112
未払金	1,859,286,882	—
未払解約金	210,003,000	81,875,100
流動負債合計	2,069,924,724	96,328,212
負債合計	2,069,924,724	96,328,212
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	58,642,095,234	57,305,049,313
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	113,365,834,168	106,347,261,037
元本等合計	172,007,929,402	163,652,310,350
純資産合計	172,007,929,402	163,652,310,350
負債純資産合計	174,077,854,126	163,748,638,562

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成26年12月2日 至 平成27年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
1. ※1 期首	平成25年12月3日	平成26年12月2日
期首元本額	60,271,757,086円	58,642,095,234円
期中追加設定元本額	4,730,279,405円	4,738,151,583円
期中一部解約元本額	6,359,941,257円	6,075,197,504円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス	2,290,419,243円	1,705,324,690円
V A		

ダイワ国内重視バランスファン ド３０ＶＡ(一般投資家私 募)	73,485,615円	64,835,690円
ダイワ国内重視バランスファ ンド５０ＶＡ(一般投資家私 募)	537,277,899円	424,599,533円
ダイワ国際分散バランスファ ンド３０ＶＡ(一般投資家私 募)	135,056,068円	94,962,008円
ダイワ国際分散バランスファ ンド５０ＶＡ(一般投資家私 募)	1,722,206,915円	1,383,635,321円
D－I's 外国債券インデッ クス	445,454円	458,057円
DCダイワ外国債券インデッ クス	34,465,553,414円	35,721,581,475円
ダイワ・ライフ・バランス３ ０	422,054,516円	453,561,180円
ダイワ・ライフ・バランス５ ０	191,757,096円	223,580,955円
ダイワ・ライフ・バランス７ ０	110,025,498円	140,934,888円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽／安定コース）	187,063,304円	208,558,781円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽／６分散コー ス）	148,457,365円	170,466,025円
DCダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽／成長コース）	36,267,690円	51,355,053円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	8,855,272円	11,127,145円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,361,098円	11,074,521円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	327,294円	617,784円
ダイワ世界バランスファンド ４０ＶＡ	2,209,328,440円	1,816,582,601円
ダイワ世界バランスファンド ６０ＶＡ	231,160,596円	190,939,449円
ダイワ・バランスファンド３ ５ＶＡ	8,707,192,168円	7,736,607,136円

ダイワ・ワールド・バランス ファンド５０ＶＡ	708,262,308円	546,037,516円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド７５ＶＡ	582,345,067円	350,468,264円
ダイワ・バランスファンド２ ５ＶＡ（適格機関投資家専 用）	454,402,000円	412,662,256円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	39,180,811円	70,890,454円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,295,256,154円	5,422,306,182円
ダイワライフスタイル２５	25,935,134円	30,209,709円
ダイワライフスタイル５０	42,372,501円	48,765,591円
ダイワライフスタイル７５	11,046,314円	12,907,049円
計	58,642,095,234円	57,305,049,313円
2. 期末日における受益権の総数	58,642,095,234口	57,305,049,313口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成26年12月2日 至 平成27年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	8,345,849,135	82,327,006
合計	8,345,849,135	82,327,006

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年12月3日から平成26年12月1日まで、及び平成26年12月2日から平成27年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成26年12月1日 現在			平成27年11月30日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	762,492,839	—	761,446,060	1,046,779	—	—	—	—
オーストラリア ・ドル	30,486,595	—	30,257,836	228,759	—	—	—	—
スイス・フラン	20,374,257	—	20,319,491	54,766	—	—	—	—
スウェーデン ・クローナ	1,522,393	—	1,517,801	4,592	—	—	—	—
デンマーク ・クローネ	168,148,908	—	167,941,222	207,686	—	—	—	—
ポーランド ・ズロチ	25,750,631	—	25,754,612	△3,981	—	—	—	—
ユーロ	504,256,011	—	503,748,037	507,974	—	—	—	—
南アフリカ ・ランド	11,954,044	—	11,907,061	46,983	—	—	—	—
買 建	1,590,254,841	—	1,597,665,105	7,410,264	1,316,101,673	—	1,311,969,573	△4,132,100
アメリカ・ドル	592,178,995	—	595,867,332	3,688,337	626,126,802	—	634,804,890	8,678,088
イギリス・ポンド	206,852,103	—	207,699,286	847,183	82,160,770	—	81,399,780	△760,990
オーストラリア ・ドル	25,305,249	—	25,252,920	△52,329	30,462,896	—	31,099,300	636,404
カナダ・ドル	45,009,250	—	45,013,505	4,255	20,008,159	—	19,916,260	△91,899
シンガポール ・ドル	5,798,086	—	5,806,720	8,634	5,422,699	—	5,470,920	48,221
スイス・フラン	5,141,486	—	5,159,280	17,794	4,399,317	—	4,290,120	△109,197
スウェーデン ・クローナ	7,651,852	—	7,663,800	11,948	6,881,802	—	6,790,520	△91,282
デンマーク ・クローネ	11,140,187	—	11,201,040	60,853	42,231,229	—	41,505,440	△725,789
ノルウェー ・クローネ	4,300,598	—	4,286,550	△14,048	4,153,665	—	4,159,500	5,835
ポーランド ・ズロチ	9,829,685	—	9,886,800	57,115	7,805,927	—	7,635,420	△170,507

マレーシア ・リンギット	990,817	—	982,906	△7,911	—	—	—	—
メキシコ・ペソ	23,911,151	—	24,061,046	149,895	15,590,542	—	15,793,200	202,658
ユーロ	643,806,196	—	646,450,000	2,643,804	463,562,173	—	451,947,553	△11,614,620
南アフリカ ・ランド	8,339,186	—	8,333,920	△5,266	7,295,692	—	7,156,670	△139,022
合計	2,352,747,680	—	2,359,111,165	8,457,043	1,316,101,673	—	1,311,969,573	△4,132,100

（注） 1. 時価の算定方法

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

- ① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.9332円 (29,332円)	2.8558円 (28,558円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1） 株式

該当事項はありません。

（2） 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	

4.625% United States Treasury Note/Bond 20161115	2,336,000.000	2,423,763.520	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20170215	2,039,000.000	2,134,812.610	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20170515	1,795,000.000	1,891,535.100	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20170815	2,401,000.000	2,561,266.750	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,686,000.000	1,794,730.140	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20180215	3,839,000.000	4,047,265.750	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,960,000.000	3,162,434.400	
4% United States Treasury Note/Bond 20180815	3,173,000.000	3,420,018.050	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,672,161.760	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,308,176.160	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,282,719.760	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,621,000.000	2,831,282.830	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20161031	85,000.000	86,942.250	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,315,510.200	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20161130	4,149,000.000	4,234,220.460	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20161231	3,154,000.000	3,240,356.520	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,884,000.000	2,963,742.600	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	5,630,000.000	6,110,745.700	
3% United States Treasury Note/Bond 20170228	2,687,000.000	2,761,617.990	
3.25% United States Treasury Note/Bond 20170331	4,635,000.000	4,790,504.250	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20170430	1,653,000.000	1,707,681.240	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,323,388.040	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20170531	2,835,000.000	2,918,150.550	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20170630	3,468,000.000	3,559,139.040	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20170731	1,773,000.000	1,818,495.180	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	2,979,975.560	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20170831	2,903,000.000	2,954,121.830	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20170930	2,831,000.000	2,882,637.440	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20171031	2,372,000.000	2,415,621.080	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,708,342.890	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20171130	883,000.000	905,860.870	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	924,000.000	958,104.840	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20180131	255,000.000	263,874.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,457,798.920	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	1,234,000.000	1,281,188.160	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20180331	1,300,000.000	1,355,289.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	260,000.000	269,778.600	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,417,000.000	3,653,763.930	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20180531	1,322,000.000	1,364,290.780	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,065,000.000	1,099,154.550	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,341,000.000	1,380,961.800	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,577,534.120	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20180831	3,444,000.000	3,476,545.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180930	2,835,000.000	2,851,386.300	
1% United States Treasury Note/Bond 20161031	142,000.000	142,460.080	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,340,974.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20211115	1,353,000.000	1,364,405.790	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20161130	3,027,000.000	3,032,176.170	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,174,959.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20161231	3,410,000.000	3,415,456.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,867,234.350	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,970,000.000	2,974,752.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,424,773.640	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,246,277.840	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170228	2,408,000.000	2,412,406.640	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,846,593.850	
1% United States Treasury Note/Bond 20170331	3,856,000.000	3,868,184.960	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	301,803.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170430	2,375,000.000	2,377,873.750	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	557,160.890	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,430,942.810	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170531	3,485,000.000	3,475,032.900	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,366,921.700	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20170630	3,906,000.000	3,901,390.920	
1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,350,900.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170731	5,660,000.000	5,629,039.800	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	1,784,000.000	1,750,674.880	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,490,944.790	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170831	6,410,000.000	6,381,667.800	
1% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,872,000.000	1,842,890.400	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170930	4,974,000.000	4,950,870.900	
1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,178,297.450	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20171031	2,648,000.000	2,640,029.520	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	877,467.240	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,094,724.160	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,336,000.000	2,321,470.080	
1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,327,631.250	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	1,913,000.000	1,904,544.540	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	894,000.000	880,590.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180131	2,153,000.000	2,147,186.900	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	1,366,000.000	1,357,243.940	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	3,850,000.000	3,850,577.500	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	3,447,000.000	3,425,559.660	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,943,537.760	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180331	2,315,000.000	2,299,535.800	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,138,609.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,590,175.600	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	4,218,000.000	4,174,132.800	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,423,213.350	
1% United States Treasury Note/Bond 20180531	3,407,000.000	3,398,209.940	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,435,405.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,693,000.000	1,704,834.070	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,154,632.790	
2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,874,041.280	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,697,000.000	1,707,996.560	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,468,000.000	4,611,780.240	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,036,586.910	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,916,064.800	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3,611,000.000	3,616,633.160	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,352,691.600	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	3,821,000.000	4,012,050.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20161115	719,000.000	718,798.680	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,638,000.000	2,639,846.600	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,537,714.680	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20161215	144,000.000	143,915.040	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,040,870.840	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,072,278.240	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20170115	2,168,000.000	2,168,411.920	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,479,782.840	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,200,010.950	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,679,676.480	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170215	2,190,000.000	2,186,912.100	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,388,187.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,756,611.360	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20170315	1,182,000.000	1,182,035.460	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,405,709.990	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,892,399.510	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170415	1,485,000.000	1,486,796.850	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,559,098.160	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	3,002,637.750	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20170515	2,237,000.000	2,239,706.770	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,407,000.000	2,468,667.340	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,251,487.880	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,763,144.800	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170615	753,000.000	753,850.890	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,910,445.700	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,548,148.200	
7.5% United States Treasury Note/Bond 20161115	1,552,000.000	1,652,445.440	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20170515	1,527,000.000	1,703,017.290	
8.875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	1,121,800.720	
8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	724,000.000	900,018.880	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	848,942.280	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,837,161.080	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	851,017.500	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,149,838.200	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	887,657.400	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	987,835.520	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	936,411.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	438,000.000	574,875.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	622,917.350	

6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,404,200.960	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,241,000.000	1,690,862.500	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,926,000.000	2,479,859.820	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	752,721.230	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	693,389.880	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	1,019,000.000	1,312,359.910	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	255,000.000	282,769.500	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	694,000.000	859,636.980	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	760,000.000	974,935.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	810,000.000	1,021,167.000	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,307,000.000	1,706,654.460	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,861,807.040	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,860,960.880	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,677,000.000	2,077,115.430	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,334,451.220	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,724,691.150	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,572,050.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,499,952.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,377,000.000	2,455,726.240	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	2,353,000.000	2,370,271.020	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,654,714.830	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	3,984,000.000	3,801,891.360	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,080,438.620	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	3,904,606.720	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,314,000.000	3,740,147.260	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,132,975.340	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,078,167.500	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,993,000.000	3,217,684.510	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170715	2,583,000.000	2,584,291.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,353,273.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,902,186.040	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,662,000.000	5,749,987.480	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	3,820,174.050	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20170815	1,818,000.000	1,818,345.420	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,189,000.000	1,198,190.970	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,313,593.680	
1% United States Treasury Note/Bond 20170915	2,187,000.000	2,191,177.170	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,444,133.160	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,683,036.250	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20171015	1,466,000.000	1,465,369.620	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,194,721.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,181,061.050	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,947,822.130	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,227,000.000	3,222,708.090	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,593,000.000	1,591,566.300	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20161031	145,000.000	144,676.650	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,888,251.080	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130	4,325,000.000	4,327,335.500	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20161130	444,000.000	443,183.040	
1% United States Treasury Note/Bond 20171215	717,000.000	717,587.940	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,214,538.530	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231	2,204,000.000	2,214,314.720	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20161231	1,544,000.000	1,542,486.880	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20180115	1,547,000.000	1,543,178.910	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131	3,963,000.000	3,917,465.130	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,386,000.000	2,379,462.360	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,371,251.810	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	6,275,000.000	6,163,681.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,384,329.310	
1% United States Treasury Note/Bond 20180215	1,961,000.000	1,960,294.040	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229	2,788,000.000	2,767,731.240	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170228	970,000.000	966,925.100	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,792,176.300	
1% United States Treasury Note/Bond 20180315	2,081,000.000	2,079,272.770	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331	2,792,000.000	2,769,077.680	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170331	2,159,000.000	2,151,486.680	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20180415	2,083,000.000	2,068,106.550	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,861,858.720	
1% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,180,000.000	2,175,814.400	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	6,188,000.000	6,134,783.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	4,035,000.000	4,027,737.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430	2,607,000.000	2,583,771.630	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,583,424.720	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20170430	2,323,000.000	2,313,638.310	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,813,622.120	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	3,001,460.210	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20180615	2,196,000.000	2,197,273.680	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	3,001,930.310	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20170630	2,313,000.000	2,305,852.830	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,021,000.000	2,042,463.020	

	0.875% United States Treasury Note/Bond 20180715	2,189,000.000	2,174,880.950	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,135,000.000	
	0.625% United States Treasury Note/Bond 20170731	1,374,000.000	1,368,998.640	
	2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,184,948.670	
	2% United States Treasury Note/Bond 20250815	6,143,000.000	6,019,648.560	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,482,531.640	
	1% United States Treasury Note/Bond 20180815	14,000.000	13,941.480	
	1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,431,430.250	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,835,046.680	
	1% United States Treasury Note/Bond 20180915	2,179,000.000	2,168,693.330	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,436,650.400	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,839,129.680	
	0.875% United States Treasury Note/Bond 20181015	2,057,000.000	2,038,425.290	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 567,249,815.180 (69,669,622,300)	
イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20200722	イギリス・ポンド 2,380,000.000	イギリス・ポンド 2,465,680.000	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,124,000.000	1,142,883.200	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	554,000.000	559,096.800	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	412,000.000	423,536.000	

8.75% United Kingdom Gilt 20170825	595,000.000	680,858.500	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,213,000.000	1,646,890.100	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,389,241.100	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,340,848.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,662,000.000	2,132,013.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,843,000.000	2,374,889.800	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,036,157.500	
4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	1,990,013.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,523,911.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	2,299,579.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,535,441.600	
5% United Kingdom Gilt 20180307	1,604,000.000	1,763,758.400	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,666,000.000	2,318,405.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,800,000.000	2,397,600.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,773,000.000	2,510,745.300	
4.5% United Kingdom Gilt 20190307	1,820,000.000	2,036,398.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,178,000.000	1,546,478.400	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,391,000.000	1,611,890.800	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,468,961.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,574,655.600	

	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,144,000.000	1,644,385.600	
	3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	2,010,579.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,657,000.000	2,194,199.400	
	3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,843,000.000	2,091,436.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20170122	1,010,000.000	1,025,049.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,182,000.000	1,558,703.400	
	1% United Kingdom Gilt 20170907	2,392,000.000	2,409,222.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,279,441.400	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,012,000.000	2,305,953.200	
	1.25% United Kingdom Gilt 20180722	2,854,000.000	2,889,675.000	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	2,167,000.000	2,267,548.800	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,506,000.000	2,000,269.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20190722	1,781,000.000	1,828,196.500	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	2,012,000.000	2,180,203.200	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,106,000.000	1,327,974.200	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 73,782,771.100 (13,620,299,545)	
オーストラリア・ドル	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,737,000.000	1,819,889.640	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,506,000.000	2,755,397.120	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	2,050,000.000	2,403,625.000	

	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,459,000.000	2,693,514.830	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,882,000.000	2,249,686.340	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	2,063,000.000	2,211,267.810	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,918,000.000	2,285,201.100	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	1,385,000.000	1,434,693.800	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,662,000.000	1,944,340.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,173,000.000	2,170,653.160	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	964,000.000	975,577.640	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,968,000.000	2,033,711.520	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	958,000.000	1,111,998.500	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20181021	671,000.000	692,579.360	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,790,000.000	2,004,424.100	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	1,029,000.000	1,051,185.240	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	763,000.000	800,211.510	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	354,000.000	321,124.020	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	386,000.000	376,068.220	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	402,000.000	386,768.220	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 31,721,917.690 (2,795,335,387)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 285,000.000	カナダ・ドル 325,444.350	

8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	635,105.100	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,425,890.650	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,017,000.000	1,548,738.450	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,386,000.000	2,027,856.600	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,835,206.030	
4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	969,000.000	1,055,211.930	
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,199,000.000	2,427,696.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,413,000.000	1,873,666.260	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,649,474.280	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	1,068,655.040	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,461,000.000	1,601,022.240	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,491,000.000	1,881,642.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	1,327,000.000	1,342,048.180	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170901	780,000.000	791,863.800	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,625,000.000	1,642,046.250	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180301	1,265,000.000	1,282,204.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	1,021,000.000	1,036,948.020	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,105,000.000	1,196,814.450	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170201	1,463,000.000	1,478,683.360	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	881,294.010	

	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	827,000.000	857,342.630	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170801	341,000.000	344,546.400	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	406,000.000	446,932.920	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,047,000.000	1,109,767.650	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20161101	1,014,000.000	1,018,126.980	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	829,000.000	853,157.060	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180201	98,000.000	99,280.860	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170501	1,018,000.000	1,012,828.560	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	649,000.000	644,424.550	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	505,000.000	495,218.150	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20171101	36,000.000	35,740.800	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	363,000.000	357,849.030	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 36,282,726.590 (3,330,391,474)	
シンガポール・ ドル	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	391,000.000	418,370.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	738,108.000	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	442,000.000	483,106.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	462,966.000	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	599,000.000	617,269.500	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	768,000.000	805,632.000	

	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	580,000.000	590,208.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	279,000.000	283,927.140	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	307,000.000	309,916.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	370,000.000	363,606.400	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20180401	272,000.000	266,641.600	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	151,000.000	155,605.500	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	173,000.000	187,435.120	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	435,000.000	445,657.500	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	70,000.000	70,000.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	224,000.000	222,772.480	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	225,516.480	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20171001	190,000.000	190,773.300	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,837,511.520 (593,906,251)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	420,000.000	563,379.600	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	506,000.000	766,539.400	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	495,000.000	535,847.400	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	568,000.000	618,199.840	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	527,000.000	603,019.750	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	457,000.000	525,979.580	

	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	370,000.000	428,615.400	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 4,041,580.970 (481,635,204)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,775,000.000	7,196,747.250	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,550,705.000	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	10,220,000.000	11,758,007.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,475,000.000	5,879,165.500	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	7,555,000.000	9,093,802.400	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	6,290,000.000	6,775,273.500	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	4,760,000.000	5,532,786.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 51,786,487.450 (726,564,419)	
デンマーク・ク ローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	3,055,000.000	4,823,234.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	8,385,000.000	9,134,032.050	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,932,000.000	19,750,443.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	10,045,107.900	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	6,150,000.000	7,212,658.500	
	2.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20161115	2,921,000.000	3,009,739.980	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	5,846,000.000	6,358,460.360	

	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	1,682,000.000	1,853,395.800	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 62,187,071.590 (1,082,676,916)	
ノルウェー・ク ローネ	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	5,755,000.000	6,066,000.200	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	5,075,000.000	5,750,736.250	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,698,000.000	7,694,461.460	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,149,000.000	5,430,083.910	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,633,042.050	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,910,000.000	1,964,855.200	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 31,539,179.070 (445,017,817)	
ポーランド・ズ ロチ	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,802,433.300	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,029,000.000	2,167,966.210	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	1,912,000.000	2,175,473.600	
	Poland Government Bond 20170725	812,000.000	791,626.920	
	1.5% Poland Government Bond 20200425	782,000.000	766,594.600	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	627,000.000	817,357.200	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,256,000.000	2,595,189.600	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	2,284,000.000	2,732,235.000	

	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20170425	1,177,000.000	1,228,552.600	
	4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025	3,083,000.000	3,415,347.400	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20180425	1,720,000.000	1,805,948.400	
	2.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20180725	2,099,000.000	2,144,884.140	
	3.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20190725	1,840,000.000	1,932,533.600	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	1,891,000.000	1,993,851.490	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 27,369,994.060 (832,868,919)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	1,210,000.000	1,237,116.100	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	1,417,000.000	1,518,187.970	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,028,712.650	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	519,424.500	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	793,342.620	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,645,591.710	
	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,457,994.440	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	578,000.000	579,976.760	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,931,328.000	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,513,651.780	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	1,595,000.000	1,608,110.900	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	834,286.250	

	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	694,428.070	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	584,831.940	
	3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT 20171031	399,000.000	403,345.110	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	444,000.000	439,737.600	
	3.26% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180301	533,000.000	533,772.850	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	401,000.000	382,437.710	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	435,281.580	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	543,011.040	
	3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	658,223.840	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	233,000.000	239,419.150	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	488,000.000	485,047.600	
	3.394% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170315	340,000.000	343,369.400	
	4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	857,000.000	
	3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	648,000.000	648,000.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	404,000.000	395,940.200	
	3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	698,859.000	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,138,337.280	
	3.759% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190315	768,000.000	775,772.160	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 24,924,538.210 (715,334,247)	
メキシコ・ペソ	5% Mexican Bonos 20191211	メキシコ・ペソ 8,802,000.000	メキシコ・ペソ 8,756,053.560	

	5.75% Mexican Bonos 20260305	2,298,000.000	2,226,003.660	
	8% Mexican Bonos 20231207	8,233,000.000	9,306,418.540	
	10% Mexican Bonos 20241205	20,222,000.000	25,786,285.520	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	8,568,000.000	9,355,484.880	
	7.25% Mexican Bonos 20161215	12,639,000.000	13,120,166.730	
	7.75% Mexican Bonos 20171214	13,756,000.000	14,759,087.520	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	9,370,086.880	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	10,448,213.160	
	8.5% Mexican Bonos 20181213	12,376,000.000	13,669,910.800	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	11,592,376.020	
	8% Mexican Bonos 20200611	12,728,000.000	14,188,156.160	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	13,441,000.000	14,113,856.460	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	17,015,000.000	18,912,682.950	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	14,299,000.000	14,863,095.550	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	9,654,000.000	10,715,167.680	
	5% Mexican Bonos 20170615	9,290,000.000	9,454,897.500	
	4.75% Mexican Bonos 20180614	13,133,000.000	13,204,968.840	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	2,101,000.000	2,333,916.860	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 226,176,829.270 (1,671,446,768)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	232,000.000	237,199.120	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	248,000.000	234,895.680	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	283,779.270	
	0.25% Austria Government Bond 20191018	347,000.000	353,471.550	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	462,000.000	484,309.980	
	0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,163,000.000	1,168,163.720	
	1% Belgium Government Bond 20310622	349,000.000	330,865.960	
	1.9% Belgium Government Bond 20380622	358,000.000	371,167.240	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	774,000.000	1,151,750.700	

6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,780,278.830	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,159,287.560	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,113,000.000	1,664,669.580	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,652,695.350	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,304,000.000	2,162,344.960	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,721,000.000	2,806,968.210	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,179,109.260	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,285,094.850	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	1,996,737.750	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,255,585.400	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,966,023.100	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	2,211,000.000	2,479,614.390	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,458,630.580	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,026,851.560	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,824,965.840	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,378,240.500	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,247,000.000	2,584,005.060	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,005,559.100	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,616,456.920	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,654,790.690	

3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,465,000.000	1,744,111.800	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,610,114.350	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,707,000.000	1,924,915.620	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,484,440.420	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,376,000.000	1,793,175.680	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,812,740.160	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,556,879.700	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	2,006,803.820	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,707,000.000	1,952,500.740	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,291,000.000	1,453,924.200	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,204,000.000	1,573,254.760	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,705,000.000	1,885,798.200	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,142,000.000	2,274,439.860	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,379,000.000	1,394,968.820	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	1,549,000.000	1,629,919.760	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20161216	485,000.000	486,988.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20170310	492,000.000	494,464.920	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20170616	795,000.000	800,016.450	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20170915	307,000.000	309,287.150	
0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170224	1,717,000.000	1,741,415.740	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170407	1,848,000.000	1,870,582.560	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20171013	1,811,000.000	1,842,275.970	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180223	890,000.000	908,218.300	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180413	1,392,000.000	1,414,104.960	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20181012	1,209,000.000	1,257,613.890	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	1,674,000.000	1,748,107.980	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,145,366.040	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,176,644.280	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417	1,731,000.000	1,750,421.820	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	596,000.000	609,177.560	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	875,601.170	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	2,058,865.550	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,225,000.000	3,364,422.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	4,059,931.860	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	4,186,840.420	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,113,000.000	3,280,432.500	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,546,428.250	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,721,000.000	2,702,142.100	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,883,752.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,222,000.000	3,233,698.820	

3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	3,288,000.000	3,477,520.320	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,397,000.000	4,420,584.040	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	3,148,000.000	3,424,016.640	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,496,279.660	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	2,467,000.000	2,792,841.360	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,365,000.000	3,742,494.250	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	3,263,000.000	3,765,045.180	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,590,000.000	4,162,999.900	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,017,000.000	1,621,759.050	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,995,105.400	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,501,035.450	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,760,000.000	4,461,428.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,480,000.000	4,111,654.800	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,099,000.000	3,710,153.790	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	1,940,000.000	2,207,254.400	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180525	2,114,000.000	2,182,810.700	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	788,000.000	1,050,041.520	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	2,747,000.000	3,031,396.910	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	2,659,000.000	2,760,387.670	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	2,486,000.000	2,848,632.820	

1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	1,764,000.000	1,839,093.480	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161125	1,401,000.000	1,409,293.920	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,680,000.000	3,132,946.800	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,799,000.000	3,085,197.750	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	2,322,000.000	2,383,579.440	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,792,000.000	2,745,038.560	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525	1,870,000.000	1,877,554.800	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20180225	113,000.000	113,802.300	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	481,000.000	491,966.800	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	729,000.000	738,907.110	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	480,000.000	492,542.400	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170225	2,315,000.000	2,375,328.900	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170725	1,868,000.000	1,909,955.280	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	214,000.000	325,160.160	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,910,364.540	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,195,000.000	1,810,795.450	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	991,000.000	1,241,425.700	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,517,062.800	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,331,853.160	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,555,731.120	

3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,340,109.480	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,349,000.000	2,077,163.220	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,732,031.070	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	1,465,000.000	1,513,052.000	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,640,829.900	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	866,000.000	1,052,744.240	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	1,477,000.000	1,527,661.100	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,539,081.250	
1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	575,000.000	603,042.750	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170415	317,000.000	320,914.950	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	955,000.000	1,269,662.950	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,620,000.000	1,835,411.400	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115	1,374,000.000	1,399,789.980	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180415	749,000.000	754,917.100	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	943,000.000	911,890.430	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,769,721.660	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,750,791.900	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,722,000.000	4,131,968.780	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	2,002,129.940	
0.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180115	1,743,000.000	1,771,027.440	

1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201	1,445,000.000	1,489,722.750	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,129,000.000	1,299,580.610	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,229,000.000	1,271,326.760	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	945,000.000	962,983.350	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	577,000.000	558,911.050	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180515	128,000.000	128,691.200	
0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501	1,211,000.000	1,230,291.230	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	357,000.000	377,488.230	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	601,000.000	623,645.680	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20181015	371,000.000	373,593.290	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,654,000.000	3,765,070.560	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	3,118,000.000	4,792,366.000	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,455,000.000	2,228,696.250	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170801	2,528,000.000	2,751,146.560	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	2,074,000.000	2,345,113.280	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,256,867.640	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,908,000.000	2,737,140.480	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,390,000.000	3,057,670.400	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,206,107.120	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170201	2,280,000.000	2,388,756.000	

4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180201	2,480,000.000	2,722,246.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,674,000.000	2,456,293.680	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	1,953,000.000	2,488,571.190	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180801	2,187,000.000	2,446,531.290	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	3,092,373.520	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	2,531,000.000	2,912,750.730	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,802,516.420	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,893,000.000	2,776,463.100	
4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,989,696.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,000,000.000	2,339,640.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,678,662.800	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,501,190.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,806,907.360	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,530,653.360	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170501	2,315,000.000	2,472,072.750	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	2,159,236.700	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170601	1,490,000.000	1,596,684.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,494,421.800	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20171101	1,295,000.000	1,382,632.650	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,810,000.000	2,430,649.000	

4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,594,000.000	1,991,352.320	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180601	2,341,000.000	2,545,556.580	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,434,000.000	2,087,029.260	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,769,047.400	
2.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20161115	421,000.000	432,333.320	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,327,335.280	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,095,000.000	1,280,569.650	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20161215	318,000.000	323,208.840	
2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,187,934.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	1,901,000.000	2,294,830.170	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,066,000.000	1,284,913.760	
1.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170515	905,000.000	920,783.200	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,726,286.310	
1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	446,000.000	467,158.240	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,706,000.000	2,582,969.300	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	896,832.000	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,704,000.000	2,697,994.320	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,377,000.000	1,710,922.500	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	209,000.000	221,073.930	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	966,000.000	1,063,817.160	

4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,121,000.000	1,280,282.890	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,636,000.000	1,938,136.480	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	1,396,000.000	2,130,393.720	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	1,656,000.000	2,059,004.160	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,275,009.480	
4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	1,094,446.350	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	1,070,000.000	1,361,553.600	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320328	777,000.000	1,075,795.350	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190928	1,123,000.000	1,260,691.030	
2.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20230622	1,338,000.000	1,524,490.440	
1.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180622	1,052,000.000	1,094,669.120	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20450622	753,000.000	1,087,136.220	
2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20240622	1,505,000.000	1,761,452.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20340622	497,000.000	617,626.870	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	759,000.000	861,055.140	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	792,030.960	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	701,459.100	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,576,772.340	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	948,186.900	
5.5% IRISH TREASURY 20171018	169,000.000	187,184.400	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	624,602.160	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	847,000.000	1,024,895.410	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	851,406.800	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	372,000.000	383,160.000	
2% IRISH TREASURY 20450218	391,000.000	387,066.540	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,035,000.000	1,238,708.700	

6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	985,000.000	1,574,896.800	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,286,000.000	1,423,061.880	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,248,000.000	1,482,761.280	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,212,000.000	1,457,599.680	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	1,218,000.000	1,836,792.720	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	711,000.000	770,404.050	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	989,000.000	1,140,287.330	
4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	675,000.000	951,972.750	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	907,000.000	946,409.150	
3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	554,000.000	678,478.260	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20221122	872,000.000	1,064,633.520	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20620126	318,000.000	538,539.360	
1.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190618	738,000.000	796,516.020	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20440620	563,000.000	773,753.420	
1.75% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20231020	675,000.000	749,108.250	
2.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340523	301,000.000	355,631.500	
1.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20181019	307,000.000	320,127.320	
1.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20241021	932,000.000	1,023,569.000	
3.875% Finland Government Bond 20170915	474,000.000	510,232.560	
4.375% Finland Government Bond 20190704	447,000.000	521,362.920	

4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	877,705.300	
3.375% Finland Government Bond 20200415	527,000.000	608,421.500	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	546,228.360	
1.875% Finland Government Bond 20170415	163,000.000	168,087.230	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	474,218.230	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	672,465.600	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	485,497.760	
2.625% Finland Government Bond 20420704	387,000.000	496,234.620	
1.125% Finland Government Bond 20180915	425,000.000	442,123.250	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	596,706.710	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,108,000.000	3,101,837.680	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20171031	1,735,000.000	1,752,297.950	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,497,000.000	1,517,748.420	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	527,000.000	520,075.220	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180430	12,000.000	12,053.280	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,642,000.000	1,737,301.680	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	609,000.000	627,665.850	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,679,000.000	2,515,595.330	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,806,399.560	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,494,000.000	1,907,285.220	

3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	2,135,000.000	2,231,352.550	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	1,606,559.500	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	2,206,000.000	2,441,821.400	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	2,262,032.150	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,759,832.840	
4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	2,052,024.250	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,173,000.000	1,619,267.850	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,428,020.650	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,789,000.000	2,297,093.890	
4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	2,033,001.400	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	3,166,083.200	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,265,000.000	1,791,682.750	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	1,456,000.000	1,513,905.120	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,576,285.660	
4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180131	2,000,000.000	2,193,580.000	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,758,000.000	2,283,132.180	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,350,000.000	1,673,595.000	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,270,000.000	1,736,115.400	
3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1,564,000.000	1,730,597.280	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	964,000.000	1,433,304.120	

	2.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170430	1,488,000.000	1,532,907.840	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,994,593.680	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	2,219,000.000	2,650,662.070	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	1,849,000.000	2,055,366.890	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	1,900,000.000	1,981,320.000	
ユーロ 小計			ユーロ 494,094,035.240 (64,172,933,297)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20170915	5,462,000.000	5,543,056.080	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	4,178,000.000	4,207,956.260	
	7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	5,768,000.000	5,622,300.320	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	13,703,000.000	15,596,754.600	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	5,611,033.560	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	7,086,000.000	6,674,303.400	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,804,000.000	7,240,744.200	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	7,507,865.700	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,839,000.000	2,748,010.050	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	8,752,000.000	8,311,774.400	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	6,321,000.000	5,920,375.020	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	3,801,000.000	3,508,323.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	2,902,000.000	2,754,781.540	

	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	4,943,000.000	4,613,549.050	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	3,166,000.000	3,083,525.700	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 88,944,352.880 (759,584,774)	
国債証券 合計			160,897,617,318 [160,897,617,318]	
合計			160,897,617,318 [160,897,617,318]	

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における〔 〕内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 233銘柄	100%	43.2%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	100%	8.5%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	100%	1.7%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.5%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.7%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券 30銘柄	100%	0.4%
メキシコ・ペソ	国債証券 19銘柄	100%	1.0%
ユーロ	国債証券 280銘柄	100%	39.9%
南アフリカ・ランド	国債証券 15銘柄	100%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成27年12月30日

I	資産総額	15,383,585,866円
II	負債総額	21,921,806円
III	純資産総額（I－II）	15,361,664,060円
IV	発行済数量	6,101,714,871口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	2.5176円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成27年12月30日

I	資産総額	161,634,449,401円
II	負債総額	29,900,247円
III	純資産総額（I－II）	161,604,549,154円
IV	発行済数量	57,405,091,443口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	2.8152円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

- ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成27年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成27年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	31	154,128
追加型株式投資信託	603	11,974,562
株式投資信託 合計	634	12,128,690
単位型公社債投資信託	3	29,316
追加型公社債投資信託	17	3,006,014
公社債投資信託 合計	20	3,035,330
総合計	654	15,164,021

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第57期事業年度に係る中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	15,186	31,438
有価証券	15,003	4,878
前払費用	157	139
未収委託者報酬	8,265	10,295
未収収益	103	110
繰延税金資産	674	585
その他	15	153
流動資産計	39,406	47,600
固定資産		
有形固定資産	※1 252	※1 255
建物	23	21
器具備品	228	234
無形固定資産	2,991	2,759
ソフトウェア	2,910	2,758
ソフトウェア仮勘定	68	1
電話加入権	11	—

投資その他の資産	15,077	12,979
投資有価証券	8,338	6,667
関係会社株式	5,141	5,129
出資金	129	124
長期差入保証金	997	996
投資不動産	※1 398	※1 —
その他	74	60
貸倒引当金	△3	—
固定資産計	18,320	15,995
資産合計	57,727	63,596

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年 3 月31日)	当事業年度 (平成27年 3 月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	53	64
未払金	8,998	9,172
未払収益分配金	7	5
未払償還金	77	72
未払手数料	4,277	4,965
その他未払金	※2 4,635	※2 4,127
未払費用	3,463	4,162
未払法人税等	1,530	1,133
未払消費税等	530	1,429
賞与引当金	955	1,092
その他	1	747
流動負債計	15,534	17,801
固定負債		
退職給付引当金	1,959	2,072
役員退職慰労引当金	80	101
繰延税金負債	1,789	1,745
その他	3	2
固定負債計	3,832	3,920
負債合計	19,366	21,722
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	10,821	14,126
利益剰余金合計	11,196	14,501
株主資本合計	37,866	41,171
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	494	702
評価・換算差額等合計	494	702
純資産合計	38,360	41,873
負債・純資産合計	57,727	63,596

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,771	90,924
その他営業収益	788	933
営業収益計	85,560	91,858
営業費用		
支払手数料	47,520	49,978
広告宣伝費	668	670
調査費	8,246	9,013
調査費	741	867
委託調査費	7,505	8,146
委託計算費	735	756
営業雑経費	1,323	1,289
通信費	249	252
印刷費	477	481
協会費	54	53
諸会費	11	13
その他営業雑経費	531	488
営業費用計	58,494	61,709
一般管理費		
給料	5,708	5,881
役員報酬	243	289
給料・手当	3,785	3,803
賞与	724	695
賞与引当金繰入額	955	1,092

福利厚生費	793	831
交際費	37	45
旅費交通費	191	176
租税公課	222	259
不動産賃借料	1,182	1,180
退職給付費用	373	383
役員退職慰労引当金繰入額	33	38
固定資産減価償却費	963	1,032
諸経費	1,354	1,372
一般管理費計	10,862	11,201
営業利益	16,203	18,948

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	※1 144	※1 1,226
受取利息	9	20
その他	220	372
営業外収益計	374	1,620
営業外費用		
投資有価証券売却損	3	84
その他	71	67
営業外費用計	74	152
経常利益	16,503	20,416
特別利益		
固定資産売却益	—	7
特別利益計	—	7
特別損失		
外国税関連費用	—	746
その他	0	26
特別損失計	0	772
税引前当期純利益	16,502	19,651
法人税、住民税及び事業税	6,525	6,238
法人税等調整額	△150	△17
法人税等合計	6,375	6,220
当期純利益	10,126	13,431

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

〈単位：百万円〉

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	7,722	8,097	34,767
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027	△7,027	△7,027
当期純利益	-	-	-	10,126	10,126	10,126
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099	3,099	3,099
当期末残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	464	464	35,231
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△7,027
当期純利益	-	-	10,126
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	30	30	30
当期変動額合計	30	30	3,129
当期末残高	494	494	38,360

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	494	494	38,360
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,126
当期純利益	-	-	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	208	208	208
当期変動額合計	208	208	3,513
当期末残高	702	702	41,873

注記事項

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産及び投資不動産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	8～47年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

（1）貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

（2）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（3）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。

また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（4）役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（貸借対照表）

前事業年度において、「流動資産」に独立掲記しておりました「貯蔵品」、「前払金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動資産」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「流動資産」に表示していた「貯蔵品」14百万円、「前払金」0百万円、「その他」0百万円は、「その他」15百万円として組替えております。

前事業年度において、「有形固定資産」に独立掲記しておりました「リース資産」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「有形固定資産」の「器具備品」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「有形固定資産」に表示していた「リース資産」4百万円、「器具備品」224百万円は、「器具備品」228百万円として組替えております。

前事業年度において、「投資その他の資産」に独立掲記しておりました「従業員に対する長期貸付金」、「長期前払費用」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「投資その他の資産」に表示していた「従業員に対する長期貸付金」68百万円、「長期前払費用」6百万円は、「その他」74百万円として組替えております。

前事業年度において、「流動負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動負債」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「流動負債」に表示していた「リース債務」1百万円は、「その他」1百万円として組替えております。

前事業年度において、「固定負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「固定負債」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「固定負債」に表示していた「リース債務」3百万円は、「その他」3百万円として組替えております。

（損益計算書）

前事業年度において、「営業費用」に独立掲記しておりました「公告費」、「受益証券発行費」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業費用」の「その他営業雑経費」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業費用」に表示していた「公告費」0百万円、「受益証券発行費」0百万円、「その他営業雑経費」530百万円は、「その他営業雑経費」531百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「有価証券利息」、「投資有価証券売却益」、「有価証券償還益」、「時効成立分配金・償還金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「有価証券利息」13百万円、「投資有価証券売却益」64百万円、「有価証券償還益」63百万円、「時効成立分配金・償還金」44百万円、「その他」34百万円は、「その他」220百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」に独立掲記しておりました「有価証券償還損」、「時効成立後支払分配金・償還金」、「投資不動産管理費用」、「貯蔵品廃棄損」は、金額的重要性が乏し

いため、当事業年度より「営業外費用」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」に表示していた「有価証券償還損」18百万円、「時効成立後支払分配金・償還金」16百万円、「投資不動産管理費用」16百万円、「貯蔵品廃棄損」9百万円、「その他」9百万円は、「その他」71百万円として組替えております。

前事業年度において、「特別損失」に独立掲記しておりました「固定資産除却損」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「特別損失」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「特別損失」に表示していた「固定資産除却損」0百万円は、「その他」0百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※ 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	18百万円	20百万円
器具備品	251百万円	275百万円
投資建物	729百万円	—
投資器具備品	24百万円	—

※ 2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払金	4,508百万円	4,084百万円

3 保証債務

前事業年度（平成26年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成27年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,834百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

※ 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
受取配当金	—	1,065百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	—	—	2,608
合 計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成26年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- ① 剰余金の配当の総額 10,126百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 3,882円
- ④ 基準日 平成26年3月31日
- ⑤ 効力発生日 平成26年6月26日

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	—	—	2,608
合 計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成27年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- | | |
|-------------|------------|
| ① 剰余金の配当の総額 | 13,428百万円 |
| ② 配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③ 1株当たり配当額 | 5,148円 |
| ④ 基準日 | 平成27年3月31日 |
| ⑤ 効力発生日 | 平成27年6月24日 |

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「証券投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３）金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（i）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

（ii）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

②信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
（1）現金・預金	15,186	15,186	—
（2）未収委託者報酬	8,265	8,265	—
（3）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,283	22,283	—
資産計	45,735	45,735	—
（1）未払手数料	4,277	4,277	—
（2）その他未払金	4,635	4,635	—
（3）未払費用（*）	2,678	2,678	—
負債計	11,591	11,591	—

（*）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
（1）現金・預金	31,438	31,438	—
（2）未収委託者報酬	10,295	10,295	—
（3）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	10,520	10,520	—
資産計	52,254	52,254	—
（1）未払手数料	4,965	4,965	—
（2）その他未払金	4,127	4,127	—
（3）未払費用（*）	3,366	3,366	—
負債計	12,460	12,460	—

（*）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059	1,025
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,141	5,129
(3) 長期差入保証金	997	996

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年3月31日）

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,186	-	-	-
未収委託者報酬	8,265	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,498	3,978	97
合計	23,452	1,498	3,978	97

当事業年度（平成27年3月31日）

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成26年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,141百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成27年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	113	55	58
（２）その他 証券投資信託	5,625	4,873	751
小計	5,738	4,928	809
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	16,544	16,586	△41
小計	16,544	16,586	△41
合計	22,283	21,514	768

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,059百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	164	55	109
（２）その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	5,779	5,793	△14
小計	5,779	5,793	△14
合計	10,520	9,482	1,038

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,025百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
その他 証券投資信託	24,501	64	3
合計	24,501	64	3

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	32	-	1
(2) その他 証券投資信託	34,371	145	84
合計	34,404	145	85

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,935百万円	1,959百万円
勤務費用	201	212
退職給付の支払額	△217	△118
その他	39	18
退職給付債務の期末残高	1,959	2,072

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
--	--	--

積立型制度の退職給付債務	—	—
年金資産	—	—
	—	—
非積立型制度の退職給付債務	1,959百万円	2,072百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072
退職給付引当金	1,959	2,072
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用	201百万円	212百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	201	212

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度172百万円、当事業年度170百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
繰延税金資産		
減損損失	833	-
退職給付引当金	698	670
賞与引当金	287	305
外国税関連費用	-	241
未払事業税	335	231
連結法人間取引（譲渡損）	141	128
投資有価証券評価損	128	105
出資金評価損	116	103
その他	246	206
繰延税金資産小計	2,789	1,992
評価性引当額	△ 1,200	△ 613
繰延税金資産合計	1,588	1,379
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,428	2,203

その他有価証券評価差額金	273	335
その他	1	-
繰延税金負債合計	2,704	2,539
繰延税金負債の純額	1,115	1,159

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	-	35.64%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	1.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	△2.02%
評価性引当額の増減額	-	△2.67%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	△0.51%
その他	-	0.07%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	31.65%

(注) 前事業年度においては、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため記載を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が44百万円、繰延税金負債（長期）が180百万円、法人税等調整額が100百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が34百万円増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3.主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,719	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	---------------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,834	—	—
-----	---	-----------	-----	---------	--------------	------	----------	-------	---	---

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁 (MAS) に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994	未払手数料	3,216
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	—	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	678	未払費用	393
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	—	本社ビルの管理	不動産の賃借料	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	—	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	—	本社ビルの管理	不動産の賃借料	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,705.91円	1株当たり純資産額	16,052.69円
1株当たり当期純利益	3,882.07円	1株当たり当期純利益	5,148.94円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益（百万円）	10,126	13,431
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

当中間会計期間 (平成27年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	22,998

有価証券		4,461
未収委託者報酬		10,719
繰延税金資産		504
その他		334
流動資産合計		39,018
固定資産		
有形固定資産	※ 1	247
無形固定資産		
ソフトウェア		2,432
その他		135
無形固定資産合計		2,568
投資その他の資産		
投資有価証券		5,468
関係会社株式		5,129
その他		1,231
投資その他の資産合計		11,830
固定資産合計		14,646
資産合計		53,664

(単位:百万円)

当中間会計期間
(平成27年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		7,124
未払費用		4,744
未払法人税等		1,085
賞与引当金		903
その他	※ 3	643
流動負債合計		14,500

固定負債

退職給付引当金		2,142
役員退職慰労引当金		111
繰延税金負債		1,497
その他		2
固定負債合計		3,754

負債合計	18,255
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	8,096
利益剰余金合計	8,471
株主資本合計	35,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	35,409
負債・純資産合計	53,664

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間	
(自 平成27年4月1日	
至 平成27年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	46,714
その他営業収益	435
営業収益合計	47,150
営業費用	
支払手数料	24,499
その他営業費用	6,487
営業費用合計	30,987
一般管理費	※ 1 5,812
営業利益	10,350
営業外収益	※ 2 378
営業外費用	※ 3 29
経常利益	10,699
税引前中間純利益	10,699
法人税、住民税及び事業税	3,260
法人税等調整額	39
中間純利益	7,398

(3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,428	△ 13,428	△ 13,428
中間純利益	-	-	-	7,398	7,398	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 6,029	△ 6,029	△ 6,029
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,096	8,471	35,141

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,428
中間純利益	-	-	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 434	△ 434	△ 434
当中間期変動額合計	△ 434	△ 434	△ 6,464
当中間期末残高	267	267	35,409

注記事項

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。

3. 引当金の計上基準

（1）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

（3）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

（2）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（中間貸借対照表関係）

※ 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成27年9月30日現在)
有形固定資産	239百万円

2 保証債務

当中間会計期間（平成27年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,765百万円に対して保証を行っております。

※ 3 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

※ 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日)
有形固定資産	15百万円
無形固定資産	532百万円

※ 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日)
外国税関連費用引当金戻入益	171百万円
投資有価証券売却益	99百万円
受取配当金	69百万円

※ 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日)
為替差損	13百万円
貯蔵品廃棄損	5百万円
投資有価証券売却損	2百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成27年 9 月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	—	—	2,608
合計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27 年 3月 31日	平成27年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間（平成27年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,998	22,998	—
(2) 未収委託者報酬	10,719	10,719	—
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,908	8,908	—
資産合計	42,626	42,626	—
(1) 未払金	7,124	7,124	—
(2) 未払費用 (*)	3,702	3,702	—
負債合計	10,827	10,827	—

(*) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負 債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,052

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成27年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	161	55	106
（２）その他 証券投資信託	3,455	3,002	453
小計	3,617	3,058	559
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	5,290	5,453	△163
小計	5,290	5,453	△163
合計	8,908	8,511	396

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,021百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（1 株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）
--

1株当たり純資産額	13,574.37円
1株当たり中間純利益金額	2,836.44円

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

(注) 2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
中間純利益(百万円)	7,398
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,398
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。
- ④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

- ① 平成27年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。
 - ・ 代表取締役の人数の変更（4名以内に変更）
- ② 平成27年6月26日付で、定款について次の変更をいたしました。
 - ・ 取締役（業務執行取締役等であるものを除く。）の責任を法令の定める限度に制限する契約を締結できる旨の規定の新設

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ① 名称 三井住友信託銀行株式会社
- ② 資本金の額 342,037百万円（平成27年3月末日現在）
- ③ 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

① 名 称	② 資本金の額 単位：百万円 (平成27年 3月末日現在)	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937	
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000	
株式会社青森銀行	19,562	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社愛媛銀行	19,107	
株式会社十六銀行	36,839	
信金中央金庫	490,998	(注1)
スルガ銀行株式会社	30,043	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社中国銀行	15,149	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994	(注2)
株式会社東京都民銀行	48,120	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社福岡銀行	82,329	
株式会社北洋銀行	121,101	
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注3)
株式会社山口銀行	10,005	(注4)
株式会社りそな銀行	279,928	(注3)
労働金庫連合会	120,000	(注5)

(注1) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注2) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注4) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

（注5）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成27年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ① 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
- ② 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- ③ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
- ④ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
 - ・ 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - ・ 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- ⑤ 使用開始日を記載することがあります。
- ⑥ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - ・ 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - ・ 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- ⑦ 次の事項を記載することがあります。
 - ・ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- ⑧ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ⑨ ファンドの形態等を記載することがあります。
- ⑩ 図案を採用することがあります。
- ⑪ ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成27年5月28日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年1月8日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ投信倶楽部外国債券インデックスの平成26年12月2日から平成27年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックスの平成27年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。