

野村ファンドラップ外国債券 Bコース

運用報告書(全体版)

第92期 (決算日2014年8月20日) 第93期 (決算日2014年9月22日) 第94期 (決算日2014年10月20日)
第95期 (決算日2014年11月20日) 第96期 (決算日2014年12月22日) 第97期 (決算日2015年1月20日)

作成対象期間 (2014年7月23日～2015年1月20日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券
信託期間	2006年10月4日以降、無期限とします。
運用方針	主として、世界の債券（主として、投資適格格付が付与されているもしくは同等の信用度を有すると判断される国債、政府機関債、地方債、国際機関債、社債など。）に実質的に投資する投資信託証券に投資し、高水準のインカムゲインの獲得と中長期的な信託財産の成長を目的として運用を行います。 投資する投資信託証券については、実質的な外貨建て資産については為替ヘッジを行わないことを基本とするもの、もしくはこれらに類するものに限定することを基本とします。組入投資信託証券については適宜見直しを行います。 運用にあたっては、野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社 ¹ に投資信託証券の運用の指図に関する権限を委託します。
主な投資対象	主として有価証券に投資する投資信託証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への直接投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として配当等収益等を中心に安定分配を行うことを基本とします。 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	額			ベンチマーク パークレイズ・グローバル総合 (日本円除く)インデックス (円換算ベース)	投資信託 組入比率	純資産額	
		税分	込配	み金				期騰落
	円		円	円	騰落	%	百万円	
68期(2012年8月20日)	6,783		15		91.84	0.7	99.2	10,632
69期(2012年9月20日)	6,909		15		93.60	2.1	99.1	10,736
70期(2012年10月22日)	7,010		15		95.08	1.7	99.1	10,850
71期(2012年11月20日)	7,154		15		97.31	2.3	99.0	10,879
72期(2012年12月20日)	7,518		16		102.28	5.3	99.1	11,368
73期(2013年1月21日)	8,023		16		109.37	6.9	99.1	12,121
74期(2013年2月20日)	8,276		17		113.18	3.4	99.2	12,514
75期(2013年3月21日)	8,340		18		114.65	1.0	99.3	12,650
76期(2013年4月22日)	8,702		18		119.81	4.6	99.2	13,308
77期(2013年5月20日)	8,992		18		123.97	3.5	99.0	13,967
78期(2013年6月20日)	8,359		18	△6.8	115.54	△6.8	98.4	13,253
79期(2013年7月22日)	8,617		18		119.85	3.3	99.4	13,849
80期(2013年8月20日)	8,325		18	△3.2	115.94	△3.3	99.0	13,707
81期(2013年9月20日)	8,450		17		118.12	1.7	99.0	14,429
82期(2013年10月21日)	8,559		17		119.72	1.5	99.0	14,900
83期(2013年11月20日)	8,701		18		121.88	1.9	98.9	16,237
84期(2013年12月20日)	9,055		18		127.03	4.3	98.7	19,144
85期(2014年1月20日)	9,103		20		127.81	0.8	99.0	20,308
86期(2014年2月20日)	9,024		19	△0.7	127.06	△0.6	98.8	24,110
87期(2014年3月20日)	9,012		18		127.10	0.1	98.9	26,504
88期(2014年4月21日)	9,134		17		128.97	1.5	99.0	28,314
89期(2014年5月20日)	9,114		17	△0.0	128.99		98.9	30,837
90期(2014年6月20日)	9,130		17		129.42	0.4	98.9	35,833
91期(2014年7月22日)	9,121		16		129.42	0.1	98.8	43,472
92期(2014年8月20日)	9,227		16		131.26	1.3	98.8	55,924
93期(2014年9月22日)	9,581		16		136.79	4.0	98.9	69,354
94期(2014年10月20日)	9,440		15	△1.3	135.00	△1.3	98.9	82,879
95期(2014年11月20日)	10,195		15		146.80	8.2	98.9	108,543
96期(2014年12月22日)	10,293		21		149.05	1.2	98.9	132,702
97期(2015年1月20日)	10,098		21	△1.7	146.45	△1.7	98.8	149,414

*基準価額の騰落率は分配金込み。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク パークレイズ・グローバル総合 (日本円除く)インデックス (円換算ベース)		投資信託 組入比率
		円	騰落率 %	円	騰落率 %	
第92期	(期首) 2014年7月22日	9,121	—	129.42	—	98.8
	7月末	9,185	0.7	130.36	0.7	98.6
	(期末) 2014年8月20日	9,243	1.3	131.26	1.4	98.8
第93期	(期首) 2014年8月20日	9,227	—	131.26	—	98.8
	8月末	9,331	1.1	132.86	1.2	98.8
	(期末) 2014年9月22日	9,597	4.0	136.79	4.2	98.9
第94期	(期首) 2014年9月22日	9,581	—	136.79	—	98.9
	9月末	9,594	0.1	136.96	0.1	98.7
	(期末) 2014年10月20日	9,455	△1.3	135.00	△1.3	98.9
第95期	(期首) 2014年10月20日	9,440	—	135.00	—	98.9
	10月末	9,576	1.4	137.11	1.6	98.7
	(期末) 2014年11月20日	10,210	8.2	146.80	8.7	98.9
第96期	(期首) 2014年11月20日	10,195	—	146.80	—	98.9
	11月末	10,290	0.9	148.27	1.0	98.8
	(期末) 2014年12月22日	10,314	1.2	149.05	1.5	98.9
第97期	(期首) 2014年12月22日	10,293	—	149.05	—	98.9
	12月末	10,383	0.9	150.48	1.0	97.8
	(期末) 2015年1月20日	10,119	△1.7	146.45	△1.7	98.8

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

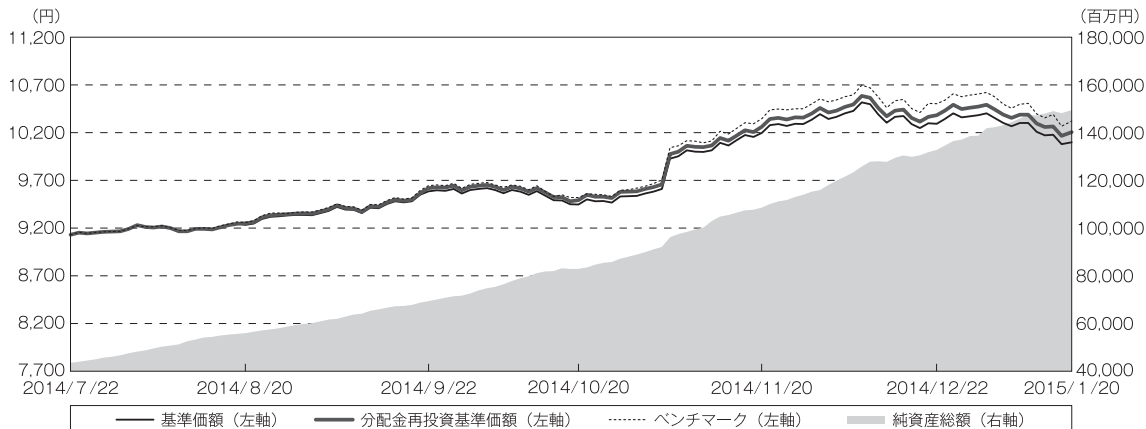
* ベンチマーク (=「パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース)」)は、パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスを当社が独自に円換算したものです。
算出にあたっては、当社がファンドにおける組入資産・為替の評価時点に合わせて計算を行っているため、パークレイズが公表する数値とは異なります。なお、設定時を100としています。

* パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスは、パークレイズ・バンク・ピーエルシーおよび関連会社(パークレイズ)が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、日本円を除く世界の投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズに帰属します。

(出所) Barclays、ブルームバーグ

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第92期首：9,121円

第97期末：10,098円（既払分配金（税込み）：104円）

騰落率：11.9%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2014年7月22日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) ベンチマークは、パークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）です。ベンチマークは、作成期首（2014年7月22日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は当作成期首の9,121円から当作成期末には10,098円となりました。

（上昇要因）

ECB（欧州中央銀行）のドラギ総裁が追加金融緩和の導入を示唆したことなどから、欧州債券が値上がりしたこと

日本銀行が追加金融緩和を発表したことなどから、米ドルが円に対して値上がりしたこと（円安／米ドル高）

○指定投資信託証券の騰落率（分配金込み）

指定投資信託証券名	第92期～第97期
ノムラ海外債券ファンドFD	15.0%
ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD	13.3%
ノムラインサイト欧州債券ファンドFD	6.1%
ノムラーAMP豪州債券ファンドFD	6.4%
LM・米国債券コア・プラスFD	19.0%
アイエヌジー・欧州債券ファンドFD	7.6%
メロン米国コア・プラス債券ファンドFD	18.2%
ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン) - 海外債券ファンドFD	8.4%

※騰落率は、当ファンドにおける指定投資信託証券の評価時点に合わせて計算（分配金を再投資して算出）を行っております。

※当作成期間中に、追加/除外となった指定投資信託証券（投資対象ファンド）については、掲載いたしておりません。

※当ファンドで投資をしていない期間がある場合についても騰落率の計算に含んでおります。

○投資環境

＜債券市場＞

ECBのドラギ総裁が量的緩和導入の可能性を示唆したことや、IMF（国際通貨基金）が2014・2015年の世界経済見通しを下方修正したこと、原油価格の下落を背景に投資家のリスク回避姿勢が高まったことなどから、当作成期間では米国債券、欧州債券、豪州債券とも値上がりとなりました。

（注）上記の環境の説明は、金利収入を含めた各債券市場全体の収益に基づくものです。

＜為替市場＞ 為替レートは対顧客電信売買相場仲値を用いて算出しています。また対象期間は、原則として投資対象ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。

FRB（米連邦準備制度理事会）によるQE3（量的金融緩和第3弾）が終了したことや、日本銀行が追加金融緩和を発表したことなどから、当作成期間では米ドル、豪ドルは円に対して値上がり（円安）となりました。一方、ユーロはECBのドラギ総裁が追加金融緩和に意欲的な姿勢を示したことなどから、円に対して値下がり（円高）となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・投資信託証券組入比率

投資方針に基づいて、当作成期を通じて高位の組入れを維持しました。

・指定投資信託証券の見直し

当作成期間において以下の指定投資信託証券（投資対象ファンド）の見直しを行いました。

【除外ファンド】

「野村豪州債券カレンシー・アルファ・ファンドFD」

・債券種別配分

各債券種別への実質的な投資比率については、ベンチマークにおける債券種別の配分を意識して、定期的に債券種別間で投資信託証券の配分を調整しました。

・各投資対象ファンドの投資比率の推移

ポートフォリオ全体の地域別配分や割安度の分布などのリスク特性がベンチマークからかい離しないようにするため、[ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ（ケイマン）－海外債券ファンドFD] などの投資比率を引き上げた一方、[ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD] などの投資比率を引き下げました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当作成期間に、基準価額の騰落率*は+11.9%となり、ベンチマークの+13.2%を1.3ポイント下回りました。

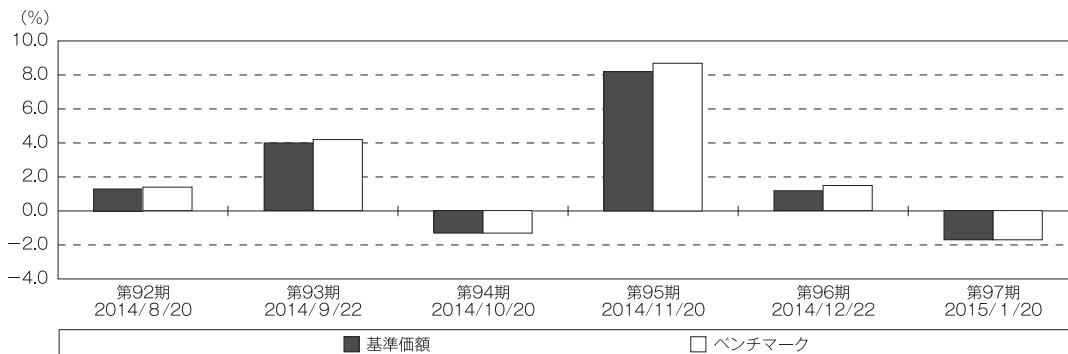
* 基準価額の騰落率は分配金（税込み）を再投資したものととして算出しております。

【主な差異要因】

（マイナス要因）

[ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ（ケイマン）－海外債券ファンドFD] の騰落率が、外国債券市場の平均を下回ったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注）ベンチマークは、バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）です。

◎分配金

収益分配金については、経費控除後の配当等収益等を中心に基準価額水準を勘案して決定しました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期	第97期
	2014年7月23日～ 2014年8月20日	2014年8月21日～ 2014年9月22日	2014年9月23日～ 2014年10月20日	2014年10月21日～ 2014年11月20日	2014年11月21日～ 2014年12月22日	2014年12月23日～ 2015年1月20日
当期分配金 (対基準価額比率)	16 0.173%	16 0.167%	15 0.159%	15 0.147%	21 0.204%	21 0.208%
当期の収益	16	16	14	15	21	14
当期の収益以外	—	—	0	—	—	6
翌期繰越分配対象額	1,588	1,919	1,919	2,497	2,566	2,560

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

引き続き、以下のように、定性的に高く評価したファンドを中心にリスク分散を考慮して投資することで、多くの運用者の資産運用力を効率よく活用し、高水準のインカムゲインの獲得とともに、トータルでの運用成果を追求してまいります。

- (1) 各投資対象ファンドについて、ファンドの運用目標を中長期的に安定して達成する可能性を定性的に評価します。
- (2) 各投資対象ファンドのリスク特性(値動きに影響を与える特徴的な要因)を定量的に分析します。
- (3) 定性的に高く評価したファンドを中心に組み入れ、かつポートフォリオ全体としてのリスク特性がベンチマークと大きくかけ離れないよう、組入ファンドの投資比率の調整を行います。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2014年7月23日～2015年1月20日)

項 目	第92期～第97期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 14	% 0.145	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(11)	(0.119)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(2)	(0.016)	購入後の情報提供、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および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.011)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	14	0.146	
作成期間の平均基準価額は、9,726円です。			

*作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年7月23日～2015年1月20日)

投資信託証券

銘 柄		第92期～第97期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	アイエヌジー・欧州債券ファンドFD	244,439	2,089,537	110,439	909,537
	LM・米国債券コア・プラスFD	1,448,640	12,464,446	—	—
	ノムラーAMP豪州債券ファンドFD	113,846	1,268,538	—	—
	メロン米国コア・プラス債券ファンドFD	1,384,117	15,439,651	1,057	11,203
	ノムラーインサイト欧州債券ファンドFD	2,042,288	23,547,991	—	—
	野村豪州債券カレンシー・アルファ・ファンドFD	1,023	18,555	10,452	191,758
	ノムラ海外債券ファンドFD	1,753,614	21,895,886	75,254	861,402
	ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD	359,846	4,380,284	146,703	1,699,602
	ケリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン) - 海外債券ファンドFD	1,396,901	19,874,262	77	1,027
合 計	8,744,714	100,979,155	343,982	3,674,531	

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

○利害関係人との取引状況等

(2014年7月23日～2015年1月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	第92期～第97期					
	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$		
	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	%
投資信託証券	100,979	81,104	80.3	3,674	3,673	100.0

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2015年1月20日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	第91期末		第97期末		
	口	数	口	数	評 価 額
	口	口	口	千円	%
アイエヌジー・欧州債券ファンドFD	236,756	370,756	3,144,752	2.1	
LM・米国債券コア・プラスFD	340,211	1,788,851	16,412,707	11.0	
ノムラーAMP豪州債券ファンドFD	29,543	143,389	1,622,446	1.1	
メロン米国コア・プラス債券ファンドFD	1,040,678	2,423,738	29,254,517	19.6	
ノムラーインサイト欧州債券ファンドFD	887,016	2,929,304	33,897,905	22.7	
野村豪州債券カレンシー・アルファ・ファンドFD	9,429	—	—	—	
ノムラ海外債券ファンドFD	609,042	2,287,402	28,878,450	19.3	
ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD	530,789	743,932	9,326,675	6.2	
ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン) - 海外債券ファンドFD	350,417	1,747,241	25,095,622	16.8	
合 計	4,033,881	12,434,613	147,633,078	98.8	

*比率は、純資産総額に対する投資信託受益証券評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

*-印は組み入れなし。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

○投資信託財産の構成

(2015年1月20日現在)

項 目	第97期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	147,633,078	97.5
コール・ローン等、その他	3,822,582	2.5
投資信託財産総額	151,455,660	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第92期末	第93期末	第94期末	第95期末	第96期末	第97期末
	2014年8月20日現在	2014年9月22日現在	2014年10月20日現在	2014年11月20日現在	2014年12月22日現在	2015年1月20日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	56,566,652,361	70,277,537,943	83,448,725,138	109,548,042,619	134,680,916,417	151,455,660,004
コール・ローン等	1,293,520,776	1,715,391,100	1,452,964,982	2,239,360,652	3,483,249,760	3,822,573,912
投資信託受益証券(評価額)	55,273,129,106	68,562,143,695	81,995,757,433	107,308,677,988	131,197,660,249	147,633,078,617
未収利息	2,479	3,148	2,723	3,979	6,408	7,475
(B) 負債	642,579,968	923,063,687	569,638,209	1,005,031,406	1,978,803,397	2,040,968,653
未払金	524,777,195	777,789,052	398,749,846	783,180,749	1,585,997,406	1,677,251,230
未払収益分配金	96,975,142	115,814,978	131,697,460	159,696,085	270,747,965	310,716,906
未払解約金	9,237,950	12,854,273	21,928,340	38,514,287	90,965,042	19,916,148
未払信託報酬	11,504,473	16,483,297	17,135,641	23,466,470	30,864,370	32,841,108
その他未払費用	85,208	122,087	126,922	173,815	228,614	243,261
(C) 純資産総額(A-B)	55,924,072,393	69,354,474,256	82,879,086,929	108,543,011,213	132,702,113,020	149,414,691,351
元本	60,609,463,886	72,384,361,812	87,798,306,792	106,464,057,289	128,927,602,796	147,960,431,822
次期繰越損益金	△ 4,685,391,493	△ 3,029,887,556	△ 4,919,219,863	2,078,953,924	3,774,510,224	1,454,259,529
(D) 受益権総口数	60,609,463,886口	72,384,361,812口	87,798,306,792口	106,464,057,289口	128,927,602,796口	147,960,431,822口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,227円	9,581円	9,440円	10,195円	10,293円	10,098円

(注) 第92期首元本額47,662百万円、第92～第97期中追加設定元本額104,011百万円、第92～第97期中一部解約元本額3,712百万円、第97期末計算口数当たり純資産額10,098円。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額76,685,222円。(野村ファンドラップ外国債券A・Bコースの合計額)

○損益の状況

項 目	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期	第97期
	2014年7月23日～ 2014年8月20日	2014年8月21日～ 2014年9月22日	2014年9月23日～ 2014年10月20日	2014年10月21日～ 2014年11月20日	2014年11月21日～ 2014年12月22日	2014年12月23日～ 2015年1月20日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	92,958,664	108,508,984	140,772,804	167,977,365	189,133,299	247,649,471
受取配当金	92,860,705	108,399,068	140,657,504	167,812,129	188,924,296	247,408,109
受取利息	97,959	109,916	115,300	165,236	209,003	241,362
(B) 有価証券売買損益	582,200,361	2,416,005,791	△ 1,222,616,184	7,372,396,911	978,459,821	△ 2,804,148,602
売買益	584,960,487	2,420,166,267	940,665	7,422,136,271	1,373,994,763	5,490,858
売買損	△ 2,760,126	△ 4,160,476	△ 1,223,556,849	△ 49,739,360	△ 395,534,942	△ 2,809,639,460
(C) 信託報酬等	△ 11,589,681	△ 16,605,384	△ 17,262,563	△ 23,640,285	△ 31,092,984	△ 33,084,369
(D) 当期損益金(A+B+C)	663,569,344	2,507,909,391	△ 1,099,105,943	7,516,733,991	1,136,500,136	△ 2,589,583,500
(E) 前期繰越損益金	1,526,391,869	2,084,896,149	4,457,376,997	3,192,112,561	10,465,787,000	11,284,905,119
(F) 追加信託差損益金	△ 6,778,377,564	△ 7,506,878,118	△ 8,145,793,457	△ 8,470,196,543	△ 7,557,028,947	△ 6,930,345,184
(配当等相当額)	(7,533,662,609)	(9,417,407,705)	(12,403,048,226)	(16,044,363,002)	(21,752,608,854)	(26,693,625,874)
(売買損益相当額)	(△14,312,040,173)	(△16,924,285,823)	(△20,548,841,683)	(△24,514,559,545)	(△29,309,637,801)	(△33,623,971,058)
(G) 計(D+E+F)	△ 4,588,416,351	△ 2,914,072,578	△ 4,787,522,403	2,238,650,009	4,045,258,189	1,764,976,435
(H) 収益分配金	△ 96,975,142	△ 115,814,978	△ 131,697,460	△ 159,696,085	△ 270,747,965	△ 310,716,906
次期繰越損益金(G+H)	△ 4,685,391,493	△ 3,029,887,556	△ 4,919,219,863	2,078,953,924	3,774,510,224	1,454,259,529
追加信託差損益金	△ 6,778,377,564	△ 7,506,878,118	△ 8,145,793,457	△ 8,470,196,543	△ 7,557,028,947	△ 6,930,345,184
(配当等相当額)	(7,533,662,609)	(9,417,407,705)	(12,403,048,226)	(16,044,363,002)	(21,752,608,854)	(26,693,625,874)
(売買損益相当額)	(△14,312,040,173)	(△16,924,285,823)	(△20,548,841,683)	(△24,514,559,545)	(△29,309,637,801)	(△33,623,971,058)
分配準備積立金	2,092,986,071	4,476,990,562	4,449,189,778	10,549,150,467	11,331,539,171	11,188,753,315
繰越損益金	-	-	△ 1,222,616,184	-	-	△ 2,804,148,602

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2014年7月23日～2015年1月20日)は以下の通りです。

項 目	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期	第97期
	2014年7月23日～ 2014年8月20日	2014年8月21日～ 2014年9月22日	2014年9月23日～ 2014年10月20日	2014年10月21日～ 2014年11月20日	2014年11月21日～ 2014年12月22日	2014年12月23日～ 2015年1月20日
a. 配当等収益(経費控除後)	91,362,765円	107,794,952円	123,510,241円	167,450,187円	184,096,236円	214,565,102円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後)	509,710,722円	2,400,114,439円	0円	6,139,909,703円	952,403,900円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	7,533,662,609円	9,417,407,705円	12,403,048,226円	16,044,363,002円	21,752,608,854円	26,693,625,874円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,588,887,726円	2,084,896,149円	4,457,376,997円	4,401,486,662円	10,465,787,000円	11,284,905,119円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	9,723,623,822円	14,010,213,245円	16,983,935,464円	26,753,209,554円	33,354,895,990円	38,193,096,095円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,604円	1,935円	1,934円	2,512円	2,587円	2,581円
g. 分配金	96,975,142円	115,814,978円	131,697,460円	159,696,085円	270,747,965円	310,716,906円
h. 分配金(1万口当たり)	16円	16円	15円	15円	21円	21円

○分配金のお知らせ

	第92期	第93期	第94期	第95期	第96期	第97期
1 万口当たり分配金 (税込み)	16円	16円	15円	15円	21円	21円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

運用報告書（全体版）について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2014年12月1日>

《指定投資信託証券の運用内容》

野村ファンドラップ外国債券 Bコースに組み入れている各投資信託証券については、次頁以降にそれぞれ直前の作成期における運用内容を掲載しております。

指定投資信託証券	ページ
アイエヌジー・欧州債券ファンドFD	P 13
LM・米国債券コア・プラスFD	P 23
ノムラーAMP豪州債券ファンドFD	P 41
メロン米国コア・プラス債券ファンドFD	P 53
ノムラーインサイト欧州債券ファンドFD	P 64
ノムラ海外債券ファンドFD	P 80
ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD	P 95
ウエルトン・マネジメント・ポートフォリオ(ケイマン) - 海外債券ファンドFD	P 107

* 当作成期末において組み入れているファンドについて運用内容の掲載をしております。

* 外国籍投資信託については、当ファンドの運用報告書作成時点において入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

アイエヌジー・欧州債券ファンドFD (適格機関投資家専用) 第102期～第107期(2014年4月8日～2014年10月7日)

◎当ファンドの仕組み

商品分類	追加型株式投資信託/海外/債券 適格機関投資家私専	
信託期間	無期限	
運用方針	アイエヌジー・欧州債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、インカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。	
主な投資対象	アイエヌジー・欧州債券ファンドFD	アイエヌジー・欧州債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	欧州諸国の現地通貨建債券を主要投資対象とします。
主な投資制限	アイエヌジー・欧州債券ファンドFD	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	決算は毎月原則7日(当該日が休業日の場合は翌営業日)に行い、毎期分配します。分配金額は、分配原資の範囲で委託者が決定するものとし、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。	

◎最近30期の運用実績

決算期	基準価額			パークレイズ・汎欧州総合インデックス (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率			
78期(2012年5月7日)	6,303	40	△ 1.6	9,704	△ 1.5	92.3	9.6	7,771
79期(2012年6月7日)	6,049	40	△ 3.4	9,255	△ 4.6	92.6	20.8	7,682
80期(2012年7月9日)	5,912	40	△ 1.6	9,218	△ 0.4	89.0	3.4	8,458
81期(2012年8月7日)	5,883	40	0.2	9,270	0.6	91.7	18.0	9,004
82期(2012年9月7日)	6,028	40	3.1	9,564	3.2	90.5	△ 3.8	10,325
83期(2012年10月9日)	6,135	40	2.4	9,768	2.1	89.9	△ 3.9	12,256
84期(2012年11月7日)	6,228	40	2.2	9,988	2.3	91.5	△ 6.3	12,560
85期(2012年12月7日)	6,509	40	5.2	10,480	4.9	95.8	△ 3.7	13,007
86期(2013年1月7日)	6,933	40	7.1	11,199	6.9	95.5	12.9	13,654
87期(2013年2月7日)	7,465	40	8.3	12,177	8.7	91.1	△ 4.2	14,323
88期(2013年3月7日)	7,233	40	△ 2.6	11,812	△ 3.0	90.7	13.5	13,771
89期(2013年4月8日)	7,683	40	6.8	12,531	6.1	95.9	△ 0.0	14,632
90期(2013年5月7日)	7,821	40	2.3	12,984	3.6	94.5	7.4	14,719
91期(2013年6月7日)	7,598	40	△ 2.3	12,740	△ 1.9	94.2	7.2	13,605
92期(2013年7月8日)	7,530	40	△ 0.4	12,546	△ 1.5	93.3	8.3	13,308
93期(2013年8月7日)	7,490	40	0.0	12,649	0.8	93.1	5.1	12,855
94期(2013年9月9日)	7,498	40	0.6	12,604	△ 0.4	93.7	△ 0.4	12,503
95期(2013年10月7日)	7,557	40	1.3	12,932	2.6	95.0	△ 1.2	12,427
96期(2013年11月7日)	7,683	40	2.2	13,190	2.0	94.1	△ 17.6	12,456
97期(2013年12月9日)	8,074	40	5.6	13,881	5.2	92.8	△ 0.9	12,673
98期(2014年1月7日)	8,135	40	1.3	14,135	1.8	93.2	△ 1.2	12,368
99期(2014年2月7日)	7,977	40	△ 1.5	13,914	△ 1.6	92.7	1.8	12,140
100期(2014年3月7日)	8,253	40	4.0	14,434	3.7	87.3	△ 30.2	12,453
101期(2014年4月7日)	8,217	40	0.0	14,482	0.3	86.7	△ 33.8	12,235
102期(2014年5月7日)	8,259	40	1.0	14,565	0.6	91.7	△ 42.8	12,064
103期(2014年6月9日)	8,231	40	0.1	14,581	0.1	91.8	△ 3.0	11,913
104期(2014年7月7日)	8,179	40	△ 0.1	14,558	△ 0.2	92.7	△ 8.9	12,041
105期(2014年8月7日)	8,098	40	△ 0.5	14,495	△ 0.4	92.9	△ 14.4	11,835
106期(2014年9月8日)	8,189	40	1.6	14,640	1.0	88.3	△ 4.1	10,611
107期(2014年10月7日)	8,282	40	1.6	14,855	1.5	91.9	1.1	9,175

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) 当ファンドは複投資信託を組み合わせますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率。
(注4) パークレイズ・汎欧州総合インデックス(円換算ベース)は設定日を10,000として指数化したものを記載しています。

◎当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		パークレイズ・汎欧州総合インデックス (円 換 算 ベ ー ス)		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
第102期	(期首) 2014年4月7日	8,235	—	—	—	—	—	—	—
	4月末	8,217	—	14,482	—	86.7	—	△33.8	—
	(期末) 2014年5月7日	8,268	0.6	14,531	0.3	91.7	—	△41.6	—
第103期	(期首) 2014年5月7日	8,299	1.0	14,565	0.6	91.7	—	△42.8	—
	5月末	8,259	—	14,565	—	91.7	—	△42.8	—
	(期末) 2014年6月9日	8,157	△1.2	14,378	△1.3	91.1	—	△7.9	—
第104期	(期首) 2014年6月9日	8,271	0.1	14,581	0.1	91.8	—	△3.0	—
	6月末	8,231	—	14,581	—	91.8	—	△3.0	—
	(期末) 2014年7月7日	8,176	△0.7	14,501	△0.5	90.7	—	△9.0	—
第105期	(期首) 2014年7月7日	8,219	△0.1	14,558	△0.2	92.7	—	△8.9	—
	7月末	8,179	—	14,558	—	92.7	—	△8.9	—
	(期末) 2014年8月7日	8,202	0.3	14,565	0.0	92.3	—	△10.9	—
第106期	(期首) 2014年8月7日	8,138	△0.5	14,495	△0.4	92.9	—	△14.4	—
	8月末	8,098	—	14,495	—	92.9	—	△14.4	—
	(期末) 2014年9月8日	8,260	2.0	14,732	1.6	90.9	—	△2.7	—
第107期	(期首) 2014年9月8日	8,229	1.6	14,640	1.0	88.3	—	△4.1	—
	9月末	8,189	—	14,640	—	88.3	—	△4.1	—
	(期末) 2014年10月7日	8,375	2.3	14,980	2.3	91.1	—	3.7	—
		8,322	1.6	14,855	1.5	91.9	—	1.1	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
 (注2) 当ファンドは積立投資信託組合に入りますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
 (注3) 債券先物比率は買建比率・売建比率。
 (注4) パークレイズ・汎欧州総合インデックス(円換算ベース)は設定日を10,000として指数化したものを記載しています。

◎当作成期の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

当ファンドの基準価額は当作成期末(第107期)において8,282円(分配落)となりました。

【運用経過】

欧州債券市場は期を通じて堅調に推移しました。ECB(欧州中央銀行)の金融緩和策に加え、欧州経済の先行きに対する不透明感やウクライナ情勢を巡る緊張などが債券市場の追い風となりました。これを受けて、独長期金利は前作成期末の1.5%台から低下基調を辿り、当作成期末には0.9%台となりました。外国為替市場では、ユーロは対ドル・対円ともに下落しました。当ファンドは、定性分析や計量モデルを活用した定量分析に基づいて、デュレーション調整、通貨・国・業種別投資比率の変更を機動的に行いました。

【分配金】

基準価額等を勘案し、1口当たり第102期から第107期は40円といたしました。留利益は運用の基本方針に基づき運用を行います。

【今後の運用方針】

世界経済は、米国を中心に先進諸国は回復基調が続く一方で、新興国全体では当面伸び悩むことが予想されます。金融政策に関して、米国では金融緩和と縮小が続くものの、ECB(欧州中央銀行)は引き続き強固な金融緩和策を継続すると考えます。欧州金利は、域内外の要因を睨みながら、方向感の見極めにくい展開が続くものと思われます。外国為替市場については、各国の経済動向や金融政策を巡る思惑から神経質な展開が予想されます。当ファンドでは、これらの各国経済状況や金融政策、市場動向等を勘案しつつ、機動的に投資を行います。

◎1口当たりの費用の明細

項 目	第102期～第107期
(a) 信託報酬	18円
(投信会社)	(14)
(販売会社)	(2)
(受託銀行)	(2)
(b) 売買委託手数料	1
(先物・オプション)	(1)
(c) 保管費用等	1
合 計	20

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。
 (a) 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率
 (b) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数
 (c) 保管費用等=期中の保管費用等/期中の平均受益権口数
 (注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
 (注3) 売買委託手数料および保管費用等は、このファンドが組入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

◎親投資信託受益証券の設定、解約状況（自2014年4月8日 至2014年10月7日）

決 算 期	第 102 期 ～ 第 107 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アイエヌジー・欧州債券マザーファンド	千口 458,083	千円 642,700	千口 2,909,219	千円 4,133,800

(注) 単位未満は切り捨て。

◎利害関係人との取引状況等（自2014年4月8日 至2014年10月7日）

(1) 作成期中の利害関係人との取引状況

アイエヌジー・欧州債券マザーファンド

区 分	当 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 4,484	百万円 14	% 0.3	百万円 8,559	百万円 13	% 0.2
債 券 先 物 取 引	39,058	—	0.0	32,838	—	0.0
為 替 直 物 取 引	55,879	—	0.0	61,812	—	0.0

平均保有割合67.2%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

アイエヌジー・欧州債券マザーファンド

種 類	当 作 成 期		
	買 付 額	売 付 額	作 成 期 末 保 有 額
普 通 社 債 券	百万円 14	百万円 13	百万円 43

(3) 作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 作 成 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	1,173千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	—千円
$(B) \div (A)$	0.0 %

(注1) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

(注2) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、アイエヌジーバンクN.V.です。

◎組入資産の明細（2014年10月7日現在）

親投資信託残高

種 類	前 作 成 期 末 (第 101 期 末)		当 作 成 期 末 (第 107 期 末)	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
アイエヌジー・欧州債券マザーファンド	千口 8,804,090	千円 12,235,044	千口 6,352,953	千円 9,174,936

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成

(2014年10月7日現在)

項 目	当 作 成 期 末 (第 107 期 末)	
	評 価 額	率
アイエヌジー・欧州債券マザーファンド	千円 9,174,936	% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 , そ の 他	290,140	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	9,465,076	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) アイエヌジー・欧州債券マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産 (12,882,876千円) の投資信託財産総額 (13,104,317千円) に対する比率は98.3%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.94円、1カナダドル=97.63円、1ユーロ=137.59円、1ポンド=175.00円、1スウェーデンクローナ=15.15円、100ハンガリーフォリント=44.71円、1ズロチ=32.90円、1オーストラリアドル=95.44円、1ランド=9.71円です。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	(2014年5月7日)		(2014年6月9日)		(2014年7月7日)		(2014年8月7日)		(2014年9月8日)		(2014年10月7日)現在	
	第102期末	第103期末	第104期末	第105期末	第106期末	第107期末	第102期末	第103期末	第104期末	第105期末	第106期末	第107期末
(A) 資産	12,136,127,528円	11,977,592,048円	12,110,320,641円	12,023,945,317円	11,086,475,466円	9,465,076,354円	12,136,127,528円	11,977,592,048円	12,110,320,641円	12,023,945,317円	11,086,475,466円	9,465,076,354円
コール・ローン等	71,142,705	64,496,147	68,781,557	49,595	53,526	290,140,007	71,142,705	64,496,147	68,781,557	49,595	53,526	290,140,007
アイエヌジー・欧州債券マザーファンド(評価額)	12,064,984,765	11,913,095,848	12,041,539,028	11,835,695,722	10,611,221,940	9,174,936,109	12,064,984,765	11,913,095,848	12,041,539,028	11,835,695,722	10,611,221,940	9,174,936,109
未収入利息	—	—	—	188,200,000	475,200,000	—	—	—	—	188,200,000	475,200,000	—
未収入利息	58	53	56	—	—	238	58	53	56	—	—	238
(B) 負債	71,145,493	64,489,412	68,888,649	188,386,550	475,433,362	290,065,578	71,145,493	64,489,412	68,888,649	188,386,550	475,433,362	290,065,578
未払収益分配金	58,430,480	57,893,520	58,889,840	58,464,640	51,828,480	44,313,360	58,430,480	57,893,520	58,889,840	58,464,640	51,828,480	44,313,360
未払信託報酬	8,354,304	1,886,920	5,920,400	125,321,470	419,041,374	242,164,472	8,354,304	1,886,920	5,920,400	125,321,470	419,041,374	242,164,472
その他未払費用	4,317,544	4,619,622	3,949,574	4,427,341	4,346,949	3,337,818	4,317,544	4,619,622	3,949,574	4,427,341	4,346,949	3,337,818
繰越利益剰余金	43,165	89,350	128,835	173,099	216,559	249,928	43,165	89,350	128,835	173,099	216,559	249,928
(C) 純資産総額(A-B)	12,064,982,035	11,913,102,636	12,041,431,992	11,835,558,767	10,611,042,104	9,175,010,776	12,064,982,035	11,913,102,636	12,041,431,992	11,835,558,767	10,611,042,104	9,175,010,776
元本	14,607,620,000	14,473,380,000	14,722,460,000	14,616,160,000	12,957,120,000	11,078,340,000	14,607,620,000	14,473,380,000	14,722,460,000	14,616,160,000	12,957,120,000	11,078,340,000
次期繰越損益金	△ 2,542,637,965	△ 2,560,277,364	△ 2,681,028,008	△ 2,780,601,233	△ 2,346,077,896	△ 1,903,329,224	△ 2,542,637,965	△ 2,560,277,364	△ 2,681,028,008	△ 2,780,601,233	△ 2,346,077,896	△ 1,903,329,224
(D) 受益権総口数	1,460,762口	1,447,338口	1,472,246口	1,461,616口	1,295,712口	1,107,834口	1,460,762口	1,447,338口	1,472,246口	1,461,616口	1,295,712口	1,107,834口
1口当たり基準価額(C/D)	8,259円	8,231円	8,179円	8,098円	8,189円	8,282円	8,259円	8,231円	8,179円	8,098円	8,189円	8,282円

	(第102期)	(第103期)	(第104期)	(第105期)	(第106期)	(第107期)
期首元本額	14,890,470,000円	14,607,620,000円	14,473,380,000円	14,722,460,000円	14,616,160,000円	12,957,120,000円
期中の追加設定元本額	111,110,000円	282,620,000円	303,180,000円	447,280,000円	222,970,000円	273,710,000円
期中の一部解約元本額	393,960,000円	416,260,000円	54,100,000円	553,580,000円	1,882,010,000円	2,152,490,000円

◎損益の状況

第102期(自2014年4月8日 至2014年5月7日) 第105期(自2014年7月8日 至2014年8月7日)
 第103期(自2014年5月8日 至2014年6月9日) 第106期(自2014年8月8日 至2014年9月8日)
 第104期(自2014年6月10日 至2014年7月7日) 第107期(自2014年9月9日 至2014年10月7日)

項 目	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期
(A) 配当等収益	663円	404円	166円	675円	1,110円	1,211円
受取利息	663	404	166	675	1,110	1,211
(B) 有価証券売買損益	124,134,572	22,799,071	△ 12,324,673	△ 55,584,766	170,561,871	143,532,583
売差益	125,030,289	26,593,272	222,342	1,225,535	191,764,680	162,115,384
売差損	△ 895,717	△ 3,794,201	△ 12,547,015	△ 56,810,301	△ 21,202,809	△ 18,582,801
(C) 信託報酬等	△ 4,360,709	△ 4,665,807	△ 3,989,059	△ 4,471,605	△ 4,390,409	△ 3,371,187
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	119,774,526	18,133,668	△ 16,313,566	△ 60,055,696	166,172,572	140,162,607
(E) 前期繰越損益金	833,117,576	869,747,699	827,009,272	725,044,009	531,513,618	501,605,482
(F) 追加信託差損益金	△ 3,437,999,587	△ 3,390,265,211	△ 3,432,833,874	△ 3,387,124,906	△ 2,991,935,606	△ 2,540,783,953
(配当等相当額)	(1,029,092,567)	(1,037,024,319)	(1,072,790,094)	(1,089,455,140)	(977,177,794)	(849,427,471)
(売買損益相当額)	(△ 4,466,192,154)	(△ 4,427,289,530)	(△ 4,505,623,968)	(△ 4,476,580,046)	(△ 3,969,113,400)	(△ 3,390,211,424)
(G) 合計(D+E+F)	△ 2,484,207,485	△ 2,502,383,844	△ 2,622,138,168	△ 2,722,136,593	△ 2,294,249,416	△ 1,859,015,864
(H) 収益分配金	58,430,480	△ 57,893,520	△ 58,889,840	△ 58,464,640	△ 51,828,480	△ 44,313,360
次期繰越損益金(G+H)	△ 2,542,637,965	△ 2,560,277,364	△ 2,681,028,008	△ 2,780,601,233	△ 2,346,077,896	△ 1,903,329,224
追加信託差損益金	△ 3,437,999,587	△ 3,390,265,211	△ 3,432,833,874	△ 3,387,124,906	△ 2,991,935,606	△ 2,540,783,953
(配当等相当額)	(1,029,320,094)	(1,037,415,422)	(1,073,496,982)	(1,090,527,364)	(977,767,690)	(849,427,471)
(売買損益相当額)	(△ 4,466,419,681)	(△ 4,427,680,633)	(△ 4,506,330,856)	(△ 4,477,652,270)	(△ 3,969,703,296)	(△ 3,390,211,424)
分配準備積立金	894,461,622	838,236,893	802,864,675	743,206,607	645,857,710	637,454,729
繰越損益金	—	△ 8,249,046	△ 51,058,809	△ 136,682,934	—	—

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額をいいます。

第102期分配金の計算過程：
 第102期計算期末における費用控除後の配当等収益(29,924,289円)、費用控除後の有価証券等損益額(66,548,845円)、信託約款に規定する収益調整金(1,029,320,094円)および分配準備積立金(856,418,968円)より分配対象収益は1,982,212,196円(1口当たり1,356円)であり、うち58,430,480円(1口当たり40円)を分配金額としております。

第103期分配金の計算過程：
 第103期計算期末における費用控除後の配当等収益(36,382,714円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,037,415,422円)および分配準備積立金(869,747,699円)より分配対象収益は1,933,545,835円(1口当たり1,335円)であり、うち57,893,520円(1口当たり40円)を分配金額としております。

第104期分配金の計算過程：
 第104期計算期末における費用控除後の配当等収益(26,526,659円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,073,496,982円)および分配準備積立金(835,227,856円)より分配対象収益は1,935,251,497円(1口当たり1,314円)であり、うち58,889,840円(1口当たり40円)を分配金額としております。

第105期分配金の計算過程：
 第105期計算期末における費用控除後の配当等収益(27,444,594円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,090,527,364円)および分配準備積立金(774,226,653円)より分配対象収益は1,892,198,611円(1口当たり1,294円)であり、うち58,464,640円(1口当たり40円)を分配金額としております。

第106期分配金の計算過程：
 第106期計算期末における費用控除後の配当等収益(26,296,760円)、費用控除後の有価証券等損益額(20,623,226円)、信託約款に規定する収益調整金(977,767,690円)および分配準備積立金(650,766,204円)より分配対象収益は1,675,453,880円(1口当たり1,203円)であり、うち51,828,480円(1口当たり40円)を分配金額としております。

第107期分配金の計算過程：
 第107期計算期末における費用控除後の配当等収益(27,380,672円)、費用控除後の有価証券等損益額(112,781,935円)、信託約款に規定する収益調整金(849,427,471円)および分配準備積立金(541,605,482円)より分配対象収益は1,531,195,560円(1口当たり1,382円)であり、うち44,313,360円(1口当たり40円)を分配金額としております。

アイエヌジー・欧州債券マザーファンド

第9期（計算期間：2013年10月8日～2014年10月7日）

◎当期の運用経過

【運用経過】

欧州債券市場は、期首では方向感に乏しい展開が続き、独長期金利は前期末の1.8%台を挟んでの値動きとなりました。2014年に入ると、新興国経済への懸念やウクライナの政治情勢が緊迫したことを背景に、質への逃避から独国債が買い進められました。また、ECB(欧州中央銀行)の金融緩和策に加え、夏場以降は欧州経済に不透明感が見え始めたことなども追い風となり、独長期金利は期末には0.9%台まで低下しました。外国為替市場では、ユーロは対ドルで下落、対円では上昇しました。当ファンドは、定性分析や計量モデルを活用した定量分析に基づいて、デュレーション調整、通貨・国・業種別投資比率の変更を機動的に行いました。

◎期中の売買及び取引の状況（自2013年10月8日 至2014年10月7日）

(1) 公社債

			買付額	売付額
			千ユーロ	千ユーロ
外 国	ド イ ツ	国債証券	21,372	14,009
		特殊債証券	—	2,308
		社債券(投資法人債券を含む)	502	966
	イ タ リ ア	国債証券	747	6,439
		社債券(投資法人債券を含む)	792	2,398
		国債証券	1,757	5,233
	フ ラ ン ス	特殊債証券	—	114
		社債券(投資法人債券を含む)	2,702	6,919 (150)
		国債証券	8,086	19,075
	オ ラ ン ダ	社債券(投資法人債券を含む)	781	4,302
		国債証券	8,835	12,475
		社債券(投資法人債券を含む)	2,019	1,101 (3,000)
	ベ ル ギ ー	国債証券	333	1,493
		社債券(投資法人債券を含む)	408	1,243
国債証券		—	611	
オ ー ス ト リ ア	社債券(投資法人債券を含む)	—	329	
	国債証券	—	421	
	社債券(投資法人債券を含む)	—	173	
ル ク セ ン ブ ル ク	国債証券	—	173	
	社債券(投資法人債券を含む)	199	352	
	社債券(投資法人債券を含む)	2,841	9,614 (100)	
ア イ ル ラ ン ド	国債証券	—	—	
	社債券(投資法人債券を含む)	—	—	
	社債券(投資法人債券を含む)	—	—	
そ の 他	国債証券	—	—	
	特殊債証券	—	—	
	社債券(投資法人債券を含む)	—	—	
国 内	イ ギ リ ス	国債証券	千ポンド	千ポンド
		特殊債証券	—	4,370
		社債券(投資法人債券を含む)	—	3,057

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は換算等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決済額	新規買付額	決済額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引	—	—	5,793	6,391
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引	—	—	15,324	15,325
10年国債標準物	—	—	2,789	2,779
US 2YR NOTE	2,423	3,026	1,602	1,592
US 10YR NOTE	1,508	1,859	1,746	2,103
US LONG BOND	366	365	—	—
CAN 10Y BOND	4,019	3,345	—	—
AUST 10YR 6%	—	—	323	14,179
AUST 3YR 6%	—	—	16,373	—
LONG GILT FU	3,540	3,625	2,480	2,296
EURO-SCHATZ	4,253	4,183	—	—
EURO-BTP FUT	4,906	5,005	—	—
EURO-OAT 10Y	1,718	1,781	478	498
EURO-BOBL FU	1,374	1,831	1,753	1,623
EURO-BUND FU	2,239	1,359	10,578	12,850
EURO BUXL 30	1,389	1,554	—	—

(注1) 単位未満は切り捨て。
 (注2) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

◎利害関係人との取引状況等(自2013年10月8日 至2014年10月7日)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期 末		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
債券先物取引	7,170	14	0.2	13,745	13	0.1
為替直物取引	87,736	—	0.0	87,539	—	0.0
	89,875	—	0.0	97,633	—	0.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
普 通 社 債 券	百万円	百万円	百万円
	14	13	43

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	3,787千円
うち利害関係人への支払額(B)	—千円
(B) / (A)	0.0 %

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは、アイエヌジーバンクN.V.です。

◎組入資産の明細(2014年10月7日現在)

(1) 公社債

外国(外貨建)公社債の種類別開示

区 分	2014年 10 月 7 日 現 在		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
	額 面 金 額	評 価 額			5年以上	2年以上	2年未満	
	千ユーロ	千ユーロ			%	%	%	%
ド イ ツ	8,391	9,130	9.7	—	3.7	6.0	—	
イ タ リ ア	5,441	6,588	906,478	7.0	—	4.6	2.1	0.3
フ ラ ン ス	12,321	14,811	2,037,960	15.7	—	12.0	3.5	0.2
オ ラ ン ダ	3,655	4,058	558,436	4.3	—	1.6	2.7	—
ス ベ イ シ ン	12,946	15,110	2,079,014	16.1	—	9.8	2.5	3.8
ベ ル ギ ー	2,694	3,259	448,411	3.5	—	2.4	0.9	0.2
オ ー ス ト リ ア	940	1,276	175,613	1.4	—	1.4	—	—
ル ク セ ン ブ ル ク	300	332	45,753	0.4	—	—	0.4	—
フ ィ ン ラ ン ド	400	466	64,152	0.5	—	0.5	—	—
ア イ ル ラ ン ド	2,372	2,740	377,001	2.9	—	1.7	0.8	0.4
ポ ル ト ガ ル	100	109	15,131	0.1	—	—	0.1	—
そ の 他	11,395	12,620	1,736,454	13.4	—	5.1	5.9	2.4
イ ギ リ ス	千ポンド	千ポンド						
	9,704	11,711	2,049,445	15.8	—	11.6	4.2	—
ポ ー ラ ン ド	千ズロチ	千ズロチ						
	4,355	4,548	149,629	1.2	—	—	—	1.2
合 計	—	—	11,899,817	91.9	—	54.3	29.2	8.5

(注1) 邦貨換算金額は、2014年10月7日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
 (注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
 (注3) 単位未満は切り捨て。
 (注4) 一円未満は四捨五入。
 (注5) 評価については価格情報会社、金融商品取引業者等よりデータを入力しています。

外国（外貨建）公社債の個別銘柄開示

区分	種類	銘柄名	2014年10月7日現在				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	1.25	3,150	3,233	444,898	2016/10/14
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	1,810	2,100	289,032	2019/7/4
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	2,531	2,802	385,536	2023/8/15
ドイツ	普通社債券(含む投資法人債券)	DEUT PFANDBRIEFBANK AG	2.125	300	323	44,518	2019/6/3
ドイツ	普通社債券(含む投資法人債券)	DEUTSCHE BANK AG	1.25	100	100	13,810	2021/9/8
ドイツ	普通社債券(含む投資法人債券)	DEUTSCHE BANK AG	1.75	200	215	29,596	2022/6/8
ドイツ	普通社債券(含む投資法人債券)	MUNICH RE	6.25	200	245	33,838	2042/5/26
ドイツ	普通社債券(含む投資法人債券)	VOLKSWAGEN LEASING GMBH	2.625	100	109	15,102	2024/1/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	470	530	73,044	2017/8/1
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	1,050	1,211	166,647	2019/9/1
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	400	453	62,454	2021/5/1
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	398	508	69,991	2029/11/1
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	1,030	1,430	196,772	2031/5/1
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	422	523	72,018	2040/9/1
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	196	236	32,511	2044/9/1
イタリア	普通社債券(含む投資法人債券)	ATLANTIA SPA	4.375	100	117	16,146	2020/3/16
イタリア	普通社債券(含む投資法人債券)	GTECH SPA	3.5	100	111	15,290	2020/3/5
イタリア	普通社債券(含む投資法人債券)	INTESA SANPAOLO	5.0	100	125	17,233	2021/1/27
イタリア	普通社債券(含む投資法人債券)	INTESA SANPAOLO SPA	4.125	300	320	44,146	2016/9/19
イタリア	普通社債券(含む投資法人債券)	INTESA SANPAOLO SPA	3.75	200	231	31,863	2019/9/25
イタリア	普通社債券(含む投資法人債券)	INTESA SANPAOLO SPA	3.375	100	117	16,184	2025/1/24
イタリア	普通社債券(含む投資法人債券)	UBI BANCA SPCA	5.25	200	252	34,768	2021/1/28
イタリア	普通社債券(含む投資法人債券)	UNICREDIT SPA	2.625	375	417	57,405	2020/10/31
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.25	660	780	107,369	2019/4/25
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.5	1,220	1,427	196,408	2020/4/25
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5.5	1,150	1,710	235,286	2029/4/25
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.0	140	188	25,881	2038/10/25
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.5	140	204	28,111	2041/4/25
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.0	451	642	88,456	2055/4/25
フランス	特殊債券(除く金融債)	CAISSE D'AMORT DETTE SOC	3.75	1,450	1,734	238,624	2020/10/25
フランス	特殊債券(除く金融債)	ELECTRICITE DE FRANCE	3.875	300	355	48,979	2022/1/18
フランス	特殊債券(除く金融債)	ELECTRICITE DE FRANCE	5.375	100	113	15,657	2049/12/29
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	ALSTOM S	3.0	100	108	14,996	2019/7/8
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	AUTOROUTES DU SUD DE LA	4.0	100	113	15,555	2018/9/24
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	AUTOROUTES DU SUD DE LA	4.125	100	116	16,092	2020/4/13
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	AUTOROUTES PARIS ARRFP	2.25	200	212	29,246	2020/1/16
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	BANQ FED CRD MUT	2.625	100	108	14,955	2024/3/18
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	BNP PARIBAS	2.875	350	391	53,823	2023/9/26
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	BNP PARIBAS	2.875	100	103	14,239	2026/3/20
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	BNP PARIBAS HOME LOAN	3.375	600	645	88,762	2017/1/12
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	BNP PARIBAS HOME LOAN	3.875	300	364	50,133	2021/7/12
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	BOUYGUES	3.641	100	112	15,513	2019/10/29
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	BPCE SA	2.75	100	101	13,922	2026/7/8
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CAISSE FRANCAISE DE FIN	4.25	400	468	64,478	2019/2/7
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CAISSE REFINANCE L'HABIT	4.0	1,100	1,361	187,268	2022/6/17
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CASINO GUICHARD COFF	3.248	200	218	30,030	2024/3/7
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CASINO GUICHARD PERRACHO	5.5	100	101	13,977	2015/1/30
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CASINO GUICHARD PERRACHO	3.994	100	114	15,777	2020/3/9
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CIE FINANCEMENT FONCIER	4.5	500	577	79,440	2018/5/16
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CNP ASSURANCES	6.875	100	120	16,510	2041/9/30
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CREDIT AGRICOLE LONDON	2.375	300	324	44,630	2020/11/27
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	CREDIT LOGEMENT SA	1.232	150	131	18,058	2049/3/16
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	EUTELSAT SA	5.0	200	233	32,164	2019/1/14
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	EUTELSAT SA	2.625	100	107	14,747	2020/1/13
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	GDF SUEZ	3.0	200	226	31,194	2023/2/1
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	ORANGE	8.125	200	340	46,856	2033/1/28
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	RCI BANQUE SA	4.0	100	104	14,425	2016/3/16
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	RCI BANQUE SA	2.875	110	117	16,142	2018/1/22
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	RCI BANQUE SA	2.25	50	52	7,236	2021/3/29
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	SANOFI	1.125	200	201	27,657	2022/3/10
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	SOCIETE GENERALE	2.25	200	213	29,435	2020/1/23
フランス	普通社債券(含む投資法人債券)	SOLVAY FINANCE	4.199	250	260	35,908	2019/5/12

区 分	種 類	銘 柄 名	2014 年 10 月 7 日 現 在				
			利 率	額 面 金 額	価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	特殊債券(除く金融債)	NEDER WATERSCHAPS BANK	1.625	370	392	54,029	2019/8/23
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	ABN AMRO BANK NV	3.625	600	657	90,429	2017/10/6
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	ABN AMRO BANK NV	1.875	450	483	66,493	2019/7/31
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	ABN AMRO BANK NV	2.5	235	266	36,616	2023/9/5
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	CRH FINANCE BV	5.0	200	233	32,171	2019/1/25
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	ELM BV (SWISS REIN CO)	5.252	100	104	14,415	2049/5/29
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	ENEL FINANCE INTL NV	5.0	200	249	34,340	2022/9/14
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	GAS NATURAL FENOSA FINAN	3.875	200	234	32,274	2022/4/11
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	HEINEKEN NV	3.5	100	116	15,985	2024/3/19
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	ING BANK NV	3.5	300	318	43,753	2023/11/21
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	KBC IFIMA NV	2.125	200	211	29,139	2018/9/10
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	RABOBANK NEDERLAND	4.75	500	569	78,365	2018/1/15
オランダ	普通社債券(含む投資法人債券)	WOLTERS KLUWER-C	2.875	200	200	30,422	2023/3/21
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	341	388	53,436	2017/7/30
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6	600	705	97,137	2019/7/30
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	550	642	88,389	2019/10/31
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	1,466	1,876	258,217	2023/1/31
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	1,619	2,009	276,454	2024/1/31
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	530	734	101,083	2032/7/30
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	370	455	62,718	2041/7/30
スペイン	特殊債券(除く金融債)	INSTITUT CREDITO OFICIAL	5.125	770	818	112,550	2016/1/25
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL	4.0	300	354	48,818	2021/3/24
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	AYT CEDULAS CAJAS IX	3.75	200	203	27,977	2015/3/31
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	3.5	1,700	1,990	273,884	2020/10/7
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BANCO DE SABADELL SA	3.375	100	109	15,071	2018/1/23
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BANCO POPULAR ESPANOL SA	3.75	100	110	15,265	2019/1/22
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BANCO SANTANDER SA	3.25	500	505	69,574	2015/2/17
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BANCO SANTANDER SA	3.125	400	411	56,609	2015/9/28
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BANCO SANTANDER SA	2.875	300	326	44,858	2018/1/30
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BANKIA	5.75	200	218	30,112	2016/6/29
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BANKIA	4.5	400	492	67,753	2022/4/26
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	BBVA SUB CAPITAL UNIPERS	3.5	200	206	28,425	2024/4/11
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	CAIXABANK	5.125	800	862	118,688	2016/4/27
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	CAIXABANK	3.0	100	109	15,028	2018/3/22
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	CEDULAS TDA 1	4.125	300	351	48,298	2019/11/29
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	CEDULAS TDA 6	4.25	100	120	16,626	2031/4/10
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	CEDULAS TDA A-3	4.0	400	456	62,758	2018/10/23
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	GAS NATURAL CAPITAL	4.125	100	111	15,306	2018/1/26
スペイン	普通社債券(含む投資法人債券)	TELEFONICA EMISIONES SAU	5.496	500	537	73,970	2016/4/1
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0	760	862	118,646	2019/9/28
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.75	411	491	67,560	2020/9/28
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	2.25	310	342	47,120	2023/6/22
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	5.5	314	461	63,540	2028/3/28
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	5.0	200	298	41,016	2035/3/28
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	99	139	19,195	2041/3/28
ベルギー	普通社債券(含む投資法人債券)	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	2.25	250	267	36,832	2020/9/24
ベルギー	普通社債券(含む投資法人債券)	BNP PARIBAS FORTIS SA	4.625	150	150	20,709	2014/10/27
ベルギー	普通社債券(含む投資法人債券)	EANDIS	4.5	200	245	33,789	2021/11/8
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	480	583	80,325	2022/4/20
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	230	363	49,986	2027/7/15
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	329	45,301	2037/3/15
ルクセンブルク	普通社債券(含む投資法人債券)	GLENCORE FINANCE EUROPE	5.25	300	332	45,753	2017/3/22
フィンランド	普通社債券(含む投資法人債券)	FINGRID OYJ	3.5	400	466	64,152	2024/4/3
アイルランド	国債証券	IRISH TSY	5.0	409	510	70,286	2020/10/18
アイルランド	国債証券	IRISH TSY	5.4	193	256	35,349	2025/3/13
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	AIB MORTGAGE BANK	3.125	200	200	30,337	2018/9/10
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	BANK OF IRELAND MTGE BNK	3.25	400	408	56,228	2015/6/22
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	BANK OF IRELAND MTGE BNK	2.75	220	237	32,726	2018/3/22
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	BANK OF IRELAND MTGE BNK	1.75	100	105	14,488	2019/3/19
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	CLOVERIE PLC SWISS REINS	6.625	150	189	26,136	2042/9/1
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	CLOVERIE PLC ZURICH INS	1.75	100	101	13,980	2024/9/16
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	DEPPA ACS BANK	3.875	200	215	29,627	2016/11/14
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	GE CAPITAL EURO FUNDING	4.625	200	262	36,162	2027/2/22
アイルランド	普通社債券(含む投資法人債券)	WILLOW NO.2 FOR ZURICH I	3.375	200	230	31,675	2022/6/27

区 分	種 類	銘 柄 名	2014 年 10 月 7 日 現 在				償 還 年 月 日
			利 率	額 面 金 額	価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ポルトガル	普通社債券(含む投資法人債券)	CAIXA GERAL DE DEPOSITOS	3.75	100	109	15,131	2018/1/18
その他	特殊債券(除く金融債)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	5.5	610	718	98,903	2018/2/15
その他	特殊債券(除く金融債)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	4.5	770	1,034	142,366	2025/10/15
その他	特殊債券(除く金融債)	EUROPEAN UNION	2.75	1,500	1,568	215,834	2016/6/3
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	ABBEY NATL TREASURY SERV	3.625	400	441	60,714	2017/10/5
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	ABBEY NATL TREASURY SERV	2.625	100	109	15,046	2020/7/16
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	AQUARIUS + INV ZURICH IN	4.25	100	109	15,022	2043/10/2
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	BANK OF AMERICA CORP	1.668	302	305	42,092	2019/5/6
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	BANK OF AMERICA CORP	2.5	140	150	20,748	2020/7/27
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	BANK OF AMERICA CORP	2.375	150	157	21,625	2024/6/19
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	BARCLAYS BANK PLC	2.25	150	157	21,688	2017/2/22
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	BAT INTL FINANCE	2.75	100	109	15,019	2025/3/25
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	BNZ INTERNATIONAL FNDNG	3.125	600	654	89,992	2017/11/23
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	CITIGROUP INC	7.375	200	262	36,090	2019/9/4
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	CITIGROUP INC	2.375	100	105	14,514	2024/5/22
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	COMMONWEALTH BANK AUST	2.625	100	105	14,542	2017/1/12
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	DNB BOLIGKREDITT AS	3.375	400	430	59,167	2017/1/20
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	FCE BANK PLC	1.875	150	155	21,362	2019/4/18
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	GE CAPITAL TRUST IV	4.625	83	86	11,948	2066/9/15
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	HSBC FINANCE CORP	4.875	350	390	53,732	2017/5/30
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	IMPERIAL TOBACCO FINANCE	3.375	200	220	30,269	2026/2/26
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	JPMORGAN CHASE & CO	1.227	600	600	82,604	2018/3/31
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	LEGAL & GENERAL GROUP	4.0	160	161	22,245	2025/6/8
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	LLOYDS BANK PLC	1.875	200	209	28,871	2018/10/10
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	LLOYDS BANK PLC	4.0	700	842	115,857	2020/9/29
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	MET LIFE GLOB FUNDING I	1.25	140	141	19,440	2021/9/17
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	NATIONAL GRID PLC	5.0	100	116	15,991	2018/7/2
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	NGG FINANCE PLC	4.25	100	107	14,790	2076/6/18
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	NORDEA HYPOTEK AB	3.5	300	323	44,507	2017/1/18
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	PHILIP MORRIS INTL INC	2.875	100	110	15,239	2024/5/30
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	ROYAL BK OF SCOTLAND PLC	4.75	440	470	64,698	2016/5/18
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	SPAREBANKEN VEST	1.5	100	104	14,419	2018/9/11
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	STANDARD CHARTERED PLC	3.625	200	207	28,605	2015/12/15
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	SVENSKA HNDLSBKN	2.25	300	323	44,524	2020/8/27
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	TDC	3.75	100	114	15,812	2022/3/2
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	TELENOR ASA	2.75	400	444	61,190	2022/6/27
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	1.8	150	158	21,850	2020/7/23
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	UBS	4.75	300	314	43,227	2026/2/12
その他	普通社債券(含む投資法人債券)	UBS AG LONDON	6.0	500	595	81,892	2018/4/18
小 計	—	—	—	—	—	9,700,742	—
イギリス				千ポンド	千ポンド		
	国債証券	UK TSY	1.0	1,050	1,044	182,756	2017/9/7
	国債証券	UK TSY	4.5	1,250	1,406	246,202	2019/3/7
	国債証券	UK TSY	4.25	719	854	149,552	2027/12/7
	国債証券	UK TSY	4.75	915	1,156	202,375	2030/12/7
	国債証券	UK TSY	4.25	257	311	54,453	2036/3/7
	国債証券	UK TSY	4.75	1,904	2,498	437,161	2038/12/7
	国債証券	UK TSY	4.25	400	491	85,962	2040/12/7
	国債証券	UK TSY	4.25	206	262	45,969	2049/12/7
	特殊債券(除く金融債)	ELECTRICITE DE FRANCE	5.5	900	1,068	187,039	2041/10/17
	特殊債券(除く金融債)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	4.75	610	682	119,389	2018/10/15
	特殊債券(除く金融債)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	5.375	720	862	150,963	2021/6/7
	特殊債券(除く金融債)	KFW	5.75	773	1,072	187,618	2032/6/7
小 計	—	—	—	—	—	2,049,445	—
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6.25	4,355	4,548	149,629	2015/10/24
合 計	—	—	—	—	—	11,899,817	—

(注1) 邦貨換算金額は、2014年10月7日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

種 別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	584
外国	債券先物取引	CAN 10Y BOND	—
		EURO-SCHATZ	671
		LONG GILT FU	—
		EURO-BTP FUT	790
		EURO-OAT 10Y	277
		EURO-BOBL FU	—
		EURO-BUND FU	888
		US 10YR NOTE	—
		EURO BUXL 30	217
		US LONG BOND	—
		AUST 10YR 6%	740
	AUST 3YR 6%	—	
			2,224

(注1) 単位未満は切り捨て。
 (注2) 邦貨換算金額は、2014年10月7日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
 (注3) ー印は組入れなし。

◎投資信託財産の構成

(2014年10月7日現在)

項 目	2014年10月7日現在	
	評 価 額	率
公 社 債	11,899,817千円	90.8%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,204,500	9.2
投 資 信 託 財 産 総 額	13,104,317	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。
 (注2) 2014年10月7日現在における外貨純資産(12,882,876千円)の投資信託財産総額(13,104,317千円)に対する比率は98.3%です。
 (注3) 外貨純資産は、2014年10月7日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.94円、1カナダドル=97.63円、1ユーロ=137.59円、1ポンド=175.00円、1スウェーデンクローナ=15.15円、100ハンガリーフォリント=44.71円、1ズロチ=32.90円、1オーストラリアドル=95.44円、1ランド=9.71円です。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

(2014年10月7日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	28,957,781,666円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	405,935,629
公 社 債 (評 価 額)	11,899,817,890
未 収 入 金	16,019,246,516
未 収 利 息	164,248,323
前 払 費 用	19,476,784
差 入 委 託 証 拠 金	449,056,524
(B) 負 債	16,015,723,581
未 払 金	16,015,723,581
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	12,942,058,085
元 本	8,961,457,266
次 期 繰 越 損 益 金	3,980,600,819
(D) 受 益 権 総 口 数	8,961,457,266口
1 万 口 当 ち り 基 準 価 額 (C / D)	14,442円

(注1) 期首元本額 14,391,078,401円
 期中追加設定元本額 1,753,939,103円
 期中解約元本額 7,183,560,238円
 (注2) 2014年10月7日現在における1口当たり純資産 1,4442円
 (注3) 2014年10月7日現在における当ファンドの元本の内訳
 アイエヌジー・欧州債券ファンドF C (適格機関投資家専用) 653,752,954円
 アイエヌジー・欧州債券ファンドF D (適格機関投資家専用) 6,352,953,960円
 アイエヌジー・欧州債券ファンドF V A (適格機関投資家専用) 1,550,769,990円
 アイエヌジー・欧州債券ファンドF (適格機関投資家専用) 403,980,362円

◎損益の状況

(自2013年10月8日 至2014年10月7日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	579,798,943円
受 取 利 息	579,609,781
そ の 他 収 益 金	189,162
(B) 有 価 証 券 買 入 損 益	2,026,654,937
売 買 損 益	3,110,499,588
売 買 損 益	△1,083,844,651
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	142,255,332
取 引 損 益	503,760,400
取 引 損 益	△ 361,505,068
(D) 信 託 報 酬 等	△ 4,783,518
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	2,743,925,694
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	3,428,453,990
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	665,860,897
(H) 受 益 権 差 損 益 金	△2,857,639,762
(I) 計 算 (E + F + G + H)	3,980,600,819
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	3,980,600,819

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注2) 損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注3) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注4) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

LM・米国債券コア・プラスFD(適格機関投資家専用)

第96期～第101期(2014年4月8日～2014年10月7日)

◎当ファンドの仕組み

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	無期限	
運用方針	主として幅広いセクターの米国ドル建ての公社債に実質的に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド	主として米国ドル建ての公社債等を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資には制限を設けません。	
分配方針	決算日(原則として毎月7日、休業日の場合は翌営業日)に、収益分配方針に基づいて分配を行います。	

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額(分配落)			ベンチマーク パークレイズ 米国総合インデックス (円換算ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	投資信託証券 組入比率	純資産 総額
		円	円	%	期 中 騰落率	期 中 騰落率				
第13 作成期	72期(2012年5月7日)	6,072	28	△1.0	9,902	△2.3	110.5	△9.8	—	2,457
	73期(2012年6月7日)	6,007	28	△0.6	9,839	△0.6	109.0	△13.3	—	2,355
	74期(2012年7月9日)	6,077	28	1.6	9,980	1.4	105.1	△11.5	—	2,382
	75期(2012年8月7日)	6,019	28	△0.5	9,886	△0.9	102.6	△12.9	—	2,359
	76期(2012年9月7日)	6,059	28	1.1	9,966	0.8	103.3	△13.1	—	2,384
第14 作成期	77期(2012年10月9日)	6,044	28	0.2	9,958	△0.1	97.3	△12.5	—	2,497
	78期(2012年11月7日)	6,185	28	2.8	10,176	2.2	99.9	△10.4	—	2,566
	79期(2012年12月7日)	6,375	18	3.4	10,494	3.1	102.0	△14.9	—	2,581
	80期(2013年1月7日)	6,761	18	6.3	11,140	6.2	102.2	△16.7	—	2,718
	81期(2013年2月7日)	7,142	18	5.9	11,816	6.1	102.9	△16.9	—	2,849
第15 作成期	82期(2013年3月7日)	7,202	18	1.1	11,841	0.2	102.2	△16.8	—	2,879
	83期(2013年4月8日)	7,596	18	5.7	12,432	5.0	100.7	△10.7	—	2,983
	84期(2013年5月7日)	7,651	18	1.0	12,690	2.1	99.9	△10.9	—	2,968
	85期(2013年6月7日)	7,364	18	△3.5	12,393	△2.3	102.3	△13.8	—	2,788
	86期(2013年7月8日)	7,425	18	1.1	12,381	△0.1	102.0	△12.4	—	2,841
第16 作成期	87期(2013年8月7日)	7,202	18	△2.8	12,101	△2.3	102.3	△12.6	—	2,848
	88期(2013年9月9日)	7,264	18	1.1	12,113	0.1	104.1	△8.2	—	2,954
	89期(2013年10月7日)	7,217	18	△0.4	12,104	△0.1	105.3	△2.0	—	2,982
	90期(2013年11月7日)	7,355	18	2.2	12,354	2.1	105.6	△10.0	—	3,052
	91期(2013年12月9日)	7,623	18	3.9	12,796	3.6	104.8	△2.6	1.6	3,230
第17 作成期	92期(2014年1月7日)	7,745	18	1.8	13,045	1.9	103.0	1.5	1.7	3,245
	93期(2014年2月7日)	7,677	18	△0.6	12,861	△1.4	95.5	1.7	1.5	3,410
	94期(2014年3月7日)	7,772	18	1.5	13,051	1.5	88.2	2.5	1.5	3,641
	95期(2014年4月7日)	7,809	18	0.7	13,151	0.8	93.7	3.3	1.4	3,692
	96期(2014年5月7日)	7,764	18	△0.3	13,026	△0.9	95.2	0.9	1.4	3,749
第17 作成期	97期(2014年6月9日)	7,862	18	1.5	13,196	1.3	87.7	△6.9	1.3	4,021
	98期(2014年7月7日)	7,826	18	△0.2	13,142	△0.4	83.2	△1.2	1.2	4,388
	99期(2014年8月7日)	7,851	18	0.5	13,254	0.9	70.2	6.4	0.9	5,738
	100期(2014年9月8日)	8,096	18	3.3	13,624	2.8	59.4	12.1	0.6	9,355
	101期(2014年10月7日)	8,380	18	3.7	14,225	4.4	68.4	5.1	0.4	14,454

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率。

(注4) 債券組入比率の中には売付債券(TBA取引)の比率は含まれておりません。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準価額		ベンチマーク パークレイズ 米国総合インデックス (円換算ベース)		債 券 組入比率	債 券 先物比率	投資信託証券 組入比率
		円	%	円	%			
第96期	(期 首) 2014年4月7日	7,809	—	13,151	—	93.7	3.3	1.4
	4月末	7,809	0.0	13,082	△0.5	95.0	2.1	1.4
	(期 末) 2014年5月7日	7,782	△0.3	13,026	△0.9	95.2	0.9	1.4
第97期	(期 首) 2014年5月7日	7,764	—	13,026	—	95.2	0.9	1.4
	5月末	7,833	0.9	13,137	0.9	89.9	△ 8.7	1.3
	(期 末) 2014年6月9日	7,880	1.5	13,196	1.3	87.7	△ 6.9	1.3
第98期	(期 首) 2014年6月9日	7,862	—	13,196	—	87.7	△ 6.9	1.3
	6月末	7,812	△0.6	13,105	△0.7	85.8	△ 1.2	1.3
	(期 末) 2014年7月7日	7,844	△0.2	13,142	△0.4	83.2	△ 1.2	1.2
第99期	(期 首) 2014年7月7日	7,826	—	13,142	—	83.2	△ 1.2	1.2
	7月末	7,913	1.1	13,271	1.0	77.0	△ 1.1	1.1
	(期 末) 2014年8月7日	7,869	0.5	13,254	0.9	70.2	6.4	0.9
第100期	(期 首) 2014年8月7日	7,851	—	13,254	—	70.2	6.4	0.9
	8月末	8,049	2.5	13,539	2.2	71.6	△ 0.5	0.8
	(期 末) 2014年9月8日	8,114	3.3	13,624	2.8	59.4	12.1	0.6
第101期	(期 首) 2014年9月8日	8,096	—	13,624	—	59.4	12.1	0.6
	9月末	8,396	3.7	14,186	4.1	70.3	1.0	0.4
	(期 末) 2014年10月7日	8,398	3.7	14,225	4.4	68.4	5.1	0.4

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注4) 債券組入比率の中には売付債券（TBA取引）の比率は含まれておりません。

◎ 当作成期の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

米国債券市場では、短期債利回りが上昇（価格は下落）する一方、長期債利回りは低下（価格は上昇）しました。期の前半は、米連邦準備制度理事会（FRB）が超低金利政策を当面継続するとの見方を背景に、利回りは低下基調となりました。期の半ばは、ウクライナや中東情勢を巡る緊張が高まり、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、安全資産としての国債が買われ、利回りは低下しました。期の後半は、米国景気の順調な回復を背景にFRBが事実上のゼロ金利政策の解除を想定より前倒しするとの見方が広がったことから、利回りは上昇しました。しかし、作成期末にかけては、中国や欧州の景気減速が意識され、利回りは長期債を中心に低下しました。このような環境の中、当作成期の基準価額の騰落率はプラス8.78%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークのプラス8.17%を0.61%上回りました。

【運用経過】

幅広いセクターの米ドル建て公社債に投資を行う「LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド」受益証券に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指したポートフォリオの運用に努めてまいりました。

【分配金】

基準価額動向や保有債券の利子収入等を勘案し、1口当たり税込みで第96期18円、第97期18円、第98期18円、第99期18円、第100期18円、第101期18円の収益分配を行いました。なお、収益分配に充当しなかった利益につきましては信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づき運用を行います。

【今後の運用方針】

米国経済に関しては、2013年4-6月期GDP成長率（確定値）は前期比年率プラス4.6%と、1-3月期から力強い改善を示しました。異例な寒波の影響でマイナス成長となった1-3月期からの回復基調が明確となりました。金融政策については、FRBは今後も実体経済を見定めながら、慎重に金融政策の正常化を進めていくものと判断されます。こうした環境下、当ファンドはこれまでと同様に、組入債券の信用リスクと金利リスクに配慮しつつ銘柄を選択し、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行う所存です。

■ 1口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	第96期～第101期
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	20円 (16) (2) (2)
(b) 売買委託手数料 (先物・オプション)	1 (1)
(c) 保管費用等	1
合 計	22

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率

(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料

(c) 保管費用等 = 期中の平均受益権口数

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 売買委託手数料および保管費用等は、このファンドが組入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況（2014年4月8日から2014年10月7日まで）

	第96期～第101期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド	千口 8,084,969	千円 10,320,143	千口 213,581	千円 268,604

(注) 単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況等（2014年4月8日から2014年10月7日まで）

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■ 第二種金融商品取引業を兼業している投資信託委託会社の自己取引状況（2014年4月8日から2014年10月7日まで）

該当事項はありません。

■ 自社による当ファンドの設定・解約状況（2014年4月8日から2014年10月7日まで）

該当事項はありません。

■ 組入資産の明細

親投資信託残高

種 類	第16作成期末		第17作成期末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド	千口 3,041,785	千円 10,913,173	千口 14,490,512	千円 14,490,512

(注) 単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

2014年10月7日現在

項 目	第17作成期末	
	評 価 額	比 率
LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド	千円 14,490,512	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	59,124	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	14,549,636	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) LM・米国債券コア・プラス・マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（22,187,512千円）の投資信託財産総額（28,084,668千円）に対する比率は79.0%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、10月7日における邦貨換算レートは、1米ドル=108.94円、1メキシコペソ=8.13円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第96期末 2014年5月7日	第97期末 2014年6月9日	第98期末 2014年7月7日	第99期末 2014年8月7日	第100期末 2014年9月8日	第101期末 2014年10月7日
	円	円	円	円	円	円
(A) 資 産	3,760,212,133	4,032,778,508	4,400,654,474	5,753,811,397	9,379,368,056	14,549,636,028
LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド(詳細)	3,759,875,830	4,032,354,392	4,400,131,003	5,753,811,397	9,379,368,056	14,490,512,227
未 収 入 金	336,303	424,116	523,471	—	—	59,123,801
(B) 負 債	10,618,103	11,440,432	12,261,207	15,204,770	23,963,522	95,284,311
未 払 収 益 分 配 金	8,692,884	9,206,748	10,093,878	13,156,416	20,799,594	31,045,698
未 払 解 約	336,303	424,116	523,471	—	—	59,123,801
未 払 信 託 報 酬	1,555,496	1,772,806	1,612,666	2,013,820	3,128,280	5,082,506
そ の 他 未 払 費 用	33,420	36,762	31,192	34,534	35,648	32,306
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	3,749,594,030	4,021,338,076	4,388,393,267	5,738,606,627	9,355,404,534	14,454,351,717
元 本	4,829,380,000	5,114,860,000	5,607,710,000	7,309,120,000	11,555,330,000	17,247,610,000
次 期 繰 越 損 益 金	△1,079,785,970	△1,093,521,924	△1,219,316,733	△1,570,513,373	△2,199,925,466	△2,793,258,283
(D) 受 益 権 総 口 数	482,938口	511,486口	560,771口	730,912口	1,155,533口	1,724,761口
1口当たり基準価額(C/D)	7,764円	7,862円	7,826円	7,851円	8,096円	8,380円

<注記事項>

(注1) 元本の状況

当作成期首元本額	4,729,410,000円
当作成期中追加設定元本額	12,749,630,000円
当作成期中一部解約元本額	231,430,000円

(注2) 元本の欠損

純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,793,258,283円であります。

■損益の状況

項 目	自 2014年4月8日 至 2014年5月7日	自 2014年5月8日 至 2014年6月9日	自 2014年6月10日 至 2014年7月7日	自 2014年7月8日 至 2014年8月7日	自 2014年8月8日 至 2014年9月8日	自 2014年9月9日 至 2014年10月7日
	円	円	円	円	円	円
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 10,916,606	58,994,735	△ 6,805,803	24,946,449	228,936,557	438,228,661
売 買 益	—	60,268,168	75,787	28,646,843	229,423,962	441,471,848
売 買 損	△ 10,985,905	△ 1,273,433	△ 6,881,590	△ 3,700,394	△ 487,405	△ 3,243,187
(B) 信 託 報 酬 等	△ 1,588,916	△ 1,809,568	△ 1,643,858	△ 2,048,354	△ 3,163,928	△ 5,114,812
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	△ 12,505,522	57,185,167	△ 8,449,661	22,898,095	225,772,629	433,113,849
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 450,579,261	△ 468,053,832	△ 418,264,914	△ 434,240,881	△ 424,499,202	△ 218,326,825
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 608,008,303	△ 673,446,511	△ 782,508,280	△ 1,146,014,171	△ 1,980,399,299	△ 2,976,999,609
(配 当 等 相 当 額)	(128,257,458)	(137,070,471)	(152,365,396)	(203,635,513)	(330,232,563)	(500,184,958)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 736,265,761)	(△ 810,516,982)	(△ 934,873,676)	(△ 1,349,649,684)	(△ 2,310,631,862)	(△ 3,477,184,567)
(F) 計 (C + D + E)	△ 1,071,093,086	△ 1,084,315,176	△ 1,209,222,855	△ 1,557,356,957	△ 2,179,125,872	△ 2,762,212,585
(G) 収 益 分 配 金	△ 8,692,884	△ 9,206,748	△ 10,093,878	△ 13,156,416	△ 20,799,594	△ 31,045,698
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	△ 1,079,785,970	△ 1,093,521,924	△ 1,219,316,733	△ 1,570,513,373	△ 2,199,925,466	△ 2,793,258,283
追 加 信 託 差 損 益 金	(△ 608,008,303)	(△ 673,446,511)	(△ 782,508,280)	(△ 1,146,014,171)	(△ 1,980,399,299)	(△ 2,976,999,609)
(配 当 等 相 当 額)	(128,432,137)	(137,444,388)	(152,831,528)	(204,800,691)	(333,325,554)	(504,857,391)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 736,440,440)	(△ 810,890,899)	(△ 935,339,808)	(△ 1,350,814,862)	(△ 2,313,724,853)	(△ 3,481,857,000)
繰 配 準 備 積 立 金	15,613,667	16,659,053	14,324,252	11,112,015	5,338,105	183,741,326
繰 越 損 益 金	△ 487,391,334	△ 436,734,466	△ 451,132,705	△ 435,611,217	△ 224,864,272	—

(注1) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額をいいます。

(注4) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬のうち販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。

(注5) 分配金の計算過程

第96期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,707,226円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(128,432,137円)および分配準備積立金(16,599,325円)より分配対象収益は152,738,688円(1口当たり316円)であり、うち8,692,884円(1口当たり18円)を分配金額としております。

第97期計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,366,031円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(137,444,388円)および分配準備積立金(15,499,770円)より分配対象収益は163,310,189円(1口当たり319円)であり、うち9,206,748円(1口当たり18円)を分配金額としております。

第98期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,814,532円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(152,831,528円)および分配準備積立金(16,603,598円)より分配対象収益は177,249,658円(1口当たり316円)であり、うち10,093,878円(1口当たり18円)を分配金額としております。

第99期計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,010,561円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(204,800,691円)および分配準備積立金(14,257,870円)より分配対象収益は229,069,122円(1口当たり313円)であり、うち13,156,416円(1口当たり18円)を分配金額としております。

第100期計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,025,684円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(333,325,554円)および分配準備積立金(11,112,015円)より分配対象収益は359,463,253円(1口当たり311円)であり、うち20,799,594円(1口当たり18円)を分配金額としております。

第101期計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,693,899円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額(189,783,311円)、信託約款に規定する収益調整金(504,857,391円)および分配準備積立金(5,309,814円)より分配対象収益は719,644,415円(1口当たり417円)であり、うち31,045,698円(1口当たり18円)を分配金額としております。

LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド

第8期（2013年4月9日～2014年4月7日）

◎当期の運用経過と今後の運用方針

[基準価額の推移]

米国債券市場は、利回りが上昇（価格は下落）しました。期の前半は、米連邦準備制度理事会（FRB）が近い将来に米国国債を中心とした資産購入策の縮小に踏み切るとの見方が浮上したため、利回りは上昇しました。期の半ばは、FRBが市場の予想に反して量的金融緩和の縮小見送りを決定したことから、利回りは低下に向かいました。期の後半にかけては、FRBによる早期の量的金融緩和の縮小が改めて意識されたため、利回りは上昇しました。しかし、量的金融緩和の縮小が発表された後は、FRBによる超低金利政策の長期化維持の発言に支えられ、利回りは低下に向かいました。期末にかけては、米国の利上げ再開の時期が市場の想定より前倒しになる可能性が意識されたことなどから、利回りは短中期債を中心に上昇しました。このような環境の中、当期の基準価額の騰落率はプラス6.33%となり、ベンチマークのプラス5.78%を0.55%上回りました。

[運用経過]

幅広いセクターの米ドル建て公社債に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指したポートフォリオの運用に努めてまいりました。

[今後の運用方針]

米国経済に関しては、2013年10-12月期GDP成長率（確報値）は前期比年率プラス2.6%と、改定値のプラス2.4%から上方修正され、米国経済の着実な成長を裏付ける内容となりました。また、米国住宅市場が回復傾向にあることも、今後の経済成長を促す要因となり得ます。こうした環境下、当ファンドはこれまでと同様に、組入債券の信用リスクと金利リスクに配慮しつつ銘柄を選択し、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行う所存です。

(※)ベンチマークはバークレイズ米国総合インデックス（円換算ベース）

■期中の売買及び取引の状況（2013年4月9日から2014年4月7日まで）

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外国	ア メ リ カ	百株 —	千米ドル —	百株 3	千米ドル 9

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(2) 優先証券

		買 付		売 付	
		額 面	金 額	額 面	金 額
外国	ア メ リ カ	千米ドル 540	千米ドル 432	千米ドル —	千米ドル —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(3) 公社債

		買付額		売付額	
外	ア	千米ドル		千米ドル	
	メ	21,711		20,582	
	リ			(4)	
	カ	519		518	
	国債証券	116,279		106,711	
	地			(3,407)	
	方	6,452		2,862	
	債			(771)	
	証券				
	特				
	殊				
	債				
	証券				
	社				
	債				
	券				
	(投資法人債券を含む)				
国	メ	千メキシコペソ		千メキシコペソ	
	キシコ	-		2,730	
	国債証券				

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(4) 投資信託証券

		買付		売付	
		単位数	金額	単位数	金額
外国	ア	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	メ	3	850	-	-
	リ				
	カ				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国		百万円	百万円	百万円	百万円
	債券先物取引	4,121	3,880	5,078	5,527
	金利先物取引	1,858	501	1,265	374

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(6) オプションの種類別取引状況

種 類 別		コール・ブット別	買 建				売 建			
			新規買付額	決 済 額	権利行使	権利放棄	新規売付額	決 済 額	権利被行使	義務消滅
外		コール	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
	債券オプション取引	コール	1	0.009352	0.9892	0.345021	3	1	1	0.977898
		ブット	0.697439	0.523557	0.204928	0.392055	3	0.554214	0.472269	1
国	金利オプション取引	ブット	-	0.15148	-	-	-	0.039534	-	-

(注1) 単位未満は切捨て。ただし、金額が単位未満の場合は小数で記載。

(注2) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	959千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	946千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.01

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等 (2013年4月9日から2014年4月7日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産の明細 (2014年4月7日現在)

(1) 外国株式

上場・登録株式

銘 柄	期 首	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) SEMGROUP CORPORATION-WRT	百株 3	百株 -	千米ドル -	千円 -	エネルギー
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3 1	- -	- -<-%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切捨て。

(2) 優先証券

銘 柄	当 期 末			
	額面金額	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千米ドル	千米ドル	千円	
CITIGROUP INC FRN	30	29	3,049	
GOLDMAN SACHS CAPITAL II	470	364	37,651	
RABOBANK FRN	80	106	10,958	
WELLS FARGO CAPITAL X	40	40	4,132	
合 計	額 面 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	620 4	540 -	55,791 <0.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 単位未満は切捨て。

(3) 外国 (外貨建) 公社債

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ < 売 付 債 券 >	千米ドル 62,663 <900>	千米ドル 57,836 <948>	千円 5,968,695 <97,875>	% 92.8 <1.5>	% -	% 77.8 <1.5>	% 11.2 <->	% 3.8 <->
メ キ シ コ	千メキシコペソ 5,031	千メキシコペソ 5,465	43,343	0.7	-	0.7	-	-
合 計	-	-	5,914,163	92.0	-	77.0	11.2	3.8

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切捨て。

外国（外貨建）公社債銘柄別

種 類	銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	千米ドル	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円	
国 債 証 券	COLOMBIA GOVT	5.625	2044/2/26	200	212	21,900	
	RUSSIA GOVT	7.5	2030/3/31	104	120	12,408	
	T-NOTE INFLATION INDEX	0.375	2023/7/15	340	338	34,895	
	T-NOTE INFLATION INDEX	2.125	2040/2/15	220	284	29,403	
	T-NOTE INFLATION INDEX	0.625	2043/2/15	210	178	18,438	
	US TREASURY BOND	2.75	2042/8/15	3,233	2,747	283,585	
	US TREASURY BOND	3.75	2043/11/15	270	278	28,718	
	US TREASURY BOND	3.625	2044/2/15	700	704	72,731	
	US TREASURY NOTE	0.25	2015/10/31	30	29	3,095	
	US TREASURY NOTE	0.75	2017/10/31	1,130	1,112	114,798	
	US TREASURY NOTE	1.375	2018/6/30	330	328	33,922	
	US TREASURY NOTE	1.5	2018/8/31	660	659	68,016	
	US TREASURY NOTE	1.5	2018/12/31	20	19	2,050	
	US TREASURY NOTE	1.5	2019/2/28	10	9	1,022	
	US TREASURY NOTE	1.625	2019/3/31	100	99	10,279	
	US TREASURY NOTE	2.0	2020/9/30	20	19	2,041	
	US TREASURY NOTE	2.0	2020/11/30	1,170	1,153	119,027	
	US TREASURY NOTE	2.0	2021/2/28	30	29	3,039	
	US TREASURY NOTE	2.75	2023/11/15	1,380	1,385	142,972	
US TREASURY NOTE	2.75	2024/2/15	200	200	20,674		
地 方 債 証 券	PR S/TAX-1ST SUB-B	6.0	2042/8/1	10	8	829	
	PR-C-SALES TAX	5.0	2040/8/1	10	8	840	
特殊債券（除く金融債）	ACE 2006-ASL1 A	0.43425	2036/2/25	170	62	6,479	
	BACM 2006-1 AM	5.421	2045/9/10	19	20	2,098	
	BACM 2006-5 AM	5.448	2047/9/10	10	10	1,105	
	BACM 2007-3 A3	5.598296	2049/6/1	297	297	30,694	
	BALTA 2004-11 2A2	2.796178	2034/11/25	747	626	64,624	
	BALTA 2004-12 1A3	0.85425	2035/1/25	91	88	9,127	
	BALTA 2004-7 2A1	3.046517	2034/8/25	89	90	9,364	
	BSARM 2004-8 12A1	3.829798	2034/11/25	12	11	1,217	
	CD 2006-CD2 AJ	5.388248	2046/1/15	110	101	10,514	
	CD 2006-CD2 AM	5.349248	2046/1/1	10	10	1,104	
	CD 2007-CD4 AJ	5.398	2049/12/11	50	38	3,972	
	COMM 2013-CR12 A4	4.046	2046/10/1	20	20	2,132	
	COMM 2013-CR12 AM	4.3	2046/10/1	20	20	2,139	
	COMM 2013-CR12 B	4.762	2046/10/1	10	10	1,076	
	CSMC 2006-C5 AJ	5.373	2039/12/15	310	289	29,851	
	CSMC 2006-CF2 A1	0.41425	2036/5/25	193	192	19,839	
	CSMC 2007-C2 AM	5.548731	2049/1/15	34	36	3,785	
	CWALT 2005-27 2A3	1.68905	2035/8/25	77	65	6,737	
	CWALT 2005-IM1 1A1	0.45425	2036/1/25	49	41	4,313	
	CWCI 2007-C2 AMFX	5.526	2047/4/15	25	27	2,836	
	CWHL 2004-20 2A1	2.656501	2034/9/25	13	10	1,134	
	CWHL 2004-29 2A1	0.48425	2035/2/25	427	378	39,063	
	CWHL 2005-11 6A1	0.75425	2035/3/25	143	126	13,059	
	EFOTS 2011-1 A2	0.8886	2035/4/25	140	140	14,456	
	FHLMC #G04715	6.0	2038/6/1	29	33	3,432	
	FHLMC #G06172	5.5	2038/12/1	143	158	16,372	
	FHLMC #G06409	6.0	2039/11/1	370	413	42,681	
FHLMC #G06669	6.5	2039/9/1	34	39	4,066		
FHLMC #G06858	5.0	2041/11/1	176	192	19,883		

種 類	銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円
特殊債券(除く金融債)	FHLMC #G07335	7.0	2039/3/1	59	65	6,781
	FHLMC #Q17792	3.5	2043/5/1	95	96	9,912
	FHLMC #U62476	3.5	2043/4/1	97	97	10,031
	FHLMC #U90316	4.0	2042/10/1	93	96	9,957
	FHMS K006 AX1 IO	1.04288	2020/1/25	914	44	4,590
	FHMS K007 X1 IO	1.196093	2020/4/25	269	14	1,482
	FHMS K008 X1 IO	1.662819	2020/6/25	182	14	1,458
	FHMS K017 X1 IO	1.443611	2021/12/1	117	10	1,035
	FHR 3621 SB IO	6.075	2040/1/15	144	22	2,283
	FHR 4226 GZ	3.0	2043/7/15	102	81	8,371
	FHR 4239 IO	3.5	2027/6/15	358	50	5,238
	FHRR R007 ZA	6.0	2036/5/15	109	122	12,618
	FICO STRIP PRIN	—	2018/8/3	10	9	948
	FICO STRIP PRN-7	—	2018/8/3	10	9	943
	FICO STRIP PRN15	—	2019/3/7	510	461	47,605
	FN AL3429	4.5	2041/6/1	75	81	8,364
	FNMA	6.625	2030/11/15	225	308	31,803
	FNMA #254793	5.0	2033/7/1	15	16	1,707
	FNMA #555743	5.0	2033/9/1	16	18	1,896
	FNMA #617656	2.292	2032/1/1	12	13	1,355
	FNMA #725162	6.0	2034/2/1	5	6	668
	FNMA #843997	2.117	2035/11/1	56	59	6,112
	FNMA #888560	6.0	2035/11/1	35	40	4,148
	FNMA #889117	5.0	2035/10/1	32	36	3,739
	FNMA #890248	6.0	2037/8/1	58	66	6,864
	FNMA #915154	5.0	2037/4/1	94	102	10,627
	FNMA #934648	7.0	2038/11/1	12	14	1,477
	FNMA #985626	6.0	2033/4/1	16	18	1,869
	FNMA #985867	7.0	2038/8/1	5	5	618
	FNMA #995072	5.5	2038/8/1	34	38	4,009
	FNMA #AB3517	4.5	2041/9/1	50	54	5,620
	FNMA #AB7130	3.5	2042/12/1	93	94	9,705
	FNMA #AB9594	4.0	2043/6/1	91	96	9,923
	FNMA #AB9980	3.5	2043/7/1	98	97	10,108
	FNMA #AE0758	7.0	2039/2/1	139	154	15,971
	FNMA #AL0215	4.5	2041/4/1	278	298	30,819
	FNMA #AL3192	5.0	2043/4/1	74	81	8,390
	FNMA #AL3572	5.0	2041/7/1	94	103	10,662
	FNMA #AQ5369	3.5	2042/12/1	92	92	9,587
	FNMA #AQ7083	3.5	2042/12/1	95	95	9,826
	FNMA #AS1348	3.5	2033/12/1	98	101	10,444
	FNMA #AT2628	3.5	2033/9/1	198	204	21,092
	FNMA #AT4281	4.0	2043/6/1	98	103	10,629
	FNMA #AT4907	3.5	2043/5/1	93	94	9,759
	FNMA #AT4961	3.5	2043/5/1	98	99	10,224
	FNMA #AT6546	4.0	2043/6/1	94	98	10,190
	FNMA #AT7101	3.5	2043/6/1	98	99	10,224
FNMA #AT7139	3.5	2043/6/1	97	98	10,167	
FNMA #AT7167	3.5	2043/6/1	97	98	10,145	
FNMA #AT8906	3.5	2043/7/1	97	98	10,163	
FNMA #AU1228	3.5	2043/7/1	96	96	9,992	
FNMA #AV7699	3.5	2034/1/1	99	102	10,550	
FNMA #MA1213	3.5	2042/9/1	187	187	19,335	

種 類	銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円
特殊債券(除く金融債)	FNMA #MA1436	3.5	2043/4/1	192	193	19,920
	FNMA #MA1543	3.5	2033/8/1	190	196	20,306
	FNMA #MA1582	3.5	2043/8/1	98	98	10,117
	FNMA #MA1608	3.5	2033/10/1	296	306	31,580
	FNMA #MA1652	3.5	2033/11/1	97	100	10,365
	FNR 2010-110 AE	9.75	2018/11/25	101	114	11,803
	FNR 2011-15 AB	9.75	2019/8/25	28	32	3,305
	FNR 2011-87 SG IO	6.39575	2040/4/25	153	27	2,875
	FNR 2012-101 AI IO	3.0	2027/6/25	406	48	4,970
	FNR 2012-28 B	6.5	2039/6/25	63	71	7,345
	FNR 2012-51 B	7.0	2042/5/25	109	121	12,528
	FNR 2012-74 SA IO	6.49575	2042/3/25	76	11	1,202
	FNR 2013-9 BC	6.5	2042/7/25	77	86	8,946
	FNR 2013-9 CB	5.5	2042/4/25	184	204	21,151
	FNS 409 C18 IO	4.0	2042/4/25	128	32	3,350
	FNS 409 C2 IO	3.0	2027/4/25	69	8	903
	GNMA #733600	5.0	2040/4/15	120	134	13,930
	GNMA2 #4617	4.5	2040/1/20	49	53	5,523
	GNMA2 #4696	4.5	2040/5/1	102	110	11,425
	GNMA2 #4772	5.0	2040/8/1	229	252	26,022
	GNMA2 #4804	6.0	2040/9/20	99	112	11,568
	GNMA2 #4928	6.0	2041/1/20	42	47	4,918
	GNMA2 #4978	4.5	2041/3/20	502	544	56,165
	GNMA2 #5240	6.0	2041/11/20	102	115	11,970
	GNMA2 #783368	4.5	2041/7/20	107	115	11,947
	GNR 2010-106 SH IO	5.84325	2040/8/20	341	65	6,754
	GNR 2010-152 IN IO	4.0	2038/3/20	133	17	1,834
	GNR 2011-135 SN IO	5.945	2041/10/16	299	58	6,023
	GNR 2011-H03 FA	0.6585	2061/1/20	296	295	30,450
	GNR 2011-H05 FB	0.6585	2060/12/20	493	491	50,765
	GNR 2011-H06 FA	0.6085	2061/2/20	315	313	32,321
	GNR 2011-H08 FD	0.6585	2061/2/20	255	254	26,267
	GNR 2011-H09 AF	0.6585	2061/3/20	86	85	8,843
	GNR 2012-100 IO	0.82522	2052/8/16	159	10	1,091
	GNR 2013-147 QS IO	6.59325	2039/12/20	284	57	5,964
	GNR 2013-152 HS IO	6.54325	2043/6/20	94	19	2,058
	GNR 2013-153 AB	2.9	2044/6/16	69	70	7,258
	GNR 2013-154 AB	2.9	2044/2/16	198	200	20,739
	GNR 2013-178 A	2.25	2035/3/16	69	69	7,154
	GNR 2013-178 IO	0.94773	2055/6/16	169	11	1,142
	GNR 2013-193AB	2.0	2055/12/16	99	99	10,224
	GNR 2013-69 AI IO	3.5	2043/5/20	289	69	7,132
	GPMF 2005-HY1 1A1A	0.42425	2035/7/25	323	308	31,805
	GPMH 1999-2 A2	2.9128	2029/3/18	25	21	2,244
	GPMH 1999-3 2A2	3.542	2029/6/19	25	21	2,244
	GPMH 2001-2 1A2	3.656	2032/2/20	75	68	7,034
	GPMH 2001-2 1IA2	3.654	2032/3/13	50	44	4,607
	GSMS 2013-GC16 A4	4.271	2046/11/10	60	63	6,535
	GSMS 2013-GC16 AS	4.649	2046/11/10	40	42	4,393
	GSMS 2013-GC16 B	5.161	2046/11/10	30	32	3,308
	HERTZ 2009-2A A2	5.29	2016/3/25	100	103	10,682
	IMM 2007-A M1	0.55425	2037/5/25	340	312	32,264
	INDS 2006-A A	0.41425	2036/6/25	716	180	18,669

種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
					外貨建金額	千米ドル	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円	
特殊債券(除く金融債)	JPMBB 2013-C15 AS	4.4196	2045/11/15	40	41	4,326	
	JPMBB 2013-C15 C	5.081713	2045/11/15	20	20	2,151	
	JPMBB 2013-C17 B	4.887497	2047/1/15	10	10	1,094	
	JPMCC 2007-CB20 AM	5.904101	2051/2/1	10	11	1,165	
	LBUBS 2007-C7 AM	6.15044	2045/9/15	10	11	1,176	
	LXS 2006-8 2A4A	0.41425	2036/6/25	772	435	44,901	
	MARM 2004-15 1A1	3.180229	2034/12/25	53	53	5,478	
	MLMI 2005-WMC1 M2	0.94925	2035/9/25	330	304	31,390	
	MLMT 2006-C2 AJ	5.802	2043/8/12	70	70	7,324	
	MSBAM 2012-C6 AS	3.476	2045/11/1	10	9	1,016	
	MSBAM 2013-C7 A4	2.918	2046/2/1	20	19	1,973	
	MSBAM 2013-C7 AS	3.214	2046/2/1	20	19	1,972	
	MSBAM 2013-C9 AS	3.456	2046/5/1	50	48	5,001	
	MSC 2006-IQ12 AJ	5.399	2043/12/15	110	99	10,245	
	MSM 2006-8AR 1A2	0.22425	2036/6/25	119	55	5,704	
	NEF 2007-1 A7	1.063	2046/1/29	75	68	7,061	
	ORGN 2006-A A2	2.6349	2037/10/15	257	219	22,628	
	PRIME 2005-5 1A3	8.0	2034/7/25	38	36	3,735	
	RASC 2003-KS2 MI1	4.8	2033/4/25	132	117	12,169	
	SACO 06-5 1A1	0.45425	2036/4/25	78	120	12,482	
	SACO 2006-6 A	0.41425	2036/6/25	226	333	34,411	
	SAIL 2004-8 A8	1.15425	2034/9/25	410	403	41,622	
	SARM 2004-10 2A	2.387903	2034/8/25	91	90	9,314	
	SASC 2006-ARS1 A1	0.37425	2036/2/25	1,227	83	8,626	
	SCSLC 2010-1 A3	1.2886	2036/10/27	150	151	15,673	
	SLMA 2001-4 B	0.7386	2021/1/25	188	187	19,371	
	SLMA 2002-5 B	0.66335	2024/9/16	200	192	19,868	
	SLMA 2004-3 A5	0.4086	2023/7/25	88	87	9,052	
	STACR 2014-DN2 M2	1.804	2024/4/25	460	459	47,471	
	TENN VALLEY AUTHORITY	5.25	2039/9/15	120	135	14,004	
	WAMU 2007-OA2 1A	0.82905	2047/3/1	105	84	8,726	
	WBCMT 2007-C30 AM	5.383	2043/12/15	20	21	2,234	
WFRBS 2011-C5 A4	3.667	2044/11/15	32	33	3,407		
特殊債券(買建TBA)	FHLMC GOLD 15YR APR FWD	3.5	2029/4/1	100	104	10,817	
	FHLMC GOLD 15YR APR FWD	2.5	2029/4/1	300	301	31,066	
	FHLMC GOLD 30YR MAY FWD	3.0	2044/5/1	900	867	89,484	
	FNMA 15YR APR FWD	3.0	2029/4/1	500	514	53,115	
	FNMA 15YR APR FWD	3.5	2029/4/1	600	630	65,023	
	FNMA 30YR APR FWD	4.5	2044/4/1	400	427	44,130	
	FNMA 30YR APR FWD	4.0	2044/4/1	500	520	53,744	
	FNMA 30YR MAY FWD	4.5	2044/5/1	1,100	1,172	120,952	
	FNMA 30YR MAY FWD	4.0	2044/5/1	2,700	2,802	289,219	
	FNMA 30YR MAY FWD	5.0	2044/5/1	400	435	44,962	
	FNMA 30YR MAY FWD	3.5	2044/5/1	100	100	10,365	
	GNMA 30YR APR FWD	3.5	2044/4/1	100	102	10,545	
	GNMA II 30YR APR FWD	4.5	2044/4/1	1,500	1,620	167,184	
	GNMA II 30YR APR FWD	3.5	2044/4/1	100	102	10,548	
	GNMA II 30YR APR FWD	4.0	2044/4/1	100	105	10,865	
	普通社債券(含む投資法人債券)	ABBVIE INC	1.75	2017/11/6	90	90	9,367
ABBVIE INC		2.9	2022/11/6	60	57	5,978	
ACCESS MIDSTREAM PARTNER		5.875	2021/4/15	10	10	1,100	
ACCESS MIDSTREAM PARTNER		4.875	2023/5/15	40	40	4,174	
ACCESS MIDSTREAM PARTNER		4.875	2024/3/15	50	49	5,147	

種 類	銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円
普通社債券(含む投資法人債券)	AES CORP	7.375	2021/7/1	10	11	1,176
	AES CORP	4.875	2023/5/15	70	66	6,898
	AES CORP	5.5	2024/3/15	10	9	1,025
	ALLY FINANCIAL INC	3.5	2019/1/27	60	60	6,207
	ALLY FINANCIAL INC	7.5	2020/9/15	90	107	11,064
	ALTRIA GROUP INC	4.75	2021/5/5	210	229	23,682
	ALTRIA GROUP INC	2.85	2022/8/9	60	56	5,855
	ALTRIA GROUP INC	5.375	2044/1/31	30	31	3,272
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	5.625	2017/11/15	60	68	7,055
	AMERICAN EXPRESS	2.65	2022/12/2	76	72	7,465
	AMERICAN INTL GROUP	6.25	2037/3/15	120	127	13,154
	ANADARKO PETRO	6.375	2017/9/15	40	46	4,758
	ANHEUSER-BUSCH	2.5	2022/7/15	180	170	17,554
	APACHE CORP	3.25	2022/4/15	29	29	3,023
	APACHE CORP	6.0	2037/1/15	60	71	7,327
	ARCELORMITTAL	5.0	2017/2/25	20	21	2,193
	AT&T INC	5.5	2018/2/1	20	22	2,336
	AT&T INC	5.8	2019/2/15	110	127	13,142
	ATWOOD OCEANICS INC	6.5	2020/2/1	10	10	1,110
	BAKER HUGHES INC	7.5	2018/11/15	100	123	12,718
	BALL CORP	5.75	2021/5/15	90	96	9,926
	BALL CORP	5.0	2022/3/15	10	10	1,059
	BANK OF AMERICA CORP	6.5	2016/8/1	380	425	43,905
	BANK OF AMERICA CORP	3.875	2017/3/22	20	21	2,203
	BANK OF AMERICA CORP	5.75	2017/12/1	10	11	1,169
	BANK OF AMERICA CORP	2.6	2019/1/15	80	80	8,312
	BANK OF AMERICA CORP	5.0	2021/5/13	10	11	1,136
	BANK OF AMERICA CORP	5.7	2022/1/24	100	114	11,848
	BANK OF AMERICA CORP	4.0	2024/4/1	100	100	10,389
	BANK OF AMERICA CORP	5.0	2044/1/21	130	134	13,848
	BANK OF AMERICA CORP	4.875	2044/4/1	80	81	8,384
	BARRICK GOLD COR	4.1	2023/5/1	110	105	10,837
	BARRICK NA FINANCE LLC	4.4	2021/5/30	100	100	10,398
	BAXTER INTERNATIONAL	4.5	2019/8/15	100	110	11,363
	BERKSHIRE HATHAWAY	3.2	2015/2/11	100	102	10,572
	BHP BILLITON FIN USA LTD	3.25	2021/11/21	150	151	15,649
	BHP BILLITON FIN USA LTD	5.0	2043/9/30	40	42	4,387
	BNP PARIBAS	2.375	2017/9/14	100	102	10,578
	BOEING CO	4.875	2020/2/15	90	101	10,446
	BP CAPITAL MARKETS PLC	3.125	2015/10/1	150	155	16,072
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	8.125	2020/4/30	80	87	9,040
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	6.5	2021/4/30	20	21	2,182
	CELULOSA ARAUCO CONSTITU	4.75	2022/1/11	40	40	4,172
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	6.125	2021/2/15	50	54	5,611
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5.75	2023/3/15	10	10	1,092
	CIE GEN GEOPHYSIQUE	7.75	2017/5/15	20	20	2,089
	CIT GROUP INC	5.0	2023/8/1	50	50	5,256
	CITIGROUP INC	6.375	2014/8/12	46	46	4,841
	CITIGROUP INC	5.5	2014/10/15	27	27	2,855
	CITIGROUP INC	6.0	2017/8/15	290	328	33,926
	CITIGROUP INC	3.5	2023/5/15	90	85	8,824
	CITIGROUP INC	5.5	2025/9/13	50	53	5,538
	CITIGROUP INC FRN	5.35	2049/5/29	30	27	2,879

種 類	銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円
普通社債券(含む投資法人債券)	CLIFFS NATURAL RESOURCES	3.95	2018/1/15	60	61	6,349
	CLIFFS NATURAL RESOURCES	4.8	2020/10/1	30	29	3,071
	CLIFFS NATURAL RESOURCES	4.875	2021/4/1	10	9	1,019
	COLGATE-PALMOLIVE CO	3.15	2015/8/5	120	124	12,832
	COMCAST CORP	6.3	2017/11/15	110	128	13,234
	COMCAST CORP	5.65	2035/6/15	30	33	3,503
	COMCAST CORP	6.95	2037/8/15	10	12	1,337
	CONCHO RESOURCES INC	6.5	2022/1/15	43	46	4,831
	CONOCOPHILLIPS	6.0	2020/1/15	70	83	8,573
	CONTINENTAL RESOURCES	5.0	2022/9/15	60	63	6,519
	CONTL AIRLINES	6.648	2017/9/15	24	25	2,677
	CREDIT AGRICOLE FRN	8.375	2049/12/13	130	148	15,327
	CSC HOLDINGS LLC	6.75	2021/11/15	20	22	2,311
	CVS CORP	5.298	2027/1/11	5	6	651
	CVS PASS-THROUGH TRUST	5.88	2028/1/10	378	420	43,404
	DEVON ENERGY CORPORATION	3.25	2022/5/15	30	29	3,056
	DEVON ENERGY CORPORATION	7.875	2031/9/30	10	13	1,402
	DEVON ENERGY CORPORATION	5.6	2041/7/15	60	66	6,890
	DIAGEO CAPITAL PLC	4.828	2020/7/15	140	156	16,103
	DISH DBS CORP	5.125	2020/5/1	10	10	1,081
	DISH DBS CORP	5.0	2023/3/15	50	50	5,172
	DUKE ENERGY CORP	3.55	2021/9/15	20	20	2,110
	EATON CORP	1.5	2017/11/2	30	29	3,091
	EATON CORP	2.75	2022/11/2	70	66	6,870
	ECOLAB INC	4.35	2021/12/8	10	10	1,118
	EL PASO NATURAL GAS	8.375	2032/6/15	120	161	16,690
	ENERGY TRANSFER EQUITY	7.5	2020/10/15	20	22	2,365
	ENTERPRISE PRODUCTS FRN	7.034	2068/1/15	250	282	29,149
	EXPRESS SCRIPTS	3.5	2016/11/15	120	127	13,116
	FIRSTENERGY CORP	2.75	2018/3/15	20	19	2,061
	FIRSTENERGY CORP	4.25	2023/3/15	90	87	9,079
	FIRSTENERGY CORP	7.375	2031/11/15	210	240	24,838
	FNMA DISCOUNT NT	—	2019/10/9	430	371	38,288
	FORD MOTOR CRED	8.125	2020/1/15	120	151	15,663
	FORD MOTOR CRED	4.75	2043/1/15	70	68	7,035
	FREDDIE MAC DISCOUNT NT	—	2014/5/19	600	599	61,912
	FREDDIE MAC DISCOUNT NT	—	2014/5/27	500	499	51,591
	FREEPORT-MC C AND G	3.55	2022/3/1	135	130	13,439
	GENERAL ELEC CAP CORP	1.625	2015/7/2	30	30	3,138
	GENERAL ELEC CAP CORP	0.85	2015/10/9	40	40	4,148
	GENERAL ELEC CAP CORP	6.0	2019/8/7	250	294	30,365
	GENERAL ELEC CAP CORP	4.5	2044/3/11	30	30	3,140
	GENERAL ELEC CAP CRP FRN	6.375	2067/11/15	290	320	33,104
	GLAXOSMITHKLINE CAPITAL	2.85	2022/5/8	50	48	5,051
	GOLDMAN SACHS GROUP	6.75	2037/10/1	240	277	28,656
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.75	2022/1/24	200	227	23,471
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	4.0	2024/3/3	30	29	3,092
	HCA INC	5.875	2022/3/15	50	53	5,553
	HCA INC	5.0	2024/3/15	20	20	2,066
	HEINEKEN NV	1.4	2017/10/1	20	19	2,056
	HEXION US FINANCE CORP	6.625	2020/4/15	40	41	4,298
	HSBC BANK PLC	4.75	2021/1/19	180	197	20,401
	HUMANA INC	3.15	2022/12/1	110	106	10,960

種 類	銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円
普通社債券(含む投資法人債券)	ILFC E-CAP TRUST I FRN	6.25	2065/12/21	200	193	19,917
	INN OF THE MOUNTAIN GODS	9.25	2020/11/30	3	2	303
	INTELSAT JACKSON HLDG	7.5	2021/4/1	60	66	6,811
	JOHN DEERE CAPITAL CORP	2.25	2019/4/17	30	30	3,108
	JOHN DEERE CAPITAL CORP	1.7	2020/1/15	10	9	991
	JP MORGAN CHASE & CO	1.1	2015/10/15	120	120	12,451
	JP MORGAN CHASE & CO	4.25	2020/10/15	270	290	29,932
	JP MORGAN CHASE & CO	3.375	2023/5/1	30	28	2,954
	KERR-MCGEE CORP	6.95	2024/7/1	130	161	16,678
	KEY ENERGY SERV	6.75	2021/3/1	50	52	5,424
	KRAFT FOODS INC	5.375	2020/2/10	100	113	11,677
	KRAFT FOODS INC	3.5	2022/6/6	50	50	5,205
	KROGER CO	6.15	2020/1/15	80	93	9,630
	LORILLARD TOBACCO CO	3.75	2023/5/20	70	66	6,870
	MARKWEST ENERGY PART/FIN	5.5	2023/2/15	40	41	4,236
	MEDTRONIC INC	4.45	2020/3/15	60	66	6,841
	MERRILL LYNCH	6.875	2018/4/25	100	118	12,197
	MIDAMERICAN ENERGY HLDGS	6.5	2037/9/15	10	12	1,277
	MOLSON COORS BREWING CO	3.5	2022/5/1	10	9	1,031
	MORGAN STANLEY	0.6866	2016/10/18	280	279	28,804
	MORGAN STANLEY	4.75	2017/3/22	10	10	1,126
	NOBLE ENERGY INC	4.15	2021/12/15	110	115	11,949
	NOVARTIS SECS INVEST LTD	5.125	2019/2/10	130	147	15,270
	NVR INC	3.95	2022/9/15	10	9	1,017
	OCCIDENTAL PETROLEUM	3.125	2022/2/15	60	59	6,154
	OCCIDENTAL PETROLEUM	2.7	2023/2/15	20	19	1,961
	ORACLE CORP	1.2	2017/10/15	70	69	7,182
	PACIFIC GAS & ELECTRIC	6.05	2034/3/1	70	82	8,532
	PEABODY ENERGY CORP	6.25	2021/11/15	50	50	5,172
	PEMEX PROJ FDG MASTER TR	6.625	2035/6/15	270	303	31,296
	PENN VIRGINIA RESOURCE	8.375	2020/6/1	39	43	4,532
	PEPSICO INC	0.7	2015/8/13	70	70	7,241
	PEPSICO INC	7.9	2018/11/1	24	30	3,105
	PETROBRAS GLOBAL FINANCE	6.25	2024/3/17	100	103	10,661
	PETROBRAS INTL FIN CO	3.875	2016/1/27	50	51	5,306
	PETROBRAS INTL FIN CO	6.125	2016/10/6	70	75	7,810
	PETROBRAS INTL FIN CO	5.75	2020/1/20	52	54	5,639
	PETROBRAS INTL FIN CO	5.375	2021/1/27	150	152	15,775
	PETROLEOS MEXICANOS	3.5	2023/1/30	18	17	1,763
	PFIZER INC	6.2	2019/3/15	10	11	1,223
	PHILIP MORRIS	2.9	2021/11/15	90	89	9,257
	PHILIP MORRIS	2.5	2022/8/22	30	28	2,917
	PHILIP MORRIS	4.5	2042/3/20	20	19	2,020
	PLAINS E&P COMP	6.5	2020/11/15	10	11	1,138
	QEP RESOURCES INC	6.875	2021/3/1	30	33	3,413
	QEP RESOURCES INC	5.25	2023/5/1	30	29	3,076
	RABOBANK NEDERLAND UTREC	3.375	2017/1/19	130	137	14,224
	RANGE RESOURCES CORP	6.75	2020/8/1	90	97	10,031
	RAYTHEON CO	3.125	2020/10/15	30	30	3,146
	REGENCY ENERGY PARTNERS	5.875	2022/3/1	53	54	5,661
	REYNOLDS AMERICAN INC	3.25	2022/11/1	30	28	2,942
	RIO TINTO FIN USA LTD	2.5	2016/5/20	50	51	5,332
	RIO TINTO FIN USA LTD	3.5	2020/11/2	100	102	10,615

種 類	銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額		
					外貨建金額	千円	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円	千円
普通社債券(含む投資法人債券)	RIO TINTO FIN USA LTD	4.125	2021/5/20	20	21	2,179	
	RIO TINTO FIN USA LTD	3.75	2021/9/20	30	30	3,190	
	ROCHE HLDGS INC	6.0	2019/3/1	34	40	4,133	
	ROGERS CABLE INC	6.75	2015/3/15	20	21	2,182	
	ROYAL BK OF SCOTLAND PLC	5.0	2014/10/1	40	40	4,189	
	ROYAL BK OF SCOTLAND PLC	2.55	2015/9/18	10	10	1,053	
	ROYAL BK OF SCOTLAND PLC	4.7	2018/7/3	10	10	1,060	
	ROYAL BK OF SCOTLAND PLC	6.1	2023/6/10	40	41	4,318	
	ROYAL BK OF SCOTLAND PLC	6.0	2023/12/19	60	61	6,393	
	ROYAL BK SCOTLND FRN	7.648	2049/8/29	20	21	2,218	
	SHELL INTL FIN	3.25	2015/9/22	110	114	11,816	
	SINOPEC GRP OVERSEA 2014	4.375	2024/4/10	200	200	20,731	
	SLM CORP	5.625	2033/8/1	145	126	13,056	
	SMURFIT CAPITAL FNDG PLC	7.5	2025/11/20	95	107	11,054	
	SOUTHERN COPPER CORP	5.25	2042/11/8	110	95	9,856	
	SPRINT CAP CORP	8.75	2032/3/15	40	44	4,587	
	SPRINT NEXTEL	7.0	2020/8/15	60	65	6,757	
	STATE STREET CORP	4.956	2018/3/15	150	163	16,862	
	STEEL DYNAMICS INC	7.625	2020/3/15	70	76	7,847	
	TELEFONICA EMISIONES	6.221	2017/7/3	20	22	2,337	
	TELEFONICA EMISIONES	5.877	2019/7/15	20	22	2,346	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC	3.6	2021/8/15	30	30	3,155	
	TIME WARNER CABLE	8.25	2019/4/1	190	237	24,492	
	TIME WARNER CABLE	5.5	2041/9/1	10	10	1,071	
	TIME WARNER ENT	8.375	2033/7/15	20	27	2,840	
	TIME WARNER INC	4.75	2021/3/29	60	66	6,817	
	TIME WARNER INC	7.7	2032/5/1	60	80	8,339	
	TIME WARNER INC	6.25	2041/3/29	10	11	1,214	
	TOYOTA MTR CRED	1.25	2017/10/5	80	79	8,197	
	TRANSOCEAN INC	5.05	2016/12/15	30	32	3,368	
	TRANSOCEAN INC	6.375	2021/12/15	10	11	1,165	
	TW TELECOM HOLDINGS INC	5.375	2022/10/1	20	20	2,107	
	UAL 2009-2A PASS THRU TR	9.75	2017/1/15	12	13	1,428	
	UNILEVER CAPITAL CORP	4.8	2019/2/15	150	168	17,356	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	4.5	2042/6/1	40	40	4,210	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	6.0	2018/2/15	180	208	21,467	
	VALE OVERSEAS LIMITED	4.375	2022/1/11	85	84	8,766	
	VALE OVERSEAS LIMITED	6.875	2036/11/21	147	158	16,365	
	VERIZON COMMUNICATIONS	6.35	2019/4/1	10	11	1,220	
	VERIZON COMMUNICATIONS	4.5	2020/9/15	20	21	2,251	
	VERIZON COMMUNICATIONS	3.45	2021/3/15	60	61	6,330	
	VERIZON COMMUNICATIONS	5.15	2023/9/15	260	285	29,467	
	VERIZON COMMUNICATIONS	4.15	2024/3/15	40	40	4,209	
	VERIZON COMMUNICATIONS	6.4	2033/9/15	190	226	23,380	
	VERIZON COMMUNICATIONS	5.05	2034/3/15	10	10	1,058	
	VERIZON COMMUNICATIONS	6.55	2043/9/15	120	146	15,113	
VIACOM INC	4.25	2023/9/1	50	51	5,345		
WASTE MANAGEMENT INC	4.6	2021/3/1	20	21	2,241		
WELLPOINT INC	1.25	2015/9/10	20	20	2,081		
WELLPOINT INC	5.875	2017/6/15	110	124	12,829		
WELLS FARGO & COMPANY	3.676	2016/6/15	70	74	7,664		
WELLS FARGO & COMPANY	2.1	2017/5/8	10	10	1,058		
WELLS FARGO & COMPANY	1.5	2018/1/16	30	29	3,072		

種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円
普通社債券(含む投資法人債券)	WELLS FARGO & COMPANY	3.45	2023/2/13	30	29	3,016
	WELLS FARGO & COMPANY	4.48	2024/1/16	289	299	30,864
	WELLS FARGO & COMPANY	5.375	2043/11/2	30	31	3,291
	WILLIAMS COS INC	7.875	2021/9/1	25	29	3,081
	WILLIAMS COS INC	7.5	2031/1/15	59	65	6,796
	WPP FINANCE (UK)	8.0	2014/9/15	120	123	12,770
	WYETH	5.95	2037/4/1	50	60	6,226
	XSTRATA FIN CAN	2.05	2015/10/23	40	40	4,173
	XSTRATA FIN CAN	2.7	2017/10/25	40	40	4,187
	ZOETIS INC	3.25	2023/2/1	20	19	1,999
	小計					5,968,695
(メキシコ)				千メキシコペソ	千メキシコペソ	
国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	8.0	2020/6/11	2,870	3,237	25,676
	MEXICAN BONOS DESARR FIX	6.5	2022/6/9	2,161	2,227	17,666
	小計					43,343
	合計					6,012,039

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

売付債券

種類	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%		千米ドル	千米ドル	千円
売建TBA	FNMA 30YR APR FWD	4.5	2044/4/1	400	427	44,130
	FNMA 30YR APR FWD	4.0	2044/4/1	500	520	53,744
	合計					97,875

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(4) 外国投資信託証券

	期 首	当 期 末		
		単 位 数	単 位 数	評 価 額
				外貨建金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
WA OPPORTUNISTIC US\$ HIGH YIELD LTD	—	3	884	91,287
合 計	—	3	884	91,287
	口 数 ・ 金 額	—	—	—
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	<1.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する投資信託証券評価額の比率。

(注3) 単位数、評価額の単位未満は切捨て。

(5) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外	債 券 先 物 取 引	百万円	百万円
	U S 5 Y R 1 4 0 6	319	—
	U S 2 Y R 1 4 0 6	—	226
	U S 1 0 Y R 1 4 0 6	—	255
	U S 2 0 Y R 1 4 0 6	178	—
国	U S U L 1 4 0 6	193	—
	金 利 先 物 取 引		
	9 0 D Y E U R 1 5 0 6	—	25
	9 0 E U R \$ 1 8 0 6	—	1,146
	9 0 E U R \$ 1 6 1 2	1,638	—

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注3) —印は組入れなし。

(6) オプションの銘柄別期末残高

銘 柄 別		コ ー ル ・ プ ッ ト 別	当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	債 券 オ プ シ ョ ン 取 引		百万円	百万円
	F V M 4 C 0 5 2 3	コール	0.002416	—
	T Y K 4 C 0 4 2 5	コール	—	0.04515
	U S K 4 C 0 4 2 5	コール	0.274126	0.07095
	U S M 4 C 0 5 2 3	コール	—	0.056438

(注1) 単位未満は切捨て。ただし、金額が単位未満の場合は小数で記載。

(注2) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

■ 投資信託財産の構成

2014年4月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
優 先 証 券	千円 55,791	% 0.7
公 社 債	6,012,039	72.0
投 資 証 券	91,287	1.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,186,507	26.2
投 資 信 託 財 産 総 額	8,345,624	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(6,347,021千円)の投資信託財産総額(8,345,624千円)に対する比率は76.1%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、4月7日における邦貨換算レートは、1米ドル=103.20円、1メキシコペソ=7.93円です。

■特定資産の価格等の調査

当ファンドにおいて行った取引の内、『投資信託及び投資法人に関する法律』により価格等の調査が必要とされた資産の取引については、新日本有限責任監査法人へ当該取引の銘柄、数量、内容に関する調査を委託しました。対象期間中（2013年4月9日から2014年4月7日まで）に該当した取引は、有価証券取引が8件あり、当該取引については、当該監査法人からの調査報告書を受領しております。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2014年4月7日
	円
(A) 資 産	8,377,127,114
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,155,674,757
優 先 証 券 (評 価 額)	55,791,726
公 社 債 (評 価 額)	6,012,039,100
投 資 証 券 (評 価 額)	91,287,389
コ ー ル ・ オ プ シ ョ ン (買)	276,544
未 取 入 金	797,757,826
未 取 利 息	31,402,447
前 払 費 用	1,126,481
差 入 委 託 証 拠 金	231,770,844
(B) 負 債	1,947,024,814
コ ー ル ・ オ プ シ ョ ン (売)	172,538
未 払 金	1,848,976,751
売 付 債 券	97,875,525
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	6,430,102,300
元 本	5,281,871,562
次 期 繰 越 損 益 金	1,148,230,738
(D) 受 益 権 総 口 数	5,281,871,562口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12.174円

<注記事項>

(注) 元本の状況

期首元本額	4,204,728,418円
期中追加設定元本額	2,061,082,902円
期中一部解約元本額	983,939,758円
期末における元本の内訳	
LM・米国債券コア・プラスFC (適格機関投資家専用)	634,416,336円
LM・米国債券コア・プラスFD (適格機関投資家専用)	3,041,785,290円
LM・米国債券コア・プラスF (適格機関投資家専用)	292,868,163円
LM・米国債券コア・プラスFVA (適格機関投資家専用)	1,312,801,773円

■損益の状況

項 目	当 期 自2013年4月9日 至2014年4月7日
	円
(A) 配 当 等 収 益	189,225,096
受 取 利 息	179,531,775
そ の 他 収 益 金	9,693,321
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	122,440,659
売 買 益	408,360,323
売 買 損	△ 285,919,664
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	49,535,857
取 引 益	97,208,024
取 引 損	△ 47,672,167
(D) 信 託 報 酬 等	△ 2,845,788
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	358,355,824
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	609,128,529
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	329,543,899
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 148,797,514
(I) 計 (E + F + G + H)	1,148,230,738
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	1,148,230,738

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

ノムラーAMP豪州債券ファンドFD(適格機関投資家専用)

第93期～第98期(2014年6月10日～2014年12月8日)

○当ファンドの仕組み

商品分類	-		
信託期間	2006年9月14日以降、無期限とします。		
運用方針	ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主としてオーストラリアドル建ての公社債(国債、政府機関債、準政府債(州政府債)、国際機関債、社債等)を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行うことを基本とします。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。		
主な投資対象	ノムラーAMP豪州債券ファンドFD	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。	
	マザーファンド	オーストラリアドル建ての公社債を主要投資対象とします。	
主な投資制限	ノムラーAMP豪州債券ファンドFD	外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。	
	マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。	
分配方針	毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。		

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク			債組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税金	期騰落	ブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックス(円換算ベース)	期騰落	中率			
	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
69期(2012年7月9日)	8,896	35	3.8	139.09	3.7	93.1	93.1	△3.2	11,030
70期(2012年8月7日)	9,013	36	1.7	142.06	2.1	92.1	92.1	10.9	10,382
71期(2012年9月7日)	8,977	38	0.0	140.73	△0.9	92.7	92.7	29.5	9,846
72期(2012年10月9日)	8,940	34	△0.0	140.16	△0.4	92.4	92.4	14.4	9,907
73期(2012年11月7日)	9,296	35	4.4	145.76	4.0	93.3	93.3	12.4	10,328
74期(2012年12月7日)	9,628	38	4.0	151.62	4.0	92.6	92.6	27.4	10,520
75期(2013年1月7日)	10,208	38	6.4	160.89	6.1	93.9	93.9	48.9	10,927
76期(2013年2月7日)	10,667	43	4.9	168.29	4.6	91.6	91.6	51.6	11,511
77期(2013年3月7日)	10,665	37	0.3	168.78	0.3	90.0	90.0	19.6	11,502
78期(2013年4月8日)	11,329	42	6.6	179.84	6.6	93.1	93.1	25.6	11,984
79期(2013年5月7日)	11,394	35	0.9	181.21	0.8	91.7	91.7	36.4	11,733
80期(2013年6月7日)	10,454	42	△7.9	165.95	△8.4	89.7	89.7	17.4	10,877
81期(2013年7月8日)	10,139	36	△2.7	161.28	△2.8	93.3	93.3	32.4	10,568
82期(2013年8月7日)	9,772	36	△3.3	155.45	△3.6	91.8	91.8	15.1	10,439
83期(2013年9月9日)	10,059	37	3.3	160.46	3.2	93.5	93.5	18.5	10,778
84期(2013年10月7日)	10,179	32	1.5	162.83	1.5	95.0	95.0	14.9	10,754
85期(2013年11月7日)	10,313	42	1.7	165.41	1.6	93.6	93.6	14.4	10,706
86期(2013年12月9日)	10,345	38	0.7	166.09	0.4	93.8	93.8	10.3	10,488
87期(2014年1月7日)	10,317	38	0.1	166.14	0.0	94.4	94.4	15.0	10,312
88期(2014年2月7日)	10,178	38	△1.0	164.67	△0.9	93.8	93.8	20.2	10,214
89期(2014年3月7日)	10,436	35	2.9	169.27	2.8	93.7	93.7	15.9	10,518
90期(2014年4月7日)	10,676	38	2.7	173.60	2.6	92.4	92.4	10.3	10,534
91期(2014年5月7日)	10,690	33	0.4	174.46	0.5	93.8	93.8	20.0	10,107
92期(2014年6月9日)	10,822	40	1.6	177.14	1.5	94.8	94.8	17.1	10,041
93期(2014年7月7日)	10,877	33	0.8	178.62	0.8	93.6	93.6	15.1	9,901
94期(2014年8月7日)	10,855	40	0.2	179.05	0.2	89.6	89.6	11.3	9,800
95期(2014年9月8日)	11,192	32	3.4	185.37	3.5	89.6	89.6	9.7	12,232
96期(2014年10月7日)	10,870	31	△2.6	180.36	△2.7	92.6	92.6	18.9	14,357
97期(2014年11月7日)	11,273	37	4.0	188.24	4.4	94.5	94.5	15.4	15,482
98期(2014年12月8日)	11,642	37	3.6	195.46	3.8	94.9	94.9	14.3	15,491

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

* ベンチマーク(=ブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックス*(円換算ベース))は、Bloomberg AusBond Composite 0+ Yr Index(オーストラリアドルベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日直前の指数値を営業日直前のオーストラリアドル為替レート(対顧客電信売相場仲値)で円換算しております。設定時を100として指数化しています。

* ブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックス(Bloomberg AusBond Composite 0+ Yr Index)は、国債、準政府債(州政府債)、社債及びアセットバック証券等で構成されており、オーストラリア債券市場において発行された全ての満期固定利付債券を対象としています。当指数は、オーストラリア債券運用のベンチマークとして広く使われています。

* 名称変更しております(旧名称はUBSオーストラリア債券インデックス)。

(出所)ブルームバーグ

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		ベンチ マ ー ク		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
第93期	(期 首) 2014年6月9日	円 10,822	% —	ブルームバーグ オーストラリア債券 (総合)インデックス (円換算ベース) 177.14	% —	% 94.8	% 17.1
	6月末	10,893	0.7	178.54	0.8	94.1	13.4
	(期 末) 2014年7月7日	10,910	0.8	178.62	0.8	93.6	15.1
第94期	(期 首) 2014年7月7日	10,877	—	178.62	—	93.6	15.1
	7月末	10,968	0.8	180.33	1.0	91.4	13.5
	(期 末) 2014年8月7日	10,895	0.2	179.05	0.2	89.6	11.3
第95期	(期 首) 2014年8月7日	10,855	—	179.05	—	89.6	11.3
	8月末	11,112	2.4	183.58	2.5	92.8	8.9
	(期 末) 2014年9月8日	11,224	3.4	185.37	3.5	89.6	9.7
第96期	(期 首) 2014年9月8日	11,192	—	185.37	—	89.6	9.7
	9月末	10,847	△3.1	179.55	△3.1	89.5	15.6
	(期 末) 2014年10月7日	10,901	△2.6	180.36	△2.7	92.6	18.9
第97期	(期 首) 2014年10月7日	10,870	—	180.36	—	92.6	18.9
	10月末	11,043	1.6	183.52	1.8	93.1	15.3
	(期 末) 2014年11月7日	11,310	4.0	188.24	4.4	94.5	15.4
第98期	(期 首) 2014年11月7日	11,273	—	188.24	—	94.5	15.4
	11月末	11,581	2.7	193.75	2.9	94.9	14.9
	(期 末) 2014年12月8日	11,679	3.6	195.46	3.8	94.9	14.3

*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当作成期の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

当作成期の基準価額の騰落率は+9.6%(分配金を再投資して算出)となり、ベンチマークの+10.3%を0.7ポイント下回りました。基準価額の主な変動要因は、当作成期を通じて、利息収入や投資していた債券の価格変動などが挙げられます。また、豪ドルが対円で上昇したことなども基準価額変動要因となりました。主な差異の要因は[ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド]において、金利低下(債券価格上昇)局面でデュレーション(金利感応度)を短期化していたことなどでした。

【運用経過】

主要投資対象の[ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド]受益証券を概ね高位に組み入れました。保有する実質的な外貨建て資産の持分について、為替ヘッジは行いませんでした。

[ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド]の運用については、オーストラリアドル建ての公社債(国債、政府機関債、準政府債(州政府債)、国際機関債、社債等)を高位に組み入れました。信用格付別構成では、AAA格、A格の銘柄を中心に組み入れを行いました。

【分配金】

配当等収益等から、1口当たり第93期33円、第94期40円、第95期32円、第96期31円、第97期37円、第98期37円の収益分配を行いました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】

主要投資対象である[ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド]受益証券を高位に組み入れます。実質的な外貨建て資産の持分について、為替ヘッジは行いません。

[ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド]の運用については、オーストラリアドル建ての公社債を高位に組み入れます。公社債への投資にあたっては、ポートフォリオの効率的なリスク配分(=リスク・バジェット)を決定し、付加価値の源泉の分散を図り、マクロ経済分析および個別発行体の信用リスク分析等に基づき、デュレーション、イールドカーブ戦略、セクター配分(種別の配分)、個別銘柄選定等をアクティブに決定・変更し、収益の獲得を目指します。

(2014年6月10日～2014年12月8日)

○ 1口当たりの費用明細

項 目	第93期～第98期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 33	% 0.296	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(27)	(0.242)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(3)	(0.027)	口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.005	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(1)	(0.005)	
(c) そ の 他 費 用	2	0.015	(c) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	36	0.316	
作成期間の平均基準価額は、11,074円です。			

*作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

*各比率は1口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年6月10日～2014年12月8日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第93期～第98期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
ノムラーAMP豪州債券ファンド	マザーファンド	2,889,346	5,599,000	741,063	1,460,000

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2014年6月10日～2014年12月8日)

利害関係人との取引状況

<ノムラーAMP豪州債券ファンドFD(適格機関投資家専用)>
該当事項はございません。

<ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド>

区 分	第93期～第98期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,570	百万円 —	% —	百万円 1,040	百万円 371	% 35.7

平均保有割合 94.9%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2014年12月8日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第92期末	第98期末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
ノムラーAMP豪州債券ファンド	マザーファンド	5,277,524	7,425,807	15,398,154

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2014年12月8日現在)

項 目	第98期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド	15,398,154	98.5
コール・ローン等、その他	228,789	1.5
投資信託財産総額	15,626,943	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンドにおいて、第98期末における外貨建て純資産(16,275,354千円)の投資信託財産総額(16,454,208千円)に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、第98期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1豪ドル=101.00円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第93期末	第94期末	第95期末	第96期末	第97期末	第98期末
	2014年7月7日現在	2014年8月7日現在	2014年9月8日現在	2014年10月7日現在	2014年11月7日現在	2014年12月8日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	10,026,823,174	9,841,672,021	12,273,139,351	14,404,367,829	15,626,267,521	15,626,943,067
コール・ローン等	97,440,158	98,361,419	123,046,100	143,549,767	164,496,011	154,788,653
ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド(評価額)	9,793,982,837	9,699,410,419	12,104,493,025	14,204,717,812	15,393,071,218	15,398,154,168
未収入金	135,400,000	43,900,000	45,600,000	56,100,000	68,700,000	74,000,000
未収利息	179	183	226	250	292	246
(B) 負債	125,220,377	41,049,628	40,625,516	47,352,128	144,248,934	135,302,746
未払収益分配金	30,039,636	36,113,840	34,974,496	40,943,281	50,813,284	49,232,940
未払解約金	90,602,834	—	—	—	85,956,908	78,222,205
未払信託報酬	4,561,330	4,917,915	5,630,557	6,385,636	7,451,657	7,819,177
その他未払費用	16,577	17,873	20,463	23,211	27,085	28,424
(C) 純資産総額(A-B)	9,901,602,797	9,800,622,393	12,232,513,835	14,357,015,701	15,482,018,587	15,491,640,321
元本	9,102,920,000	9,028,460,000	10,929,530,000	13,207,510,000	13,733,320,000	13,306,200,000
次期繰越損益金	798,682,797	772,162,393	1,302,983,835	1,149,505,701	1,748,698,587	2,185,440,321
(D) 受益権総口数	910,292口	902,846口	1,092,953口	1,320,751口	1,373,332口	1,330,620口
1口当たり基準価額(C/D)	10,877円	10,855円	11,192円	10,870円	11,273円	11,642円

(注)第93期首元本額9,278百万円、第93～第98期中追加設定元本額5,204百万円、第93～第98期中一部解約元本額1,177百万円、第98期末計算口数当たり純資産額11,642円。

(注)投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額14,875,120円。(ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド)

○損益の状況

項 目	第93期	第94期	第95期	第96期	第97期	第98期
	2014年6月10日～ 2014年7月7日	2014年7月8日～ 2014年8月7日	2014年8月8日～ 2014年9月8日	2014年9月9日～ 2014年10月7日	2014年10月8日～ 2014年11月7日	2014年11月8日～ 2014年12月8日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	5,273	5,946	6,862	7,108	8,307	8,607
受取利息	5,273	5,946	6,862	7,108	8,307	8,607
(B) 有価証券売買損益	84,721,533	19,839,342	374,682,606	△ 338,575,213	613,572,537	543,406,376
売買益	86,540,944	21,126,892	374,682,606	—	616,753,406	554,217,751
売買損	△ 1,819,411	△ 1,287,550	—	△ 338,575,213	△ 3,180,869	△ 10,811,375
(C) 信託報酬等	△ 4,577,907	△ 4,935,788	△ 5,651,020	△ 6,408,847	△ 7,478,742	△ 7,847,601
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	80,148,899	14,909,500	369,038,448	△ 344,976,952	606,102,102	535,567,382
(E) 前期繰越損益金	1,869,289,454	1,851,864,129	1,830,659,789	2,164,723,741	1,769,052,649	2,229,937,698
(F) 追加信託差損益金	△1,120,715,920	△1,058,497,396	△ 861,739,906	△ 629,297,807	△ 575,642,880	△ 530,831,819
(配当等相当額)	(259,054,357)	(322,380,354)	(879,620,611)	(1,554,626,320)	(1,728,659,281)	(1,699,617,404)
(売買損益相当額)	(△1,379,770,277)	(△1,380,877,750)	(△1,741,360,517)	(△2,183,924,127)	(△2,304,302,161)	(△2,230,449,223)
(G) 計(D+E+F)	828,722,433	808,276,233	1,337,958,331	1,190,448,982	1,799,511,871	2,234,673,261
(H) 収益分配金	△ 30,039,636	△ 36,113,840	△ 34,974,496	△ 40,943,281	△ 50,813,284	△ 49,232,940
次期繰越損益金(G+H)	798,682,797	772,162,393	1,302,983,835	1,149,505,701	1,748,698,587	2,185,440,321
追加信託差損益金	△1,120,715,920	△1,058,497,396	△ 861,739,906	△ 629,297,807	△ 575,642,880	△ 530,831,819
(配当等相当額)	(259,151,734)	(322,767,360)	(884,154,445)	(1,560,685,994)	(1,730,697,663)	(1,700,002,202)
(売買損益相当額)	(△1,379,867,654)	(△1,381,264,756)	(△1,745,894,351)	(△2,189,983,801)	(△2,306,340,543)	(△2,230,834,021)
分配準備積立金	2,404,985,759	2,321,810,289	2,332,705,864	2,334,837,719	2,332,563,409	2,716,272,140
繰越損益金	△ 485,587,042	△ 491,150,500	△ 167,982,123	△ 556,034,211	△ 8,221,942	—

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド

第8期(計算期間：2013年6月8日～2014年6月9日)

◎当期の運用経過

- ・基準価額は当作成期初の17,328円から当作成期末には18,844円に上昇し、騰落率は+8.7%となりました。ベンチマーク対比では、相対的に利回りの高い社債を多めに組入れたことなどから、ベンチマークの+6.7%を2.0ポイント上回りました。
- ・主要投資対象であるオーストラリアドル建ての公社債(先物を含まない)の組み入れ比率は概ね高位を維持しました。
- ・信用格付け別組入比率はAAA格、AA格、A格、BBB格の順に、当作成期初は23%、13%、30%、24%程度、当作成期末は22%、15%、34%、23%程度となりました。
- ・種別組入比率は国債・政府機関債等、州政府債等、社債等、アセットバック証券の順に、当作成期初は7%、20%、60%、4%程度、当作成期末は9%、18%、65%、3%程度となりました。

◎今後の運用方針

オーストラリアドル建ての公社債を高位に組み入れます。公社債への投資にあたっては、ポートフォリオの効率的なリスク配分(=リスク・バジェットティング)を決定し、付加価値の源泉の分散を図り、マクロ経済分析および個別発行体の信用リスク分析等に基づき、デュレーション、イールドカーブ戦略、セクター配分(種別の配分)、個別銘柄選定等をアクティブに決定・変更し、収益の獲得を目指します。

*ベンチマーク(=UBSオーストラリア債券インデックス(円換算ベース))はUBS Australian All Maturities Composite Bond Index(オーストラリアドルベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日のオーストラリアドル為替レート(対顧客電信売相場仲値)で円換算しております。

*UBSオーストラリア債券インデックス(UBS Australian All Maturities Composite Bond Index)は、国債、準政府債(州政府債)、社債及びアセットバック証券等で構成されており、オーストラリア債券市場において発行された全ての満期固定利付き債券を対象としています。当指数は、オーストラリア債券運用のベンチマークとして広く使われています。

UBSオーストラリア債券インデックスは、UBS AGが管理・公表しています。UBSオーストラリア債券インデックスに関する一切の知的財産権その他一切の権利はUBS AGに帰属しております。

(出所)ブルームバーグ、UBS

◎1万口当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	2円 (2)
(b) 保管費用等	5
合 計	7

* (a) 売買委託手数料、(b) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◎期中の売買及び取引の状況(自2013年6月8日 至2014年6月9日)

(1) 公社債

		買付額	売付額
外 国	オーストラリア	千豪ドル	千豪ドル
	国債証券	16,547	15,942
	特殊債券	6,266	9,424
	社債券(投資法人債券を含む)	18,503	7,437
			(11,245)

* 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

* 単位未満は切り捨て。

* ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

* 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引	16,725	16,798	2,075	1,992

* 単位未満は切り捨て。

* 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

◎組入資産の明細

(1) 外国(外貨建)公社債

区 分	期 首					当 期					期 末				
	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率				
			5年以上	2年以上	2年未満		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満		
オーストラリア	%	—	%	%	%	千豪ドル	千豪ドル	千円	%	—	%	%	%		
	90.6	—	38.5	37.3	14.8	97,738	103,218	9,885,221	95.7	—	46.4	26.1	23.2		
合 計	90.6	—	38.5	37.3	14.8	97,738	103,218	9,885,221	95.7	—	46.4	26.1	23.2		

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 一印は組み入れなし。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

外国(外貨建)公社債銘柄別

種類	銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)			%	千豪ドル	千豪ドル	千円
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	600	617	59,119	2015/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6.0	1,500	1,623	155,477	2017/2/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	850	884	84,676	2017/7/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.25	500	546	52,311	2019/3/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	500	531	50,863	2020/4/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	1,950	2,222	212,878	2021/5/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,050	947	90,769	2029/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	700	717	68,725	2033/4/21
特殊債券(除く金融債)	AIRSERVICES AUSTRALIA	4.75	500	513	49,158	2020/11/19
	AUSTRALIAN POSTAL CORP	5.0	800	828	79,377	2020/11/13
	NEW S WALES TREASURY CRP	6.0	500	563	53,997	2020/5/1
	NEW S WALES TREASURY CRP	6.0	2,080	2,378	227,826	2022/3/1
	NORTHERN TERRITORY TREAS	4.25	500	508	48,711	2021/9/20
	QUEENSLAND TREASURY CORP	4.0	1,100	1,127	107,980	2019/6/21
	QUEENSLAND TREASURY CORP	6.0	4,960	5,651	541,213	2022/7/21
	TREASURY CORP VICTORIA	6.0	280	321	30,797	2022/10/17
	TREASURY CORP VICTORIA	5.5	5,800	6,464	619,122	2024/12/17
	WESTERN AUST TREAS CORP	7.0	1,500	1,793	171,753	2021/7/15
	WESTERN AUST TREAS CORP	5.0	750	795	76,219	2025/7/23
普通社債券(含む投資法人債券)	ABB FINANCE AUSTRALIA	4.25	500	520	49,886	2017/11/22
	ADANI ABBOT POINT TERMIN	5.75	1,000	1,002	95,999	2018/11/1
	AIRPORT MOTORWAY TRUST	5.5	500	517	49,516	2020/12/9
	ANGLO AMERICAN CAPITAL	5.75	1,000	1,037	99,323	2018/11/27
	ANZ WEALTH AUST LTD	4.005	600	601	57,645	2016/3/22
	APT PIPELINES LTD	7.75	1,700	1,909	182,867	2020/7/22
	AURIZON NETWORK PTY LTD	5.75	1,000	1,033	99,007	2020/10/28
	AUST & NZ BANKING GROUP	4.865	500	512	49,077	2023/6/19
	AUST & NZ BANKING GROUP	5.0	1,500	1,544	147,894	2023/8/16
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.0	800	805	77,183	2019/11/7
	BARCLAYS BANK PLC/AUST	6.75	1,000	1,040	99,664	2015/8/17
	BNP PARIBAS AUSTRALIA	4.5	500	509	48,828	2017/10/4
	BNP PARIBAS AUSTRALIA	4.75	1,300	1,329	127,302	2018/2/1
	BP CAPITAL MARKETS PLC	4.75	1,100	1,123	107,638	2018/11/15
	BPCE SA	4.5	500	501	48,033	2018/4/17
	BRISBANE AIRPORT CORP	2.9033	500	485	46,521	2016/7/1
	BRISBANE AIRPORT CORP LT	8.0	800	922	88,300	2019/7/9

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	BWP TRUST	4.5	500	500	47,949	2019/5/27
	CATERPILLAR FIN AUSTRALI	4.75	1,900	1,956	187,349	2017/5/31
	CIE FINANCEMENT FONCIER	5.5	1,300	1,334	127,825	2015/9/22
	CIVIC NEXUS FINANCE LTD	6.5	1,500	1,507	144,332	2014/9/15
	COMMONWEALTH BANK AUST	7.25	500	574	55,027	2020/2/5
	CONNECTEAST FINANCE PTY	5.75	1,000	1,036	99,312	2020/9/2
	DBNGP FINANCE CO PTY	8.25	2,200	2,311	221,357	2015/9/29
	DEXIA MUNICIPAL AGENCY	5.75	1,300	1,329	127,333	2015/8/24
	DEXUS FINANCE PTY LTD	8.75	800	895	85,741	2017/4/21
	DOWNER GROUP FINANCE PTY	5.75	500	512	49,086	2018/11/29
	ELM BV (SWISS REIN CO)	3.89	900	868	83,130	2049/4/29
	ETSA UTILITIES FINANCE	6.25	700	743	71,168	2017/9/7
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	4.5	1,100	1,126	107,864	2018/1/30
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5.5	500	524	50,238	2022/8/8
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	7.75	1,000	1,090	104,465	2016/11/23
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.0	800	815	78,094	2019/8/21
	GOODMAN AUSTRALIA INDUST	7.75	1,800	1,918	183,692	2016/5/19
	ICPF FINANCE PTY LTD	6.75	1,600	1,678	160,725	2016/6/3
	IDOL TRUST	-	500	500	47,885	2045/6/17
	ING BANK NV/SYDNEY	5.0	1,100	1,130	108,222	2018/11/27
	LEIGHTON FINANCE	9.5	1,900	1,912	183,191	2014/7/28
	LLOYDS TSB BANK PLC-AU	7.5	1,900	1,997	191,270	2015/10/2
	MACQUARIE UNIVERSITY	6.75	700	782	74,965	2020/9/9
	MIRVAC GROUP FINANCE LTD	8.0	1,000	1,077	103,192	2016/9/16
	MIRVAC GROUP FUNDING LTD	8.25	800	827	79,259	2015/3/15
	NATIONAL CAPITL TRST III	3.645	1,500	1,455	139,345	2049/1/29
	NATIONAL WEALTH MANAGEME	6.75	400	413	39,591	2026/6/16
	NEW TERMINAL FINANCING C	5.195	2,000	2,029	194,348	2015/9/15
	PERTH AIRPORT PTY LTD	5.5	500	516	49,441	2021/3/25
	POWERCOR AUSTRALIA LLC	3.0717	2,000	1,976	189,332	2015/11/15
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.0	1,000	1,020	97,693	2017/7/27
	RABOBANK NEDERLAND	6.5	1,500	1,545	147,964	2015/4/20
RESIMAC	-	1,000	1,000	95,770	2043/6/7	
SGSP AUSTRALIA ASSETS	5.5	800	818	78,342	2021/3/12	
SMHL 2009-2 A	4.1467	485	489	46,884	2041/9/9	
SMHL 2009-3 A1	4.0583	622	628	60,174	2040/11/7	
SMHL 2010-1 A	3.9967	545	550	52,679	2041/3/9	

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	SPI ELECTRICITY & GAS	7.5	1,900	2,080	199,249	2017/9/25
	STOCKLAND TRUST	5.5	500	516	49,477	2019/9/6
	STOCKLAND TRUST MANAGEME	8.5	1,000	1,030	98,695	2015/2/18
	SYDNEY AIRPORT FINANCE	8.0	1,300	1,358	130,109	2015/7/6
	TELSTRA CORP LTD	7.75	1,400	1,650	158,104	2020/7/15
	TORR 2009-3 A	4.0217	564	572	54,782	2041/1/14
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	4.25	500	506	48,478	2019/5/15
	TRANSPOWER NEW ZEALAND L	5.75	900	950	91,045	2023/8/28
	UNIV OF SYDNEY	4.75	500	506	48,531	2021/4/16
	VERO INSURANCE LTD	6.75	500	516	49,451	2026/10/6
	VOLKSWAGEN FIN SERV AUST	5.0	1,000	1,042	99,868	2017/6/27
	VOLKSWAGEN FIN SERV AUST	4.25	800	814	78,041	2018/4/4
	WELLS FARGO & COMPANY	4.25	1,100	1,113	106,653	2018/1/25
	WELLS FARGO & COMPANY	5.25	500	514	49,268	2022/9/7
	WESFARMERS LTD	6.0	1,000	1,056	101,133	2016/11/4
	WESFARMERS LTD	6.25	800	872	83,542	2019/3/28
	WESTPAC BANKING CORP	7.25	500	572	54,859	2020/2/11
WESTPAC BANKING CORP	5.25	600	628	60,202	2023/11/21	
WOOLWORTHS LIMITED	6.0	1,000	1,083	103,800	2019/3/21	
合 計			-	-	9,885,221	-

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	期首評価額		当期末評価額	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引				
A U 0 3 Y R	2,392	-	2,308	-
A U 1 0 Y R	-	478	-	521

* 単位未満は切り捨て。

* 邦貨換算金額は、期首、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* -印は組み入れなし。

◎投資信託財産の構成 (2014年6月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	9,885,221	93.9
コール・ローン等、その他	641,605	6.1
投資信託財産総額	10,526,826	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(10,281,896千円)の投資信託財産総額(10,526,826千円)に対する比率は97.7%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1豪ドル=95.77円。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2014年6月9日)現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	10,573,258,373
コール・ローン等	406,239,720
公社債(評価額)	9,885,221,910
未収入金	55,615,868
未収利息	128,859,765
前払費用	3,305,262
差入委託証拠金	94,015,848
(B) 負 債	244,935,000
未払金	191,535,000
未払解約金	53,400,000
(C) 純資産総額(A-B)	10,328,323,373
元 本	5,480,932,941
次期繰越損益金	4,847,390,432
(D) 受益権総口数	5,480,932,941口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,844円

◎損益の状況

(自2013年6月8日 至2014年6月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	601,405,618
受 取 利 息	598,096,393
そ の 他 収 益 金	3,309,225
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	275,832,338
売 買 益	428,016,351
売 買 損	△ 152,184,013
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	17,408,130
取 引 益	80,386,429
取 引 損	△ 62,978,299
(D) 信 託 報 酬 等	△ 3,027,395
(E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	891,618,691
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	4,613,517,449
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	321,975,525
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 979,721,233
(I) 計 (E+F+G+H)	4,847,390,432
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	4,847,390,432

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注)期首元本額6,295百万円、期中追加設定元本額439百万円、期中一部解約元本額1,254百万円、計算口数当たり純資産額18,844円。

(注)当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額、ノムラーAMP豪州債券ファンドFC(適格機関投資家専用)203百万円、ノムラーAMP豪州債券ファンドFD(適格機関投資家専用)5,277百万円。

メロン米国コア・プラス債券ファンドFD（適格機関投資家専用）

第78～83期（決算日：2014年10月7日）

■当ファンドの仕組み

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	無期限	
運用方針	主として「メロン米国コア・プラス債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」という場合があります。）受益証券への投資を通じ、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目標として運用を行うことを基本とします。	
主要運用対象	メロン米国コア・プラス債券ファンドFD（適格機関投資家専用）	メロン米国コア・プラス債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	メロン米国コア・プラス債券マザーファンド	主として米ドル建ての公社債、国際機関債および資産担保証券（ABS、MBS等）などに投資します。債券種別や業種毎の投資配分は、経済状況や市場動向を総合的に勘案して、機動的に変更します。
組入制限	メロン米国コア・プラス債券ファンドFD（適格機関投資家専用）	マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	メロン米国コア・プラス債券マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時（原則として毎月7日、休業日の場合は翌営業日）に、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			ベンチマーク パークレイズ・米国総合 インデックス（円換算ベース）		株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
		円 (分配)	円 税込み 分配金	期 中 騰落率 %	期 中 騰落率 %	期 中 騰落率 %					
第10 作成期	54期(2012年5月7日)	8,047	17	△1.1	252.43	△2.3	—	—	115.1	—	4,240
	55期(2012年6月7日)	7,965	23	△0.7	250.83	△0.6	—	—	117.2	—	4,109
	56期(2012年7月9日)	8,044	16	1.2	254.44	1.4	—	—	116.1	—	4,269
	57期(2012年8月7日)	7,964	17	△0.8	252.04	△0.9	—	—	119.5	△1.5	4,248
	58期(2012年9月7日)	8,025	19	1.0	254.08	0.8	—	—	122.7	△4.1	4,299
	59期(2012年10月9日)	8,034	16	0.3	253.87	△0.1	—	—	118.3	△6.9	4,185
第11 作成期	60期(2012年11月7日)	8,238	21	2.8	259.43	2.2	—	—	113.0	△1.4	4,233
	61期(2012年12月7日)	8,512	21	3.6	267.53	3.1	—	—	117.9	△11.2	4,247
	62期(2013年1月7日)	9,064	21	6.7	284.00	6.2	—	—	115.6	△10.5	4,461
	63期(2013年2月7日)	9,586	27	6.1	301.23	6.1	—	—	115.8	△10.8	4,682
	64期(2013年3月7日)	9,639	22	0.8	301.88	0.2	—	—	114.8	△6.2	4,705
	65期(2013年4月8日)	10,164	26	5.7	316.94	5.0	—	—	113.2	△6.3	4,896
第12 作成期	66期(2013年5月7日)	10,241	27	1.0	323.52	2.1	—	—	113.3	△5.4	4,948
	67期(2013年6月7日)	9,852	24	△3.6	315.96	△2.3	—	—	112.5	△6.3	4,744
	68期(2013年7月8日)	9,946	21	1.2	315.63	△0.1	—	—	109.5	—	4,869
	69期(2013年8月7日)	9,638	21	△2.9	308.51	△2.3	—	—	112.4	—	4,777
	70期(2013年9月9日)	9,727	20	1.1	308.82	0.1	—	—	113.7	—	4,948
	71期(2013年10月7日)	9,642	19	△0.7	308.58	△0.1	—	—	119.8	△2.7	5,030
第13 作成期	72期(2013年11月7日)	9,828	24	2.2	314.95	2.1	—	—	117.0	△10.9	5,273
	73期(2013年12月9日)	10,210	23	4.1	326.22	3.6	—	—	117.2	△11.2	5,924
	74期(2014年1月7日)	10,359	26	1.7	332.56	1.9	—	—	118.0	△12.0	6,139
	75期(2014年2月7日)	10,166	26	△1.6	327.88	△1.4	—	—	111.9	△1.7	6,833
	76期(2014年3月7日)	10,305	17	1.5	332.73	1.5	—	—	111.8	△3.7	7,856
	77期(2014年4月7日)	10,336	21	0.5	335.26	0.8	—	—	119.9	△3.2	8,185
第14 作成期	78期(2014年5月7日)	10,267	15	△0.5	332.09	△0.9	—	—	119.7	△2.0	8,575
	79期(2014年6月9日)	10,396	17	1.4	336.43	1.3	—	—	119.0	△9.1	9,772
	80期(2014年7月7日)	10,350	15	△0.3	335.04	△0.4	—	—	115.8	△1.8	11,188
	81期(2014年8月7日)	10,374	15	0.4	337.91	0.9	—	—	117.5	△2.5	13,679
	82期(2014年9月8日)	10,679	15	3.1	347.33	2.8	—	—	113.7	—	16,608
	83期(2014年10月7日)	11,065	19	3.8	362.65	4.4	—	—	118.9	△3.0	19,700

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率です。

(注4) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率です。

(注5) ベンチマーク（パークレイズ・米国総合インデックス（円換算ベース））は、基準価額算出基準を考慮し、基準日前日の指数を用いております。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク パークレイズ・米国総合 インデックス (円換算ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	債 券 先物比率
		円	騰落率	円	騰落率				
第78期	(期 首) 2014年 4月 7日	10,336	—	335.26	—	—	—	119.9	△3.2
	4月末	10,328	△0.1	333.51	△0.5	—	—	120.2	△3.1
	(期 末) 2014年 5月 7日	10,282	△0.5	332.09	△0.9	—	—	119.7	△2.0
第79期	(期 首) 2014年 5月 7日	10,267	—	332.09	—	—	—	119.7	△2.0
	5月末	10,358	0.9	334.93	0.9	—	—	120.1	△9.8
	(期 末) 2014年 6月 9日	10,413	1.4	336.43	1.3	—	—	119.0	△9.1
第80期	(期 首) 2014年 6月 9日	10,396	—	336.43	—	—	—	119.0	△9.1
	6月末	10,326	△0.7	334.10	△0.7	—	—	118.3	△2.5
	(期 末) 2014年 7月 7日	10,365	△0.3	335.04	△0.4	—	—	115.8	△1.8
第81期	(期 首) 2014年 7月 7日	10,350	—	335.04	—	—	—	115.8	△1.8
	7月末	10,443	0.9	338.34	1.0	—	—	117.2	△0.4
	(期 末) 2014年 8月 7日	10,389	0.4	337.91	0.9	—	—	117.5	△2.5
第82期	(期 首) 2014年 8月 7日	10,374	—	337.91	—	—	—	117.5	△2.5
	8月末	10,599	2.2	345.18	2.2	—	—	118.3	—
	(期 末) 2014年 9月 8日	10,694	3.1	347.33	2.8	—	—	113.7	—
第83期	(期 首) 2014年 9月 8日	10,679	—	347.33	—	—	—	113.7	—
	9月末	11,095	3.9	361.65	4.1	—	—	120.2	△3.7
	(期 末) 2014年10月 7日	11,084	3.8	362.65	4.4	—	—	118.9	△3.0

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率です。

(注4) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率です。

(注5) ベンチマーク (パークレイズ・米国総合インデックス (円換算ベース)) は、基準価額算出基準を考慮し、基準日前日の指数を用いております。

■ 当作成期の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

基準価額は、当作成期初の10,336円から当作成期末には11,065円となりました。期中の分配金(税込み)累計96円を加えて基準価額は825円上昇、期中騰落率は+7.98%となりました。

当作成期、米国景気が着実な景気拡大をみせた一方、ウクライナを巡るロシアと欧米との対立が強まったことや、中東において諸々の紛争が続いたことなどから投資家の警戒感が強まり、債券利回りは低下傾向が続きました。米国10年物国債利回りは前作成期末の2.72%から当作成期末には2.42%へ低下しました。一方、為替市場では米国景気が着実に拡大したことから当作成期を通じて米ドル高が進行し、当作成期初の103円台から当作成期末には108円台に到達しました。この状況下、基準価額は主に円安の影響を受けて大きく上昇しました。

【運用経過】

メロン米国コア・プラス債券マザーファンド受益証券を高位に組入れ、終始これを維持しました。

マザーファンドでは、国債とのスプレッド(利回り格差)を縮小させた社債セクターが堅調に推移したことがプラスに貢献しました。一方、債券利回りの上昇を予想してデュレーションを比較的短くしたことがマイナスの影響を及ぼしました。

【今後の運用方針】

今後も信託財産の中長期的成長を図ることを目標として、主にメロン米国コア・プラス債券マザーファンド受益証券への投資を行ってまいります。マザーファンドでは、運用の指図に関する権限をスタンディッシュ・メロン・アセット・マネジメントに委託します。米ドル建ての公社債、国際機関債、資産担保証券などの債券を主な投資対象とし、信用リスクにも配慮した投資を行います。

■ 1口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	第78期～第83期
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	24円 (19) (3) (2)
(b) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0 (0)
(c) 保管費用等	1
合 計	25

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 信託報酬＝平均基準価額×信託報酬率

(b) 売買委託手数料、(c) 保管費用等は、各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 売買委託手数料および保管費用等は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。また、保管費用等には監査報酬等が含まれております。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況（自 2014年4月8日 至 2014年10月7日）

決 算 期	第78期～第83期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
メロン米国コア・プラス債券マザーファンド	千口 7,320,938	千円 10,349,493	千口 74,197	千円 109,763

(注) 単位未満は切り捨てです。

■ 利害関係人との取引状況等（自 2014年4月8日 至 2014年10月7日）

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律（第11条第1項）に規定される利害関係人です。

■ 組入資産の明細

親投資信託残高

(2014年10月7日現在)

項 目	前作成期末（第77期末）		当作成期末（第83期末）	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
メロン米国コア・プラス債券マザーファンド	千口 5,932,595	千円 19,695,201	千口 13,179,336	千円 19,695,201

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

■ 投資信託財産の構成

(2014年10月7日現在)

項 目	当作成期末（第83期末）	
	評 価 額	比 率
メロン米国コア・プラス債券マザーファンド	千円 19,695,201	% 99.6
コー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	69,897	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	19,765,098	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てです。

(注2) メロン米国コア・プラス債券マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建て純資産（44,344,290千円）の投資信託財産総額（56,500,628千円）に対する比率は78.5%です。

(注3) 外貨建て資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは、1米ドル=108.94円、1メキシコペソ=8.13円、1ユーロ=137.59円です。

■ 特定資産の価格等の調査

当ファンドの主要投資対象であるメロン米国コア・プラス債券マザーファンドにおいて行った取引の内、投資信託及び投資法人に関する法律により価格等の調査が必要とされる資産の取引については、あらた監査法人へその調査を委託しました。

対象期間中（2013年10月8日～2014年10月7日）に該当した取引は、直物が替先渡取引（41件）であり、当該取引については、当該監査法人から調査報告書を受領しております。当該資産の特定取引に係る取引の計上日、取引相手先名、通貨の種類、売買、想定元本、期日、約定レート、契約額（USD）その他当該直物が替先渡取引の内容については、当社から提示した一定の関係書類と照合の結果、すべて一致しました。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2014年5月7日) (2014年6月9日) (2014年7月7日) (2014年8月7日) (2014年9月8日) (2014年10月7日)現在

項 目	第78期末	第79期末	第80期末	第81期末	第82期末	第83期末
(A) 資 産	8,599,161,549円	9,792,465,250円	11,208,722,536円	13,717,491,722円	16,637,923,999円	19,765,098,082円
コール・ローン等	26,674,820	22,500,000	21,627,876	42,655,038	33,100,000	—
メロン米国コア・プラス債券 マザーファンド(評価額)	8,572,486,715	9,769,965,238	11,187,094,649	13,674,836,661	16,604,823,981	19,695,201,073
未 収 入 金	—	—	—	—	—	69,897,009
未 収 利 息	14	12	11	23	18	—
(B) 負 債	24,112,089	19,689,795	20,018,207	37,521,411	29,462,449	64,724,017
未 払 収 益 分 配 金	12,527,745	15,981,564	16,216,230	19,780,140	23,329,725	33,827,011
未 払 解 約 金	8,474,820	—	227,876	13,055,038	—	24,297,009
未 払 信 託 報 酬	3,078,024	3,676,731	3,542,601	4,654,733	6,101,224	6,568,497
そ の 他 未 払 費 用	31,500	31,500	31,500	31,500	31,500	31,500
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	8,575,049,460	9,772,775,455	11,188,704,329	13,679,970,311	16,608,461,550	19,700,374,065
元 本	8,351,830,000	9,400,920,000	10,810,820,000	13,186,760,000	15,553,150,000	17,803,690,000
次 期 繰 越 損 益 金	223,219,460	371,855,455	377,884,329	493,210,311	1,055,311,550	1,896,684,065
(D) 受 益 権 総 口 数	835,183口	940,092口	1,081,082口	1,318,676口	1,555,315口	1,780,369口
1口当たり基準価額(C/D)	10,267円	10,396円	10,350円	10,374円	10,679円	11,065円

(注1) 当ファンドの第78期元本額は、919,010,000円、第78～83期中追加設定元本額は10,077,330,000円、第78～83期中一部解約元本額は192,650,000円です。
(注2) 1口当たり純資産額は、第78期10,267円、第79期10,396円、第80期10,350円、第81期10,374円、第82期10,679円、第83期11,065円です。

■損益の状況

第78期 自2014年4月8日 至2014年5月7日 第81期 自2014年7月8日 至2014年8月7日
第79期 自2014年5月8日 至2014年6月9日 第82期 自2014年8月8日 至2014年9月8日
第80期 自2014年6月10日 至2014年7月7日 第83期 自2014年9月9日 至2014年10月7日

項 目	第78期	第79期	第80期	第81期	第82期	第83期
(A) 受 当 等 収 益	127円	62円	58円	54円	132円	29円
配 取 利 息	127	62	58	54	132	29
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 40,336,304	131,270,822	△ 23,028,149	52,461,691	478,069,648	670,162,473
売 買 益	280,907	131,323,351	36,661	52,594,315	478,737,475	672,509,927
売 買 損	△ 40,617,211	△ 52,529	△ 23,064,810	△ 132,624	△ 667,827	△ 2,347,454
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,109,524	△ 3,708,231	△ 3,574,101	△ 4,686,233	△ 6,132,724	△ 6,599,997
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 43,445,701	127,562,653	△ 26,602,192	47,775,512	471,937,056	663,562,505
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	801,308,006	744,027,358	854,852,381	810,313,837	835,717,064	1,279,875,784
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 522,115,100	△ 483,752,992	△ 434,149,630	△ 345,098,898	△ 229,012,845	△ 12,927,213
(配当等相当額)	(732,835,026)	(928,062,759)	(1,198,017,874)	(1,654,091,034)	(2,111,698,109)	(2,612,962,230)
(売買損益相当額)	(△1,254,950,126)	(△1,411,815,751)	(△1,632,167,504)	(△1,999,189,932)	(△2,340,710,954)	(△2,625,889,443)
(G) 計 (D+E+F)	235,747,205	387,837,019	394,100,559	512,990,451	1,078,641,275	1,930,511,076
(H) 収 益 分 配 金	△ 12,527,745	△ 15,981,564	△ 16,216,230	△ 19,780,140	△ 23,329,725	△ 33,827,011
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	223,219,460	371,855,455	377,884,329	493,210,311	1,055,311,550	1,896,684,065
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 522,115,100	△ 483,752,992	△ 434,149,630	△ 345,098,898	△ 229,012,845	△ 12,927,213
(配当等相当額)	(733,740,325)	(929,532,290)	(1,200,534,981)	(1,658,204,264)	(2,116,431,008)	(2,617,386,359)
(売買損益相当額)	(△1,255,855,425)	(△1,413,285,282)	(△1,634,684,611)	(△2,003,303,162)	(△2,345,443,853)	(△2,630,313,572)
分 配 準 備 積 立 金	802,059,310	855,608,447	854,988,957	854,173,658	1,284,324,395	1,909,611,278
繰 越 損 益 金	△ 56,724,570	—	△ 42,954,998	△ 15,864,449	—	—

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額をいいます。
(注4) 第78期計算期末における費用控除後の配当等収益(13,279,049円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(733,740,325円)および分配準備積立金(801,308,006円)より分配対象収益は1,548,327,380円(1口当たり1,853円)であり、うち12,527,745円(1口当たり15円)を分配金額としております。
(注5) 第79期計算期末における費用控除後の配当等収益(16,440,183円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(54,497,208円)、信託約款に規定する収益調整金(929,532,290円)および分配準備積立金(800,652,620円)より分配対象収益は1,801,122,301円(1口当たり2,191円)であり、うち15,981,564円(1口当たり17円)を分配金額としております。
(注6) 第80期計算期末における費用控除後の配当等収益(16,352,806円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,200,534,981円)および分配準備積立金(854,852,381円)より分配対象収益は2,071,740,168円(1口当たり2,416円)であり、うち16,216,230円(1口当たり19円)を分配金額としております。
(注7) 第81期計算期末における費用控除後の配当等収益(20,775,956円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,658,204,264円)および分配準備積立金(853,177,942円)より分配対象収益は2,532,158,002円(1口当たり2,920円)であり、うち19,780,140円(1口当たり19円)を分配金額としております。
(注8) 第82期計算期末における費用控除後の配当等収益(24,343,606円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(431,778,056円)、信託約款に規定する収益調整金(2,116,431,008円)および分配準備積立金(851,532,450円)より分配対象収益は4,342,085,128円(1口当たり5,021円)であり、うち23,329,725円(1口当たり19円)を分配金額としております。
(注9) 第83期計算期末における費用控除後の配当等収益(35,290,894円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(628,271,611円)、信託約款に規定する収益調整金(2,617,386,359円)および分配準備積立金(1,279,875,784円)より分配対象収益は4,560,824,648円(1口当たり5,261円)であり、うち33,827,011円(1口当たり19円)を分配金額としております。
(注10) 信託財産の運用指図にかかる権限の全部又は一部を委託するために要する費用；
当ファンドに属するメロン米国コア・プラス債券マザーファンドの受益証券の時価総額に年0.15%の率を乗じて得た額

メロン米国コア・プラス債券マザーファンド 第7期（決算日：2014年10月7日）

■当期の運用経過

[運用経過]

当期は、国債とのスプレッド（利回り格差）を縮小させた社債セクターが堅調に推移したことがプラスに貢献しました。一方、債券利回りの上昇を予想してデュレーションを比較的短くしたことが若干マイナスの影響を及ぼしました。

■期中の売買及び取引の状況（自 2013年10月8日 至 2014年10月7日）

(1) 公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 761,086	千米ドル 479,642 (165,780)
		地方債証券	342	1,694
		特殊債証券	728,115	703,981 (2,140)
		社債券(投資法人債券を含む)	107,904	49,249 (2,328)
国	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 15,355	千メキシコペソ 14,404
		ブラジル	千ブラジルレアル 8,413	千ブラジルレアル 13,458
	ペルー	国債証券	千ペルーヌエボソル 3,314	千ペルーヌエボソル 3,019
		ユーロ	千ユーロ 1,098	千ユーロ 1,123
	イタリア	国債証券	1,098	1,123
		ポルトガル	1,821	2,018
	ロシア	国債証券	千ルーブル 37,414	千ルーブル 35,124
		南アフリカ	南アフリカランド 15,468	南アフリカランド 15,391

(注1) 金額は受け渡し代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨てです。

(注3) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外	債券先物取引	百万円 -	百万円 -	百万円 20,326	百万円 19,748

(注1) 単位未満は切り捨てです。

(注2) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(3) 先渡取引状況

種 類	当 期
	取引契約金額
直物為替先渡取引	百万円 5,860

■利害関係人との取引状況等（自 2013年10月8日 至 2014年10月7日）

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律（第11条第1項）に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

(1) 外国（外貨建）公社債

(2014年10月7日現在)

区 分	当 期				末			
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
	466,315	483,080	52,626,736	119.0	1.4	56.2	22.3	40.5
合 計	—	—	52,626,736	119.0	1.4	56.2	22.3	40.5

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 単位未満は切り捨てです。

(注4) ー印は組み入れなしです。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 外国（外貨建）公社債銘柄別

(2014年10月7日現在)

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	0.125% TSY IL IX N/B 4/1	0.125	12,340	12,833	1,398,051	2018/4/15
	0.125% TSY INF N/B 04/19	0.125	2,610	2,663	290,198	2019/4/15
	0.25% US TREASURY 12/15	0.25	61,719	61,755	6,727,640	2015/12/31
	1.5% US TREASURY 12/18	1.5	38,007	37,944	4,133,698	2018/12/31
	3.75% US TREASURY 11/43	3.75	13,350	14,972	1,631,142	2043/11/15
	5.125% REPUB PORTU 10/24	5.125	845	881	96,005	2024/10/15
	6.25% US TREASURY 05/30	6.25	1,195	1,723	187,789	2030/5/15
	7.125% REP OF KOREA 4/19	7.125	475	577	62,866	2019/4/16
	US TREASURY 2016-07	0.095001	97,990	98,044	10,680,923	2016/7/31
地方債証券	4.6% QUEBEC PROVINC 5/15	4.6	1,030	1,058	115,292	2015/5/26
	5.1% ILLINOIS ST 6/33	5.1	640	628	68,518	2033/6/1
	5.985% NEW YORK N 12/36	5.985	1,035	1,284	139,911	2036/12/1
	6.314% CHICAGO IL 1/44	6.314	250	258	28,113	2044/1/1
	7.3% CALIFORNIA ST 10/39	7.3	1,000	1,413	153,958	2039/10/1
特殊債券(除く金融債)	2.25% KOREA FINANCE 8/17	2.25	860	871	94,990	2017/8/7
	3% FNCL 10/14	3.0	9,370	9,301	1,013,325	2044/10/1
	3% FNCL 11/14	3.0	9,210	9,117	993,219	2044/11/1
	3.5% FNCL 10/14	3.5	8,200	8,428	918,236	2044/10/1
	3.5% FNCL 11/14	3.5	8,655	8,870	966,388	2044/11/1
	4% FGLMC 10/14	4.0	3,910	4,136	450,634	2044/10/1
	4% FNCL 10/14	4.0	5,685	6,029	656,888	2029/10/1
	4% FNCL 10/14	4.0	10,360	10,972	1,195,329	2044/10/1
	4% FNCL 11/14	4.0	5,090	5,374	585,537	2044/11/1
	4.5% FNCL 10/14	4.5	1,140	1,206	131,387	2029/10/1
	4.5% FNCL 10/14	4.5	8,645	9,359	1,019,630	2044/10/1
	4.5% G2SF 10/14	4.5	4,515	4,913	535,309	2044/10/1
	5% FG A93635	5.0	547	610	66,495	2040/9/1
	5% FG G01959	5.0	995	1,104	120,345	2035/12/1
	5% FG G12308	5.0	20	21	2,340	2020/12/1
	5% FN 845444	5.0	9	10	1,103	2021/3/1
	5% FN 963302	5.0	611	664	72,384	2023/5/1

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
特殊債券(除く金融債)	5% FN AD5170	5.0	205	229	25,052	2040/7/1
	5% FN AE1579	5.0	357	399	43,555	2040/9/1
	5% FNCL 10/14	5.0	2,015	2,229	242,916	2044/10/1
	5% FNCL 11/14	5.0	845	933	101,666	2044/11/1
	5.5% FG A92262	5.5	70	79	8,616	2040/5/1
	5.5% FG J06488	5.5	77	84	9,213	2022/12/1
	5.5% FN 735358	5.5	708	797	86,893	2035/2/1
	5.5% FN 889176	5.5	332	375	40,876	2038/3/1
	5.5% FN 965449	5.5	37	40	4,418	2022/11/1
	5.5% FN 966794	5.5	412	451	49,196	2023/2/1
	5.5% FN 967588	5.5	112	123	13,430	2022/12/1
	5.5% FN AD8281	5.5	93	105	11,529	2040/7/1
	5.5% FN AE1559	5.5	582	651	71,025	2040/8/1
	5.5% FNCL 11/14	5.5	2,945	3,280	357,417	2044/11/1
	5.5% PETROLEOS MEX 1/21	5.5	760	836	91,115	2021/1/21
	6% FN 948134	6.0	331	379	41,361	2037/11/1
	6% FN 956163	6.0	167	180	19,648	2022/10/1
	6% FN 956178	6.0	35	38	4,168	2022/10/1
	6% FN AA0616	6.0	92	105	11,471	2039/2/1
	普通社債券(含む投資法人債券)	6.25% HUNGARIAN DEV10/20	6.25	610	671	73,098
6.625% PEMEX MASTER 6/35		6.625	880	1,031	112,385	2035/6/15
10.2% ALTRIA GROUP 2/39		10.2	63	107	11,675	2039/2/6
2.19% AFIN 2013-1 D		2.19	425	424	46,233	2021/9/20
2.2% PNC BANK NA 01/19		2.2	350	351	38,278	2019/1/28
2.27% SDART 2013-1 D		2.27	550	551	60,102	2019/1/15
2.4751% JPMCC 2012-LC9 A		2.4751	395	393	42,891	2047/12/15
2.5% ABN AMRO BANK 10/18		2.5	2,715	2,741	298,614	2018/10/30
2.52% SDART 2012-6 D		2.52	760	771	84,059	2018/9/17
2.55% ROYAL BK SCO 9/15		2.55	715	725	79,020	2015/9/18
2.6% BANK OF AMER 1/19		2.6	2,195	2,208	240,587	2019/1/15
2.68% AMCAR 2012-4 D		2.68	655	663	72,244	2018/10/9
2.7% SDART 2012-5 C		2.7	1,130	1,154	125,748	2018/8/15
2.75% STAPLES INC 01/18		2.75	570	577	62,903	2018/1/12
2.76% SDART 2014-2 D		2.76	1,190	1,187	129,408	2020/2/18
2.81% AFIN 2014-2 D		2.81	2,150	2,140	233,202	2019/8/20
2.95% SPECTRA PARTN 9/18		2.95	245	252	27,538	2018/9/25
3% ARC PROP OPER LP 2/19		3.0	1,110	1,105	120,470	2019/2/6
3% NEWS AMER INC 9/22		3.0	595	584	63,670	2022/9/15
3.1% WALGREEN CO 9/22		3.1	540	527	57,508	2022/9/15
3.3% WELLPOINT INC 01/23	3.3	765	755	82,355	2023/1/15	
3.35% WILLIAMS PART 8/22	3.35	315	309	33,721	2022/8/15	
3.375% WM WRIGLEY 10/20	3.375	725	738	80,462	2020/10/21	
3.5% AON PLC 6/24	3.5	590	583	63,620	2024/6/14	
3.5% DOW CHEMICAL 10/24	3.5	2,070	2,045	222,783	2024/10/1	
3.625% MARATHON PET 9/24	3.625	2,040	2,018	219,852	2024/9/15	
3.667% WFRBS 2011-C5 A4	3.667	515	539	58,784	2044/11/15	
3.75% BANK OF AMER 7/16	3.75	355	370	40,368	2016/7/12	
3.75% BRITISH SKY BROADC	3.75	1,980	1,987	216,497	2024/9/16	
3.75% LORILLARD TOB 5/23	3.75	1,565	1,548	168,691	2023/5/20	
3.75% MORGAN STANLEY2/23	3.75	590	598	65,173	2023/2/25	
3.75% SABMILLER HL 01/22	3.75	1,985	2,039	222,197	2022/1/15	
3.75% SYN FINANCIAL 8/21	3.75	825	837	91,191	2021/8/15	

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	3.75% TALISMAN ENER 2/21	3.75	520	528	57,522	2021/2/1
	3.75% TRANS-CANADA 10/23	3.75	575	585	63,818	2023/10/16
	3.8% MORGAN STANLEY 4/16	3.8	520	541	58,990	2016/4/29
	3.8%TRANSOCEAN INC 10/22	3.8	940	867	94,463	2022/10/15
	3.85% ERAC USA FIN 11/24	3.85	120	120	13,163	2024/11/15
	3.875%CITIGROUP INC10/23	3.875	375	384	41,919	2023/10/25
	3.9017% ESA 2013-ESH7 C7	3.9017	2,400	2,439	265,811	2031/12/5
	3.9582% JPMCC2013-LC11 C	3.9582	1,190	1,174	127,986	2046/4/15
	4% 21st CENTURY FOX10/23	4.0	140	146	15,924	2023/10/1
	4% ALTRIA GROUP 1/24	4.0	175	180	19,631	2024/1/31
	4% HSBC 3/22	4.0	835	881	96,047	2022/3/30
	4% LYB INTL FIN 7/23	4.0	1,800	1,881	205,014	2023/7/15
	4%BANK OF AMER CRP 04/24	4.0	2,135	2,188	238,401	2024/4/1
	4.023% WFRBS 2013-C17 A4	4.023	875	925	100,794	2046/12/15
	4.0793% JPMBB2014-C18 A5	4.0793	1,215	1,286	140,152	2047/2/15
	4.1% ROGERS COMM 10/23	4.1	545	567	61,793	2023/10/1
	4.125% ANGLO AMERIC 4/21	4.125	225	227	24,822	2021/4/15
	4.25% ALTRIA GROUP 8/42	4.25	285	262	28,623	2042/8/9
	4.25% MOSAIC CO 11/23	4.25	750	788	85,889	2023/11/15
	4.25% PERNOD-RICARD 7/22	4.25	200	209	22,806	2022/7/15
	4.3% HEWLETT-PACK 6/21	4.3	215	228	24,844	2021/6/1
	4.35% JPMORGAN CHAS 8/21	4.35	2,275	2,447	266,658	2021/8/15
	4.3733% CSMC 09/14	4.3733	1,135	1,026	111,865	2037/9/15
	4.3733% CSMC 09/14	4.3733	1,050	1,031	112,337	2037/9/15
	4.375% HYUNDAI CAP 7/16	4.375	450	474	51,677	2016/7/27
	4.375% VALE OVERSEA 1/22	4.375	755	760	82,897	2022/1/11
	4.45% NISOURCE F 12/21	4.45	1,900	2,048	223,212	2021/12/1
	4.45% PERNOD-RICARD 1/22	4.45	1,155	1,229	133,971	2022/1/15
	4.5% ENSCO PLC 10/24	4.5	1,010	1,021	111,307	2024/10/1
	4.5% WILLIAMS PART 11/23	4.5	1,795	1,887	205,604	2023/11/15
	4.625% ALLY FINANC 6/15	4.625	625	639	69,619	2015/6/26
	4.65% CONAGRA INC 1/43	4.65	172	169	18,507	2043/1/25
4.72% AMCAR 2012-1 D	4.72	1,835	1,916	208,733	2018/3/8	
4.74% SDART 2011-4 D	4.74	550	574	62,568	2017/9/15	
4.75% ALTRIA GROUP 5/21	4.75	325	356	38,832	2021/5/5	
4.75% DEVELOPERS DI 4/18	4.75	1,000	1,080	117,705	2018/4/15	
4.75% SPECTRA PARTN 3/24	4.75	205	222	24,208	2024/3/15	
4.8% GENWORTH HLD 2/24	4.8	2,775	2,871	312,769	2024/2/15	
4.85% REYNOLDS AMER 9/23	4.85	1,480	1,585	172,750	2023/9/15	
4.875% COM FED ELEC 1/24	4.875	1,220	1,282	139,685	2024/1/15	
4.9% ENERGY TRAN P 2/24	4.9	2,180	2,292	249,724	2024/2/1	
5% CIT GROUP INC 05/17	5.0	300	313	34,111	2017/5/15	
5% FORD MOTOR CRED 5/18	5.0	1,195	1,310	142,766	2018/5/15	
5.05% AMCAR 2011-5 D	5.05	1,750	1,835	199,911	2017/12/8	
5.125% CHS/COMMUNITY 8/2	5.125	95	95	10,452	2021/8/1	
5.125% HARTFORD 4/22	5.125	675	756	82,429	2022/4/15	
5.125% HEALTHCARE 03/43	5.125	2,850	3,003	327,196	2043/3/15	
5.125% PACIFIC LIF 01/43	5.125	950	986	107,455	2043/1/30	
5.15% ENERGY TP 02/43	5.15	1,115	1,089	118,737	2043/2/1	
5.15% NBCUNIVERSAL 4/20	5.15	480	545	59,447	2020/4/30	
5.15% VERIZON COMM 09/23	5.15	930	1,038	113,176	2023/9/15	
5.2 DISCOVER FIN 04/22	5.2	1,604	1,765	192,287	2022/4/27	

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	5.25% GOLDMAN SACHS 7/21	5.25	2,200	2,454	267,373	2021/7/27
	5.25% REG 08/01/15	5.25	372	385	42,008	2015/8/1
	5.35% TIME WARNER 12/43	5.35	765	825	89,888	2043/12/15
	5.4% MYLAN INC 11/43	5.4	535	573	62,422	2043/11/29
	5.45% FREEPORT-MC 3/43	5.45	1,660	1,734	188,993	2043/3/15
	5.5% CITIGROUP INC 9/25	5.5	740	817	89,051	2025/9/13
	5.5% MORGAN STANLEY 7/21	5.5	655	741	80,777	2021/7/28
	5.625% XEROX CORP 12/19	5.625	490	555	60,537	2019/12/15
	5.65% NISOURCE F 2/45	5.65	1,730	2,015	219,574	2045/2/1
	5.7% BANK OF AMER 1/22	5.7	655	749	81,648	2022/1/24
	5.75% BANCO NAC DES09/23	5.75	1,420	1,512	164,749	2023/9/26
	5.75% PLAINS ALL 01/20	5.75	200	230	25,072	2020/1/15
	5.875% ECOPETROL 9/23	5.875	1,150	1,281	139,625	2023/9/18
	5.875% PRUDENTIAL F 9/42	5.875	625	658	71,747	2042/9/15
	6% DIGICEL GR 4/21	6.0	330	334	36,489	2021/4/15
	6% ENEL FINANCE 10/39	6.0	1,210	1,390	151,463	2039/10/7
	6% NUMERICABLEGROUP 5/22	6.0	200	205	22,359	2022/5/15
	6.125% CITIGROUP I 05/18	6.125	510	579	63,102	2018/5/15
	6.125% T-MOBILE USA 1/22	6.125	310	317	34,573	2022/1/15
	6.25% COX COMMUN INC0618	6.25	465	531	57,855	2018/6/1
	6.25% EXELON GENER 10/39	6.25	890	1,047	114,076	2039/10/1
	6.3% WILLIAMS PART 4/40	6.3	170	199	21,749	2040/4/15
	6.375% ANADARKO PE 9/17	6.375	480	542	59,152	2017/9/15
	6.375% TRANSOCEAN 12/21	6.375	1,320	1,413	153,941	2021/12/15
	6.4% COMCAST CORP 5/38	6.4	385	499	54,444	2038/5/15
	6.5% BIOMET INC 8/20	6.5	305	324	35,303	2020/8/1
	6.5% LIBERTY MUTUAL42/05	6.5	260	320	34,918	2042/5/1
	6.5% NEVADA POWER 08/18	6.5	415	485	52,887	2018/8/1
	6.5% SEMPRA ENERGY 6/16	6.5	470	512	55,851	2016/6/1
	6.55% VERIZON COMM 9/43	6.55	1,685	2,158	235,102	2043/9/15
	6.625% UNIT CORP 5/21	6.625	305	306	33,392	2021/5/15
	6.75% SIMON PROP G 02/40	6.75	180	242	26,402	2040/2/1
	6.8% PETRO-CANADA 5/38	6.8	1,730	2,315	252,294	2038/5/15
	6.875% CHS/COMMUNITY 2/2	6.875	90	95	10,417	2022/2/1
	6.875% OASIS PETROL 3/22	6.875	295	312	34,065	2022/3/15
	6.875% PLAINS EXPL 02/23	6.875	1,830	2,077	226,273	2023/2/15
	6.875% VALE LTD 11/36	6.875	2,200	2,501	272,461	2036/11/21
	6.9% AIG 03/32 144A	6.9	185	248	27,061	2032/3/15
	6.92% CINCINNATI FI 5/28	6.92	504	625	68,147	2028/5/15
	7% ERAC USA 10/15/37	7.0	645	852	92,922	2037/10/15
	7.2% GENWORTH FINL 02/21	7.2	205	242	26,406	2021/2/15
	7.25% INTELSAT JAC 4/19	7.25	295	310	33,784	2019/4/1
	7.375% WASTE MANAGE 5/29	7.375	505	673	73,392	2029/5/15
	7.375% WIND ACQUISTI 4/21	7.375	525	534	58,265	2021/4/23
	7.625% CLEAR CHNL W 3/20	7.625	300	315	34,397	2020/3/15
	7.7% GENWORTH FINL 06/20	7.7	305	367	40,088	2020/6/15
	7.75% EL PASO LLC 01/32	7.75	1,975	2,439	265,718	2032/1/15
	7.875% WEST CORP 1/19	7.875	118	122	13,385	2019/1/15
	8% AES CORP 6/20	8.0	275	314	34,302	2020/6/1
	8.125% EQT CORP 06/19	8.125	510	626	68,214	2019/6/1
	8.353% CVS PASS-THR 7/31	8.353	1,416	1,919	209,119	2031/7/10
	AMCAR 2013-1 D	2.09	810	810	88,325	2019/2/8

種類	銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	AMCAR 2014-1 D	2.54	1,050	1,035	112,791	2020/5/8
	AMERIPRISE FINL 06/66	7.518	750	817	89,058	2066/6/1
	AT&T INC 11/18	1.1484	1,010	1,027	111,954	2018/11/27
	BANK OF AMER CRP 1/19	1.2736	1,350	1,369	149,158	2019/1/15
	COMM 2007-C9 AAB	5.98882	263	264	28,866	2049/12/10
	COMM 2013-LC13 C	5.21657	385	414	45,163	2046/8/10
	COMM 2014-CR14 A4	4.236	1,020	1,095	119,397	2047/2/10
	COMM 2014-UBS2 AM	4.199	260	273	29,768	2047/3/10
	COMM 2014-UBS2 B	4.701	190	201	21,957	2047/3/10
	CRMSI 2007-2 A3	5.69579	32	32	3,587	2037/6/25
	DTAOT 2014-2A C	2.46	2,300	2,296	250,168	2020/1/15
	EART 2013-2A B	3.09	1,150	1,172	127,706	2018/7/16
	ENEL SPA 9/73	8.75	275	319	34,751	2073/9/24
	FNLC 2005-2 M1	0.6345	420	397	43,317	2035/9/25
	FORD MOTOR CRED 3/19	1.0646	4,045	4,060	442,384	2019/3/12
	GEN ELEC CAP CRP 1/19	0.7436	3,005	3,025	329,569	2019/1/14
	GOLDMAN SACHS 11/18	1.3336	1,365	1,387	151,154	2018/11/15
	GOLDMAN SACHS GP 11/23	1.8346	1,210	1,256	136,903	2023/11/29
	HILT 2013-HLT CFX	3.7141	1,110	1,132	123,362	2030/11/5
	JPMBB2013-C14 C	4.71325	1,200	1,237	134,796	2046/8/15
	UBSCM 2012-C1 A3 10/45	3.4	520	531	57,955	2045/5/10
	WFRBS 2012-C7 A2	3.431	1,070	1,099	119,769	2045/6/15
合計					52,626,736	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨てです。

(3) 先渡取引残高

種類	取引契約残高
	当期末想定元本額
直物為替先渡取引	628

百万円

■投資信託財産の構成

(2014年10月7日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
公 社 債	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	52,626,737	93.1
投 資 信 託 財 産 総 額	3,873,891	6.9
	56,500,628	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨てです。

(注2) 当期末における外貨建て純資産(44,344,290千円)の投資信託財産総額(56,500,628千円)に対する比率は78.5%です。

(注3) 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=108.94円、1メキシコペソ=8.13円、1ユーロ=137.59円です。

■特定資産の価格等の調査

当ファンドにおいて行った取引の内、投資信託及び投資法人に関する法律により価格等の調査が必要とされる資産の取引については、あらたに監査法人への調査を委託しました。

対象期間中(2013年10月8日~2014年10月7日)に該当した取引は、直物為替先渡取引(41件)であり、当該取引については、当該監査法人から調査報告書を受領しております。当該資産の特定取引に係る取引の計上日、取引相手先名、通貨の種類、売買、想定元本、期日、約定レート、契約額(USD)その他当該直物為替先渡取引の内容については、当社から提示した一定の関係書類と照合の結果、すべて一致しました。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2014年10月7日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	56,606,109,874円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	595,104,045
公 社 債 (評 価 額)	52,626,737,039
未 収 入 金	3,130,839,559
未 収 利 息	147,893,699
前 払 費 用	54,367,119
差 入 委 託 証 拠 金	51,168,413
(B) 負 債	12,372,712,436
未 払 金	12,245,928,979
未 払 解 約 金	126,783,457
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	44,233,397,438
元 本	29,599,434,261
次 期 繰 越 損 益 金	14,633,963,177
(D) 受 益 権 総 口 数	29,599,434,261口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	14,944円

- (注1) 当親投資信託の期首元本額は18,244,890,990円、期中追加設定元本額は15,241,890,797円、期中一部解約元本額は3,887,347,526円です。
- (注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額は、メロン米国コア・プラス債券ファンドF D (適格機関投資家専用) 13,179,336,907円、メロン米国コア・プラス債券ファンドF V A (適格機関投資家専用) 8,989,574,089円、メロン米国コア・プラス債券ファンドF C (適格機関投資家専用) 5,120,269,360円、メロン米国コア・プラス債券ファンドF (適格機関投資家専用) 2,310,253,905円です。
- (注3) また、1口当たり純資産額は14,944円です。

■損益の状況

(自 2013年10月8日 至 2014年10月7日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	813,163,198円
受 取 利 息	799,419,735
そ の 他 収 益 金	13,743,463
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,600,481,707
売 益	5,030,105,732
売 買 損	△ 429,624,025
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 22,210,208
取 引 損	△ 142,284,012
取 引 益	△ 164,494,220
(D) 信 託 報 酬 等	△ 4,217,893
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	5,387,216,804
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	4,863,432,250
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,998,804,054
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 1,615,489,931
(I) 計 (E + F + G + H)	14,633,963,177
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	14,633,963,177

- (注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注2) 損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注3) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
- (注4) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

ノムラインサイト欧州債券ファンドFD(適格機関投資家専用)

第74期～第79期(2014年6月10日～2014年12月8日)

○当ファンドの仕組み

商品分類	-	
信託期間	2008年4月10日以降、無期限とします。	
運用方針	ノムラインサイト欧州債券 マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として汎欧州通貨建ての公社債に投資し、インカムゲインの確保と信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	ノムラインサイト欧州債券ファンドFD	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	汎欧州通貨建ての公社債を主要投資対象とします。なお、汎欧州通貨建て以外の公社債へ投資する場合があります。
主な投資制限	ノムラインサイト欧州債券ファンドFD	外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額	
		税金	込	期	期	中				中
	円	分	金	騰	落	騰	落	率	率	
50期(2012年7月9日)	7,149		16		△1.1	77.65	△1.5	92.9	△26.2	3,131
51期(2012年8月8日)	7,238		16		1.5	78.31	0.8	90.3	△12.7	3,164
52期(2012年9月10日)	7,479		16		3.6	81.17	3.7	92.4	△11.9	3,226
53期(2012年10月9日)	7,613		16		2.0	82.71	1.9	87.5	5.1	3,274
54期(2012年11月8日)	7,724		16		1.7	83.99	1.5	91.5	4.7	3,237
55期(2012年12月10日)	8,116		16		5.3	88.26	5.1	93.3	0.9	3,353
56期(2013年1月8日)	8,718		15		7.6	94.71	7.3	91.5	3.8	3,487
57期(2013年2月8日)	9,364		21		7.7	102.28	8.0	92.1	9.5	3,787
58期(2013年3月8日)	9,319		17		△0.3	101.90	△0.4	91.6	△2.2	3,781
59期(2013年4月8日)	9,770		15		5.0	107.07	5.1	91.8	△33.7	3,968
60期(2013年5月8日)	9,956		21		2.1	108.96	1.8	91.6	△35.2	4,029
61期(2013年6月10日)	9,760		20		△1.8	107.14	△1.7	92.9	△3.1	3,958
62期(2013年7月8日)	9,674		17		△0.7	106.38	△0.7	92.4	12.8	3,965
63期(2013年8月8日)	9,671		22		0.2	106.34	△0.0	92.4	2.2	4,125
64期(2013年9月9日)	9,732		21		0.8	107.42	1.0	95.9	7.8	4,285
65期(2013年10月8日)	9,873		20		1.7	108.94	1.4	91.8	14.5	4,466
66期(2013年11月8日)	10,016		23		1.7	110.53	1.5	90.0	10.1	4,645
67期(2013年12月9日)	10,659		19		6.6	117.86	6.6	92.7	1.3	5,295
68期(2014年1月8日)	10,822		22		1.7	119.62	1.5	92.6	5.1	5,433
69期(2014年2月10日)	10,740		20		△0.6	118.77	△0.7	91.9	9.2	6,121
70期(2014年3月10日)	11,082		18		3.4	122.51	3.1	92.6	18.6	7,003
71期(2014年4月8日)	11,049		19		△0.1	122.10	△0.3	92.9	8.2	7,276
72期(2014年5月8日)	11,148		20		1.1	123.13	0.8	92.9	6.3	7,750
73期(2014年6月9日)	11,136		18		0.1	123.23	0.1	93.5	△10.5	8,892
74期(2014年7月8日)	11,077		18		△0.4	122.81	△0.3	91.0	△4.1	10,247
75期(2014年8月8日)	10,988		18		△0.6	122.28	△0.4	90.3	△5.4	13,108
76期(2014年9月8日)	11,119		18		1.4	123.82	1.3	91.9	3.8	16,936
77期(2014年10月8日)	11,219		21		1.1	125.31	1.2	92.7	△0.8	21,772
78期(2014年11月10日)	11,665		21		4.2	130.70	4.3	95.7	△4.3	26,989
79期(2014年12月8日)	12,331		15		5.8	138.33	5.8	94.1	△7.8	30,931

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*ベンチマーク(=パークレイズ・汎欧州総合インデックス(円換算ベース))は、パークレイズが公表する営業日前日のパークレイズ・汎欧州総合インデックス(欧州通貨ベース)を営業日当日の欧州通貨レート(対顧客電売買相場仲値)で当社が独自に円換算したものです。なお、設定時=100として指数化しています。

*パークレイズ・汎欧州総合インデックスは、パークレイズ・バンク・ビーエルシーおよび関連会社(パークレイズ)が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、汎欧州通貨建て投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズに帰属します。

(出所：パークレイズ)

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		ベンチ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率	券 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
第74期	(期 首) 2014年6月9日	円 11,136	% —	パーブレイズ・ 汎欧州総合インデックス (円基準ベース) 123.23	% —	93.5	% △10.5		
	6月末	11,071	△0.6	122.53	△0.6	90.2	0.7		
	(期 末) 2014年7月8日	11,095	△0.4	122.81	△0.3	91.0	△4.1		
第75期	(期 首) 2014年7月8日	11,077	—	122.81	—	91.0	△4.1		
	7月末	11,130	0.5	123.28	0.4	89.6	△4.9		
	(期 末) 2014年8月8日	11,006	△0.6	122.28	△0.4	90.3	△5.4		
第76期	(期 首) 2014年8月8日	10,988	—	122.28	—	90.3	△5.4		
	8月末	11,193	1.9	124.51	1.8	93.3	△2.3		
	(期 末) 2014年9月8日	11,137	1.4	123.82	1.3	91.9	3.8		
第77期	(期 首) 2014年9月8日	11,119	—	123.82	—	91.9	3.8		
	9月末	11,368	2.2	126.68	2.3	92.3	△0.6		
	(期 末) 2014年10月8日	11,240	1.1	125.31	1.2	92.7	△0.8		
第78期	(期 首) 2014年10月8日	11,219	—	125.31	—	92.7	△0.8		
	10月末	11,278	0.5	126.13	0.7	92.8	△4.2		
	(期 末) 2014年11月10日	11,686	4.2	130.70	4.3	95.7	△4.3		
第79期	(期 首) 2014年11月10日	11,665	—	130.70	—	95.7	△4.3		
	11月末	12,169	4.3	136.37	4.3	95.0	△5.7		
	(期 末) 2014年12月8日	12,346	5.8	138.33	5.8	94.1	△7.8		

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当作成期の運用経過と今後の運用方針

[基準価額の推移]

基準価額の主な変動要因は、ECB(欧州中央銀行)による追加金融緩和に対する期待感、イラクやシリアおよびウクライナでの地政学的リスクの高まりを受け安全資産を求める動きが強まり、国債への需要が高まったことなどでした。

また、ユーロが対円で上昇したことも変動要因となりました。

当作成期の基準価額の騰落率は+11.8%(分配金を再投資して算出)となり、ベンチマークの+12.3%を0.5ポイント下回りました。主な差異の要因は【ノムラインサイト欧州債券 マザーファンド】において、国債をアンダーウェイトし、社債をオーバーウェイトする資産配分効果や銘柄選択効果などです。

[運用経過]

主要投資対象である【ノムラインサイト欧州債券 マザーファンド】受益証券を高位に組み入れました。実質組入外貨建て資産については為替ヘッジを行いませんでした。

【ノムラインサイト欧州債券 マザーファンド】の運用については、当作成期末には、国債51.9%、社債31.3%、政府関連債9.4%、資産担保債2.5%としました。また、国別組入比率については、イタリア16.0%、英国13.7%、スペイン10.6%、フランス10.4%、オランダ7.7%等としました。通貨別組入比率については、ユーロ75.9%、ポンド19.4%、スウェーデン・クローナ1.5%、デンマーク・クローネ0.9%、ポーランド・ズロチ0.6%等としました。

[分配金]

配当等収益等から、1口当たり第74期18円、第75期18円、第76期18円、第77期21円、第78期21円、第79期15円とさせていただきます。

なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

[今後の運用方針]

主要投資対象である【ノムラインサイト欧州債券 マザーファンド】受益証券を高位に組み入れます。実質組入外貨建て資産については、為替ヘッジを行いません。

【ノムラインサイト欧州債券 マザーファンド】の運用については、主要投資対象である汎欧州通貨建ての公社債を高位に組み入れます。デュレーション、国別配分、通貨配分、セクター配分に関して、欧州中央銀行の金融政策の運営姿勢など適宜環境変化を勘案し、機動的な対応を行ってまいります。

(2014年6月10日～2014年12月8日)

○1口当たりの費用明細

項 目	第74期～第79期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 28	% 0.242	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(22)	(0.187)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(3)	(0.027)	口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	1	0.010	(c) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.009)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	29	0.254	
作成期間の平均基準価額は、11,368円です。			

*作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

*各比率は1口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年6月10日～2014年12月8日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第74期～第79期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
ノムラーインサイト欧州債券 マザーファンド	千口 13,190,066	千円 19,168,000	千口 210,115	千円 313,700

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2014年6月10日～2014年12月8日)

利害関係人との取引状況

<ノムラーインサイト欧州債券ファンドFD(適格機関投資家専用)>

該当事項はございません。

<ノムラーインサイト欧州債券 マザーファンド>

区分	第74期～第79期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 75,977	百万円 1,115	% 1.5	百万円 50,919	百万円 -	% -

平均保有割合 39.2%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2014年12月8日現在)

親投資信託残高

銘柄	第73期末	第79期末	
	口数	口数	評価額
ノムラーインサイト欧州債券 マザーファンド	千口 6,187,449	千口 19,167,401	千円 30,610,340

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2014年12月8日現在)

項 目	第79期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ノムラーインサイト欧州債券 マザーファンド	30,610,340	98.8
コール・ローン等、その他	372,970	1.2
投資信託財産総額	30,983,310	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*ノムラーインサイト欧州債券 マザーファンドにおいて、第79期末における外貨建て純資産(64,476,023千円)の投資信託財産総額(68,856,288千円)に対する比率は93.6%です。

*外貨建て資産は、第79期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1英ポンド=189.42円、1スイスフラン=124.29円、1スウェーデンクローナ=16.11円、1ノルウェークローネ=16.98円、1デンマーククローネ=20.08円、1ユーロ=149.42円、1チェココルナ=5.41円、1フォリント=0.4891円、1ズロチ=35.97円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第74期末	第75期末	第76期末	第77期末	第78期末	第79期末
	2014年7月8日現在	2014年8月8日現在	2014年9月8日現在	2014年10月8日現在	2014年11月10日現在	2014年12月8日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	10,268,075,889	13,141,189,486	16,969,699,742	21,823,221,517	27,055,633,440	30,983,310,278
コール・ローン等	102,908,747	131,620,606	169,942,061	219,153,341	292,355,670	307,469,666
ノムラーインサイト欧州債券 マザーファンド(評価額)	10,140,766,956	12,973,368,627	16,761,057,386	21,554,467,817	26,722,677,281	30,610,340,050
未収入金	24,400,000	36,200,000	38,700,000	49,600,000	40,600,000	65,500,000
未収利息	186	253	295	359	489	562
(B) 負債	20,960,002	32,893,947	33,579,535	50,392,208	65,860,463	51,575,502
未払収益分配金	16,652,070	21,473,208	27,416,592	40,753,461	48,589,800	37,628,190
未払解約金	666,360	6,788,439	—	1,837,872	6,535,760	3,364,799
未払信託報酬	3,625,468	4,611,816	6,135,684	7,766,366	10,687,413	10,535,697
その他未払費用	16,104	20,484	27,259	34,509	47,490	46,816
(C) 純資産総額(A-B)	10,247,115,887	13,108,295,539	16,936,120,207	21,772,829,309	26,989,772,977	30,931,734,776
元本	9,251,150,000	11,929,560,000	15,231,440,000	19,406,410,000	23,138,000,000	25,085,460,000
次期繰越損益金	995,965,887	1,178,735,539	1,704,680,207	2,366,419,309	3,851,772,977	5,846,274,776
(D) 受益権総口数	925,115口	1,192,956口	1,523,144口	1,940,641口	2,313,800口	2,508,546口
1口当たり基準価額(C/D)	11,077円	10,988円	11,119円	11,219円	11,665円	12,331円

(注) 第74期首元本額7,985百万円、第74～第79期中追加設定元本額17,271百万円、第74～第79期中一部解約元本額171百万円、第79期末計算口数当たり純資産額12,331円。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額47,595,351円。(ノムラーインサイト欧州債券 マザーファンド)

○損益の状況

項 目	第74期	第75期	第76期	第77期	第78期	第79期
	2014年6月10日～ 2014年7月8日	2014年7月9日～ 2014年8月8日	2014年8月9日～ 2014年9月8日	2014年9月9日～ 2014年10月8日	2014年10月9日～ 2014年11月10日	2014年11月11日～ 2014年12月8日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	5,106	6,659	8,849	10,048	14,590	13,959
受取利息	5,106	6,659	8,849	10,048	14,590	13,959
(B) 有価証券売買損益	△ 27,261,110	△ 77,050,563	183,972,943	172,128,667	1,088,233,912	1,612,552,891
売買益	490	52,351	184,326,436	173,592,858	1,088,486,704	1,613,862,446
売買損	△ 27,261,600	△ 77,102,914	△ 353,493	△ 1,464,191	△ 252,792	△ 1,309,555
(C) 信託報酬等	△ 3,641,572	△ 4,632,300	△ 6,162,943	△ 7,800,875	△ 10,734,903	△ 10,582,513
(D) 当期繰越益金(A+B+C)	△ 30,897,576	△ 81,676,204	177,818,849	164,337,840	1,077,513,599	1,601,984,337
(E) 前期繰越損益金	1,006,340,077	956,745,090	851,989,385	1,000,061,579	1,121,787,436	2,146,263,065
(F) 追加信託差損益金	37,175,456	325,139,861	702,288,565	1,242,773,351	1,701,061,742	2,135,655,564
(配当等相当額)	(1,159,357,692)	(1,791,341,979)	(2,570,678,242)	(3,560,964,666)	(4,468,524,674)	(5,037,145,164)
(売買損益相当額)	(△1,122,182,236)	(△1,466,202,118)	(△1,868,389,677)	(△2,318,191,315)	(△2,767,462,932)	(△2,901,489,600)
(G) 計(D+E+F)	1,012,617,957	1,200,208,747	1,732,096,799	2,407,172,770	3,900,362,777	5,883,902,966
(H) 収益分配金	△ 16,652,070	△ 21,473,208	△ 27,416,592	△ 40,753,461	△ 48,589,800	△ 37,628,190
次期繰越損益金(G+H)	995,965,887	1,178,735,539	1,704,680,207	2,366,419,309	3,851,772,977	5,846,274,776
追加信託差損益金	37,175,456	325,139,861	702,288,565	1,242,773,351	1,701,061,742	2,135,655,564
(配当等相当額)	(1,161,001,377)	(1,793,475,111)	(2,575,059,287)	(3,565,053,327)	(4,474,984,205)	(5,038,691,926)
(売買損益相当額)	(△1,123,825,921)	(△1,468,335,250)	(△1,872,770,722)	(△2,322,279,976)	(△2,773,922,463)	(△2,903,036,362)
分配準備積立金	1,008,644,269	1,007,565,746	1,013,063,762	1,123,645,958	2,150,711,235	3,710,619,212
繰越損益金	△ 49,853,838	△ 153,970,068	△ 10,672,120	—	—	—

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

①書面決議の要件緩和等に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2014年12月1日＞

②書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用とする所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2014年12月1日＞

ノムラーインサイト欧州債券 マザーファンド

第7期(計算期間：2013年6月11日～2014年6月9日)

◎ 当作成期の運用経過

- (1) 欧州債券の組入比率(先物を除く)は、当作成期末時点で94.5%としました。
- (2) 当作成期末時点での格付け別組入比率については、AAA格20.8%、AA格21.0%、A格13.1%、BBB格38.6%、BB格以下1.1%としました。
- (3) 当作成期末時点でのセクター別組入比率については、国債45.9%、社債36.0%、政府関連債10.6%、資産担保債2.0%としました。
- (4) 当作成期末時点での国別組入比率については、イタリア18.3%、英国12.3%、フランス11.8%、ドイツ11.6%、スペイン8.9%等としました。
- (5) 当作成期末時点での通貨別組入比率については、ユーロ78.5%、ポンド16.7%、スウェーデン・クローナ1.6%、デンマーク・クローネ0.9%、ポーランド・ズロチ0.7%等としました。
- (6) 基準価額は当作成期初の12,105円から当作成期末には14,224円となりました。基準価額の騰落率は+17.5%となり、ベンチマークの+15.0%を2.5ポイント上回りました。

◎ 今後の運用方針

主要投資対象である汎欧州通貨建ての公社債を高位に組み入れます。デュレーション、国別配分、通貨配分、セクター配分に関して、欧州中央銀行の金融政策の運営姿勢など適宜環境変化を勘案し、機動的な対応を行います。

*ベンチマーク(≡パークレイズ・汎欧州総合インデックス(円換算ベース))は、パークレイズが公表する営業日前日のパークレイズ・汎欧州総合インデックス(欧州通貨ベース)を営業日当日の欧州通貨レート(対顧客電信売買相場仲値)で当社が独自に円換算したものです。なお、設定時=100として指数化しています。

*パークレイズ・汎欧州総合インデックスは、パークレイズ・バンク・ピーエルシーおよび関連会社(パークレイズ)が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、汎欧州通貨建て投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズに帰属します。

(出所：パークレイズ)

◎1万口当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	1円 (1)
(b) 保 管 費 用 等	3
合 計	4

* (a) 売買委託手数料、(b) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◎期中の売買及び取引の状況(自2013年6月11日 至2014年6月9日)

(1) 公社債

	買付額	売付額
外 国		
イ ギ リ ス	千英ポンド	千英ポンド
国 債 証 券	48,763	43,618
特 殊 債 券	—	1,640
社債券(投資法人債券を含む)	2,102	1,874
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ
国 債 証 券	13,775	25,158
社債券(投資法人債券を含む)	—	12,087
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ
国 債 証 券	52,178	46,826
地 方 債 証 券	—	7,014
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ
国 債 証 券	14,385	14,674
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ
ド イ ツ		
国 債 証 券	40,662	40,535
特 殊 債 券	12,032	5,131
社債券(投資法人債券を含む)	975	—
イ タ リ ア		
国 債 証 券	53,151	45,121
社債券(投資法人債券を含む)	8,847	2,292
		(700)

	買付額	売付額
ユ ヨ	千ユーロ	千ユーロ
フランス		
国債証券	34,226	33,103
社債券(投資法人債券を含む)	13,215	7,219 (450)
イギリス		
社債券(投資法人債券を含む)	3,577	3,062
オランダ		
国債証券	22,014	25,812
社債券(投資法人債券を含む)	8,605	8,812
スペイン		
国債証券	28,331	33,094
特殊債券	1,897	5,656
社債券(投資法人債券を含む)	3,621	4,235
ベルギー		
国債証券	8,702	8,337
社債券(投資法人債券を含む)	3,273	—
スウェーデン		
社債券(投資法人債券を含む)	—	— (637)
ノルウェー		
社債券(投資法人債券を含む)	696	—
オーストリア		
国債証券	7,463	8,652
特殊債券	2,393	—
ルクセンブルグ		
社債券(投資法人債券を含む)	—	1,028
フィンランド		
国債証券	19,083	11,982
デンマーク		
社債券(投資法人債券を含む)	2,297	—

	買付額	売付額
ユ ヨ	千ユーロ	千ユーロ
アイルランド		
国債証券	4,756	3,615
社債券(投資法人債券を含む)	813	2,568
ポルトガル		
国債証券	1,815	1,816
スロバキア		
国債証券	3,275	3,449
スロベニア		
国債証券	656	2,872
アメリカ		
社債券(投資法人債券を含む)	3,958	1,276
メキシコ		
社債券(投資法人債券を含む)	1,269	—
ラトビア		
国債証券	2,389	1,684
国際機関		
特殊債券	10,101	8,389
ハンガリー	千フォリント	千フォリント
国債証券	553,948	832,645
ポーランド	千ズロチ	千ズロチ
国債証券	30,510	24,446

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引	44,170	42,935	21,334	16,977

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

◎組入資産の明細

(1) 外国(外貨建)公社債

区 分	期 首					当 期			期 末				
	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
	%	%	5年以上	2年以上	2年未満	千英ポンド	外貨建金額	邦貨換算金額	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
イギリス	13.6	—	10.4	3.3	—	千英ポンド 24,790	千英ポンド 26,033	千円 4,487,159	13.2	—	12.1	—	1.1
スウェーデン	2.5	—	0.3	1.5	0.7	千スウェーデンクローナ 16,400	千スウェーデンクローナ 18,645	288,440	0.8	—	0.8	—	—
ノルウェー	0.5	—	0.5	—	—	千ノルウェークローネ 5,300	千ノルウェークローネ 5,702	98,254	0.3	—	0.3	—	—
ユ ー ロ						千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	10.1	0.5	4.1	6.0	—	24,690	28,249	3,953,268	11.6	0.4	8.9	2.7	—
イタリア	13.7	—	7.2	6.5	—	40,540	44,604	6,241,963	18.3	0.3	12.2	6.2	—
フランス	10.6	0.5	8.9	0.5	1.3	24,640	28,810	4,031,765	11.8	0.2	10.5	1.3	—
イギリス	1.7	—	1.0	0.8	—	4,020	4,189	586,345	1.7	—	0.7	1.0	—
オランダ	7.1	—	3.6	2.8	0.7	9,965	10,482	1,466,889	4.3	—	2.6	1.2	0.5
スペイン	14.4	—	4.1	8.6	1.7	19,220	21,664	3,031,744	8.9	—	5.4	3.5	—
ベルギー	3.1	—	3.1	—	—	9,100	10,017	1,401,847	4.1	—	3.5	0.6	—
スウェーデン	0.3	0.3	—	0.3	—	—	—	—	—	—	—	—	—
ノルウェー	—	—	—	—	—	700	738	103,375	0.3	—	0.3	—	—
オーストリア	1.4	—	1.4	—	—	3,900	4,022	562,848	1.7	—	1.7	—	—
ルクセンブルグ	1.3	0.4	0.2	0.3	0.7	1,340	1,405	196,668	0.6	0.1	—	—	0.6
フィンランド	0.3	—	0.3	—	—	7,500	7,671	1,073,546	3.2	—	1.5	1.7	—
デンマーク	—	—	—	—	—	2,300	2,298	321,636	0.9	—	—	0.9	—
アイルランド	1.4	—	0.5	0.8	—	2,050	2,224	311,349	0.9	—	0.9	—	—
スロバキア	0.1	—	0.1	—	—	170	203	28,485	0.1	—	0.1	—	—
スロベニア	1.0	1.0	1.0	—	—	250	273	38,221	0.1	0.1	0.1	—	—
アメリカ	2.0	0.2	0.2	1.8	—	6,415	6,767	946,981	2.8	—	1.5	0.6	0.7
国際機関	3.6	—	2.1	1.6	—	8,200	9,028	1,263,455	3.7	—	3.7	—	—
ジャージー	0.8	—	—	0.8	—	1,350	1,454	203,579	0.6	—	—	0.6	—
アラブ首長国連邦	0.3	—	—	0.3	—	600	609	85,286	0.3	—	—	—	0.3
メキシコ	0.5	—	0.5	—	—	2,000	2,240	313,599	0.9	—	0.9	—	—
チェコ	0.3	—	—	0.3	—	580	612	85,775	0.3	—	—	0.3	—
ポーランド	1.1	—	1.1	—	—	1,760	2,225	311,426	0.9	—	0.9	—	—
ラトビア	—	—	—	—	—	750	779	109,032	0.3	—	0.3	—	—
チエコ	0.4	—	0.4	—	—	千チェココルナ 15,500	千チェココルナ 18,773	95,743	0.3	—	—	0.3	—
ハンガリー	0.5	0.5	—	0.5	—	千フォリント —	千フォリント —	—	—	—	—	—	—
ポーランド	1.2	—	0.2	1.0	—	千ズロチ 14,250	千ズロチ 16,298	556,581	1.6	—	1.2	0.4	—
合 計	93.7	3.5	51.0	37.6	5.1	—	—	32,195,273	94.5	1.1	70.2	21.2	3.0

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*一印は組み入れなし。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*スタンダード・アンド・プアーズ、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

外国(外貨建)公社債銘柄別

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)						
国 債 証 券	UK TREASURY	1.75	6,300	6,245	1,076,529	2019/7/22
	UK TREASURY	4.25	4,750	5,405	931,691	2032/6/7
	UK TREASURY	3.5	250	256	44,210	2068/7/22
	UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	4,760	4,586	790,487	2044/1/22
特殊債券(除く金融債)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	5.375	1,300	1,531	264,041	2021/6/7
普通社債券(含む投資法人債券)	ABP FINANCE PLC	6.25	845	1,004	173,054	2026/12/14
	GATWICK FUNDING LIMITED	5.25	600	665	114,734	2024/1/23
	GLENCORE FINANCE EUROPE	6.0	370	417	71,895	2022/4/3
	HOLMES MASTER ISSUER PLC	2.07531	1,500	1,549	267,123	2054/10/15
	IMPERIAL TOBACCO FINANCE	4.875	455	464	80,125	2032/6/7
	KONINKLIJKE KPN NV	5.0	530	552	95,265	2026/11/18
	LLOYDS BANK PLC	5.125	710	815	140,517	2025/3/7
	PEARSON FUNDING ONE	6.0	610	652	112,394	2015/12/15
	QBE INSURANCE GROUP LTD	6.125	1,380	1,456	250,979	2015/9/28
	THAMES WATER UTIL CAY FI	4.625	430	429	74,107	2046/6/4
小 計		-	-	-	4,487,159	-
(スウェーデン)						
国 債 証 券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	16,400	18,645	288,440	2022/6/1
小 計		-	-	-	288,440	-
(ノルウェー)						
国 債 証 券	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	3,600	3,947	68,007	2021/5/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	1,700	1,755	30,247	2024/3/14
小 計		-	-	-	98,254	-
(ユーロ)						
(ドイツ)						
国 債 証 券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	4,900	6,667	933,108	2028/7/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,500	1,562	218,621	2046/8/15
	DEUTSCHLAND I/L BOND	1.75	5,300	6,610	925,111	2020/4/15
特殊債券(除く金融債)	KfW	0.875	2,200	2,231	312,285	2019/3/18
	KfW	3.625	1,200	1,390	194,636	2020/1/20
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	1.25	3,400	3,404	476,414	2022/5/20
普通社債券(含む投資法人債券)	ALLIANZ SE	4.75	400	436	61,089	2049/10/29
	COMMERZBANK AG	1.5	1,400	1,441	201,685	2018/2/28
	DEUTSCHE BANK AG	1.047	2,180	2,178	304,901	2017/3/9
	ENBW	3.625	580	579	81,132	2076/4/2
	NORDENIA INT AG	9.75	710	750	105,010	2017/7/15
	UNITYMEDIA KABEL BW GMBH	9.625	920	995	139,269	2019/12/1
(イタリア)						
国 債 証 券	BUONI POLIENNALI DEL I/L	2.55	5,430	5,722	800,810	2016/10/22
	BUONI POLIENNALI DEL I/L	2.15	3,700	3,856	539,725	2017/11/12
	BUONI POLIENNALI DEL I/L	2.35	4,300	4,652	651,092	2024/9/15
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,630	1,811	253,489	2017/5/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	720	817	114,429	2018/8/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	2,000	2,040	285,606	2020/4/23
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	720	798	111,719	2021/5/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	10,330	11,879	1,662,417	2023/5/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	480	547	76,608	2026/3/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	2,380	2,819	394,506	2040/9/1

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(イタリア)						
普通社債券(含む投資法人債券)	ASSICURAZIONI GENERALI	2.875	550	584	81,846	2020/1/14
	ASSICURAZIONI GENERALI	5.125	1,110	1,344	188,090	2024/9/16
	ASSICURAZIONI GENERALI	4.125	400	418	58,564	2026/5/4
	BANCA MONTE DEI PASCHI S	2.875	630	647	90,648	2021/4/16
	ENI SPA	3.625	390	427	59,848	2029/1/29
	INTESA SANPAOLO SPA	3.625	600	674	94,400	2022/12/5
	INTESA SANPAOLO SPA	4.0	720	808	113,074	2023/10/30
	MONTE DEI PASCHI SIENA	3.5	2,100	2,225	311,491	2017/3/20
	SNAM SPA	3.25	500	541	75,760	2024/1/22
	UNICREDIT SPA	4.0	500	555	77,680	2018/1/31
UNICREDIT SPA	3.0	1,350	1,430	200,150	2024/1/31	
(フランス)						
国 債 証 券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	3,700	5,208	728,876	2029/4/25
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	900	1,336	187,080	2032/10/25
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	1,690	2,286	320,006	2035/4/25
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	560	691	96,786	2038/10/25
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	2,130	2,719	380,518	2060/4/25
普通社債券(含む投資法人債券)	ALD INTERNATIONAL	2.0	1,400	1,425	199,520	2017/5/26
	AUTOROUTES DU SUD DE LA	2.875	200	213	29,927	2023/1/18
	BPCE SA	4.625	800	898	125,716	2023/7/18
	BPCE SA	3.0	1,300	1,398	195,693	2024/7/19
	BPCE SFH - SOCIETE DE FI	2.125	2,000	2,128	297,820	2020/9/17
	CAISSE REFINANCE L'HABIT	2.4	1,180	1,246	174,500	2025/1/17
	CREDIT AGRICOLE HOME LOA	1.625	1,100	1,145	160,360	2020/3/11
	CREDIT AGRICOLE LONDON	2.375	900	913	127,898	2024/5/20
	DEXIA CREDIT LOCAL	1.375	2,600	2,662	372,543	2019/9/18
	ELECTRICITE DE FRANCE	4.625	900	1,096	153,389	2030/4/26
	ELECTRICITE DE FRANCE	5.0	300	320	44,893	2049/1/22
	FONCIERE LYONNAISE	3.5	900	969	135,706	2017/11/28
	LA BANQUE POSTALE	2.75	1,000	1,014	141,899	2026/4/23
	RENAULT S.A.	3.125	380	396	55,511	2021/3/5
	VIVENDI SA	2.375	700	736	103,115	2019/1/21
(イギリス)						
普通社債券(含む投資法人債券)	CHANNEL LINK	3.643	1,050	1,044	146,195	2050/6/30
	LLOYDS BANK PLC	1.875	870	903	126,483	2018/10/10
	NATIONWIDE BLDG SOCIETY	3.125	1,400	1,493	208,944	2017/4/3
	NATIONWIDE BLDG SOCIETY	4.125	700	748	104,721	2023/3/20
(オランダ)						
国 債 証 券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.25	1,600	1,661	232,468	2019/1/15
普通社債券(含む投資法人債券)	ACHMEA BV	2.5	810	845	118,338	2020/11/19
	ACHMEA HYPOTHEEKBANK NV	2.375	1,100	1,130	158,159	2016/2/8
	ACHMEA HYPOTHEEKBANK NV	2.75	300	317	44,416	2021/2/18
	BAT HOLDINGS BV	3.125	190	196	27,545	2029/3/6
	DEUTSCHE ANN FIN BV	2.125	800	819	114,734	2016/7/25
	DEUTSCHE ANN FIN BV	3.625	525	580	81,208	2021/10/8
	ENEL FINANCE INTL NV	4.875	460	542	75,862	2020/3/11
	HEINEKEN NV	2.875	500	524	73,360	2025/8/4
	IBERDROLA INTL BV	4.5	400	445	62,346	2017/9/21
	KONINKLIJKE KPN NV	4.5	300	345	48,281	2021/10/4
	STORM BV	1.868	1,900	1,955	273,636	2054/5/22
	VOLKSWAGEN INTL FIN NV	3.75	1,080	1,118	156,530	2049/3/24

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(スペイン)						
国 債 証 券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1	2,700	2,804	392,479	2017/4/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.5	880	992	138,916	2018/1/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	470	538	75,335	2019/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	4,000	4,938	691,074	2021/4/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	550	678	94,900	2023/1/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	1,310	1,595	223,340	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT	4.2	3,010	3,272	457,907	2037/1/31
普通社債券(含む投資法人債券)	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	3.5	2,000	2,177	304,677	2017/12/5
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	4.0	400	465	65,147	2025/2/25
	BANCO SANTANDER SA	4.5	2,300	2,481	347,224	2016/7/29
	CAIXABANK	2.625	1,000	1,030	144,208	2024/3/21
	TELEFONICA EMISIONES SAU	4.71	300	349	48,965	2020/1/20
	TELEFONICA EMISIONES SAU	3.961	300	339	47,567	2021/3/26
(ベルギー)						
国 債 証 券	BELGIUM KINGDOM	3.0	4,680	5,175	724,275	2019/9/28
	BELGIUM KINGDOM	4.25	450	572	80,161	2041/3/28
	BELGIUM KINGDOM	3.75	340	397	55,582	2045/6/22
	BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	380	525	73,586	2028/3/28
普通社債券(含む投資法人債券)	BELFIUS BANK SA/NV	2.25	1,500	1,558	218,127	2018/9/26
	BNP PARIBAS FORTIS SA	4.625	1,150	1,132	158,517	2049/10/29
	BRUSSELS AIR HOLDING NV/	3.25	600	654	91,596	2020/7/1
(ノルウェー)						
普通社債券(含む投資法人債券)	DNB BANK ASA	3.0	700	738	103,375	2023/9/26
(オーストリア)						
特殊債券(除く金融債)	HYPO ALPE-ADRIA INTL AG	2.375	3,900	4,022	562,848	2022/12/13
(ルクセンブルグ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	CHN IND FIN EMTN	5.25	340	349	48,961	2015/3/11
	GLENCORE FINANCE EUROPE	7.125	1,000	1,055	147,706	2015/4/23
(フィンランド)						
国 債 証 券	FINNISH GOVERNMENT	1.125	3,900	4,024	563,121	2018/9/15
	FINNISH GOVERNMENT	1.625	800	821	114,929	2022/9/15
	FINNISH GOVERNMENT	1.5	2,800	2,826	395,495	2023/4/15
(デンマーク)						
普通社債券(含む投資法人債券)	DANSKE BANK A/S	0.66	2,300	2,298	321,636	2017/6/2
(アイルランド)						
国 債 証 券	IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	1,200	1,300	181,991	2024/3/18
普通社債券(含む投資法人債券)	GE CAPITAL EURO FUNDING	2.875	850	924	129,357	2019/6/18
(スロバキア)						
国 債 証 券	SLOVAKIA GOVERNMENT BOND	4.35	170	203	28,485	2025/10/14
(スロベニア)						
国 債 証 券	REPUBLIKA SLOVENIJA	4.125	250	273	38,221	2020/1/26
(アメリカ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	AT&T INC	2.4	350	354	49,623	2024/3/15
	BANK OF AMERICA CORP	2.5	405	427	59,843	2020/7/27
	CITIGROUP INC	4.0	1,600	1,679	234,964	2015/11/26
	DIRECTV HOLDINGS/FING	2.75	400	415	58,136	2023/5/19
	MORGAN STANLEY	3.75	1,370	1,489	208,493	2017/9/21
	MORGAN STANLEY	2.375	1,330	1,372	192,057	2021/3/31
	PROLOGIS LP	3.375	400	426	59,681	2024/2/20
	VERIZON COMMUNICATIONS	3.25	560	601	84,181	2026/2/17

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(国際機関)						
特殊債券(除く金融債)	EFSF	2.125	1,300	1,357	190,035	2024/2/19
	EURO STABILITY MECHANISM	0.875	400	403	56,530	2019/10/15
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2.75	2,100	2,333	326,552	2021/9/15
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2.125	1,600	1,682	235,419	2024/1/15
	EUROPEAN UNION	3.5	2,800	3,250	454,916	2021/6/4
(ジャージー)						
普通社債券(含む投資法人債券)	BAA FUNDING LTD	4.125	1,350	1,454	203,579	2016/10/12
(アラブ首長国連邦)						
普通社債券(含む投資法人債券)	XSTRATA FINANCE DUBAI LT	1.75	600	609	85,286	2016/5/19
(メキシコ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4.125	1,200	1,374	192,378	2019/10/25
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	5.125	800	866	121,221	2073/9/6
(チェコ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	EP ENERGY AS	4.375	580	612	85,775	2018/5/1
(ポーランド)						
国 債 証 券	REPUBLIC OF POLAND	5.25	1,760	2,225	311,426	2025/1/20
(ラトビア)						
国 債 証 券	REPUBLIC OF LATVIA	2.625	750	779	109,032	2021/1/21
	小 計	-	-	-	26,669,093	-
(チェコ)			千チェココルナ	千チェココルナ		
国 債 証 券	CZECH REPUBLIC	5.0	15,500	18,773	95,743	2019/4/11
	小 計	-	-	-	95,743	-
(ポーランド)			千ズロチ	千ズロチ		
国 債 証 券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	3,650	3,942	134,619	2017/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	10,600	12,356	421,962	2022/9/23
	小 計	-	-	-	556,581	-
	合 計	-	-	-	32,195,273	-

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	期首評価額		当期末評価額	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引				
B O B L	-	3,206	-	1,342
B U N D S	1,871	-	-	6,338
G I L T S	542	-	813	-
S C H A T Z	-	-	3,266	-

* 単位未満は切り捨て。

* 邦貨換算金額は、期首、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* -印は組み入れなし。

◎投資信託財産の構成 (2014年6月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	32,195,273	87.6
コール・ローン等、その他	4,567,782	12.4
投資信託財産総額	36,763,055	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(33,495,535千円)の投資信託財産総額(36,763,055千円)に対する比率は91.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1英ポンド=172.36円、1スウェーデンクローナ=15.47円、1ノルウェークローネ=17.23円、1デンマーククローネ=18.76円、1ユーロ=139.94円、1チェココルナ=5.10円、1フォリント=0.4635円、1ズロチ=34.15円。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2014年6月9日)現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	42,396,744,391
コール・ローン等	2,387,067,607
公社債(評価額)	32,195,273,331
未収入金	6,586,298,322
未収利息	268,888,427
前払費用	50,594,765
差入委託証拠金	908,621,939
(B) 負 債	8,319,871,106
未払金	8,242,771,106
未払解約金	77,100,000
(C) 純資産総額(A-B)	34,076,873,285
元 本	23,957,308,735
次期繰越損益金	10,119,564,550
(D) 受益権総口数	23,957,308,735口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,224円

◎損益の状況

(自2013年6月11日 至2014年6月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	918,727,320
受 取 利 息	918,355,271
そ の 他 収 益 金	372,049
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,703,297,975
売 買 益	4,349,374,056
売 買 損	△ 646,076,081
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 1,342,900
取 引 益	264,070,236
取 引 損	△ 265,413,136
(D) 信 託 報 酬 等	△ 6,314,353
(E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	4,614,368,042
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	4,412,580,780
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,444,079,392
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 1,351,463,664
(I) 計 (E + F + G + H)	10,119,564,550
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	10,119,564,550

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(D)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注)期首元本額20,960百万円、期中追加設定元本額7,269百万円、期中一部解約元本額4,273百万円、計算口数当たり純資産額14,224円。

(注)当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額、ノムラ・グローバル・オールスターズ2,924百万円、ノムラインサイト欧州債券ファンドF(適格機関投資家専用)2,295百万円、ノムラインサイト欧州債券ファンドFC(適格機関投資家専用)2,430百万円、ノムラインサイト欧州債券ファンドFD(適格機関投資家専用)6,187百万円、ノムラインサイト欧州債券ファンドFVA(適格機関投資家専用)10,119百万円。

ノムラ海外債券ファンドFD(適格機関投資家専用)

第62期～第67期(2014年6月11日～2014年12月10日)

○当ファンドの仕組み

商品分類	—	
信託期間	2009年4月9日以降、無期限とします。	
運用方針	ノムラ海外債券ファンド マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界の公社債(国債、政府保証債、政府機関債、準政府債(州政府債)、国際機関債、社債、モーゲージ証券等)を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行うことを基本とします。 実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	ノムラ海外債券ファンドFD	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	日本を除く世界の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	ノムラ海外債券ファンドFD	外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
	マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
分配方針	毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		税込配	金期騰落	パーセント 騰落	マーカー 騰落			
	円		円	%		%	%	百万円
38期(2012年7月10日)	8,277		17	△0.4	97.93	△0.2	95.1	1,600
39期(2012年8月10日)	8,246		19	△0.1	97.79	△0.1	94.9	1,678
40期(2012年9月10日)	8,366		17	1.7	99.23	1.5	95.0	1,775
41期(2012年10月10日)	8,407		16	0.7	99.96	0.7	95.0	1,957
42期(2012年11月12日)	8,536		19	1.8	101.76	1.8	95.5	2,136
43期(2012年12月10日)	8,933		16	4.8	106.64	4.8	95.0	2,340
44期(2013年1月10日)	9,527		19	6.9	114.22	7.1	94.2	2,565
45期(2013年2月12日)	10,150		21	6.8	122.24	7.0	96.3	2,753
46期(2013年3月11日)	10,166		17	0.3	123.09	0.7	95.8	2,709
47期(2013年4月10日)	10,723		20	5.7	129.52	5.2	95.1	2,749
48期(2013年5月10日)	10,922		19	2.0	132.33	2.2	94.4	2,836
49期(2013年6月10日)	10,356		22	△5.0	126.30	△4.6	94.2	2,715
50期(2013年7月10日)	10,300		20	△0.3	126.76	0.4	95.3	2,700
51期(2013年8月12日)	10,022		22	△2.5	123.62	△2.5	96.7	2,589
52期(2013年9月10日)	10,177		19	1.7	126.38	2.2	96.3	2,567
53期(2013年10月10日)	10,199		21	0.4	126.56	0.1	94.0	2,529
54期(2013年11月11日)	10,321		23	1.4	128.28	1.4	95.0	2,640
55期(2013年12月10日)	10,884		21	5.7	135.37	5.5	91.4	3,103
56期(2014年1月10日)	11,007		24	1.4	137.04	1.2	92.3	3,176
57期(2014年2月10日)	10,903		21	△0.8	135.64	△1.0	91.3	3,737
58期(2014年3月10日)	11,078		19	1.8	137.99	1.7	91.0	4,382
59期(2014年4月10日)	11,041		22	△0.1	137.77	△0.2	95.1	4,551
60期(2014年5月12日)	11,097		19	0.7	138.49	0.5	96.1	4,799
61期(2014年6月10日)	11,161		19	0.7	139.35	0.6	95.6	5,474
62期(2014年7月10日)	11,140		21	0.0	139.33	△0.0	96.2	6,442
63期(2014年8月11日)	11,162		23	0.4	139.79	0.3	94.5	7,421
64期(2014年9月10日)	11,478		22	3.0	143.63	2.7	96.7	8,033
65期(2014年10月10日)	11,646		24	1.7	145.79	1.5	97.3	8,836
66期(2014年11月10日)	12,252		23	5.4	153.54	5.3	93.8	12,213
67期(2014年12月10日)	12,874		20	5.2	160.91	4.8	93.2	20,369

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率・売り建て比率。

* ベンチマーク(=パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース))は、パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスをもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算しております。設定時を100として指数化しています。

* パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスは、パークレイズ・バンク・ビーエルシーおよび関連会社(パークレイズ)が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、日本円を除く世界の投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズに帰属します。

(出所)パークレイズ

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
		円	騰落率	パーセント	騰落率		
第62期	(期首) 2014年6月10日	11,161	—	139.35	—	95.6	5.0
	6月末	11,127	△0.3	138.94	△0.3	95.1	3.3
	(期末) 2014年7月10日	11,161	0.0	139.33	△0.0	96.2	4.9
第63期	(期首) 2014年7月10日	11,140	—	139.33	—	96.2	4.9
	7月末	11,242	0.9	140.29	0.7	96.0	2.9
	(期末) 2014年8月11日	11,185	0.4	139.79	0.3	94.5	2.8
第64期	(期首) 2014年8月11日	11,162	—	139.79	—	94.5	2.8
	8月末	11,402	2.2	142.46	1.9	95.8	△0.9
	(期末) 2014年9月10日	11,500	3.0	143.63	2.7	96.7	△9.8
第65期	(期首) 2014年9月10日	11,478	—	143.63	—	96.7	△9.8
	9月末	11,766	2.5	147.05	2.4	96.4	△9.6
	(期末) 2014年10月10日	11,670	1.7	145.79	1.5	97.3	△9.1
第66期	(期首) 2014年10月10日	11,646	—	145.79	—	97.3	△9.1
	10月末	11,784	1.2	147.61	1.2	95.8	△10.7
	(期末) 2014年11月10日	12,275	5.4	153.54	5.3	93.8	△9.7
第67期	(期首) 2014年11月10日	12,252	—	153.54	—	93.8	△9.7
	11月末	12,778	4.3	159.77	4.1	96.1	△6.4
	(期末) 2014年12月10日	12,894	5.2	160.91	4.8	93.2	△5.2

*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当作成期の運用経過と今後の運用方針

[基準価額の推移]

基準価額は、当作成期初11,161円から当作成期末12,874円(分配後)となりました。この間、133円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は1,846円となりました。当作成期の基準価額の騰落率は+16.66%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの+15.47%を1.19%上回りました。

[運用経過]

引き続き主要投資対象の「ノムラ海外債券ファンド マザーファンド」を高位に組み入れました。実質組入外貨建て資産については、為替ヘッジを行いませんでした。

「ノムラ海外債券ファンド マザーファンド」においては、通貨配分については、日本の経常黒字の縮小や大規模な金融緩和などを背景に円のアンダーウェイトを継続しました。また、米金融政策の正常化や経常赤字の縮小などを重視し、米ドルのオーバーウェイト幅を拡大する一方、ECB(欧州中央銀行)の金融緩和が下押し材料になると見込み、欧州通貨をアンダーウェイトに変更しました。デレレーションについては、世界経済の低成長や低インフレなどから世界的に利回りが低値で推移する環境が当面継続すると想定し、キャリーを考慮してベンチマークに対して長期化を維持しました。セクター配分については、非国債セクターはアウトパフォーマンスの余地が狭まっていると判断し、ベンチマーク比中立もしくはアンダーウェイトとしました。種別では、政府関連債をオーバーウェイト、社債と資産担保証券は中立もしくはアンダーウェイトとしました。

[分配金]

当作成期を通して、配当等収益等から、1口あたり計133円の収益分配を行いません。尚、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

[今後の運用方針]

引き続き主要投資対象の「ノムラ海外債券ファンド マザーファンド」を高位に組み入れます。実質組入外貨建て資産については、為替ヘッジを行わない方針です。

「ノムラ海外債券ファンド マザーファンド」においては、デレレーションについてはファンド全体でベンチマークに対して長期化を維持します。地域別では、欧州圏を長期化、ドル圏を中立とします。通貨配分については、ドルをオーバーウェイト、欧州通貨をアンダーウェイト、円や豪ドルなどをアンダーウェイトとします。セクター配分は、基本的にガイドラインに沿って、保守的な運用を行いません。政府関連債はオーバーウェイト、社債はアンダーウェイト、資産担保証券はアンダーウェイトとします。

以上が当面の運用方針ですが、市場環境の変化に応じて、随時、戦略の変更を行なってまいります。

○ 1口当たりの費用明細

(2014年6月11日～2014年12月10日)

項 目	第62期～第67期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 23	% 0.200	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(17)	(0.147)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(3)	(0.027)	口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	1	0.010	(c) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.009)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	24	0.212	
作成期間の平均基準価額は、11,683円です。			

*作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

*各比率は1口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年6月11日～2014年12月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第62期～第67期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
ノムラ海外債券ファンド	マザーファンド	9,346,690	13,990,000	582,317	816,000

* 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2014年6月11日～2014年12月10日)

利害関係人との取引状況

<ノムラ海外債券ファンドFD(適格機関投資家専用)>

該当事項はございません。

<ノムラ海外債券ファンド マザーファンド>

区 分	第62期～第67期					
	買付額等 A			うち利害関係人 との取引状況B	売付額等 C	
	百万円	%	百万円		%	
公社債	25,646		4,663	18.2	6,018	22.5

平均保有割合 45.6%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2014年12月10日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第61期末		第67期末	
		口 数		評 価 額	
		千口	千円	千口	千円
ノムラ海外債券ファンド	マザーファンド	4,021,672		12,786,045	20,345,154

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2014年12月10日現在)

項 目	第67期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ノムラ海外債券ファンド マザーファンド	20,345,154	99.7
コール・ローン等、その他	61,496	0.3
投資信託財産総額	20,406,650	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*ノムラ海外債券ファンド マザーファンドにおいて、第67期末における外貨建て純資産(35,808,569千円)の投資信託財産総額(41,325,978千円)に対する比率は86.6%です。

*外貨建て資産は、第67期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=119.46円、1カナダドル=104.31円、1英ポンド=187.19円、1スウェーデンクローナ=15.87円、1ノルウェークローネ=16.79円、1ユーロ=147.89円、1ズロチ=35.63円、1シンガポールドル=90.80円、1ウォン=0.1081円、1豪ドル=99.13円、1メキシコペソ=8.29円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第62期末	第63期末	第64期末	第65期末	第66期末	第67期末
	2014年7月10日現在	2014年8月11日現在	2014年9月10日現在	2014年10月10日現在	2014年11月10日現在	2014年12月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	6,456,560,197	7,439,511,723	8,145,364,644	8,857,792,618	12,240,108,182	20,406,650,158
コール・ローン等	20,749,283	1,111,399	20,430,273	27,403,641	41,817,015	61,495,119
ノムラ海外債券ファンド マザーファンド(評価額)	6,435,810,879	7,392,400,322	8,016,934,334	8,830,388,933	12,198,291,098	20,345,154,929
未収入金	—	46,000,000	108,000,000	—	—	—
未収利息	35	2	37	44	69	110
(B) 負債	14,071,868	17,763,225	112,073,308	20,848,148	26,281,377	36,785,648
未払収益分配金	12,144,951	15,292,562	15,397,140	18,210,360	22,928,677	31,644,640
未払解約金	—	—	94,030,644	—	—	—
未払信託報酬	1,916,570	2,457,392	2,631,312	2,623,616	3,334,685	5,113,379
その他未払費用	10,347	13,271	14,212	14,172	18,015	27,629
(C) 純資産総額(A-B)	6,442,488,329	7,421,748,498	8,033,291,336	8,836,944,470	12,213,826,805	20,369,864,510
元本	5,783,310,000	6,648,940,000	6,998,700,000	7,587,650,000	9,968,990,000	15,822,320,000
次期繰越損益金	659,178,329	772,808,498	1,034,591,336	1,249,294,470	2,244,836,805	4,547,544,510
(D) 受益権総口数	578,331口	664,894口	699,870口	758,765口	996,899口	1,582,232口
1口当たり基準価額(C/D)	11,140円	11,162円	11,478円	11,646円	12,252円	12,874円

(注) 第62期首元本額4,904百万円、第62～第67期中追加設定元本額11,669百万円、第62～第67期中一部解約元本額752百万円、第67期末計算口数当たり純資産額12,874円。
(注) 投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額11,433,507円。(ノムラ海外債券ファンド マザーファンド)

○損益の状況

項 目	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	2014年6月11日～ 2014年7月10日	2014年7月11日～ 2014年8月11日	2014年8月12日～ 2014年9月10日	2014年9月11日～ 2014年10月10日	2014年10月11日～ 2014年11月10日	2014年11月11日～ 2014年12月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	598	1,514	1,854	761	1,727	1,517
受取利息	598	1,514	1,854	761	1,727	1,517
(B) 有価証券売買損益	3,782,173	30,883,035	229,813,674	124,849,965	554,902,165	753,863,831
売買益	3,782,173	31,589,443	239,486,130	126,541,675	554,902,165	753,863,831
売買損	—	△ 706,408	△ 9,672,456	△ 1,691,710	—	—
(C) 信託報酬等	△ 1,926,917	△ 2,470,663	△ 2,645,524	△ 2,637,788	△ 3,352,700	△ 5,141,008
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	1,855,854	28,413,886	227,170,004	122,212,938	551,551,192	748,724,340
(E) 前期繰越損益金	635,094,879	615,460,196	599,775,713	775,812,393	879,814,971	1,408,437,486
(F) 追加信託差損益金	34,372,547	144,226,978	223,042,759	369,479,499	836,399,319	2,422,027,324
(配当等相当額)	(904,133,831)	(1,146,289,321)	(1,271,271,594)	(1,484,037,392)	(2,227,234,915)	(4,367,998,854)
(売買損益相当額)	(△869,761,284)	(△1,002,062,343)	(△1,048,228,835)	(△1,114,557,893)	(△1,390,835,596)	(△1,945,971,530)
(G) 計(D+E+F)	671,323,280	788,101,060	1,049,988,476	1,267,504,830	2,267,765,482	4,579,189,150
(H) 収益分配金	△ 12,144,951	△ 15,292,562	△ 15,397,140	△ 18,210,360	△ 22,928,677	△ 31,644,640
次期繰越損益金(G+H)	659,178,329	772,808,498	1,034,591,336	1,249,294,470	2,244,836,805	4,547,544,510
追加信託差損益金	34,372,547	144,226,978	223,042,759	369,479,499	836,399,319	2,422,027,324
(配当等相当額)	(905,552,312)	(1,148,225,537)	(1,272,555,927)	(1,485,039,194)	(2,231,056,306)	(4,376,623,888)
(売買損益相当額)	(△871,179,765)	(△1,003,998,559)	(△1,049,513,168)	(△1,115,559,695)	(△1,394,656,987)	(△1,954,596,564)
分配準備積立金	638,324,261	633,634,859	811,548,577	879,814,971	1,408,437,486	2,125,517,186
繰越損益金	△ 13,518,479	△ 5,053,339	—	—	—	—

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

①書面決議の要件緩和等に関する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2014年12月1日>

②書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用とする所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2014年12月1日>

ノムラ海外債券ファンド マザーファンド

第6期(計算期間：2013年6月11日～2014年6月10日)

◎運用実績

基準価額は、期初12,248円から期末13,579円となり、値上がり額は1,331円となりました。当期の基準価額の騰落率は+10.87%となり、ベンチマークの+10.33%を0.54%上回りました。

◎運用経過

通貨配分については、米金融緩和の縮小観測や、流動性の巻戻しによる資金の還流を背景にドル高の蓋然性が高いと判断し、ドルをアンダーウェイトからオーバーウェイトに変更しました。また、日本の経常黒字の縮小などを背景に円をオーバーウェイトからアンダーウェイトに変更しました。デュレーションについては、FRB(米連邦準備制度理事会)の低金利政策が当面の間は継続すると見込む中で、債券利回りはレンジ推移となると想定し、キャリアを考慮してベンチマークに対して長期化を維持しました。セクター配分については、非国債セクターは緩和的な金融環境の下で安定した推移が見込まれると考え、ベンチマーク比オーバーウェイトとしました。種別では、政府関連債をオーバーウェイト、社債を中立から若干のオーバーウェイト、資産担保証券はアンダーウェイトとしました。

◎今後の運用方針

デュレーションについてはファンド全体でベンチマークに対して長期化を維持します。地域別では、欧州圏を長期化、ドル圏を短期化とします。通貨配分については、ドルをオーバーウェイト、欧州通貨をオーバーウェイト、円、豪ドル、カナダドルなどをアンダーウェイトとします。セクター配分は、基本的にガイドラインに沿って、保守的な運用を行ないます。政府関連債はオーバーウェイト、社債は中立から若干のオーバーウェイト、資産担保証券はアンダーウェイトとします。

以上が当面の運用方針ですが、市場環境の変化に応じて、随時、戦略の変更を行なってまいります。

※ベンチマーク(≡バークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース))は、バークレイズが公表する営業日前日のバークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(現地通貨ベース)を営業日当日の為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で当社が独自に円換算したものです。

※バークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスは、バークレイズ・バンク・ビーエルシーおよび関連会社(バークレイズ)が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、日本円を除く世界の投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はバークレイズに帰属します。

(出所：バークレイズ)

◎1万口当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0円 (0)
(b) 保 管 費 用 等	2
合 計	2

* (a) 売買委託手数料、(b) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◎期中の売買及び取引の状況(自2013年6月11日 至2014年6月10日)

(1) 公社債

	買付額	売付額
外 国		
ア メ リ カ	千米ドル	千米ドル
国 債 証 券	13,206	10,845
地 方 債 証 券	—	408
特 殊 債 券	2,755	8,191
	(0.00569)	(3,509)
社債券(投資法人債券を含む)	16,409	21,040
カ ナ ダ	千カナダドル	千カナダドル
国 債 証 券	—	767
特 殊 債 券	—	304
		(200)
イ ギ リ ス	千英ポンド	千英ポンド
国 債 証 券	—	916
特 殊 債 券	—	219
社債券(投資法人債券を含む)	723	1,862
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ
国 債 証 券	—	9,677
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ
ド イ ツ		
国 債 証 券	3,478	2,928
特 殊 債 券	—	2,079
社債券(投資法人債券を含む)	430	434
イ タ リ ア		
国 債 証 券	9,105	4,531
社債券(投資法人債券を含む)	404	699
フ ラ ン ス		
国 債 証 券	2,035	2,187
社債券(投資法人債券を含む)	2,855	2,893
イ ギ リ ス		
社債券(投資法人債券を含む)	1,711	979
ス イ ス		
社債券(投資法人債券を含む)	530	467
オ ラ ン ダ		
特 殊 債 券	2,066	—
社債券(投資法人債券を含む)	822	2,312
ス ペ イ ン		
国 債 証 券	4,454	1,306
ベ ル ギ ー		
国 債 証 券	—	2,063
ス ウ ェ ー デ ン		
社債券(投資法人債券を含む)	878	632
オ ー ス ト リ ア		
社債券(投資法人債券を含む)	112	—

	買付額	売付額
ユ ム	千ユーロ	千ユーロ
ル ク セ ン プ ル グ		
社債券(投資法人債券を含む)	544	270
デ ン マ ー ク		
社債券(投資法人債券を含む)	221	—
日 本		
特 殊 債 券	—	—
社債券(投資法人債券を含む)	311	(900)
ア メ リ カ		
社債券(投資法人債券を含む)	1,284	1,491
メ キ シ コ		
社債券(投資法人債券を含む)	212	104
アラブ首長国連邦		
社債券(投資法人債券を含む)	—	259
ポ ー ラ ン ド	千ズロチ	千ズロチ
国 債 証 券	—	1,356
		(700)
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル	千シンガポールドル
国 債 証 券	—	2,198
韓 国	千ウォン	千ウォン
国 債 証 券	1,394,123	—
		(1,300,000)
オ ー ス ト ラ リ ア	千豪ドル	千豪ドル
国 債 証 券	—	380
特 殊 債 券	1,226	630
		(200)
メ キ シ コ	千メキシコペソ	千メキシコペソ
国 債 証 券	15,866	5,404

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

*()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
債 券 先 物 取 引	10,280	9,719	3,569	2,208

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

◎組入資産の明細

(1) 外国(外貨建)公社債

区 分	期 首					当 期			期 末				
	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
			5年以上	2年以上	2年未満		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	%	%	%	%	%	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	47.1	—	37.1	7.4	2.6	57,810	60,563	6,205,383	42.9	—	30.7	11.6	0.5
						千カナダドル	千カナダドル						
カ ナ ダ	3.6	—	2.0	1.3	0.3	3,900	4,310	404,753	2.8	—	1.5	1.3	—
						千英ポンド	千英ポンド						
イ ギ リ ス	7.3	—	5.4	1.8	—	4,100	4,736	815,579	5.6	—	4.4	0.2	1.0
						千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
ス ウ ェー デ ン	0.7	—	—	0.7	—	6,500	6,969	106,839	0.7	—	—	0.7	—
						千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノ ル ウ ェー	1.1	—	—	0.9	0.2	—	—	—	—	—	—	—	—
ユ ー ロ ッ						千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	3.1	—	2.4	0.8	—	1,700	2,079	289,486	2.0	—	2.0	—	—
イ タ リ ア	6.8	—	2.5	4.3	—	11,400	12,715	1,770,458	12.2	—	1.8	8.9	1.5
フ ラ ン ス	6.6	—	3.9	2.2	0.5	6,850	7,684	1,069,933	7.4	—	5.4	2.0	—
イ ギ リ ス	0.6	—	0.3	0.3	—	1,327	1,411	196,592	1.4	—	1.3	0.1	—
ス イ ス	0.2	—	0.2	—	—	300	301	42,035	0.3	—	0.3	—	—
オ ラ ン ダ	1.6	—	0.4	0.3	1.0	2,400	2,512	349,783	2.4	—	2.3	0.1	—
ス ペ イ ン	2.8	—	2.0	0.7	—	5,900	6,855	954,607	6.6	—	5.7	0.9	—
バ ル ギ ー	2.9	—	1.1	—	1.8	1,100	1,344	187,227	1.3	—	1.3	—	—
ス ウ ェー デ ン	0.8	—	0.8	—	—	1,050	1,209	168,380	1.2	—	1.2	—	—
オーストリア	—	—	—	—	—	100	114	15,957	0.1	—	0.1	—	—
ルクセンブルグ	—	—	—	—	—	250	279	38,969	0.3	—	—	0.3	—
デンマーク	—	—	—	—	—	200	225	31,462	0.2	—	0.2	—	—
アイルランド	0.1	—	0.1	—	—	100	107	15,009	0.1	—	0.1	—	—
日 本	0.8	—	—	—	0.8	300	310	43,242	0.3	—	0.3	—	—
ア メ リ カ	0.7	—	0.5	0.2	—	657	684	95,243	0.7	—	0.7	—	—
国 際 機 関	1.9	—	1.0	0.9	—	2,100	2,280	317,581	2.2	—	1.2	1.0	—
オーストラリア	0.6	—	0.6	—	—	600	668	93,101	0.6	—	0.6	—	—
ジャージー	0.1	—	0.1	—	—	150	151	21,071	0.1	—	0.1	—	—
アラブ首長国連邦	0.2	—	0.2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
メキシコ	—	—	—	—	—	100	114	15,901	0.1	—	0.1	—	—
ポーランド	0.2	—	0.2	—	—	200	238	33,216	0.2	—	—	0.2	—
						千ズロチ	千ズロチ						
ポ ー ラ ン ド	0.4	—	—	0.3	0.1	—	—	—	—	—	—	—	—
						千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シ ン ガ ポー ル	1.1	—	0.3	0.8	—	—	—	—	—	—	—	—	—
						千ウォン	千ウォン						
韓 国	1.0	—	0.3	—	0.8	1,800,000	1,860,176	187,877	1.3	—	1.0	0.3	—
						千豪ドル	千豪ドル						
オーストラリア	1.8	—	0.2	1.3	0.3	2,850	2,980	285,594	2.0	—	0.7	1.3	—
						千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メ キ シ コ	0.3	—	—	0.3	—	15,000	15,966	125,817	0.9	—	0.9	—	—
合 計	94.5	—	61.7	24.3	8.5	—	—	13,881,109	95.9	—	63.9	29.0	3.0

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*—印は組み入れなし。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

外国(外貨建)公社債銘柄別

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国 債 証 券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.875	1,300	1,496	153,344	2019/1/15
	MEXICO GLOBAL	5.625	2,000	2,230	228,485	2017/1/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.665	1,000	1,027	105,277	2024/1/17
	RUSSIA FOREIGN BOND	5.0	500	537	55,054	2020/4/29
	UNITED MEXICAN STATES	3.625	1,000	1,041	106,660	2022/3/15
	US TREASURY N/B	1.125	4,500	4,381	448,912	2019/5/31
	US TREASURY N/B	4.5	500	597	61,267	2036/2/15
	US TREASURY N/B	3.5	3,600	3,691	378,279	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	1,000	1,181	121,006	2041/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,000	943	96,624	2043/2/15

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
				千米ドル	千円	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
地 方 債 証 券	QUEBEC PROVINCE	5.125	600	662	67,894	2016/11/14
特殊債券(除く金融債)	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.125	800	880	90,189	2016/10/5
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	4.375	200	222	22,810	2021/2/16
	EXPORT-IMPORT BK KOREA	4.125	710	740	75,833	2015/9/9
	EXPORT-IMPORT BK KOREA	4.0	600	635	65,066	2021/1/29
	FG A95258	4.0	407	428	43,951	2040/11/1
	FG C09029	3.0	929	909	93,231	2043/3/1
	FG E09012	2.5	1,232	1,244	127,543	2027/10/1
	FG G05447	4.5	742	801	82,105	2039/5/1
	FG J16680	3.0	453	468	48,051	2026/9/1
	FG Q11213	3.0	1,764	1,726	176,915	2042/9/1
	FGOLD 15YR G13408	5.0	99	108	11,103	2024/1/1
	FGOLD 15YR G18306	4.5	139	150	15,459	2024/4/1
	FGOLD 15YR G18323	4.5	173	187	19,212	2024/9/1
	FGOLD 30YR A84626	4.5	61	65	6,749	2039/2/1
	FGOLD 30YR G03445	6.0	144	162	16,621	2037/11/1
	FGOLD 30YR G04588	5.5	310	344	35,341	2038/8/1
	FGOLD 30YR G05889	5.0	420	463	47,480	2040/5/1
	FGOLD 30YR G05984	4.5	351	378	38,821	2040/8/1
	FGOLD 30YR G08323	5.0	149	164	16,854	2039/2/1
	FN 190399	5.5	227	253	25,958	2039/11/1
	FN AA9357	4.5	578	625	64,046	2039/8/1
	FN AB1501	4.0	375	396	40,662	2040/9/1
	FN AE0981	3.5	1,088	1,113	114,083	2041/3/1
	FN AH1318	3.5	686	727	74,523	2026/1/1
	FN AH3431	3.5	415	439	45,057	2026/1/1
	FN AJ1816	4.0	881	931	95,443	2041/8/1
	FN AJ7680	3.5	1,252	1,281	131,335	2041/12/1
	FNMA 30YR 745275	5.0	233	258	26,515	2036/2/1
	FNMA 30YR 889579	6.0	154	174	17,861	2038/5/1
	FNMA 30YR 889749	5.5	183	204	20,992	2038/6/1
	FNMA 30YR 995050	6.0	96	109	11,206	2037/9/1
	FREDDIE MAC	3.75	300	328	33,690	2019/3/27
	G2 MA0318	3.5	823	852	87,307	2042/8/20
	GNMA 30YR 698484	5.0	492	541	55,472	2039/8/15
	GNMA 30YR 704185	5.5	58	65	6,718	2039/1/15
	GNMA 30YR 737086	4.5	421	460	47,165	2040/8/15
	GNMA 737914	4.0	547	582	59,671	2041/1/15
	JAPAN BANK FOR INTL COOP	1.125	1,000	1,001	102,618	2017/7/19
	JAPAN BANK FOR INTL COOP	3.375	2,000	2,085	213,707	2023/7/31
	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	2.125	328	329	33,766	2019/3/6
	NORDIC INVESTMENT BANK	5.0	500	554	56,802	2017/2/1
	SWEDISH EXPORT CREDIT	5.125	500	556	56,997	2017/3/1
普通社債券(含む投資法人債券)	21ST CENTURY FOX AMERICA	4.0	300	310	31,792	2023/10/1
	ABN AMRO BANK NV	2.5	350	354	36,355	2018/10/30
	ACE INA HOLDINGS	2.7	250	240	24,672	2023/3/13
	AMERICAN INTL GROUP	3.375	500	517	53,033	2020/8/15
	AMGEN INC	5.375	150	163	16,792	2043/5/15
	ANHEUSER-BUSCH INBEV FIN	3.7	500	516	52,894	2024/2/1
	AUTOZONE INC	2.875	400	380	38,984	2023/1/15
	BANK OF AMERICA CORP	4.1	500	517	53,050	2023/7/24
	BARRICK GOLD CORPORATION	3.85	200	194	19,927	2022/4/1
	BAT INTL FINANCE PLC	3.25	200	197	20,238	2022/6/7
	BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	5.15	200	220	22,595	2043/11/15
	BOSTON PROPERTIES LP	3.8	150	151	15,480	2024/2/1
	BPCE SA	4.0	250	249	25,579	2024/4/15
	BURLINGTN NORTH SANTA FE	3.85	300	312	32,021	2023/9/1
	CBS CORP	3.375	500	499	51,183	2022/3/1
	CONAGRA INC	3.2	250	242	24,808	2023/1/25
	DOMINION RESOURCES INC	4.45	300	328	33,665	2021/3/15
	DUKE ENERGY CORP	3.75	350	356	36,575	2024/4/15
	ENBRIDGE ENERGY PARTNERS	4.2	250	262	26,942	2021/9/15

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	ENSCO International Inco	4.7	400	433	44,385	2021/3/15
	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	5.75	200	230	23,608	2021/2/1
	FREEPORT-MCMORAN C & G	2.375	100	100	10,333	2018/3/15
	FREEPORT-MCMORAN C & G	3.55	200	195	20,059	2022/3/1
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.75	400	460	47,195	2022/1/24
	HCP INC	5.375	200	226	23,252	2021/2/1
	INDIANA MICHIGAN POWER	3.2	500	493	50,579	2023/3/15
	INTL PAPER CO	7.95	200	245	25,116	2018/6/15
	JPMORGAN CHASE & CO	2.35	600	605	62,052	2019/1/28
	KINDER MORGAN ENER PART	3.5	350	335	34,386	2023/9/1
	KRAFT FOODS INC	3.5	250	254	26,083	2022/6/6
	LINCOLN NATIONAL CORP	4.85	200	221	22,676	2021/6/24
	LORILLARD TOBACCO CO	3.75	150	147	15,073	2023/5/20
	LYB INTL FINANCE BV	4.875	150	153	15,682	2044/3/15
	MARATHON OIL CORPORATION	2.8	250	240	24,595	2022/11/1
	MORGAN STANLEY	3.75	500	505	51,805	2023/2/25
	NBCUNIVERSAL MEDIA LLC	4.375	675	740	75,826	2021/4/1
	NEXTERA ENERGY CAPITAL	4.5	200	217	22,293	2021/6/1
	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE	2.35	150	150	15,398	2019/3/4
	NUCOR CORP	4.0	200	205	21,066	2023/8/1
	OMNICOM GROUP INC	3.625	300	305	31,312	2022/5/1
	ORACLE CORP	3.625	500	512	52,535	2023/7/15
	PEMEX PROJ FDG MASTER TR	5.75	1,000	1,130	115,779	2018/3/1
	PETROHAWK ENERGY CORP	7.25	500	525	53,817	2018/8/15
	PRINCIPAL FINANCIAL GROU	3.125	200	194	19,925	2023/5/15
	RABOBANK NEDERLAND	11.0	250	335	34,388	2049/12/29
	REPUBLIC SERVICES INC	5.0	250	279	28,607	2020/3/1
	ROYAL BK OF SCOTLAND PLC	5.625	500	570	58,454	2020/8/24
	SWEDBANK AB	2.375	476	479	49,093	2019/2/27
	UNION PACIFIC CORP	2.25	400	404	41,491	2019/2/15
	VENTAS REALTY LP/CAP CRP	4.75	325	353	36,255	2021/6/1
VERIZON COMMUNICATIONS	5.15	450	503	51,619	2023/9/15	
WALGREEN COMPANY	3.1	400	391	40,109	2022/9/15	
WELLPOINT INC	3.3	400	397	40,700	2023/1/15	
WELLS FARGO & COMPANY	3.45	250	248	25,465	2023/2/13	
小 計		-	-	-	6,205,383	-
(カナダ)			千カナダドル	千カナダドル		
国 債 証 券	CANADIAN GOVERNMENT	3.25	1,000	1,086	102,055	2021/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0	300	363	34,175	2041/6/1
地 方 債 証 券	CITY OF TORONTO	5.05	500	551	51,765	2017/7/18
	ONTARIO (PROVINCE OF)	4.2	300	327	30,719	2018/3/8
	ONTARIO (PROVINCE OF)	4.0	500	544	51,147	2021/6/2
	QUEBEC PROVINCE	4.5	800	877	82,359	2017/12/1
	QUEBEC PROVINCE	5.0	300	357	33,570	2041/12/1
特殊債券(除く金融債)	JAPAN BANK FOR INTL COOP	2.3	200	201	18,960	2018/3/19
小 計		-	-	-	404,753	-
(イギリス)			千英ポンド	千英ポンド		
国 債 証 券	UK TREASURY	4.75	400	479	82,529	2030/12/7
	UK TREASURY	4.75	700	857	147,632	2038/12/7
	UK TREASURY	4.25	500	578	99,545	2046/12/7
特殊債券(除く金融債)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	5.375	500	588	101,306	2021/6/7
普通社債券(含む投資法人債券)	BANK OF AMERICA CORP	4.25	100	102	17,669	2026/12/10
	EXPERIAN FINANCE PLC	3.5	100	101	17,392	2021/10/15
	FIRSTGROUP PLC	6.125	150	166	28,649	2019/1/18
	GE CAPITAL UK FUNDING 6.	6.25	100	128	22,124	2038/5/5
	GREAT ROLLING STOCK	6.25	100	115	19,881	2020/7/27
	IMPERIAL TOBACCO FINANCE	9.0	100	134	23,107	2022/2/17
	LLOYDS BANK PLC	7.5	150	194	33,569	2024/4/15
	MACQUARIE BANK LTD	3.5	100	100	17,373	2020/12/18
	NETWORK RAIL INFRA FIN	4.875	800	848	146,015	2015/11/27
	RSA INSURANCE GROUP PLC	9.375	100	121	21,004	2039/5/20
	RWE AG	7.0	100	108	18,726	2049/3/29

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	WESTERN POWER DIST EAST	5.25	100	110	19,049	2023/1/17
	小 計	—	—	—	815,579	—
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
普通社債券(含む投資法人債券)	NORDEA HYPOTEK AB	4.5	6,500	6,969	106,839	2016/6/15
	小 計	—	—	—	106,839	—
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)						
国 債 証 券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	500	512	71,381	2023/5/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	800	1,086	151,348	2028/7/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	400	479	66,756	2042/7/4
(イタリア)						
国 債 証 券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.75	1,500	1,548	215,673	2015/12/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	4,000	4,536	631,592	2017/8/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	3,300	3,708	516,423	2018/2/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,000	1,056	147,120	2019/5/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	800	922	128,512	2024/3/1
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	600	721	100,436	2034/8/1
普通社債券(含む投資法人債券)	SNAM	3.375	200	220	30,699	2021/1/29
(フランス)						
国 債 証 券	FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,000	2,101	292,598	2024/5/25
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	1,500	1,653	230,163	2017/4/25
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	500	704	98,070	2029/4/25
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	800	991	137,997	2038/10/25
特殊債券(除く金融債)	CAISSE D'AMORT DETTE SOC	4.25	800	954	132,968	2020/4/25
普通社債券(含む投資法人債券)	CARREFOUR SA	1.75	400	411	57,286	2019/5/22
	GDF SUEZ	3.0	300	303	42,281	2049/6/2
	PERNOD RICARD SA	2.0	300	306	42,670	2020/6/22
	RCI BANQUE SA	2.25	250	257	35,896	2021/3/29
(イギリス)						
普通社債券(含む投資法人債券)	ABBEY NATL TREASURY SERV	2.0	102	105	14,697	2019/1/14
	AON PLC	2.875	100	101	14,140	2026/5/14
	BANK OF SCOTLAND PLC	3.875	300	348	48,536	2020/2/7
	BARCLAYS BANK PLC	2.25	250	250	34,895	2024/6/10
	BP CAPITAL MARKETS PLC	2.177	275	285	39,795	2021/9/28
	HAMMERSON PLC	2.75	300	319	44,526	2019/9/26
(スイス)						
普通社債券(含む投資法人債券)	CREDIT SUISSE LONDON	1.375	300	301	42,035	2019/11/29
(オランダ)						
特殊債券(除く金融債)	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	1.875	2,000	2,089	290,914	2021/1/14
普通社債券(含む投資法人債券)	ACHMEA HYPOTHEEK BANK NV	2.75	300	317	44,232	2021/2/18
	LEASEPLAN CORPORATION NV	2.375	100	105	14,636	2019/4/23
(スペイン)						
国 債 証 券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6	3,500	4,085	568,896	2019/7/30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,600	1,854	258,162	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT	5.5	800	916	127,549	2017/7/30
(ベルギー)						
国 債 証 券	BELGIUM KINGDOM	4.25	1,100	1,344	187,227	2022/9/28
(スウェーデン)						
普通社債券(含む投資法人債券)	SKANDINAVISKA ENSKILDA	4.125	800	958	133,453	2021/4/7
	SKANDINAVISKA ENSKILDA	2.5	250	250	34,926	2026/5/28
(オーストリア)						
普通社債券(含む投資法人債券)	OMV AG	6.75	100	114	15,957	2049/6/29
(ルクセンブルグ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	GLENCORE FINANCE EUROPE	4.625	250	279	38,969	2018/4/3
(デンマーク)						
普通社債券(含む投資法人債券)	TDC A/S	3.75	200	225	31,462	2022/3/2
(アイルランド)						
普通社債券(含む投資法人債券)	CRH FINANCE LTD	3.125	100	107	15,009	2023/4/3
(日本)						
普通社債券(含む投資法人債券)	SUMITOMO MITSUI BANKING	2.25	300	310	43,242	2020/12/16
(アメリカ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	AT&T INC	2.5	200	207	28,844	2023/3/15

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ)						
(アメリカ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	MET LIFE GLOB FUNDING I	2.375	100	103	14,368	2023/1/11
	MORGAN STANLEY	2.375	207	213	29,732	2021/3/31
	PROLOGIS LP	3.375	150	160	22,297	2024/2/20
(国際機関)						
特殊債券(除く金融債)	EFSF	1.625	1,000	1,041	144,997	2017/9/15
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2.5	900	984	137,058	2019/9/16
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	4.0	200	255	35,525	2037/10/15
(オーストラリア)						
普通社債券(含む投資法人債券)	COMMONWEALTH BANK AUST	3.0	600	668	93,101	2022/5/3
(ジャージー)						
普通社債券(含む投資法人債券)	UBS AG JERSEY BRANCH	4.5	150	151	21,071	2019/9/16
(メキシコ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4.125	100	114	15,901	2019/10/25
(ポーランド)						
国 債 証 券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.625	200	238	33,216	2018/6/20
小 計		—	—	—	5,749,263	—
(韓国)						
国 債 証 券	KOREA TREASURY BOND	5.75	400,000	443,423	44,785	2018/9/10
	KOREA TREASURY BOND	3.5	1,400,000	1,416,752	143,091	2024/3/10
小 計		—	—	—	187,877	—
(オーストラリア)						
特殊債券(除く金融債)	KFW	6.0	200	215	20,633	2017/3/28
	NEW S WALES TREASURY CRP	4.0	1,000	1,014	97,170	2021/4/8
	QUEENSLAND TREASURY CORP	6.0	400	436	41,865	2017/9/14
	TREASURY CORP VICTORIA	3.5	250	253	24,261	2017/11/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	5.75	1,000	1,061	101,663	2017/1/25
小 計		—	—	—	285,594	—
(メキシコ)						
国 債 証 券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	15,000	15,966	125,817	2022/6/9
小 計		—	—	—	125,817	—
合 計		—	—	—	13,881,109	—

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	期首評価額		当期末評価額	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
債 券 先 物 取 引				
2 Y - T N O T E	—	—	899	—
T N O T E (5 Y E A R)	—	—	—	1,096
B O B L	162	—	888	—
B U N D S	277	—	161	—
G I L T S	70	—	131	—
T N O T E 10 Y E A R	882	—	—	254

*単位未満は切り捨て。

*邦貨換算金額は、期首、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*一印は組み入れなし。

◎投資信託財産の構成

(2014年6月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	13,881,109	92.2
コール・ローン等、その他	1,179,699	7.8
投資信託財産総額	15,060,808	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(14,265,937千円)の投資信託財産総額(15,060,808千円)に対する比率は94.7%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=102.46円、1カナダドル=93.91円、1英ポンド=172.18円、1スウェーデンクローナ=15.33円、1ノルウェークローネ=17.16円、1ユーロ=139.24円、1ズロチ=33.96円、1シンガポールドル=81.95円、1ウォン=0.101円、1豪ドル=95.81円、1メキシコペソ=7.88円。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2014年6月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	19,113,854,386
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 (評 価 額)	574,599,699
公 社 債 (評 価 額)	13,881,109,714
未 収 入 金 息	4,364,409,373
未 収 利 息	128,675,273
前 払 託 費 用	24,167,071
差 入 委 託 拠 出 金	140,893,256
(B) 負 債	4,637,167,649
未 払 借 入 金	4,538,167,649
未 払 解 約 金	99,000,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	14,476,686,737
元 本	10,661,268,282
次 期 繰 越 損 益 金	3,815,418,455
(D) 受 益 権 総 口 数	10,661,268,282口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,579円

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注)期首元本額12,354百万円、期中追加設定元本額3,840百万円、期中一部解約元本額5,533百万円、計算口数当たり純資産額13,579円。

(注)当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額、ノムラ海外債券ファンドF(適格機関投資家専用)905百万円、ノムラ海外債券ファンドFC(適格機関投資家専用)1,824百万円、ノムラ海外債券ファンドFD(適格機関投資家専用)4,021百万円、ノムラ海外債券ファンドFVA(適格機関投資家専用)3,909百万円。

◎損益の状況

(自2013年6月11日 至2014年6月10日)

項 目	当 期
(A) 受 配 当 等 利 益	484,726,990
(受 取 取 息)	484,726,990
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	805,132,375
売 買 益	1,362,783,575
売 買 損	△ 557,651,200
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	18,655,296
取 引 益	100,060,682
取 引 損	△ 81,405,386
(D) 信 託 報 酬 等	△ 2,623,261
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	1,305,891,400
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	2,776,906,035
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,173,859,698
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 1,441,238,678
(I) 計 (E + F + G + H)	3,815,418,455
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	3,815,418,455

「当ファンドの運用の一部を委託されている米国の投資顧問会社(米国投資顧問会社)は、米国の証券関連法令(「米国法」)の適用を受けています。当該米国投資顧問会社は、米国法を遵守するという限定的な目的で、Arthur P. Bell, Jr. & Associates, L.L.C. (「アーサー・ベル社」)を、当ファンドの受益者の「独立した代理人」に任命しました。アーサー・ベル社は、「独立した代理人」として、米国法で求められている口座明細書やその他の必要な通知を、当ファンドの受益者に代わって当ファンドの受託銀行または保管銀行から受け取ります。アーサー・ベル社が「独立した代理人」としての地位を失うのは、(1)同社が辞任したとき、(2)同社の退任を当ファンドの受益者が承諾したとき、または(3)同社の解任が受益者にとって最善の利益になると独立の第三者が判断したときのみです。アーサー・ベル社が「独立した代理人」に任命されることによって、受益者のみなさまが現在受け取っている当ファンドに関する運用報告書の内容、お知らせ、その他の情報に何ら影響が及ぶものではありません。」

ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD (適格機関投資家専用)

第62期～第67期(2014年6月11日～2014年12月10日)

○当ファンドの仕組み

商品分類	—	
信託期間	2009年4月9日以降、無期限とします。	
運用方針	ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界先進主要国の公社債に投資し、中長期的な信託財産の成長とインカムゲインの確保を目標に運用を行うことを基本とします。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	日本を除く世界先進主要国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD	外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
	マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
分配方針	毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産総額		
		税金	込	み	期	中				期	中
	円	分	配	金	騰	落	率	率	率		
38期(2012年7月10日)	8,613			16	0.2		97.93	△0.2	96.3	—	百万円
39期(2012年8月10日)	8,559			18	△0.4		97.79	△0.1	95.1	—	2,326
40期(2012年9月10日)	8,644			16	1.2		99.23	1.5	95.8	—	2,267
41期(2012年10月10日)	8,667			18	0.5		99.96	0.7	95.4	—	2,261
42期(2012年11月12日)	8,808			20	1.9		101.76	1.8	97.4	—	2,163
43期(2012年12月10日)	9,211			17	4.8		106.64	4.8	95.2	—	1,938
44期(2013年1月10日)	9,837			23	7.0		114.22	7.1	95.2	—	1,932
45期(2013年2月12日)	10,482			18	6.7		122.24	7.0	95.4	—	1,905
46期(2013年3月11日)	10,570			17	1.0		123.09	0.7	94.7	—	1,839
47期(2013年4月10日)	11,062			23	4.9		129.52	5.2	95.3	—	1,846
48期(2013年5月10日)	11,279			20	2.1		132.33	2.2	95.3	—	1,928
49期(2013年6月10日)	10,733			21	△4.7		126.30	△4.6	95.0	—	1,932
50期(2013年7月10日)	10,803			21	0.8		126.76	0.4	92.7	—	1,856
51期(2013年8月12日)	10,471			21	△2.9		123.62	△2.5	95.1	—	1,910
52期(2013年9月10日)	10,627			21	1.7		126.38	2.2	94.9	—	1,883
53期(2013年10月10日)	10,577			22	△0.3		126.56	0.1	95.9	—	1,975
54期(2013年11月11日)	10,690			21	1.3		128.28	1.4	95.2	—	2,024
55期(2013年12月10日)	11,208			22	5.1		135.37	5.5	94.5	—	2,167
56期(2014年1月10日)	11,300			26	1.1		137.04	1.2	95.1	—	2,548
57期(2014年2月10日)	11,134			21	△1.3		135.64	△1.0	95.6	—	2,620
58期(2014年3月10日)	11,282			18	1.5		137.99	1.7	95.0	—	3,115
59期(2014年4月10日)	11,214			24	△0.4		137.77	△0.2	95.0	—	3,647
60期(2014年5月12日)	11,237			21	0.4		138.49	0.5	95.3	—	3,847
61期(2014年6月10日)	11,276			21	0.5		139.35	0.6	94.1	—	4,109
62期(2014年7月10日)	11,230			21	△0.2		139.33	△0.0	93.5	—	4,746
63期(2014年8月11日)	11,248			21	0.3		139.79	0.3	95.8	—	5,660
64期(2014年9月10日)	11,519			21	2.6		143.63	2.7	96.1	—	6,512
65期(2014年10月10日)	11,705			24	1.8		145.79	1.5	93.9	—	6,928
66期(2014年11月10日)	12,302			24	5.3		153.54	5.3	93.0	—	6,489
67期(2014年12月10日)	12,809			24	4.3		160.91	4.8	95.8	—	6,544
										—	7,971

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

* ベンチマーク(=「パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース)」)は、「パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス」をもとに当社が円換算したものです。なお、設定時=100として指数化しています。

* パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスは、パークレイズ・バンク・ビーエルシーおよび関連会社(パークレイズ)が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、日本円を除く世界の投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズに帰属します。

(出所: パークレイズ)

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債先物比率
		円	騰落率	パーケリス・グローバル総合 (日本円除く)インデックス (円換算ベース)	騰落率		
第62期	(期首) 2014年6月10日	11,276	%	139.35	%	94.1	%
	6月末	11,223	△0.5	138.94	△0.3	94.5	—
	(期末) 2014年7月10日	11,251	△0.2	139.33	△0.0	93.5	—
第63期	(期首) 2014年7月10日	11,230	—	139.33	—	93.5	—
	7月末	11,309	0.7	140.29	0.7	94.1	—
	(期末) 2014年8月11日	11,269	0.3	139.79	0.3	95.8	—
第64期	(期首) 2014年8月11日	11,248	—	139.79	—	95.8	—
	8月末	11,437	1.7	142.46	1.9	94.2	—
	2014年9月10日	11,540	2.6	143.63	2.7	96.1	—
第65期	(期首) 2014年9月10日	11,519	—	143.63	—	96.1	—
	9月末	11,815	2.6	147.05	2.4	96.0	—
	(期末) 2014年10月10日	11,729	1.8	145.79	1.5	93.9	—
第66期	(期首) 2014年10月10日	11,705	—	145.79	—	93.9	—
	10月末	11,861	1.3	147.61	1.2	96.1	—
	(期末) 2014年11月10日	12,326	5.3	153.54	5.3	93.0	—
第67期	(期首) 2014年11月10日	12,302	—	153.54	—	93.0	—
	11月末	12,768	3.8	159.77	4.1	94.1	—
	(期末) 2014年12月10日	12,833	4.3	160.91	4.8	95.8	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当作成期の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

基準価額の主な変動要因は、FOMC(米連邦公開市場委員会)において量的金融緩和策の終了があったものの、ECB(欧州中央銀行)による追加金融緩和策に対する期待感、イラクやシリアおよびウクライナでの地政学的リスクの高まりを受け安全資産を求める動きが強まり、国債への需要が高まったことなどでした。

当作成期を通じて円安・ドル高が進んだことも変動要因となりました。

当作成期の基準価額の騰落率は+14.9%(分配金を再投資して算出)となり、ベンチマークの+15.5%を0.6ポイント下回りました。主な差異の要因は【ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド】において、デレージョンを短期化していたことなどでした。

【運用経過】

主要投資対象の【ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド】受益証券を高位に組み入れました。実質組入外貨建て資産については、為替ヘッジを行いませんでした。

【ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド】の運用については、当作成期末には、国債53.6%、社債25.8%、政府機関債1.9%、資産担保債15.5%となりました。また、国別比率は、米国35.6%、英国11.3%、スウェーデン9.5%、オランダ7.2%、ドイツ6.7%、ニュージーランド4.9%、メキシコ4.7%等としました。通貨別比率は、米ドル60.2%、ユーロ15.1%、ポンド7.8%、スウェーデン・クローネ6.0%、メキシコ・ペソ4.9%等としました。

【分配金】

配当等収益等から、1口当たり第62期21円、第63期21円、第64期21円、第65期24円、第66期24円、第67期24円の収益分配を行いました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】

主要投資対象である【ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド】受益証券を高位に組み入れます。実質組入外貨建て資産については、為替ヘッジは行いません。

【ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド】の運用については、各国の債券利回りから、独自モデルにより算出されたインフレ予想値を差し引いた「実質金利」を比較し、相対的に高い「実質金利」の国の債券組入比率を高め、相対的に低い「実質金利」の国の債券組入比率を低めとする方針です。通貨配分戦略に関しましては、独自モデルによって算出される購買力平価等をもとに割安・割高を判断し、比率を決定いたします。

○1口当たりの費用明細

(2014年6月11日～2014年12月10日)

項 目	第62期～第67期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 48	% 0.406	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(42)	(0.351)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(3)	(0.027)	口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	2	0.017	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.016)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	50	0.423	
作成期間の平均基準価額は、11,735円です。			

* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年6月11日～2014年12月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第62期～第67期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド	千口 2,766,607	千円 4,018,800	千口 1,235,182	千円 1,781,200

* 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2014年6月11日～2014年12月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2014年12月10日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第61期末	第67期末	
	口 数	口 数	評 価 額
ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド	千口 3,379,967	千口 4,911,392	千円 7,891,625

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2014年12月10日現在)

項 目	第67期末	
	評 価 額	比 率
ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド	千円 7,891,625	% 98.8
コール・ローン等、その他	98,658	1.2
投資信託財産総額	7,990,283	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

* ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンドにおいて、第67期末における外貨建て純資産 (14,956,046千円) の投資信託財産総額 (15,561,699千円) に対する比率は96.1%です。

* 外貨建て資産は、第67期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=119.46円、1英ポンド=187.19円、1スウェーデンクローナ=15.87円、1ユーロ=147.89円、1ズロチ=35.63円、1豪ドル=99.13円、1ニュージーランドドル=91.89円、1メキシコペソ=8.29円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第62期末	第63期末	第64期末	第65期末	第66期末	第67期末
	2014年7月10日現在	2014年8月11日現在	2014年9月10日現在	2014年10月10日現在	2014年11月10日現在	2014年12月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	5,673,789,469	6,528,062,143	7,043,581,460	6,506,670,180	6,560,771,894	7,990,283,801
コール・ローン等	56,630,051	65,199,916	70,236,710	65,322,820	65,821,656	79,858,458
ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド(評価額)	5,603,359,322	6,446,562,105	6,957,044,621	6,425,647,255	6,479,950,128	7,891,625,200
未収入金	13,800,000	16,300,000	16,300,000	15,700,000	15,000,000	18,800,000
未収利息	96	122	129	105	110	143
(B) 負債	13,614,925	15,913,674	114,674,135	17,068,141	16,396,975	19,086,138
未払収益分配金	10,584,504	12,157,656	12,631,899	13,306,248	12,767,496	14,934,912
未払解約金	—	—	98,159,824	—	—	—
未払信託報酬	3,021,424	3,744,365	3,870,051	3,750,007	3,618,223	4,137,795
その他未払費用	8,997	11,653	12,361	11,886	11,256	13,431
(C) 純資産総額(A-B)	5,660,174,544	6,512,148,469	6,928,907,325	6,489,602,039	6,544,374,919	7,971,197,663
元本	5,040,240,000	5,789,360,000	6,015,190,000	5,544,270,000	5,319,790,000	6,222,880,000
次期繰越損益金	619,934,544	722,788,469	913,717,325	945,332,039	1,224,584,919	1,748,317,663
(D) 受益権総口数	504,024口	578,936口	601,519口	554,427口	531,979口	622,288口
1口当たり基準価額(C/D)	11,230円	11,248円	11,519円	11,705円	12,302円	12,809円

(注) 第62期首元本額4,209百万円、第62～第67期中追加設定元本額3,480百万円、第62～第67期中一部解約元本額1,467百万円、第67期末計算口数当たり純資産額12,809円。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額23,836,186円。(ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド)

○損益の状況

項 目	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	2014年6月11日～ 2014年7月10日	2014年7月11日～ 2014年8月11日	2014年8月12日～ 2014年9月10日	2014年9月11日～ 2014年10月10日	2014年10月11日～ 2014年11月10日	2014年11月11日～ 2014年12月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	2,834	3,796	3,954	3,379	3,398	4,104
受取利息	2,834	3,796	3,954	3,379	3,398	4,104
(B) 有価証券売買損益	△ 6,433,370	25,460,826	172,526,127	119,772,075	315,944,249	315,975,072
売買益	—	26,157,335	180,748,849	125,283,277	318,683,289	315,975,072
売買損	△ 6,433,370	△ 696,509	△ 8,222,722	△ 5,511,202	△ 2,739,040	—
(C) 信託報酬等	△ 3,030,421	△ 3,756,018	△ 3,882,412	△ 3,761,893	△ 3,629,479	△ 4,151,226
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	△ 9,460,957	21,708,604	168,647,669	116,013,561	312,318,168	311,827,950
(E) 前期繰越損益金	373,330,634	347,718,561	338,311,812	456,068,359	502,937,179	802,487,851
(F) 追加信託差損益金	266,649,371	365,518,960	419,389,743	386,556,367	422,097,068	648,936,774
(配当等相当額)	(734,731,923)	(907,912,635)	(979,996,153)	(904,172,374)	(901,408,482)	(1,191,163,133)
(売買損益相当額)	(△468,082,552)	(△542,393,675)	(△560,606,410)	(△517,616,007)	(△ 479,311,414)	(△ 542,226,359)
(G) 計(D+E+F)	630,519,048	734,946,125	926,349,224	958,638,287	1,237,352,415	1,763,252,575
(H) 収益分配金	△ 10,584,504	△ 12,157,656	△ 12,631,899	△ 13,306,248	△ 12,767,496	△ 14,934,912
次期繰越損益金(G+H)	619,934,544	722,788,469	913,717,325	945,332,039	1,224,584,919	1,748,317,663
追加信託差損益金	266,649,371	365,518,960	419,389,743	386,556,367	422,097,068	648,936,774
(配当等相当額)	(735,996,607)	(909,534,946)	(980,971,089)	(904,172,374)	(901,836,248)	(1,192,870,204)
(売買損益相当額)	(△469,347,236)	(△544,015,986)	(△561,581,346)	(△517,616,007)	(△ 479,739,180)	(△ 543,933,430)
分配準備積立金	379,752,962	376,979,615	494,327,582	558,775,672	802,487,851	1,099,380,889
繰越損益金	△ 26,467,789	△ 19,710,106	—	—	—	—

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

①書面決議の要件緩和等に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2014年12月1日＞

②書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用とする所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2014年12月1日＞

ノムラーモンドリアン海外債券ファンド マザーファンド

第6期(計算期間：2013年6月11日～2014年6月10日)

◎当期の運用経過

- (1) 主要投資対象である世界先進主要国の公社債を高位に組み入れました。
- (2) 当作成期末のセクター別組入比率については、国債61.2%、社債20.1%、政府機関債1.6%、資産担保債12.2%としました。
- (3) 当作成期末の国別組入比率については、米国27.7%、豪州11.7%、スウェーデン10.9%、英国9.0%、ポーランド7.5%等としました。
- (4) 当作成期末の通貨別組入比率については、米ドル54.8%、ユーロ14.4%、スウェーデン・クローネ7.8%、ポーランド・ズロチ7.8%、ポンド5.9%等としました。
- (5) 基準価額は当作成期初の12,809円から当作成期末13,901円となりました。基準価額の騰落率は+8.5%となり、ベンチマークの+10.3%を1.8ポイント下回りました。

◎今後の運用方針

当ファンドは、独自のモデルを活用した定量分析及び定性判断等に基づいて、国別配分、通貨配分、銘柄選択等を行ないポートフォリオを構築し、収益の獲得を目指します。また、通貨配分については、為替予約取引等を用いて債券の国別配分とは独立した通貨配分戦略を行なう場合があります。

*ベンチマーク(＝パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円換算ベース))は、パークレイズが公表する営業日前日のパークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(現地通貨ベース)を営業日当日の各通貨レート(対顧客電信売買相場仲値)で当社が独自に円換算したものです。

*パークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスは、パークレイズ・バンク・ビーエルシーおよび関連会社(パークレイズ)が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、日本円を除く世界の投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズに帰属します。

(出所：パークレイズ)

◎1万口当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	4円
合 計	4

* (a) 保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
* 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◎期中の売買及び取引の状況(自2013年6月11日 至2014年6月10日)

● 公社債

外 国	買付額	売付額
ア メ リ カ	千米ドル	千米ドル
国 債 証 券	34,835	27,934 (4,200)
特 殊 債 券	18,398	1,039 (2,517)
社債券(投資法人債券を含む)	7,071	1,551 (2,267)
カ ナ ダ	千カナダドル	千カナダドル
国 債 証 券	3,521	3,523
イ ギ リ ス	千英ポンド	千英ポンド
国 債 証 券	5,598	2,583
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ
国 債 証 券	19,593	—
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ
ド イ ツ		
国 債 証 券	7,285	4,353 (940)
イ ギ リ ス		
社債券(投資法人債券を含む)	294	1,776
オ ラ ン ダ		
社債券(投資法人債券を含む)	502	—
ア メ リ カ		
社債券(投資法人債券を含む)	369	— (450)
ポ ー ラ ン ド	千ズロチ	千ズロチ
国 債 証 券	9,698	2,506
マ レ ー シ ア	千リング	千リング
国 債 証 券	—	9,840
オ ー ス ト ラ リ ア	千豪ドル	千豪ドル
国 債 証 券	6,997	1,941
メ キ シ コ	千メキシコペソ	千メキシコペソ
国 債 証 券	31,283	—

* 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

* 単位未満は切り捨て。

* ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

* 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

◎組入資産の明細

● 外国(外貨建)公社債

区 分	期 首					当 期						末				
	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率					
			5年以上	2年以上	2年未満		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満			
ア メ リ カ	43.3	—	14.4	10.7	18.1	千米ドル 63,411	千米ドル 66,438	千円 6,807,262	45.5	—	30.4	7.9	7.1			
イ ギ リ ス	3.0	—	0.6	2.4	—	千英ポンド 4,568	千英ポンド 5,027	865,574	5.8	—	5.8	—	—			
ス ウ ェー デ ン	7.9	—	1.7	6.2	—	千スウェーデンクローナ 67,500	千スウェーデンクローナ 74,595	1,143,543	7.6	—	3.3	3.1	1.3			
ユ ー ロ						千ユーロ	千ユーロ									
ド イ ツ	7.3	—	2.4	2.4	2.5	7,250	7,946	1,106,409	7.4	—	4.5	1.7	1.2			
イ ギ リ ス	4.7	—	2.3	2.4	—	1,950	2,316	322,575	2.2	—	2.0	0.2	—			
オ ラ ン ダ	2.3	—	1.6	0.7	—	2,241	2,426	337,919	2.3	—	1.5	0.7	—			
ス ウ ェー デ ン	0.8	—	0.8	—	—	640	674	93,930	0.6	—	—	0.6	—			
ア メ リ カ	1.2	—	1.2	—	—	855	885	123,341	0.8	—	0.8	—	—			
オーストラリア	1.2	—	—	1.2	—	850	944	131,514	0.9	—	—	0.9	—			
ポ ー ラ ン ド	7.5	—	3.9	1.8	1.9	千ズロチ 29,730	千ズロチ 33,256	1,129,378	7.5	—	4.4	2.1	1.1			
マ レ ー シ ア	3.0	—	0.6	2.4	—	千リンギ —	千リンギ —	—	—	—	—	—	—			
オーストラリア	9.2	—	3.0	2.1	4.1	千豪ドル 14,496	千豪ドル 15,147	1,451,241	9.7	—	4.5	2.6	2.6			
メ キ シ コ	4.4	—	3.5	—	0.9	千メキシコペソ 82,000	千メキシコペソ 89,959	708,884	4.7	—	2.1	2.1	0.6			
合 計	95.9	—	36.2	32.3	27.4	—	—	14,221,576	95.0	—	59.3	21.9	13.8			

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 一印は組み入れなし。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

外国(外貨建)公社債銘柄別

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国 債 証 券	EMIRATE OF ABU DHABI	6.75	1,900	2,328	238,602	2019/4/8
	STATE OF QATAR	4.0	2,150	2,195	224,970	2015/1/20
	US TREASURY N/B	0.25	1,850	1,851	189,728	2014/12/15
	US TREASURY N/B	1.75	1,380	1,405	143,957	2015/7/31
	US TREASURY N/B	2.375	1,920	1,991	204,031	2016/3/31
	US TREASURY N/B	0.625	1,930	1,934	198,249	2016/8/15
	US TREASURY N/B	0.875	680	681	69,820	2017/4/30
	US TREASURY N/B	1.0	6,875	6,611	677,446	2019/8/31
	US TREASURY N/B	1.125	2,060	1,964	201,272	2020/4/30
特殊債券(除く金融債)	US TREASURY N/B	3.875	5,320	5,797	594,017	2040/8/15
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	4.375	2,100	2,336	239,372	2021/2/16
	FG G08528	3.0	6,784	6,639	680,260	2043/4/1
	FG Q19379	3.0	1,986	1,944	199,227	2043/6/1

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
特殊債券(除く金融債)	FN 889983	6.0	281	317	32,553	2038/10/1
	FN 929964	6.0	442	497	50,982	2038/9/1
	FN 995251	6.0	682	770	78,921	2038/11/1
	FN 995279	6.0	325	367	37,665	2038/12/1
	FN AB0536	6.0	228	257	26,412	2037/2/1
	FN AE0643	6.0	407	459	47,064	2040/4/1
	FN AE0755	7.0	279	313	32,083	2040/1/1
	FN AE0825	6.0	302	340	34,836	2039/10/1
	FN AL0914	6.0	780	881	90,279	2041/2/1
	FN AL3074	6.0	950	1,074	110,045	2039/10/1
	FN AL3365	6.0	922	1,040	106,604	2041/5/1
KOMMUNALBANKEN AS	2.375	2,900	2,992	306,642	2016/1/19	
TEMASEK FINANCIAL I LTD	4.3	1,010	1,116	114,428	2019/10/25	
普通社債券(含む投資法人債券)	BANK OF AMERICA CORP	7.625	650	804	82,435	2019/6/1
	BANK OF AMERICA CORP	4.1	1,285	1,330	136,339	2023/7/24
	CAISSE FRANCAISE DE FIN	5.25	980	1,073	109,969	2017/2/16
	DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	8.75	880	1,282	131,371	2030/6/15
	E.ON INTL FINANCE BV	5.8	1,340	1,527	156,517	2018/4/30
	LLOYDS BANK PLC	5.8	1,270	1,478	151,524	2020/1/13
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.625	1,592	1,702	174,461	2019/10/15
	RABOBANK NEDERLAND UTREC	3.875	885	933	95,696	2022/2/8
	ROYAL BANK OF CANADA	1.2	2,100	2,094	214,590	2017/9/19
	STADSHYPOTEK AB	1.875	1,677	1,650	169,150	2019/10/2
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	5.125	965	1,096	112,368	2020/3/30
	SWEDBANK HYPOTEK AB	1.375	1,113	1,107	113,427	2018/3/28
UNITED OVERSEAS BANK LTD	2.875	2,225	2,244	229,934	2022/10/17	
小 計		-	-	-	6,807,262	-
(イギリス)			千英ポンド	千英ポンド		
国 債 証 券	UK TREASURY	3.75	1,640	1,792	308,636	2020/9/7
	UK TREASURY	3.75	2,150	2,352	405,058	2021/9/7
	UK TREASURY	4.25	778	882	151,879	2027/12/7
小 計		-	-	-	865,574	-
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
国 債 証 券	SWEDISH GOVERNMENT	4.5	11,700	12,253	187,844	2015/8/12
	SWEDISH GOVERNMENT	3.75	27,600	30,224	463,345	2017/8/12
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	28,200	32,116	492,353	2022/6/1
小 計		-	-	-	1,143,543	-
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)						
国 債 証 券	BUNDES OblIGATION	1.75	460	470	65,481	2015/10/9
	BUNDES OblIGATION	0.5	465	470	65,517	2017/10/13
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	215	248	34,597	2019/7/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	2,160	2,407	335,165	2021/1/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,250	1,498	208,615	2042/7/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	650	677	94,307	2044/7/4

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)				千ユーロ	千円	
(ドイツ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	BAYERISCHE LANDESBANK	3.25	750	772	107,558	2015/6/8
	DEUT PFANDBRIEFBANK AG	3.375	1,300	1,401	195,166	2017/1/18
(イギリス)						
普通社債券(含む投資法人債券)	HSBC HOLDINGS PLC	6.25	150	176	24,564	2018/3/19
	HSBC HOLDINGS PLC	6.0	1,020	1,233	171,750	2019/6/10
	NATIONAL GRID PLC	4.375	780	906	126,261	2020/3/10
(オランダ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	ING BANK NV	3.5	1,100	1,123	156,441	2020/9/16
	ING BANK NV	6.125	441	506	70,462	2023/5/29
	RABOBANK NEDERLAND	4.75	700	797	111,016	2018/1/15
(スウェーデン)						
普通社債券(含む投資法人債券)	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	2.25	640	674	93,930	2018/6/14
(アメリカ)						
普通社債券(含む投資法人債券)	ZURICH FINANCE (USA) INC	4.5	855	885	123,341	2025/6/15
(オーストラリア)						
普通社債券(含む投資法人債券)	TELSTRA CORP LTD.	4.75	850	944	131,514	2017/3/21
小 計		—	—	—	2,115,692	—
(ポーランド)				千ズロチ		
国 債 証 券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	4,630	4,738	160,914	2015/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	8,450	9,126	309,918	2017/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	16,650	19,391	658,545	2022/9/23
小 計		—	—	—	1,129,378	—
(オーストラリア)				千豪ドル		
国 債 証 券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	4,075	4,103	393,139	2014/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	3,930	4,085	391,462	2016/6/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,431	1,518	145,529	2020/4/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	5,060	5,438	521,110	2027/4/21
小 計		—	—	—	1,451,241	—
(メキシコ)				千メキシコペソ	千メキシコペソ	
国 債 証 券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	34,400	39,618	312,193	2018/12/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	36,900	39,278	309,512	2022/6/9
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9.5	10,700	11,063	87,178	2014/12/18
小 計		—	—	—	708,884	—
合 計		—	—	—	14,221,576	—

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成

(2014年6月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	14,221,576	92.8
コール・ローン等、その他	1,104,664	7.2
投資信託財産総額	15,326,240	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(14,692,228千円)の投資信託財産総額(15,326,240千円)に対する比率は95.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=102.46円、1カナダドル=93.91円、1英ポンド=172.18円、1スウェーデンクローナ=15.33円、1ユーロ=139.24円、1ズロチ=33.96円、1豪ドル=95.81円、1メキシコペソ=7.88円。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2014年6月10日)現在

◎損益の状況

(自2013年6月11日 至2014年6月10日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	18,168,354,907
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	781,960,993
公 社 債 (評 価 額)	14,221,576,545
未 収 入 金	2,979,602,736
未 収 利 息	164,450,531
前 払 費 用	20,764,102
(B) 負 債	3,204,964,233
未 払 金	3,166,864,233
未 払 解 約 金	38,100,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	14,963,390,674
元 本	10,764,580,142
次 期 繰 越 損 益 金	4,198,810,532
(D) 受 益 権 総 口 数	10,764,580,142口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,901円

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	440,398,081
受 取 利 息	440,398,081
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	553,504,623
売 買 益	911,106,795
売 買 損	△ 357,602,172
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,828,442
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	990,074,262
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,280,571,522
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,552,356,232
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 624,191,484
(H) 計 (D + E + F + G)	4,198,810,532
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	4,198,810,532

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注)期首元本額8,118百万円、期中追加設定元本額4,637百万円、期中一部解約元本額1,991百万円、計算口数当たり純資産額13,901円。

(注)当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額、ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFC(適格機関投資家専用)1,531百万円、ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFD(適格機関投資家専用)3,379百万円、ノムラーモンドリアン海外債券ファンドFVA(適格機関投資家専用)4,773百万円、ノムラーモンドリアン海外債券ファンドF(適格機関投資家専用)1,079百万円。

ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン) ー 海外債券ファンド Fクラス/FCクラス/FDクラス/FVAクラス

2013年12月31日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	円建て英領ケイマン諸島籍外国投資信託
運 用 方 針	世界に分散した債券ポートフォリオへ投資することにより、ベンチマーク指数を上回る収益の確保を目指して運用を行います。 ファンドは、バークレイズ・グローバル総合(日本円除く)インデックスをベンチマークとします。
投 資 対 象	世界各国の発行体が発行する債券および先進諸国上場国債先物に主に投資を行います。
受 託 会 社 管理事務代行会社	ステート・ストリート・ケイマン・トラスト・カンパニー・リミテッド
投 資 顧 問 会 社	ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー
保 管 受 託 銀 行	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー

*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

*掲載している組入資産の明細及び計算書等は、Wellington Management Portfolios (Cayman) - World Bond Fund(ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン)ー海外債券ファンド)の年次報告書から抜粋・邦訳したものです。

◎計算書

●運用計算書

2013年1月1日から2013年12月31日までの期間

収益		
受取利息	\$	2,345,331
受取銀行利息		753
投資有価証券売買に係る実現損益		14,924
外国為替取引に係る実現損益	(15,434,012)	
先物取引に係る実現損益		829,290
投資有価証券に係る未実現損益	(2,176,198)	
外国為替取引に係る未実現損益		846,948
先物取引に係る未実現損益		564,378
収益合計	\$	<u>(13,008,586)</u>
費用		
パフォーマンス・フィー	\$	48,688
保管手数料		118,564
運用報酬		261,123
事務管理手数料		155,667
先物取引およびオプション取引に係る手数料		124,728
専門家報酬		41,926
名義書換代理人手数料		23,999
受託手数料		18,002
支払金利		5,459
費用合計	\$	<u>798,156</u>
税引前損益		(13,806,742)
源泉税		(36,192)
純投資損益	\$	<u>(13,842,934)</u>
財務費用		
収益分配クラスの保有者に対する分配：		
FCクラス	\$	(74,325)
FDクラス		(297,245)
		<u>(371,570)</u>
純資産の増減額	\$	<u>(14,214,504)</u>

期末一口あたり純資産価格

FCクラス(期末純資産総額\$6,789,349/期末口数61,166)	\$	111.00
FCクラス(期末純資産総額¥713,594,547/期末口数61,166)	¥	11,667
FDクラス(期末純資産総額\$19,440,851/期末口数153,471)	\$	126.67
FDクラス(期末純資産総額¥2,043,330,684/期末口数153,471)	¥	13,314
Fクラス(期末純資産総額\$11,405,211/期末口数91,733)	\$	124.33
Fクラス(期末純資産総額¥1,198,744,677/期末口数91,733)	¥	13,068
FVAクラス(期末純資産総額\$56,131,775/期末口数461,527)	\$	121.62
FVAクラス(期末純資産総額¥5,899,730,252/期末口数461,527)	¥	12,783

◎組入資産の明細(2013年12月31日現在)

◎有価証券明細*1

有価証券	額面金額/ユニット数	満期日	表面利率(%)	通貨	評価額(\$)
現金等価物					
ABBEY NATL TREASURY SERV	100,000	01/15/2014	4.000	USD	103,280
ALLIANT ENERGY CORP	105,000	03/08/2014	5.000	USD	108,640
CANADIAN GOVERNMENT	325,000	03/13/2014	2.750	CAD	312,219
COMMONWEALTH BANK AUST	100,000	03/14/2014	2.375	USD	103,341
DUKE ENERGY CORP	45,000	03/25/2014	4.500	USD	46,592
ENEL FINANCE INTL NV	100,000	04/07/2014	3.000	USD	103,073
EUROPEAN INVESTMENT BANK	100,000	04/15/2014	3.125	USD	101,134
FREDDIE MAC	375,000	04/23/2014	2.500	USD	379,544
FANNIE MAE	470,000	05/15/2014	8.250	USD	476,305
TREASURY CORP VICTORIA	30,000	05/27/2014	5.375	AUD	27,583
ONTARIO (PROVINCE OF)	100,000	06/01/2014	5.000	CAD	96,240
PNC FUNDING CORP	25,000	06/10/2014	5.400	USD	25,630
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	50,000	07/14/2014	1.375	USD	52,312
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000	08/01/2014	4.250	EUR	743,024
TORONTO DOMINION BANK	35,000	09/15/2014	3.950	USD	35,438
US BANCORP	50,000	09/16/2014	3.875	USD	51,234
BAYER CAPITAL CORP BV	55,000	09/20/2014	5.100	EUR	78,982
XEROX CORPORATION	15,000	09/26/2014	4.625	USD	15,560
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000	10/06/2014	3.000	EUR	666,431
HOLCIM FINANCE LUX SA	50,000	10/15/2014	4.000	EUR	71,403
IRISH TSY 4 2014	50,000	10/15/2014	4.750	EUR	71,613
EUROPEAN INVESTMENT BANK	50,000	11/10/2014	3.875	EUR	70,989
SFEF	125,000	11/15/2014	6.000	EUR	177,251
AMERICAN HONDA FINANCE	100,000	11/20/2014	2.875	EUR	142,598
VATTENFALL AB	110,000	12/09/2014	4.375	EUR	157,661
INTER AMERICAN DEVEL BK	100,000	05/27/2014	4.500	AUD	90,863
UBS AG LONDON	10,000	10/06/2014	4.400	EUR	14,151
SCHLUMBERGER FINANCE BV	50,000	03/25/2014	5.000	EUR	71,899
現金等価物合計					4,394,987
金融					
NATIONAL RURAL UTIL COOP	100,000	02/02/2015	4.250	USD	101,002
GOLDMAN SACHS GROUP INC	35,000	02/02/2015	3.750	EUR	51,554
ACE INA HOLDINGS	75,000	03/13/2043	4.150	USD	68,918
AMERICAN EXPRESS CO	57,000	12/02/2022	2.650	USD	52,999
AMERICAN INTL GROUP	100,000	09/15/2016	4.875	USD	111,268
AMERICAN INTL GROUP	50,000	06/01/2022	4.875	USD	53,944
BANCO DO BRASIL (CAYMAN)	100,000	01/22/2020	6.000	USD	108,150
BANK OF AMERICA CORP	50,000	08/15/2016	5.750	USD	56,227
BANK OF AMERICA CORP	40,000	05/01/2018	5.650	USD	45,907
BANK OF AMERICA CORP	35,000	06/01/2019	7.625	USD	43,634
BANK OF AMERICA CORP	50,000	05/13/2021	5.000	USD	54,972
BANK OF MONTREAL	65,000	01/11/2017	2.500	USD	67,723
BANK OF NOVA SCOTIA	100,000	10/30/2018	2.050	USD	99,409
BERKSHIRE HATHAWAY FIN	100,000	01/15/2021	4.250	USD	108,228
BLACKROCK INC	15,000	12/10/2019	5.000	USD	16,980
CITIGROUP INC	30,000	08/15/2017	6.000	USD	34,873
CITIGROUP INC	185,000	11/21/2017	6.125	USD	214,510
CITIGROUP INC	75,000	08/09/2020	5.375	USD	86,913
CITIGROUP INC	75,000	01/10/2017	4.450	USD	82,870
CITIGROUP INC	100,000	09/26/2018	2.500	USD	101,164
DEUTSCHE BANK AG LONDON	100,000	01/11/2016	3.250	USD	106,121
AVIVA PLC	80,000	11/14/2036	6.125	GBP	138,668
HBOS PLC	50,000	03/20/2015	4.875	EUR	74,138
GENERAL ELEC CAP CORP	55,000	02/11/2021	5.300	USD	62,658
GENERAL ELEC CAP CORP	40,000	01/14/2038	5.875	USD	46,655
GENERAL ELEC CAP CORP	40,000	05/01/2018	5.625	USD	46,310
GENERAL ELEC CAP CORP	90,000	08/07/2019	6.000	USD	107,758
GENERAL ELEC CAP CORP	65,000	01/08/2020	5.500	USD	76,154
GENERAL ELEC CAP CORP	175,000	01/07/2021	4.625	USD	194,740
GENERAL ELEC CAP CORP	75,000	04/27/2017	2.300	USD	77,397
GOLDMAN SACHS GROUP INC	120,000	02/15/2019	7.500	USD	149,556
GOLDMAN SACHS GROUP INC	75,000	03/15/2020	5.375	USD	84,597
GOLDMAN SACHS GROUP INC	85,000	07/27/2021	5.250	USD	94,971
HARTFORD FINL SVCS GRP	21,000	04/15/2022	5.125	USD	23,101

ING BANK NV	200,000	03/07/2017	3.750	USD	213,019
JPMORGAN CHASE + CO	25,000	06/27/2017	6.125	USD	28,412
JPMORGAN CHASE + CO	20,000	05/15/2038	6.400	USD	24,034
JPMORGAN CHASE + CO	125,000	04/23/2019	6.300	USD	149,019
JPMORGAN CHASE + CO	100,000	08/15/2021	4.350	USD	107,035
LYB INTL FINANCE BV	100,000	07/15/2023	4.000	USD	100,539
LINCOLN NATIONAL CORP	45,000	09/01/2023	4.000	USD	45,084
MACQUARIE GROUP LTD	50,000	12/03/2018	3.000	USD	49,915
METLIFE INC	80,000	06/01/2016	6.750	USD	91,412
MORGAN STANLEY	65,000	07/28/2021	5.500	USD	74,154
NEW YORK LIFE GLOBAL FDG	125,000	05/15/2017	1.650	USD	125,401
NORDEA BANK AB	200,000	03/20/2017	3.125	USD	210,890
PNC FUNDING CORP	100,000	06/10/2019	6.700	USD	120,508
KFW	125,000	12/07/2015	5.500	GBP	225,883
RIO TINTO FIN USA PLC	25,000	03/22/2042	4.750	USD	24,625
BANK OF AMERICA CORP	20,000	12/04/2019	5.500	GBP	37,082
ALLIANZ SE	210,000	12/31/2049	5.500	EUR	304,829
ROYAL BANK OF CANADA	50,000	12/15/2015	2.625	USD	51,896
TORONTO DOMINION BANK	100,000	10/19/2016	2.375	USD	104,298
UBS AG STAMFORD CT	100,000	04/25/2018	5.750	USD	115,859
RABOBANK NEDERLAND	75,000	05/20/2019	5.875	EUR	122,621
UNUMPROVIDENT FINANCE CO	75,000	11/15/2015	6.850	USD	82,745
DNB BOLIGKREDITT AS	380,000	01/20/2017	3.375	EUR	581,016
WELLPOINT INC	25,000	08/15/2020	4.350	USD	26,834
WELLPOINT INC	100,000	01/15/2044	5.100	USD	101,219
WELLS FARGO + COMPANY	200,000	04/01/2021	4.600	USD	221,545
WELLS FARGO + COMPANY	65,000	03/08/2022	3.500	USD	65,731
WELLS FARGO + COMPANY	175,000	05/08/2017	2.100	USD	178,805
WELLS FARGO + COMPANY	75,000	08/15/2023	4.125	USD	75,107
BARCLAYS BANK PLC	75,000	01/20/2017	4.000	EUR	115,834
NORDEA BANK AB	50,000	03/26/2020	4.500	EUR	77,382
DNB BOLIGKREDITT AS	100,000	04/20/2016	2.750	EUR	144,628
OP MORTGAGE BANK	175,000	07/11/2019	3.500	EUR	270,048
BNP PARIBAS	75,000	01/14/2022	4.125	EUR	119,290
SOCIETE GENERALE	100,000	04/20/2016	4.000	EUR	151,137
SANTANDER INTL DEBT SA	100,000	10/04/2017	4.125	EUR	150,331
MUNICH RE	100,000	05/26/2041	6.000	EUR	164,361
AXA SA	50,000	04/16/2040	5.250	EUR	76,141
BANK OF AMERICA CORP	100,000	09/14/2018	0.827	EUR	129,509
NRW.BANK	75,000	05/29/2017	4.500	EUR	118,741
LLOYDS BANK PLC	150,000	01/11/2017	3.500	EUR	230,239
KFW	225,000	02/09/2022	5.500	AUD	213,586
BNP PARIBAS HOME LOAN CO	200,000	03/22/2022	3.125	EUR	303,907
SKANDINAVISKA ENSKILDA	100,000	11/14/2019	1.875	EUR	136,963
BBVA SENIOR FINANCE SA	100,000	01/17/2018	3.750	EUR	151,430
FCE BANK PLC	100,000	09/09/2016	1.625	EUR	139,454
RABOBANK CAP FD TR IV	25,000	12/31/2049	5.556	GBP	42,437
BANK OF SCOTLAND PLC	75,000	12/20/2024	4.875	GBP	135,764
AYT CEDULAS CAJAS IX	100,000	03/31/2015	3.750	EUR	144,837
ING BANK NV	75,000	09/16/2020	3.500	EUR	105,161
CAISSE REFINANCE L HABIT	100,000	04/25/2017	3.500	EUR	153,101
BANK OF AMERICA CORP	50,000	02/07/2017	4.625	EUR	76,756
HSBC FINANCE CORP	50,000	05/30/2017	4.875	EUR	78,913
JP MORGAN CHASE BANK NA	100,000	05/31/2017	0.994	EUR	136,145
AMERICAN INTL GROUP	50,000	06/26/2017	5.000	EUR	78,547
KFW	220,000	08/30/2017	3.375	CHF	277,636
CREDIT AGRICOLE SA	50,000	02/01/2018	5.971	EUR	82,577
CREDIT SUISSE LONDON	175,000	01/25/2017	3.875	EUR	269,507
EADS FINANCE B.V.	75,000	08/12/2016	4.625	EUR	115,049
GAZPROM (GAZ CAPITAL SA)	150,000	04/23/2019	9.250	USD	186,746
LLOYDS BANK PLC	50,000	09/03/2019	5.375	EUR	82,730
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	75,000	05/26/2016	5.500	GBP	139,423
ROYAL BK OF SCOTLAND PLC	100,000	09/30/2019	5.375	EUR	160,868
HSBC HOLDINGS PLC	85,000	05/20/2024	6.500	GBP	174,227
LUKOIL INTL FINANCE BV	100,000	11/05/2019	7.250	USD	116,628
DEUT PFANDBRIEFBANK AG	575,000	01/18/2017	3.375	EUR	880,010
ABN AMRO BANK NV	100,000	04/11/2016	4.250	EUR	152,136
ABB FINANCE BV	101,000	03/26/2019	2.625	EUR	147,171
BARCLAYS BANK PLC	200,000	03/02/2022	4.250	EUR	332,153
ABN AMRO BANK NV	175,000	06/22/2020	3.625	EUR	273,286
SOCIETE GENERALE SCF	50,000	03/27/2019	5.000	EUR	83,805

STANDARD CHARTERED PLC	100,000	11/23/2022	3.625	EUR	134,254
金融合計					13,756,438
資本金・サービス					
AXA SA	150,000	01/23/2015	4.000	EUR	223,513
AT+T INC	245,000	02/01/2018	5.500	USD	281,406
ALTRIA GROUP INC	18,000	11/10/2018	9.700	USD	23,906
AMERICA MOVIL SAB DE CV	100,000	03/30/2020	5.000	USD	110,158
ANADARKO PETROLEUM CORP	75,000	03/15/2019	8.700	USD	96,877
ANHEUSER BUSCH INBEV WOR	70,000	01/15/2019	7.750	USD	89,908
ASTRAZENECA PLC	75,000	09/15/2017	5.900	USD	87,063
AT+T INC	50,000	09/01/2040	5.350	USD	50,363
BG ENERGY CAPITAL PLC	200,000	10/15/2016	2.875	USD	209,994
BP CAPITAL MARKETS PLC	75,000	11/06/2022	2.500	USD	68,573
BRITISH TELECOM PLC	25,000	12/07/2028	5.750	GBP	45,977
BOEING CO	25,000	03/15/2039	6.875	USD	33,553
CBS CORP	45,000	03/01/2022	3.375	USD	43,454
CF INDUSTRIES INC	55,000	06/01/2023	3.450	USD	50,386
CARDINAL HEALTH INC	125,000	03/15/2043	4.600	USD	118,415
CATERPILLAR INC	50,000	05/27/2021	3.900	USD	52,119
CATERPILLAR FINANCIAL SE	75,000	03/24/2017	1.750	USD	75,268
COCA COLA CO/THE	50,000	11/15/2020	3.150	USD	50,924
COMCAST CORP	75,000	05/15/2038	6.400	USD	87,219
CONOCOPHILLIPS	100,000	02/01/2039	6.500	USD	128,110
COX COMMUNICATIONS INC	50,000	03/01/2039	8.375	USD	62,035
DAIMLER FINANCE NA LLC	150,000	04/10/2017	2.400	USD	153,146
DEERE + COMPANY	50,000	06/08/2022	2.600	USD	46,836
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	100,000	07/08/2019	6.000	USD	118,651
DEVON ENERGY CORPORATION	35,000	07/15/2021	4.000	USD	36,254
DOW CHEMICAL CO/THE	45,000	11/15/2041	5.250	USD	45,136
EMC CORP	125,000	06/01/2023	3.375	USD	120,452
ECOLAB INC	150,000	12/08/2021	4.350	USD	155,957
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	50,000	08/15/2042	4.850	USD	48,004
GILEAD SCIENCES INC	50,000	12/01/2041	5.650	USD	55,897
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL	95,000	05/08/2022	2.850	USD	89,997
HALLIBURTON COMPANY	25,000	09/15/2018	5.900	USD	29,523
HOLCIM US FINANCE SARL +	30,000	12/30/2019	6.000	USD	33,913
HOME DEPOT INC	25,000	09/15/2040	5.400	USD	27,462
HONEYWELL INTERNATIONAL	50,000	03/01/2021	4.250	USD	54,355
IBM CORP	125,000	02/06/2017	1.250	USD	125,304
INTL PAPER CO	40,000	06/15/2018	7.950	USD	48,729
KROGER CO/THE	105,000	10/01/2015	3.900	USD	111,549
LOWE S COMPANIES INC	75,000	04/15/2021	3.750	USD	77,977
MCDONALD S CORP	45,000	02/15/2042	3.700	USD	38,740
MEDTRONIC INC	150,000	03/15/2022	3.125	USD	147,127
MERCK + CO INC	50,000	01/15/2021	3.875	USD	53,630
MICROSOFT CORP	100,000	06/01/2019	4.200	USD	110,573
NBCUNIVERSAL MEDIA LLC	10,000	04/01/2021	4.375	USD	10,694
21ST CENTURY FOX AMERICA	65,000	08/15/2020	5.650	USD	74,226
NOBLE ENERGY INC	25,000	03/01/2019	8.250	USD	31,761
GLENCORE CANADA CORP	45,000	06/15/2035	6.200	USD	44,131
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	65,000	06/01/2016	4.125	USD	70,140
ORACLE CORP	50,000	07/15/2020	3.875	USD	53,666
PEMEX PROJ FDG MASTER TR	75,000	03/01/2018	5.750	USD	85,250
PEPSICO INC	100,000	05/10/2016	2.500	USD	104,107
PEPSICO INC	90,000	03/05/2042	4.000	USD	79,535
PETROBRAS INTL FIN CO	175,000	01/27/2016	3.875	USD	182,694
PETROLEOS MEXICANOS	250,000	03/15/2015	4.875	USD	265,089
PETROLEOS MEXICANOS	50,000	06/27/2044	5.500	USD	45,781
PHILIP MORRIS INTL INC	200,000	11/15/2021	2.900	USD	191,672
PROCTER + GAMBLE CO/THE	125,000	02/06/2022	2.300	USD	118,313
REPUBLIC SERVICES INC	65,000	03/01/2020	5.000	USD	72,364
ORANGE SA	10,000	01/23/2034	5.625	GBP	18,710
SCHLUMBERGER INVESTMENT	45,000	08/01/2022	2.400	USD	41,694
STATOIL ASA	100,000	04/15/2019	5.250	USD	114,445
TELEFONICA EMISIONES SAU	100,000	02/16/2021	5.462	USD	107,563
TIME WARNER INC	50,000	11/15/2016	5.875	USD	56,784
TIME WARNER INC	75,000	01/15/2021	4.700	USD	81,252
TIME WARNER ENT	25,000	07/15/2033	8.375	USD	28,203
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	75,000	10/24/2018	2.000	USD	75,257
BASF FINANCE EUROPE NV	50,000	06/09/2015	5.125	EUR	75,331

ROCHE HLDGS INC	22,000	03/04/2016	5.625	EUR	34,902
TELEFONICA EMISIONES SAU	50,000	04/01/2016	5.496	EUR	77,984
UNITED TECHNOLOGIES CORP	100,000	04/15/2020	4.500	USD	109,742
UNITEDHEALTH GROUP INC	50,000	02/15/2018	6.000	USD	58,899
UNITEDHEALTH GROUP INC	100,000	11/15/2041	4.625	USD	95,053
CARGILL INC	50,000	07/24/2015	6.250	EUR	76,606
LINDE FINANCE BV	50,000	12/08/2015	6.750	EUR	77,204
VALE OVERSEAS LIMITED	20,000	09/15/2019	5.625	USD	22,063
VERIZON COMMUNICATIONS	100,000	04/01/2037	6.250	USD	112,379
VERIZON COMMUNICATIONS	155,000	09/15/2023	5.150	USD	168,706
VIACOM INC	75,000	10/05/2017	6.125	USD	85,966
VIACOM INC	75,000	09/15/2019	5.625	USD	86,541
VODAFONE GROUP PLC	175,000	03/16/2021	4.375	USD	184,008
WAL MART STORES INC	150,000	07/01/2015	4.500	USD	162,544
WAL MART STORES INC	100,000	10/25/2040	5.000	USD	105,536
BG ENERGY CAPITAL PLC	100,000	11/16/2018	3.000	EUR	146,019
TESCO PLC	100,000	11/02/2018	3.375	EUR	148,173
BP CAPITAL MARKETS PLC	50,000	10/06/2017	3.830	EUR	75,747
HUTCH WHAMPOA FINANCE 06	50,000	09/21/2016	4.625	EUR	76,122
BHP BILLITON FINANCE LTD	100,000	11/29/2018	2.125	EUR	141,073
NESTLE FINANCE INTL LTD	40,000	10/17/2016	0.750	EUR	55,440
ROSNEFT(ROSNEFT INT FIN)	200,000	03/06/2017	3.149	USD	204,262
TELEFONICA EMISIONES SAU	50,000	02/02/2016	4.375	EUR	75,967
BRISTOL MYERS SQUIBB CO	50,000	11/15/2016	4.375	EUR	75,915
ORANGE SA	100,000	02/21/2017	4.750	EUR	157,951
PROCTER + GAMBLE CO/THE	50,000	05/11/2027	4.875	EUR	84,212
WOLTERS KLUWER NV	50,000	04/10/2018	6.375	EUR	84,966
BRITISH TELECOM PLC	50,000	07/07/2015	6.500	EUR	76,926
TOTAL CAPITAL SA	75,000	05/19/2015	3.625	EUR	109,994
COMPAGNIE DE ST GOBAIN	50,000	10/08/2018	4.000	EUR	75,840
KONINKLIJKE KPN NV	50,000	09/30/2024	5.625	EUR	80,270
PFIZER INC	100,000	06/03/2021	5.750	EUR	174,556
IMPERIAL TOBACCO FINANCE	50,000	02/17/2016	8.375	EUR	84,283
IMPERIAL TOBACCO FINANCE	50,000	02/17/2022	9.000	GBP	116,029
SIEMENS FINANCIERINGSMAT	50,000	02/20/2017	5.125	EUR	80,597
TESCO PLC	50,000	02/24/2022	6.125	GBP	98,122
COCA COLA ENTERPRISES	130,000	05/07/2025	2.375	EUR	167,993
PPR	75,000	04/23/2019	3.125	EUR	111,198
HEINEKEN NV	100,000	08/04/2020	2.125	EUR	137,124
CRH FINLAND SERVICES OYJ	125,000	10/15/2020	2.750	EUR	173,144
CNPC GENERAL CAPITAL	200,000	04/16/2018	1.950	USD	194,491
HUTCH WHAM INT 09 LTD	125,000	04/09/2019	7.625	USD	153,201
VOTORANTIM OVERSEAS IV	100,000	06/24/2020	7.750	USD	114,526
資本財・サービス合計					10,479,368

モーゲージ債

FNMA CONV 15YR TBA	425,000	12/01/2099	2.500	USD	420,617
FNMA TBA 15 YR	125,000	12/01/2099	3.000	USD	127,563
FNMA TBA 15 YR	50,000	12/01/2099	3.500	USD	52,287
FNMA TBA 30YR SINGLE FAMILY JA	1,000,000	12/01/2099	3.500	USD	993,359
FNMA TBA SINGLE FAMILY JAN 15	50,000	12/01/2099	4.000	USD	52,980
FNMA TBA SINGLE FAMILY MORTGAG	175,000	12/01/2099	4.000	USD	180,141
FNMA TBA JAN 30 SINGLE FAM	175,000	12/01/2099	4.500	USD	185,425
FNMA TBA JAN 30 SINGLE FAM	225,000	12/01/2099	5.000	USD	244,354
FNMA TBA JAN 30 SINGLE FAM	25,000	12/01/2099	5.500	USD	27,499
FNMA TBA JAN 30 SINGLE FAM	50,000	12/01/2099	6.000	USD	55,457
GNMA I TBA JAN 30 SINGLE FAM	500,000	12/01/2099	3.500	USD	503,926
TBA FHLMC GOLD CONV INTER AGGR	275,000	12/01/2099	2.500	USD	272,454
FHLMC TBA JAN 15 GOLD SINGLE	175,000	12/01/2099	3.000	USD	178,240
FHLMC TBA JAN 30 GOLD SINGLE	475,000	12/01/2099	3.500	USD	471,289
FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE COR	700,000	12/01/2099	4.000	USD	718,867
FHLMC TBA JAN 30 GOLD SINGLE	250,000	12/01/2099	4.500	USD	264,521
FHLMC TBA JAN 30 GOLD SINGLE	50,000	12/01/2099	5.500	USD	54,609
BEAR STEARNS COMMERCIAL MORTGA	161,141	02/13/2042	4.933	USD	167,589
BEAR STEARNS COMMERCIAL MORTGA	135,000	11/11/2041	4.825	USD	138,721
BEAR STEARNS COMMERCIAL MORTGA	315,000	09/11/2038	5.712	USD	345,826
GOVERNMENT NATL MTG ASSN	300,000	12/01/2099	3.000	USD	289,852
GNMA II JUMBOS 3.5 30 YRS TBA	275,000	12/01/2099	3.500	USD	277,417
GNMA II TBA JAN 30 JUMBOS	375,000	12/01/2099	4.000	USD	389,897
FED HM LN PC POOL G04008	125,187	03/01/2038	5.500	USD	137,777
FED HM LN PC POOL G04913	71,668	03/01/2038	5.000	USD	77,486

ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン) - 海外債券ファンド

FED HM LN PC POOL G05408	171,347	12/01/2036	5.000	USD	185,504
FED HM LN PC POOL G07021	116,969	09/01/2039	5.000	USD	126,437
FED HM LN PC POOL G14375	58,764	07/01/2026	4.000	USD	62,251
FED HM LN PC POOL G08537	175,000	07/01/2043	3.000	USD	166,173
FED HM LN PC POOL G08534	200,000	06/01/2043	3.000	USD	189,913
FED HM LN PC POOL C91467	257,897	07/01/2032	3.500	USD	263,599
FED HM LN PC POOL J15852	28,314	07/01/2026	3.500	USD	29,620
FED HM LN PC POOL J16665	69,126	09/01/2026	3.500	USD	72,310
FED HM LN PC POOL A86009	212,351	05/01/2039	4.500	USD	226,771
FED HM LN PC POOL Q19058	75,000	06/01/2043	3.000	USD	71,217
FED HM LN PC POOL Q19773	49,999	06/01/2043	3.000	USD	47,477
FNMA POOL 254199	63,915	02/01/2032	6.500	USD	72,021
FNMA POOL AH4158	92,120	01/01/2041	4.000	USD	95,204
FNMA POOL AH5583	198,619	02/01/2041	4.500	USD	211,280
FNMA POOL AK5394	228,073	02/01/2027	3.000	USD	233,563
FNMA POOL AL1123	116,040	11/01/2026	3.500	USD	121,768
FNMA POOL AL2581	282,941	06/01/2040	6.000	USD	315,263
FNMA POOL AL2090	105,398	08/01/2026	4.000	USD	112,058
FNMA POOL AR9977	24,999	02/01/2043	2.500	USD	22,673
FNMA POOL AT1572	149,999	05/01/2043	3.000	USD	142,722
FNMA POOL AT8339	99,999	07/01/2043	3.000	USD	95,143
FNMA POOL AU1629	74,999	07/01/2043	3.000	USD	71,362
FNMA POOL AU3195	74,999	08/01/2043	3.000	USD	71,362
FNMA POOL AU3820	400,000	08/01/2043	3.000	USD	380,577
FNMA POOL AU4310	25,000	08/01/2043	2.500	USD	22,671
FNMA POOL AU6531	99,999	09/01/2028	2.000	USD	96,536
FNMA POOL 829291	321,227	09/01/2035	5.500	USD	355,447
FNMA POOL 889299	45,460	04/01/2038	6.000	USD	50,608
FNMA POOL 892782	31,667	11/01/2036	6.500	USD	35,377
FNMA POOL 934946	178,590	09/01/2039	4.500	USD	190,410
FNMA POOL 990652	62,305	09/01/2038	6.500	USD	69,732
FNMA POOL AA7999	134,158	05/01/2024	5.000	USD	143,498
FNMA POOL AB2037	48,513	01/01/2031	4.500	USD	51,881
FNMA POOL AB9747	50,000	06/01/2043	3.000	USD	47,574
FNMA POOL AC1416	214,706	08/01/2039	4.000	USD	221,785
FNMA POOL AC3703	158,337	11/01/2024	4.500	USD	169,509
FNMA POOL MA0878	18,549	10/01/2031	4.000	USD	19,439
FNMA POOL MA0667	54,944	03/01/2031	4.000	USD	57,583
FNMA POOL MA0668	5,699	03/01/2031	4.500	USD	6,147
FNMA POOL MA1804	100,000	01/01/2044	3.000	USD	95,241
GNMA II POOL MA0532	24,790	11/20/2042	2.500	USD	22,881
GNMA II POOL MA1011	24,702	05/20/2043	3.000	USD	23,973
GNMA POOL AE7511	299,997	06/15/2043	3.000	USD	291,040
GNMA POOL 605616	6,978	04/15/2035	5.500	USD	7,752
GNMA II POOL 005175	280,908	09/20/2041	4.500	USD	301,860
GNMA POOL 724330	430,422	09/15/2039	5.000	USD	473,463
GNMA POOL 738520	315,725	07/15/2041	4.500	USD	338,993
GNMA POOL 783647	93,973	09/15/2035	5.500	USD	104,832
GNMA POOL 783237	133,620	01/15/2041	4.000	USD	139,749
GNMA POOL 644862	14,098	06/15/2035	5.500	USD	15,722
GNMA POOL 658258	89,438	01/15/2037	6.000	USD	99,908
GNMA POOL 677100	6,550	07/15/2038	5.500	USD	7,238
JP MORGAN CHASE COMMERCIAL MOR	100,000	09/12/2037	4.895	USD	105,134
MORGAN STANLEY CAPITAL I TRUST	384,763	01/14/2042	5.168	USD	395,858
WACHOVIA BANK COMMERCIAL MORTG	94,077	07/15/2042	5.118	USD	99,541
WACHOVIA BANK COMMERCIAL MORTG	100,000	03/15/2042	5.083	USD	103,807
モーゲージ債合計					14,179,609
地方債					
NEW JERSEY ST TURNPIKE AUTH	125,000	01/01/2040	7.414	USD	169,215
LAND BERLIN	60,000	09/14/2015	3.125	EUR	87,348
地方債合計					256,563
非米国政府機関債					
WESTERN AUST TREAS CORP	75,000	07/15/2017	8.000	AUD	79,830
NEW S WALES TREASURY CRP	200,000	03/20/2019	3.500	AUD	177,811
NEW S WALES TREASURY CRP	200,000	04/01/2019	6.000	AUD	201,326
非米国政府機関債合計					458,967
非米国政府債					
FED REPUBLIC OF BRAZIL	30,000	01/20/2037	7.125	USD	35,231

BRITISH COLUMBIA PROV OF	100,000	12/18/2018	4.650	CAD	104,723
CANADIAN GOVERNMENT	500,000	11/01/2015	1.000	CAD	470,449
CANADIAN GOVERNMENT	115,000	06/01/2041	4.000	CAD	123,513
CANADIAN GOVERNMENT	415,000	06/01/2022	2.750	CAD	394,172
CANADA HOUSING TRUST	275,000	12/15/2022	2.400	CAD	245,302
CANADA HOUSING TRUST	725,000	06/15/2018	1.750	CAD	673,848
REPUBLIC OF COLOMBIA	35,000	01/28/2033	10.375	USD	52,906
UK TSY 4 1/4 2036	70,000	03/07/2036	4.250	GBP	128,877
IRISH TSY 4 1/2 2020	100,000	04/18/2020	4.500	EUR	155,058
KINGDOM OF DENMARK	690,000	11/10/2024	7.000	DKK	191,463
ITALY GOV T INT BOND	50,000	09/27/2023	6.875	USD	60,167
REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000	07/15/2027	6.250	EUR	98,909
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	165,000	01/31/2029	6.000	EUR	272,359
FRANCE (GOVT OF)	285,000	04/25/2029	5.500	EUR	527,190
RUSSIA FOREIGN BOND	30,000	06/24/2028	12.750	USD	50,887
SINGAPORE GOVERNMENT	190,000	09/01/2018	4.000	SGD	170,744
QUEENSLAND TREASURY CORP	75,000	10/14/2015	6.000	AUD	71,728
ONTARIO (PROVINCE OF)	255,000	06/02/2037	4.700	CAD	260,725
REPUBLIC OF POLAND	50,000	07/15/2019	6.375	USD	59,835
BUONI POLIENNALI DEL TES	75,000	02/01/2033	5.750	EUR	120,192
PROVINCE OF QUEBEC	225,000	12/01/2038	5.000	CAD	235,763
PROVINCE OF QUEBEC	150,000	12/01/2017	4.500	CAD	154,707
FRANCE (GOVT OF)	650,000	04/25/2019	4.250	EUR	1,055,597
REPUBLIC OF POLAND	60,000	04/21/2021	5.125	USD	65,436
UNITED MEXICAN STATES	25,000	04/08/2033	7.500	USD	31,870
UNITED MEXICAN STATES	266,000	03/15/2022	3.625	USD	264,849
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	225,000	04/30/2020	4.000	EUR	330,208
RUSSIA FOREIGN BOND	100,000	04/29/2015	3.625	USD	103,749
CAISSE D AMORT DETTE SOC	140,000	04/25/2021	3.375	EUR	216,276
KOREA TREASURY BOND	306,000,000	06/10/2021	4.250	KRW	303,767
KOREA TREASURY BOND	606,200,000	09/10/2016	3.500	KRW	589,875
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000	01/04/2022	2.000	EUR	1,012,118
KOREA TREASURY BOND	63,070,000	12/10/2031	4.000	KRW	62,190
REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000	11/22/2022	3.400	EUR	106,713
BUONI POLIENNALI DEL TES	240,000	05/01/2017	4.750	EUR	361,267
FINNISH GOVERNMENT	45,000	07/04/2028	2.750	EUR	63,543
MALAYSIAN GOVERNMENT	325,000	08/15/2022	3.418	MYR	95,021
FRENCH TREASURY NOTE	110,000	02/25/2017	1.750	EUR	159,163
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	240,000	07/04/2044	2.500	EUR	317,626
KOREA TREASURY BOND	145,000,000	06/10/2022	3.750	KRW	140,569
QUEENSLAND TREASURY CORP	175,000	06/21/2019	4.000	AUD	156,884
FRANCE (GOVT OF)	150,000	10/25/2022	2.250	EUR	207,719
SWEDISH GOVERNMENT	580,000	11/13/2023	1.500	SEK	82,509
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000	11/01/2017	3.500	EUR	245,840
BUNDESOBLIGATION	460,000	02/23/2018	0.500	EUR	630,905
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	265,000	02/15/2023	1.500	EUR	359,496
UK TSY 1.25 2018	800,000	07/22/2018	1.250	GBP	1,295,831
BELGIUM KINGDOM	140,000	06/22/2018	1.250	EUR	194,636
BUONI POLIENNALI DEL TES	80,000	05/01/2023	4.500	EUR	116,231
BUNDESOBLIGATION	1,015,000	04/13/2018	0.250	EUR	1,369,106
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	80,000	10/31/2023	4.400	EUR	113,055
BUONI POLIENNALI DEL TES	70,000	09/01/2044	4.750	EUR	96,876
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	565,000	05/15/2023	1.500	EUR	758,808
FRANCE (GOVT OF)	160,000	11/25/2018	1.000	EUR	218,385
NETHERLANDS GOVERNMENT	140,000	01/15/2019	1.250	EUR	194,664
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000	10/19/2018	1.150	EUR	207,675
FADE	100,000	12/17/2016	2.250	EUR	138,293
MEX BONOS DESARR FIX RT	3,645,800	12/07/2023	8.000	MXN	310,988
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,380,000	09/15/2017	8.250	ZAR	547,629
BELGIUM KINGDOM	150,000	03/28/2035	5.000	EUR	265,135
NORWEGIAN GOVERNMENT	500,000	05/15/2015	5.000	NOK	88,947
AUSTRALIAN GOVERNMENT	360,000	02/15/2017	6.000	AUD	358,431
FRANCE (GOVT OF)	50,000	04/25/2055	4.000	EUR	78,454
REPUBLIC OF AUSTRIA	75,000	07/15/2020	3.900	EUR	119,978
UK TSY 4 1/4 2055	175,000	12/07/2055	4.250	GBP	332,262
NETHERLANDS GOVERNMENT	90,000	01/15/2037	4.000	EUR	152,262
REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000	07/15/2015	3.500	EUR	499,359
MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000	02/07/2018	4.240	MYR	126,110
SWEDISH GOVERNMENT	11,250,000	07/12/2016	3.000	SEK	1,858,433
BUONI POLIENNALI DEL TES	890,000	08/01/2021	3.750	EUR	1,274,561
KINGDOM OF DENMARK	1,300,000	11/15/2017	4.000	DKK	272,683

BUONI POLIENNALI DEL TES	45,000	08/01/2016	3.750	EUR	66,249
NETHERLANDS GOVERNMENT	175,000	01/15/2023	3.750	EUR	282,335
UK TSY 4 1/4 2046	155,000	12/07/2046	4.250	GBP	287,894
BELGIUM KINGDOM	180,000	03/28/2022	4.000	EUR	287,749
UK TSY 4 1/4 2027	120,000	12/07/2027	4.250	GBP	218,160
NETHERLANDS GOVERNMENT	335,000	07/15/2016	4.000	EUR	511,876
FRANCE (GOVT OF)	165,000	10/25/2038	4.000	EUR	254,680
REPUBLIC OF AUSTRIA	45,000	03/15/2037	4.150	EUR	76,235
UK TSY 5 2018	225,000	03/07/2018	5.000	GBP	428,615
UK TSY 4 1/2 2042	215,000	12/07/2042	4.500	GBP	412,951
FRANCE (GOVT OF)	500,000	10/25/2023	4.250	EUR	802,330
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	135,000	07/30/2040	4.900	EUR	188,429
CZECH REPUBLIC	2,680,000	04/11/2017	4.000	CZK	153,283
UK TSY 4 3/4 2030	470,000	12/07/2030	4.750	GBP	907,838
AUSTRALIAN GOVERNMENT	160,000	05/15/2021	5.750	AUD	161,212
SWEDISH GOVERNMENT	1,250,000	03/12/2019	4.250	SEK	224,597
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000	07/30/2018	4.100	EUR	444,641
FINNISH GOVERNMENT	100,000	07/04/2019	4.375	EUR	163,379
NORWEGIAN GOVERNMENT	650,000	05/22/2019	4.500	NOK	121,541
POLAND GOVERNMENT BOND	650,000	10/25/2019	5.500	PLN	235,686
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000	03/01/2019	4.500	EUR	921,117
UK TSY 4 2022	150,000	03/07/2022	4.000	GBP	274,744
SWEDISH GOVERNMENT	260,000	03/30/2039	3.500	SEK	43,218
BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000	09/01/2040	5.000	EUR	461,735
AUSTRALIAN GOVERNMENT	140,000	04/15/2020	4.500	AUD	132,212
NETHERLANDS GOVERNMENT	30,000	01/15/2042	3.750	EUR	49,621
THAILAND GOVERNMENT BOND	10,250,000	06/13/2019	3.875	THB	319,675
UK TSY 4 2060	100,000	01/22/2060	4.000	GBP	184,022
IRISH TSY 5.9 2019	75,000	10/18/2019	5.900	EUR	122,537
FRANCE (GOVT OF)	100,000	04/25/2041	4.500	EUR	169,827
BELGIUM KINGDOM	475,000	03/28/2015	3.500	EUR	696,640
UK TSY 1.75 2022	100,000	09/07/2022	1.750	GBP	152,242
ISRAEL FIXED BOND	230,000	03/31/2023	4.250	ILS	71,412
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	90,000	01/31/2023	5.400	EUR	142,402
UK TSY 3 1/2 2068	25,000	07/22/2068	3.500	GBP	41,142
RUSSIA FOREIGN BOND	53,625	03/31/2030	7.500	USD	63,597
非米国政府債合計					32,686,552
その他有価証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000	01/31/2015	3.875	EUR	370,466
UK TSY 2 3/4 2015	400,000	01/22/2015	2.750	GBP	686,080
CAISSE FRANCAISE DE FIN	100,000	07/16/2020	1.750	EUR	138,814
その他有価証券合計					1,195,360
不動産					
AVALONBAY COMMUNITIES	50,000	03/15/2017	5.700	USD	56,683
CIE FINANCEMENT FONCIER	300,000	09/16/2015	2.500	USD	310,770
ERP OPERATING LP	60,000	07/15/2020	4.750	USD	64,816
CIE FINANCEMENT FONCIER	50,000	01/24/2017	3.750	EUR	77,394
UNIBAIL RODAMCO SE	100,000	03/22/2019	3.000	EUR	147,392
DEUTSCHE ANN FIN BV	60,000	10/08/2021	3.625	EUR	85,472
不動産合計					742,527
国際機関債					
EUROPEAN INVESTMENT BANK	100,000	09/13/2016	5.125	USD	112,957
EUROPEAN INVESTMENT BANK	25,000	04/15/2025	5.500	GBP	49,928
EUROPEAN INVESTMENT BANK	20,000	10/15/2018	4.750	GBP	37,281
INTL BK RECON + DEVELOP	125,000	05/20/2019	3.875	EUR	199,964
EUROPEAN INVESTMENT BANK	40,000	10/15/2016	3.875	EUR	60,658
ASIAN DEVELOPMENT BANK	100,000	03/09/2022	5.000	AUD	92,343
EUROPEAN INVESTMENT BANK	150,000	10/15/2037	4.000	EUR	241,964
EUROPEAN INVESTMENT BANK	50,000	10/15/2015	3.125	EUR	72,833
EUROPEAN INVESTMENT BANK	170,000	04/15/2024	4.125	EUR	277,470
EUROPEAN INVESTMENT BANK	40,000	04/15/2016	3.500	EUR	60,360
INTL BK RECON + DEVELOP	150,000	02/17/2015	5.750	AUD	141,448
国際機関債合計					1,347,207
運輸					
BURLINGTN NORTH SANTA FE	100,000	09/15/2021	3.450	USD	99,774
BURLINGTN NORTH SANTA FE	100,000	03/15/2042	4.400	USD	90,403
CSX CORP	90,000	03/01/2043	4.400	USD	81,246

ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン) - 海外債券ファンド

CANADIAN NATL RAILWAY	200,000	03/01/2019	5.550	USD	233,202
ERAC USA FINANCE LLC	75,000	05/01/2015	5.800	USD	80,358
RYDER SYSTEM INC	125,000	02/26/2019	2.350	USD	123,421
UNITED PARCEL SERVICE	100,000	04/01/2019	5.125	USD	115,021
ASF	50,000	03/20/2019	7.375	EUR	90,932
HEATHROW FUNDING LTD	50,000	12/10/2031	6.450	GBP	100,379
運輸合計					1,014,736
米国政府機関債					
FREDDIE MAC	150,000	01/19/2016	4.750	USD	166,341
FANNIE MAE	150,000	09/15/2016	5.250	USD	170,606
米国政府機関債合計					336,947
米国政府債					
US TREASURY N/B	1,055,000	08/15/2028	5.500	USD	1,322,369
US TREASURY N/B	985,000	02/15/2043	3.125	USD	855,033
US TREASURY N/B	280,000	05/15/2043	2.875	USD	227,976
US TREASURY N/B	820,000	03/31/2015	2.500	USD	848,524
US TREASURY N/B	2,215,000	04/30/2016	2.000	USD	2,299,073
US TREASURY N/B	630,000	05/15/2021	3.125	USD	659,282
US TREASURY N/B	1,100,000	08/31/2018	1.500	USD	1,100,021
US TREASURY N/B	700,000	09/30/2018	1.375	USD	693,928
US TREASURY N/B	950,000	12/15/2015	0.250	USD	947,965
US TREASURY N/B	840,000	12/31/2017	0.750	USD	821,379
US TREASURY N/B	905,000	02/15/2023	2.000	USD	846,365
US TREASURY N/B	3,925,000	02/28/2015	0.250	USD	3,930,787
US TREASURY N/B	1,000,000	03/31/2018	0.750	USD	973,478
US TREASURY N/B	750,000	04/30/2018	0.625	USD	724,084
US TREASURY N/B	270,000	06/30/2018	1.375	USD	267,964
米国政府債合計					16,518,260
公益事業					
RWE FINANCE BV	100,000	02/10/2015	1.000	EUR	150,425
CONS EDISON CO OF NY	40,000	12/01/2018	7.125	USD	48,972
CONSUMERS ENERGY CO	50,000	08/15/2023	3.375	USD	49,336
DOMINION RESOURCES INC	15,000	08/15/2019	5.200	USD	17,098
DUKE ENERGY CORP	100,000	11/15/2016	2.150	USD	102,759
ELECTRICITE DE FRANCE	100,000	01/26/2019	6.500	USD	121,029
E.ON INTL FINANCE BV	75,000	04/30/2018	5.800	USD	86,413
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	80,000	01/31/2020	5.250	USD	90,944
EXELON GENERATION CO LLC	50,000	10/01/2019	5.200	USD	54,534
FLORIDA POWER + LIGHT	25,000	04/01/2039	5.960	USD	29,608
GEORGIA POWER COMPANY	40,000	03/15/2042	4.300	USD	36,491
HYDRO QUEBEC	220,000	02/15/2045	5.000	CAD	237,101
KINDER MORGAN ENER PART	75,000	03/01/2021	5.800	USD	84,751
PACIFIC GAS + ELECTRIC	100,000	04/15/2042	4.450	USD	94,741
PLAINS ALL AMER PIPELINE	75,000	06/01/2022	3.650	USD	73,915
PROGRESS ENERGY INC	100,000	03/01/2031	7.750	USD	131,359
ENEL SOCIETA PER AZIONI	75,000	06/12/2018	4.750	EUR	116,811
SEMPRA ENERGY	90,000	06/01/2016	6.500	USD	101,756
SOUTHERN CAL EDISON	100,000	12/01/2041	3.900	USD	88,737
SOUTHERN CO	105,000	09/01/2016	1.950	USD	107,837
WILLIAMS PARTNERS LP	65,000	03/15/2020	5.250	USD	72,081
WILLIAMS PARTNERS LP	60,000	04/15/2040	6.300	USD	65,281
GAS NATURAL FENOSA FINAN	100,000	04/11/2022	3.875	EUR	149,102
GDF SUEZ	150,000	01/18/2021	6.375	EUR	274,408
公益事業合計					2,385,488
現金等価物および債券の投資合計^{*2}					99,753,009

* 1 上記の有価証券明細表は、IFRS準拠にて監査済みのWellington Management Portfolios (Cayman) - World Bond Fund(ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン)-海外債券ファンド)の年次報告書には含まれておりません。

* 2 四捨五入の関係上、各項目の総計が投資合計と一致しない場合があります。

○先物取引

約定内容	想定元本	満期日	約定件数	買(売)	未実現益(\$)
Australia Bond Futures 10 Yr	61,344,905	03/17/2014		598	327,685
Canada Bond Futures 10 Yr	(119,285)	03/20/2014		(1)	65
German Euro Bond Futures	(63,000,000)	03/06/2014		(328)	624,762
U.S. Bond Futures	(36,000,000)	03/20/2014		(279)	343,469
U.S. Note Futures 5 Yr	(70,000,000)	03/31/2014		(587)	911,967
United Kingdom Long Gilt Bond Futures	(13,000,000)	03/27/2014		(76)	158,983
United States Euro Bond Futures 90 Day	(2,243,813)	03/17/2014		(9)	438
					<u>2,367,369</u>

約定内容	想定元本	満期日	約定件数	買(売)	未実現損(\$)
Australia Bond Futures 3 Yr	(4,272,859)	03/17/2014		(44)	(6,409)
German Euro BOBL Futures	66,011,429	03/06/2014		385	(463,392)
German Euro BUXL Futures 30 Yr	12,946,580	03/06/2014		77	(114,569)
Germany Euro SCHATZ Futures	2,431,805	03/06/2014		16	(2,598)
U.S. Note Futures 10 Yr	61,031,250	03/20/2014		496	(695,156)
U.S. Note Futures 2 Yr	439,625	03/31/2014		2	(804)
					<u>(1,282,928)</u>

2013年12月31日現在、\$5,640,099相当の証券が上記先物取引の担保として差し出されています。

○外国為替取引

約定件数	支払い	受取り	信用格付	期日	未実現益
2	40,000 AUD	35,754 USD	A+	01/17/2014	\$ 2
1	157,000 AUD	143,297 USD	A	01/17/2014	2,965
4	1,672,000 AUD	1,540,220 USD	A	01/17/2014	45,741
1	30,000 AUD	27,332 USD	A	01/17/2014	517
4	2,868,000 CAD	2,719,231 USD	A+	01/17/2014	20,900
1	30,000 CAD	28,226 USD	A	01/17/2014	-
1	75,000 CAD	70,578 USD	A-	01/17/2014	15
1	681,000 EUR	940,835 USD	A	01/17/2014	2,457
3	380,000 EUR	523,632 USD	A-	01/17/2014	15
2	45,000 GBP	74,527 USD	A	01/17/2014	2
2	47,100,000 JPY	448,146 USD	A-	01/17/2014	-
1	643,667 JPY	6,128 USD	AA-	01/08/2014	4
1	120,107,212 JPY	1,144,038 USD	A	01/07/2014	1,303
1	10,840,000 KRW	10,329 USD	A+	01/17/2014	40
3	3,764,000 MXN	287,326 USD	A+	01/17/2014	263
4	614,000 MYR	190,355 USD	A	01/21/2014	3,184
1	40,000 MYR	12,442 USD	AA-	01/21/2014	248
4	188,000 SGD	150,380 USD	AA-	01/17/2014	1,481
4	8,432,000 THB	263,253 USD	A+	01/17/2014	6,822
1	107,125 USD	120,000 AUD	A	01/17/2014	134
1	53,828 USD	57,197 CAD	A	01/06/2014	5
1	272,196 USD	290,000 CAD	A	01/17/2014	647
1	626,467 USD	573,000 CHF	A	01/17/2014	17,883

1	253,877	USD	185,000	EUR	A+	01/17/2014	1,042
1	432,204	USD	320,000	EUR	A+	01/17/2014	8,737
2	313,864	USD	230,000	EUR	AA-	01/17/2014	3,063
1	405,699	USD	295,000	EUR	A	01/17/2014	794
1	197,017	USD	145,000	EUR	A+	01/17/2014	2,785
1	533,198	USD	325,000	GBP	A+	01/17/2014	5,035
1	132,830	USD	82,000	GBP	A+	01/17/2014	2,970
1	242,644	USD	150,000	GBP	AA-	01/17/2014	5,771
1	227,803	USD	140,000	GBP	A+	01/17/2014	4,051
1	128,928	USD	77,950	GBP	A-	01/06/2014	176
2	172,292	USD	105,000	GBP	A+	01/17/2014	1,598
1	62,544	USD	223,000	ILS	AA-	01/17/2014	1,686
1	83,813	USD	89,221,000	KRW	A+	01/17/2014	868
1	69,150	USD	910,000	MXN	AA-	01/17/2014	251
1	125,924	USD	155,000	NZD	A+	01/17/2014	1,550
1	86,112	USD	269,000	PLN	AA-	01/17/2014	2,957
1	101,120	USD	650,000	SEK	A+	01/17/2014	61
4	5,354,000	ZAR	523,923	USD	A+	01/17/2014	13,760
為替予約取引に係る未実現益合計							\$ 161,783

約定件数	支払い	受取り	信用格付	期日	未実現損		
1	80,000	CAD	75,208	USD	A+	01/17/2014	\$ (59)
1	57,000	CAD	53,627	USD	A+	01/17/2014	(1)
1	45,000	CAD	42,192	USD	A	01/17/2014	(146)
3	705,000	CHF	770,784	USD	A+	01/17/2014	(22,000)
1	10,000	CHF	11,245	USD	AA-	01/17/2014	-
1	10,000	CHF	11,056	USD	A+	01/17/2014	(189)
4	1,146,000	CZK	56,710	USD	A	01/17/2014	(988)
4	1,918,000	DKK	348,259	USD	A+	01/17/2014	(6,039)
1	70,000	DKK	12,758	USD	A	01/17/2014	(173)
1	160,000	EUR	215,509	USD	A	01/17/2014	(4,961)
1	50,000	EUR	68,598	USD	A+	01/17/2014	(300)
2	143,000	EUR	195,065	USD	A-	01/17/2014	(1,980)
1	310,000	EUR	421,316	USD	AA-	01/17/2014	(5,845)
5	18,683,000	EUR	25,225,713	USD	A+	01/17/2014	(518,349)
1	85,000	EUR	115,137	USD	A-	01/17/2014	(1,988)
1	152,000	EUR	208,880	USD	A+	01/17/2014	(567)
1	65,000	EUR	89,391	USD	A+	01/17/2014	(175)
1	40,000	EUR	54,349	USD	AA-	01/17/2014	(768)
3	3,368,000	GBP	5,455,763	USD	A	01/17/2014	(121,982)
1	35,000	GBP	56,518	USD	A	01/17/2014	(1,445)
1	65,000	GBP	106,318	USD	A+	01/17/2014	(1,329)
1	78,000	GBP	129,002	USD	A-	01/17/2014	(173)
1	465,000	GBP	762,609	USD	A+	01/17/2014	(7,478)
2	54,000	GBP	88,660	USD	A+	01/17/2014	(770)
2	350,000	ILS	98,163	USD	A+	01/17/2014	(2,646)
4	1,025,113,000	KRW	963,021	USD	AA-	01/17/2014	(9,931)
1	140,000	MXN	10,547	USD	AA-	01/17/2014	(130)
4	1,226,000	NOK	200,561	USD	AA-	01/17/2014	(1,415)
3	140,000	NZD	113,738	USD	AA-	01/17/2014	(1,400)
3	730,000	PLN	233,686	USD	A+	01/17/2014	(8,026)

4	13,456,000	SEK	2,020,511	USD	A	01/17/2014	(74,087)
1	110,000	SEK	16,858	USD	A	01/17/2014	(265)
1	647,753	USD	470,000	EUR	A	01/17/2014	(121)
1	427,043	USD	309,100	EUR	A	01/08/2014	(1,119)
1	513,643	USD	371,780	EUR	A-	01/03/2014	(1,348)
1	273,332	USD	165,000	GBP	A	01/17/2014	(75)
1	6,455	USD	677,976	JPY	A-	01/08/2014	(4)
2	1,142,191	USD	119,901,487	JPY	A	01/07/2014	(1,413)
3	215,467	USD	22,000,000	JPY	A+	01/17/2014	(6,142)
1	83,960	USD	8,600,000	JPY	AA-	01/17/2014	(2,133)
2	1,690,024	USD	177,400,000	JPY	A	01/17/2014	(2,104)
1	221,212	USD	22,700,000	JPY	A	01/17/2014	(5,227)
1	93,123	USD	9,500,000	JPY	AA-	01/17/2014	(2,732)
4	73,782,458	USD	7,465,304,000	JPY	AA-	01/17/2014	(2,751,878)
7	741,391	USD	76,048,000	JPY	A+	01/17/2014	(17,812)
3	584,763	USD	59,800,000	JPY	A+	01/17/2014	(15,780)
1	70,860	USD	74,500,000	KRW	A+	01/17/2014	(151)
1	1,985	USD	26,000	MXN	A	01/17/2014	(2)
為替予約取引に係る未実現損合計							\$ (3,603,646)
為替予約取引に係る未実現純損益							\$ (3,441,863)

(通貨コード)

AUD	-	オーストラリア・ドル	MXN	-	メキシコ・ペソ
CAD	-	カナダ・ドル	MYR	-	マレーシア・リンギット
CHF	-	スイス・フラン	NOK	-	ノルウェー・クローネ
CZK	-	チェコ・コルナ	NZD	-	ニュージーランド・ドル
DKK	-	デンマーク・クローネ	PLN	-	ポーランド・ズロチ
EUR	-	ユーロ	SEK	-	スウェーデン・クローナ
GBP	-	英ポンド	SGD	-	シンガポール・ドル
ILS	-	イスラエル・シケル	THB	-	タイ・バーツ
JPY	-	日本円	USD	-	米ドル
KRW	-	韓国ウォン	ZAR	-	南アフリカ・ランド

<お申し込み時の留意点>

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようお願いいたします。

(2015年1月20日現在)

年 月	日
2015年 1 月	—
2 月	16
3 月	—
4 月	3
5 月	25
6 月	—
7 月	3
8 月	—
9 月	7
10月	—
11月	26
12月	25

※2015年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意ください。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。