

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	信託期間は2010年4月6日から無期限です。	
運用方針	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	外国債券インデックスe	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外国債券インデックスe	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資は転換社債を転換したものとおよび新株予約権を行使したものに限りします。
	外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資には、制限を設けません。株式への投資は転換社債を転換したものとおよび新株予約権を行使したものに限りします。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金および収益調整金は、全額分配に使用することがあります。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。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。 ③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

外国債券インデックスe

運用報告書

第3期(決算日 2013年2月7日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

本運用報告書に関するお問い合わせ先

フリーダイヤル:0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

当社ではHPでファンドの情報提供を行っております。

PCサイト <http://www.smtam.jp/>

モバイルサイト <http://m.smtam.jp/>

＜委託会社の合併およびファンド名称等の変更に關するお知らせ＞を次頁に記載していますのでご覧ください。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

目 次

設定以来の運用実績	1
当期中の基準価額と市況の推移	1
当期中の運用経過と今後の運用方針	2
1万口当たりの費用明細	5
売買および取引の状況	5
利害関係人との取引状況等	5
組入資産の明細	5
投資信託財産の構成	6
資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況	6
約款変更のお知らせ	7
復興特別所得税等に関するお知らせ	7
外国債券マザーファンド	8

第12期決算運用報告書(決算日2013年2月7日)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組み入れ、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

＜委託会社の合併およびファンド名称等の変更に関するお知らせ＞

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2012年4月1日付で、住信アセットマネジメント株式会社と中央三井アセットマネジメント株式会社が合併したことにより発足致しました。それに伴い、以下の変更を行いました。

なお、合併後も、ファンドの運用方針およびご購入・ご換金のお手続きなどに変更はございません。引き続き変わらぬご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

変更項目	変更前	変更後
委託会社名	中央三井アセットマネジメント株式会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
住所	東京都港区芝三丁目23番1号	東京都港区芝三丁目33番1号
ファンド名	CMAM外国債券インデックスe	外国債券インデックスe
マザーファンド名	中央三井外国債券マザーファンド	外国債券マザーファンド
受託会社名	中央三井アセット信託銀行株式会社	三井住友信託銀行株式会社

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組比率	債券先比率	債券先物比率	純資産総額
	円	円	%	円	%				
設定日(2010年4月6日)	10,000	—	—	317.381	—	—	—	—	1
第1期(2011年2月7日)	8,891	0	△11.1	280.388	△11.7	97.3	0.9	305	
第2期(2012年2月7日)	8,855	0	△0.4	281.993	0.6	97.5	1.0	901	
第3期(2013年2月7日)	11,307	0	27.7	362.920	28.7	98.2	0.4	1,687	

(注1) 当ファンドは親投資信託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。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
	円	%	円	%		
(当期首) 2012年 2月 7日	8,855	—	281.993	—	97.5	1.0
2月末	9,475	7.0	300.879	6.7	97.5	0.7
3月末	9,557	7.9	304.182	7.9	98.1	0.3
4月末	9,444	6.7	300.314	6.5	98.2	0.4
5月末	8,991	1.5	287.840	2.1	98.4	0.3
6月末	9,048	2.2	288.769	2.4	97.7	0.8
7月末	9,002	1.7	287.559	2.0	97.9	0.6
8月末	9,153	3.4	292.505	3.7	97.5	0.8
9月末	9,215	4.1	294.625	4.5	98.0	0.5
10月末	9,468	6.9	302.949	7.4	97.9	0.5
11月末	9,854	11.3	315.774	12.0	98.1	0.4
12月末	10,502	18.6	333.868	18.4	97.8	0.5
2013年 1月末	11,044	24.7	353.763	25.5	98.2	0.3
(当期末) 2013年 2月 7日	11,307	27.7	362.920	28.7	98.2	0.4

(注1) 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、「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。

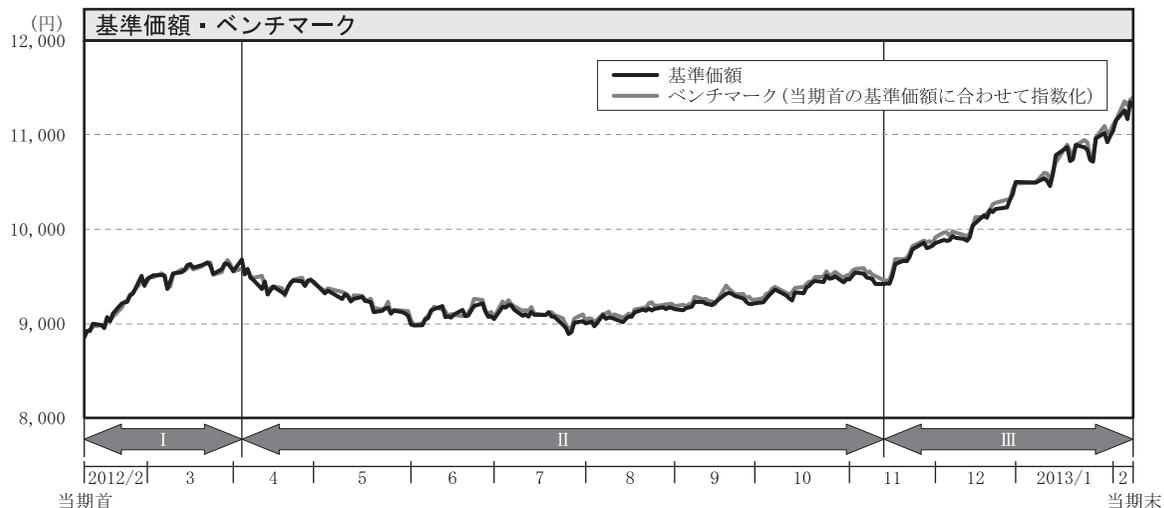
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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

シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同インデックスに関する著作権・知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。なお、本報告書においては、基準価額への反映を考慮して各期日の前営業日(現地ベース)の指数を掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額および市況の推移ならびに基準価額の変動要因



	Iの期間 (当期首～2012年4月)	IIの期間 (2012年4月～2012年11月)	IIIの期間 (2012年11月～当期末)
基準価額の動き	上昇	横ばい	上昇
基準価額変動をもたらした主な要因	<p>欧州債務問題への懸念が一服したことや米国景気の上昇期待などから、主要国の長期金利は一旦上昇(債券価格は下落)しましたが、その後ユーロ圏の景況感指数の悪化などから低下(債券価格は上昇)しました。</p> <p>外国為替市場で、2012年2月から3月にかけてギリシャ追加支援策合意などにより、欧州債務懸念が和らぎ円安が進行したことが、基準価額上昇の要因となりました。</p>	<p>主要国の長期金利は、欧州債務問題や米国景気動向を材料に比較的大きな変動幅となったものの、レンジ内推移となりました。</p> <p>外国為替市場では、6月に欧州債務問題の深刻化によるリスク回避の動きから円高となりましたが、その後は欧州債務問題に対する政策対応への期待などから、徐々に円安推移となりました。</p>	<p>米国での堅調な経済指標や「財政の崖」問題の一旦回避を背景としたリスク選好の動きの強まりから、主要国の長期金利は上昇しました。</p> <p>外国為替市場で、日本の衆議院選挙で自民党が圧勝し、新政権のもとで日銀に対する金融緩和圧力が一段と高まるとの思惑などから円安が進行したことが、基準価額上昇の要因となりました。</p>

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
8,855円	11,307円	+2,452円	+27.69%	+28.70%	△1.01%

当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、信託報酬および為替評価差要因^{*}等です。

※当ファンドの為替評価レートは一般社団法人投資信託協会所定のレートを使用しておりますが、ベンチマークの為替評価レートはWMロイター公表のレートを使用していることによるものです。

■運用状況

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「外国債券マザーファンド」への投資を通じて、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

【「外国債券マザーファンド」の運用経過】

(1) 債券組入比率

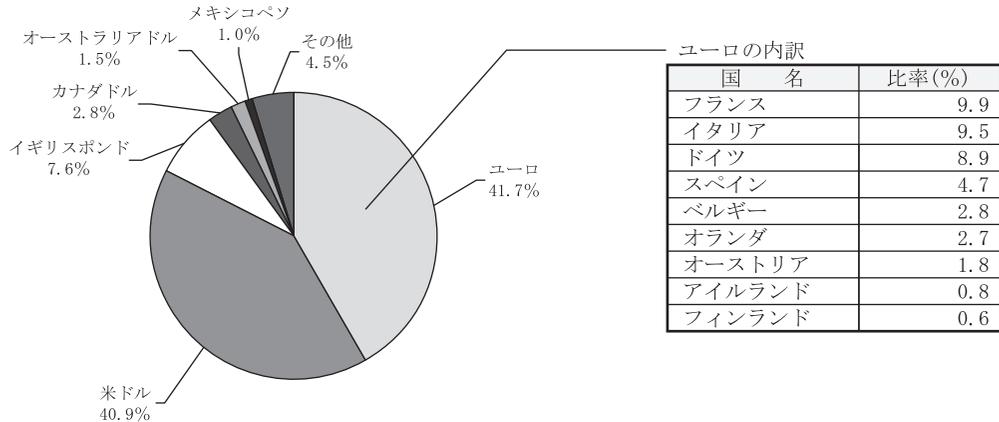
キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

なお、2012年10月より南アフリカがベンチマークに採用されたことに伴い、同国国債を組み入れました。

国・通貨別組入比率(当期末)



(注)比率は、マザーファンドの債券評価総額に対する評価額の比率です。(経過利子を含みます。)

■収益分配

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(分配原資の内訳)

(単位：円、1万口当たり・税引前)

項目	当期
当期分配金	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,178

(注)金額は円未満切捨てで表記しております。

収益分配金の計算過程につきましては、後記<注記事項>分配金の計算過程をご参照ください。

■今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「外国債券マザーファンド」への投資を通じて、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

今後とも、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

1万口当たりの費用明細

項 目	当 期
(a) 信託報酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	50円 (19) (27) (4)
(b) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0 (0)
(c) 保管費用等	3
合 計	53

(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、(c) 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。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 売買委託手数料及び保管費用等は、この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。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券マザーファンド	千口 431,790	千円 686,942	千口 152,562	千円 240,109

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

<外国債券マザーファンド>

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	126,277	126,277	100.0	130,267	130,267	100.0
為替直物取引	13,033	12,122	93.0	55,341	54,323	98.2

<平均保有割合 0.3%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券マザーファンド	千口 613,850	千口 893,078	千円 1,687,114

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、241,811,908千口です。

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券マザーファンド	1,687,114	99.4
コール・ローン等、その他	9,489	0.6
投資信託財産総額	1,696,603	100.0

(注1) 外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(453,756,531千円)の投資信託財産総額(457,385,367千円)に対する比率は99.2%です。

(注2) 外貨建資産は、当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=93.54円、1カナダドル=93.92円、1メキシコペソ=7.38円、1ユーロ=126.40円、1イギリスポンド=146.39円、1スイスフラン=102.78円、1スウェーデンクローナ=14.70円、1ノルウェークローネ=17.01円、1デンマーククローネ=16.95円、1ポーランドズロチ=30.28円、1オーストラリアドル=96.40円、1シンガポールドル=75.48円、1マレーシアリンギット=30.15円、1南アフリカランド=10.50円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2013年2月7日現在
(A) 資 産	1,696,603,096円
コール・ローン等	9,488,480
外国債券マザーファンド(評価額)	1,687,114,600
未 収 利 息	16
(B) 負 債	9,461,842
未 払 解 約 金	5,927,845
未 払 信 託 報 酬	3,499,063
そ の 他 未 払 費 用	34,934
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,687,141,254
元 本	1,492,178,603
次 期 繰 越 損 益 金	194,962,651
(D) 受 益 権 総 口 数	1,492,178,603口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,307円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2012年2月8日 至 2013年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	1,771円
受 取 利 息	1,771
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	304,970,064
売 買 益	338,241,303
売 買 損	△33,271,239
(C) 信 託 報 酬 等	△6,308,635
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	298,663,200
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△12,499,451
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△91,201,098
(配 当 等 相 当 額)	(37,966,950)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△129,168,048)
(G) 計 (D+E+F)	194,962,651
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	194,962,651
追 加 信 託 差 損 益 金	△91,201,098
(配 当 等 相 当 額)	(38,946,987)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△130,148,085)
分 配 準 備 積 立 金	286,163,749

(注1) (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) (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) (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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は1,017,603,015円、期中追加設定元本額は942,684,963円、期中一部解約元本額は468,109,375円です。

※1口当たり純資産額は、1.1307円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	35,932,705円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	235,442,065円
(C) 収益調整金額	38,946,987円
(D) 分配準備積立金額	14,788,979円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	325,110,736円
(F) 期末残存口数	1,492,178,603口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	2,178.76円
(H) 分配金額(1万口当たり)	—円
(I) 収益分配金金額 (F×H/10,000)	—円

約款変更のお知らせ

当ファンドの委託会社の合併に伴い、委託会社名、当ファンド及び当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの名称を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。また、当ファンドの受託会社の合併に伴い、受託会社名を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2012年4月1日)

復興特別所得税等に関するお知らせ

2013年1月1日から2013年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税7%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、10.147%(所得税及び復興特別所得税7.147%、並びに住民税3%(法人受益者は7.147%の源泉徴収が行われます。))の税率が適用されます。

なお、復興特別所得税に係る記載がされた目論見書の再交付をご希望される受益者の方につきましては、お申し出頂ければ再度、送付させていただきますので、その旨を販売会社までお申し出下さい。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2013年2月7日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2001年2月22日から無期限です。
運用方針	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債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。 株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

本運用報告書に関するお問い合わせ先

フリーダイヤル: 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組み入れ、異動等の該当がないことを示します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第8期(2009年2月9日)	14,804	△17.2	281.433	△18.2	97.2	0.9	412,110
第9期(2010年2月8日)	15,656	5.8	300.684	6.8	97.4	0.9	454,748
第10期(2011年2月7日)	14,691	△6.2	280.388	△6.7	97.2	0.9	419,677
第11期(2012年2月7日)	14,713	0.1	281.993	0.6	97.2	1.0	397,567
第12期(2013年2月7日)	18,891	28.4	362.920	28.7	98.2	0.4	456,807

(注)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2012年 2月 7日	14,713	—	281.993	—	97.2	1.0
2月末	15,749	7.0	300.879	6.7	97.5	0.7
3月末	15,893	8.0	304.182	7.9	98.1	0.3
4月末	15,712	6.8	300.314	6.5	98.1	0.4
5月末	14,966	1.7	287.840	2.1	98.2	0.3
6月末	15,067	2.4	288.769	2.4	97.5	0.8
7月末	14,998	1.9	287.559	2.0	97.7	0.6
8月末	15,256	3.7	292.505	3.7	97.5	0.8
9月末	15,367	4.4	294.625	4.5	98.0	0.5
10月末	15,796	7.4	302.949	7.4	97.9	0.5
11月末	16,448	11.8	315.774	12.0	98.1	0.4
12月末	17,536	19.2	333.868	18.4	97.8	0.5
2013年 1月末	18,451	25.4	353.763	25.5	98.2	0.3
(当期末) 2013年 2月 7日	18,891	28.4	362.920	28.7	98.2	0.4

(注1)騰落率は期首比です。

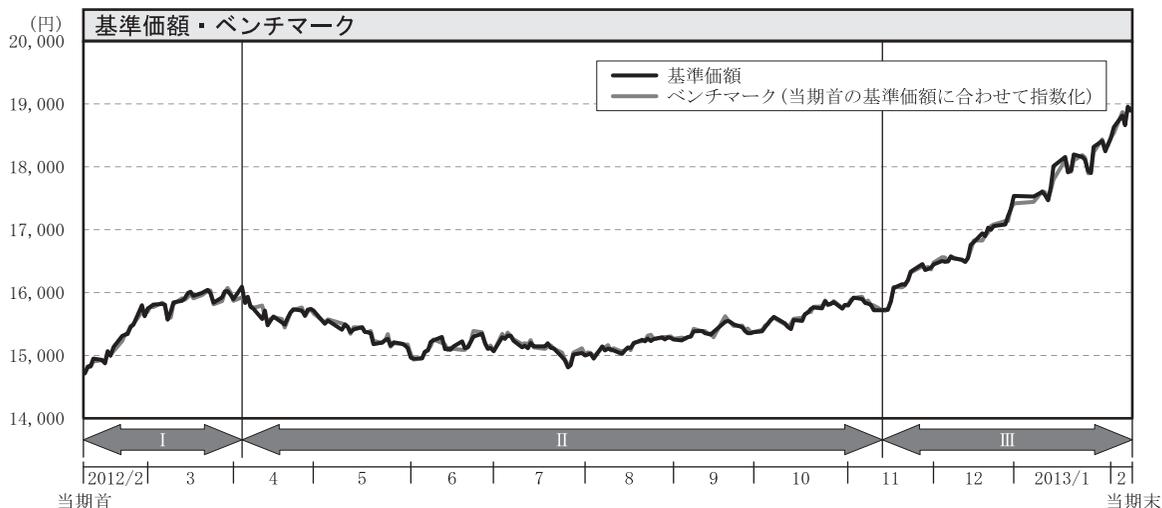
(注2)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

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

シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同インデックスに関する著作権・知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。なお、本報告書においては、基準価額への反映を考慮して各期日の前営業日(現地ベース)の指数を掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額および市況の推移ならびに基準価額の変動要因



	I の期間 (当期首～2012年4月)	II の期間 (2012年4月～2012年11月)	III の期間 (2012年11月～当期末)
基準価額の動き	上昇	横ばい	上昇
基準価額変動をもたらした主な要因	<p>欧州債務問題への懸念が一服したことや米国景気の上昇期待などから、主要国の長期金利は一旦上昇（債券価格は下落）しましたが、その後ユーロ圏の景況感指数の悪化などから低下（債券価格は上昇）しました。</p> <p>外国為替市場で、2012年2月から3月にかけてギリシャ追加支援策合意などにより、欧州債務懸念が和らぎ円安が進行したことが、基準価額上昇の要因となりました。</p>	<p>主要国の長期金利は、欧州債務問題や米国景気動向を材料に比較的大きな変動幅となったものの、レンジ内推移となりました。</p> <p>外国為替市場では、6月に欧州債務問題の深刻化によるリスク回避の動きから円高となりましたが、その後は欧州債務問題に対する政策対応への期待などから、徐々に円安推移となりました。</p>	<p>米国での堅調な経済指標や「財政の崖」問題の一旦回避を背景としたリスク選好の動きの強まりから、主要国の長期金利は上昇しました。</p> <p>外国為替市場で、日本の衆議院選挙で自民党が圧勝し、新政権のもとで日銀に対する金融緩和と圧力が一段と高まるとの思惑などから円安が進行したことが、基準価額上昇の要因となりました。</p>

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
14,713円	18,891円	+4,178円	+28.40%	+28.70%	△0.30%

当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差要因[※]等です。

※当ファンドの為替評価レートは一般社団法人投資信託協会所定のレートを使用しておりますが、ベンチマークの為替評価レートはWMロイター公表のレートを使用していることによるものです。

■運用状況

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 債券組入比率

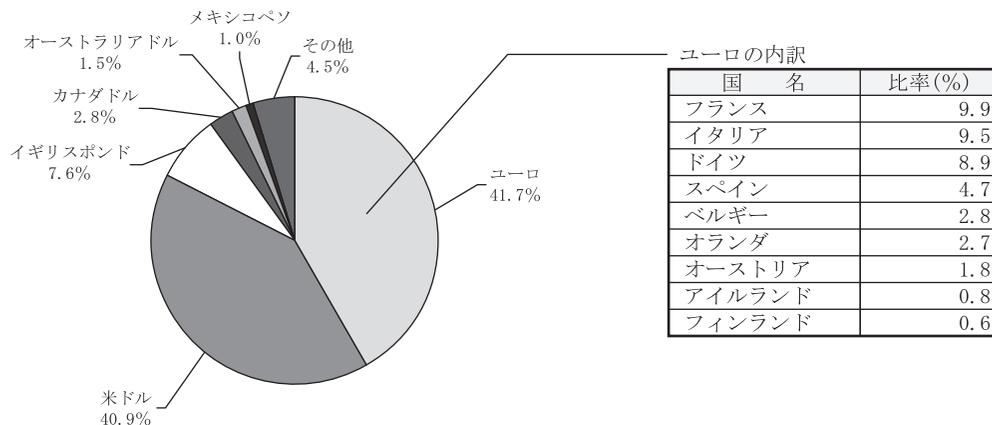
キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

なお、2012年10月より南アフリカがベンチマークに採用されたことに伴い、同国国債を組み入れました。

国・通貨別組入比率(当期末)



(注)比率は、債券評価総額に対する評価額の比率です。(経過利子を含みます。)

■今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、引き続き運用の基本方針に従い、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

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	5
合 計	5

(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) 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。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 752,336	千米ドル 864,429
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 22,381	千カナダドル 38,224
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 99,120	千メキシコペソ 102,929
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	50,570	89,173
	イ タ リ ア	国 債 証 券	44,741	82,088
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	38,210	65,593
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	16,188	19,658
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	27,831	33,955
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	15,346	24,195
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	3,412	10,945
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,887	5,452
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	4,816	10,015
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 23,293	千イギリスポンド 61,072
	ス イ ス	国 債 証 券	千スイスフラン 3,786	千スイスフラン 6,987
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 23,418	千スウェーデンクローナ 35,383
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 22,126	千ノルウェークローネ 31,066
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 26,097	千デンマーククローネ 57,581
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 22,614	千ポーランドズロチ 34,924
オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 14,370	千オーストラリアドル 14,794	
シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 6,414	千シンガポールドル 7,633	
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 17,009	千マレーシアリンギット 23,306	
南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 282,623	千南アフリカランド 20,655	

(注) 金額は受渡金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 44,546	百万円 47,335	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

主要な売買銘柄

<公社債>

買 付		期 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
T 1.75% 05/15/22(アメリカ)	2,574,741	T 1.5% 12/31/13(アメリカ)	3,765,579
T 1.25% 01/31/19(アメリカ)	2,456,206	T 0.5% 11/15/13(アメリカ)	2,778,233
T 1.25% 02/15/14(アメリカ)	2,064,002	T 3.625% 02/15/21(アメリカ)	2,451,342
T 4.75% 08/15/17(アメリカ)	1,878,202	T 0.625% 02/28/13(アメリカ)	2,237,022
T 0.375% 04/15/15(アメリカ)	1,870,769	T 3.875% 08/15/40(アメリカ)	2,140,212
T 3.5% 02/15/39(アメリカ)	1,738,315	UKT 4.5% 03/07/13(イギリス)	2,089,958
T 0.25% 12/15/15(アメリカ)	1,726,724	T 1.75% 04/15/13(アメリカ)	1,921,899
T 0.25% 05/15/15(アメリカ)	1,588,109	T 2.75% 10/31/13(アメリカ)	1,913,367
T 0.25% 09/15/15(アメリカ)	1,431,729	T 2.625% 01/31/18(アメリカ)	1,899,746
T 0.25% 04/30/14(アメリカ)	1,395,637	T 5.125% 05/15/16(アメリカ)	1,851,573

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期			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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	126,277	126,277	100.0	130,267	130,267	100.0
為替直物取引	13,033	12,122	93.0	55,341	54,323	98.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

〈外国(外貨建)公社債〉 (A)債券種類別開示

区 分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち80%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 1,850,950	千米ドル 1,967,095	千円 184,002,093	% 40.3	% —	% 13.8	% 17.0	% 9.5
カ ナ ダ	千カナダドル 119,500	千カナダドル 134,013	12,586,551	2.8	—	1.2	0.7	0.8
メ キ シ コ	千メキシコペソ 523,430	千メキシコペソ 619,883	4,574,742	1.0	—	0.6	0.3	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	277,030	316,604	40,018,851	8.8	—	4.7	2.9	1.1
イ タ リ ア	325,060	338,499	42,786,348	9.4	—	5.6	2.8	1.0
フ ラ ン ス	308,490	349,945	44,233,085	9.7	—	5.7	3.0	1.0
オ ラ ン ダ	82,740	93,982	11,879,403	2.6	—	1.5	0.7	0.3
ス ペ イ ン	167,490	165,802	20,957,405	4.6	—	2.2	1.4	1.0
ベ ル ギ ー	84,770	96,940	12,253,288	2.7	—	1.6	0.8	0.3
オ ー ス ト リ ア	53,940	62,709	7,926,543	1.7	—	1.0	0.6	0.2
フ ィ ン ラ ン ド	19,740	21,790	2,754,288	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ア イ ル ラ ン ド	25,100	26,635	3,366,738	0.7	—	0.5	0.2	—
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 201,920	千イギリスポンド 233,862	34,235,103	7.5	—	5.2	1.3	1.0
ス イ ス	千スイスフラン 14,410	千スイスフラン 17,044	1,751,808	0.4	—	0.2	0.2	—
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 172,230	千スウェーデンクローナ 191,243	2,811,284	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 75,650	千ノルウェークローネ 82,396	1,401,562	0.3	—	0.1	0.2	—
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 177,180	千デンマーククローネ 215,787	3,657,600	0.8	—	0.5	0.3	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 105,680	千ポーランドズロチ 113,515	3,437,244	0.8	—	0.3	0.3	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 64,580	千オーストラリアドル 70,685	6,814,067	1.5	—	0.7	0.6	0.2
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 21,250	千シンガポールドル 23,128	1,745,756	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 78,470	千マレーシアリンギット 81,000	2,442,154	0.5	—	0.3	0.2	0.0
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 246,700	千南アフリカランド 262,351	2,754,689	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	448,390,615	98.2	—	47.3	34.0	16.8

(注1) 邦貨換算金額は、当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) 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。

(B) 個別銘柄開示

当 期 末					当 期 末				
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日
		外貨建金額	評価額				外貨建金額	評価額	
	%	千米ドル	千円			%	千米ドル	千円	
(アメリカ)									
国債証券									
T 0.125% 07/31/14	0.125	1,000	998	2014/7/31	T 1% 08/31/16	1.0	21,000	21,361	2016/8/31
T 0.125% 12/31/14	0.125	15,000	14,966	2014/12/31	T 1% 08/31/19	1.0	6,000	5,907	2019/8/31
T 0.25% 01/15/15	0.25	9,000	9,000	2015/1/15	T 1% 09/30/16	1.0	10,000	10,169	2016/9/30
T 0.25% 01/31/14	0.25	10,000	10,008	2014/1/31	T 1% 09/30/19	1.0	5,000	4,916	2019/9/30
T 0.25% 02/15/15	0.25	15,000	14,996	2015/2/15	T 1% 10/31/16	1.0	9,000	9,151	2016/10/31
T 0.25% 02/28/14	0.25	9,000	9,007	2014/2/28	T 1% 11/30/19	1.0	6,100	5,978	2019/11/30
T 0.25% 03/31/14	0.25	8,000	8,006	2014/3/31	T 1.125% 05/31/19	1.125	12,000	11,964	2019/5/31
T 0.25% 04/30/14	0.25	17,600	17,613	2014/4/30	T 1.125% 12/31/19	1.125	5,200	5,131	2019/12/31
T 0.25% 05/15/15	0.25	20,090	20,068	2015/5/15	T 1.25% 01/31/19	1.25	30,050	30,334	2019/1/31
T 0.25% 05/31/14	0.25	15,000	15,010	2014/5/31	T 1.25% 02/15/14	1.25	25,000	25,274	2014/2/15
T 0.25% 06/30/14	0.25	1,000	1,000	2014/6/30	T 1.25% 03/15/14	1.25	15,100	15,276	2014/3/15
T 0.25% 07/15/15	0.25	10,000	9,994	2015/7/15	T 1.25% 04/15/14	1.25	5,110	5,174	2014/4/15
T 0.25% 08/15/15	0.25	5,000	4,990	2015/8/15	T 1.25% 04/30/19	1.25	2,000	2,011	2019/4/30
T 0.25% 08/31/14	0.25	1,000	1,000	2014/8/31	T 1.25% 08/31/15	1.25	11,990	12,271	2015/8/31
T 0.25% 09/15/14	0.25	18,000	18,008	2014/9/15	T 1.25% 09/30/15	1.25	21,980	22,507	2015/9/30
T 0.25% 09/15/15	0.25	18,000	17,960	2015/9/15	T 1.25% 10/31/15	1.25	10,000	10,244	2015/10/31
T 0.25% 09/30/14	0.25	9,000	9,003	2014/9/30	T 1.375% 02/28/19	1.375	15,000	15,234	2019/2/28
T 0.25% 10/15/15	0.25	5,000	4,987	2015/10/15	T 1.375% 09/30/18	1.375	10,520	10,732	2018/9/30
T 0.25% 10/31/14	0.25	5,000	5,001	2014/10/31	T 1.375% 11/30/15	1.375	4,550	4,677	2015/11/30
T 0.25% 11/30/14	0.25	4,000	4,001	2014/11/30	T 1.375% 11/30/18	1.375	9,000	9,168	2018/11/30
T 0.25% 12/15/15	0.25	6,100	6,101	2014/12/15	T 1.375% 12/31/18	1.375	3,700	3,766	2018/12/31
T 0.25% 12/15/15	0.25	19,000	18,937	2015/12/15	T 1.5% 06/30/16	1.5	13,450	13,914	2016/6/30
T 0.375% 03/15/15	0.375	15,300	15,331	2015/3/15	T 1.5% 07/31/16	1.5	9,950	10,295	2016/7/31
T 0.375% 04/15/15	0.375	23,700	23,745	2015/4/15	T 1.5% 08/31/18	1.5	6,500	6,681	2018/8/31
T 0.375% 06/15/15	0.375	6,000	6,010	2015/6/15	T 1.625% 08/15/22	1.625	10,000	9,745	2022/8/15
T 0.375% 11/15/14	0.375	10,000	10,025	2014/11/15	T 1.625% 11/15/22	1.625	6,900	6,692	2022/11/15
T 0.375% 11/15/15	0.375	6,000	6,003	2015/11/15	T 1.75% 01/31/14	1.75	18,900	19,193	2014/1/31
T 0.5% 07/31/17	0.5	7,010	6,940	2017/7/31	T 1.75% 03/31/14	1.75	13,000	13,232	2014/3/31
T 0.5% 08/15/14	0.5	20,150	20,238	2014/8/15	T 1.75% 05/15/22	1.75	31,900	31,587	2022/5/15
T 0.5% 10/15/14	0.5	5,100	5,123	2014/10/15	T 1.75% 05/31/16	1.75	10,960	11,425	2016/5/31
T 0.625% 05/31/17	0.625	14,000	13,966	2017/5/31	T 1.75% 07/31/15	1.75	22,000	22,776	2015/7/31
T 0.625% 07/15/14	0.625	2,000	2,011	2014/7/15	T 1.75% 10/31/18	1.75	10,630	11,058	2018/10/31
T 0.625% 08/31/17	0.625	16,500	16,414	2017/8/31	T 1.875% 02/28/14	1.875	2,000	2,035	2014/2/28
T 0.625% 09/30/17	0.625	12,000	11,924	2017/9/30	T 1.875% 04/30/14	1.875	6,880	7,022	2014/4/30
T 0.625% 11/30/17	0.625	5,000	4,959	2017/11/30	T 1.875% 06/30/15	1.875	23,900	24,797	2015/6/30
T 0.75% 06/15/14	0.75	10,000	10,074	2014/6/15	T 1.875% 08/31/17	1.875	2,000	2,102	2017/8/31
T 0.75% 06/30/17	0.75	4,000	4,008	2017/6/30	T 1.875% 09/30/17	1.875	1,210	1,271	2017/9/30
T 0.75% 12/31/17	0.75	5,000	4,983	2017/12/31	T 1.875% 10/31/17	1.875	4,900	5,150	2017/10/31
T 0.875% 01/31/17	0.875	13,000	13,138	2017/1/31	T 11.25% 02/15/15	11.25	2,550	3,114	2015/2/15
T 0.875% 02/28/17	0.875	6,000	6,060	2017/2/28	T 2% 01/31/16	2.0	3,000	3,142	2016/1/31
T 0.875% 04/30/17	0.875	7,000	7,062	2017/4/30	T 2% 02/15/22	2.0	6,000	6,094	2022/2/15
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,000	4,892	2019/7/31	T 2% 04/30/16	2.0	6,090	6,395	2016/4/30
T 0.875% 11/30/16	0.875	2,000	2,023	2016/11/30	T 2% 11/15/21	2.0	24,320	24,802	2021/11/15
T 0.875% 12/31/16	0.875	9,500	9,606	2016/12/31	T 2.125% 05/31/15	2.125	6,950	7,241	2015/5/31
T 1% 03/31/17	1.0	10,000	10,145	2017/3/31	T 2.125% 08/15/21	2.125	22,400	23,157	2021/8/15
T 1% 05/15/14	1.0	5,600	5,656	2014/5/15	T 2.125% 11/30/14	2.125	21,400	22,129	2014/11/30
T 1% 06/30/19	1.0	5,000	4,939	2019/6/30	T 2.125% 12/31/15	2.125	11,000	11,552	2015/12/31
					T 2.25% 01/31/15	2.25	14,900	15,485	2015/1/31

当 期 末					当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日		
		外貨建金額	評価額				外貨建金額	評価額			
	%	千米ドル	千米ドル	千円		%	千米ドル	千米ドル	千円		
T 2.25% 03/31/16	2.25	9,150	9,674	904,954	2016/3/31	T 3.5% 02/15/18	3.5	6,850	7,746	724,584	2018/2/15
T 2.25% 05/31/14	2.25	7,930	8,142	761,692	2014/5/31	T 3.5% 02/15/39	3.5	16,320	17,660	1,651,978	2039/2/15
T 2.25% 07/31/18	2.25	8,000	8,555	800,234	2018/7/31	T 3.5% 05/15/20	3.5	14,900	17,077	1,597,418	2020/5/15
T 2.25% 11/30/17	2.25	2,000	2,138	200,007	2017/11/30	T 3.625% 02/15/20	3.625	22,030	25,427	2,378,482	2020/2/15
T 2.375% 02/28/15	2.375	15,500	16,169	1,512,537	2015/2/28	T 3.625% 02/15/21	3.625	5,230	6,046	565,548	2021/2/15
T 2.375% 03/31/16	2.375	7,900	8,382	784,054	2016/3/31	T 3.625% 08/15/19	3.625	1,400	1,613	150,944	2019/8/15
T 2.375% 05/31/18	2.375	8,080	8,694	813,256	2018/5/31	T 3.75% 08/15/41	3.75	12,440	13,983	1,308,001	2041/8/15
T 2.375% 06/30/18	2.375	4,960	5,336	499,217	2018/6/30	T 3.75% 11/15/18	3.75	5,040	5,812	543,695	2018/11/15
T 2.375% 07/31/17	2.375	2,000	2,146	200,774	2017/7/31	T 3.875% 05/15/18	3.875	2,040	2,353	220,111	2018/5/15
T 2.375% 08/31/14	2.375	26,000	26,871	2,513,551	2014/8/31	T 3.875% 08/15/40	3.875	4,910	5,650	528,514	2040/8/15
T 2.375% 09/30/14	2.375	22,150	22,932	2,145,075	2014/9/30	T 4% 02/15/14	4.0	4,000	4,156	388,753	2014/2/15
T 2.375% 10/31/14	2.375	15,950	16,538	1,546,979	2014/10/31	T 4.0% 02/15/15	4.0	10,020	10,773	1,007,749	2015/2/15
T 2.5% 03/31/15	2.5	12,820	13,431	1,256,354	2015/3/31	T 4.0% 08/15/18	4.0	6,000	6,988	653,713	2018/8/15
T 2.5% 04/30/15	2.5	4,930	5,171	483,777	2015/4/30	T 4.125% 05/15/15	4.125	4,040	4,388	410,517	2015/5/15
T 2.5% 06/30/17	2.5	8,200	8,841	827,041	2017/6/30	T 4.25% 05/15/39	4.25	5,510	6,738	630,274	2039/5/15
T 2.625% 01/31/18	2.625	5,250	5,709	534,064	2018/1/31	T 4.25% 08/15/14	4.25	12,550	13,318	1,245,852	2014/8/15
T 2.625% 02/29/16	2.625	12,850	13,717	1,283,123	2016/2/29	T 4.25% 08/15/15	4.25	10,500	11,531	1,078,660	2015/8/15
T 2.625% 04/30/16	2.625	13,580	14,530	1,359,167	2016/4/30	T 4.25% 11/15/14	4.25	9,230	9,882	924,434	2014/11/15
T 2.625% 04/30/18	2.625	5,600	6,096	570,231	2018/4/30	T 4.25% 11/15/17	4.25	1,350	1,569	146,801	2017/11/15
T 2.625% 06/30/14	2.625	13,000	13,437	1,256,918	2014/6/30	T 4.25% 11/15/40	4.25	9,220	11,278	1,054,954	2040/11/15
T 2.625% 07/31/14	2.625	28,200	29,203	2,731,697	2014/7/31	T 4.375% 02/15/38	4.375	2,150	2,675	250,245	2038/2/15
T 2.625% 08/15/20	2.625	15,000	16,245	1,519,568	2020/8/15	T 4.375% 05/15/40	4.375	11,800	14,718	1,376,783	2040/5/15
T 2.625% 11/15/20	2.625	15,000	16,214	1,516,718	2020/11/15	T 4.375% 05/15/41	4.375	3,350	4,180	391,031	2041/5/15
T 2.625% 12/31/14	2.625	3,480	3,636	340,180	2014/12/31	T 4.375% 11/15/39	4.375	5,800	7,233	676,575	2039/11/15
T 2.75% 02/15/19	2.75	2,000	2,194	205,258	2019/2/15	T 4.5% 02/15/16	4.5	2,420	2,717	254,229	2016/2/15
T 2.75% 02/28/18	2.75	290	317	29,686	2018/2/28	T 4.5% 02/15/36	4.5	5,620	7,103	664,418	2036/2/15
T 2.75% 05/31/17	2.75	9,900	10,776	1,008,015	2017/5/31	T 4.5% 05/15/17	4.5	15,530	18,037	1,687,203	2017/5/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	12,150	11,185	1,046,322	2042/8/15	T 4.5% 05/15/38	4.5	1,500	1,901	177,864	2038/5/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	800	735	68,789	2042/11/15	T 4.5% 08/15/39	4.5	7,450	9,468	885,709	2039/8/15
T 2.75% 11/30/16	2.75	15,500	16,771	1,568,776	2016/11/30	T 4.5% 11/15/15	4.5	2,160	2,406	225,060	2015/11/15
T 2.75% 12/31/17	2.75	11,000	12,025	1,124,880	2017/12/31	T 4.625% 02/15/17	4.625	18,500	21,444	2,005,881	2017/2/15
T 2.875% 03/31/18	2.875	4,800	5,285	494,391	2018/3/31	T 4.625% 02/15/40	4.625	14,700	19,046	1,781,614	2040/2/15
T 3% 02/28/17	3.0	28,850	31,595	2,955,420	2017/2/28	T 4.625% 11/15/16	4.625	2,450	2,820	263,862	2016/11/15
T 3% 05/15/42	3.0	16,080	15,629	1,461,996	2042/5/15	T 4.75% 02/15/37	4.75	3,500	4,585	428,925	2037/2/15
T 3% 08/31/16	3.0	1,030	1,120	104,791	2016/8/31	T 4.75% 02/15/41	4.75	7,900	10,440	976,575	2041/2/15
T 3% 09/30/16	3.0	4,000	4,356	407,512	2016/9/30	T 4.75% 05/15/14	4.75	9,300	9,835	920,027	2014/5/15
T 3.125% 01/31/17	3.125	5,000	5,495	514,058	2017/1/31	T 4.75% 08/15/17	4.75	19,000	22,409	2,096,160	2017/8/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	3,800	3,792	354,764	2042/2/15	T 4.875% 08/15/16	4.875	750	864	80,870	2016/8/15
T 3.125% 04/30/17	3.125	4,900	5,403	505,398	2017/4/30	T 5.0% 05/15/37	5.0	1,250	1,694	158,465	2037/5/15
T 3.125% 05/15/19	3.125	15,520	17,397	1,627,339	2019/5/15	T 5.125% 05/15/16	5.125	2,000	2,302	215,405	2016/5/15
T 3.125% 05/15/21	3.125	9,190	10,259	959,632	2021/5/15	T 5.25% 02/15/29	5.25	1,600	2,147	200,882	2029/2/15
T 3.125% 10/31/16	3.125	1,400	1,533	143,409	2016/10/31	T 5.25% 11/15/28	5.25	3,350	4,489	419,919	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	17,770	17,756	1,660,907	2041/11/15	T 5.375% 02/15/31	5.375	5,980	8,245	771,317	2031/2/15
T 3.25% 03/31/17	3.25	15,300	16,936	1,584,257	2017/3/31	T 5.5% 08/15/28	5.5	2,250	3,086	288,698	2028/8/15
T 3.25% 05/31/16	3.25	12,000	13,103	1,225,695	2016/5/31	T 6.0% 02/15/26	6.0	1,440	2,032	190,094	2026/2/15
T 3.25% 06/30/16	3.25	9,000	9,843	920,767	2016/6/30	T 6.125% 08/15/29	6.125	1,200	1,761	164,802	2029/8/15
T 3.25% 07/31/16	3.25	3,560	3,899	364,761	2016/7/31	T 6.125% 11/15/27	6.125	2,700	3,901	364,961	2027/11/15
T 3.25% 12/31/16	3.25	9,800	10,806	1,010,831	2016/12/31	T 6.25% 05/15/30	6.25	3,520	5,268	492,785	2030/5/15
T 3.375% 11/15/19	3.375	10,390	11,813	1,105,039	2019/11/15	T 6.25% 08/15/23	6.25	7,950	11,176	1,045,457	2023/8/15

当 期 末					当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日		
		外貨建金額	邦貨換算金額				外貨建金額	邦貨換算金額			
	%	千米ドル	千カナダドル	千円		%	千メキシコ コペソ	千ユーロ	千円		
T 6.5% 11/15/26	6.5	1,150	1,701	159,142	2026/11/15	(メキシコ) 国債証券					
T 6.875% 08/15/25	6.875	4,240	6,379	596,742	2025/8/15	MBONO 10% 11/20/36	10.0	23,210	34,873	257,363	2036/11/20
T 7.125% 02/15/23	7.125	1,450	2,145	200,683	2023/2/15	MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,920	44,574	328,962	2024/12/5
T 7.25% 05/15/16	7.25	1,670	2,437	190,630	2016/5/15	MBONO 5% 06/15/17	5.0	12,330	12,564	92,722	2017/6/15
T 7.25% 08/15/22	7.25	1,000	1,478	138,304	2022/8/15	MBONO 6% 06/18/15	6.0	36,300	37,652	277,877	2015/6/18
T 7.5% 11/15/16	7.5	8,250	10,384	971,353	2016/11/15	MBONO 6.25% 06/16/16	6.25	25,960	27,400	202,214	2016/6/16
T 7.5% 11/15/24	7.5	2,690	4,191	392,044	2024/11/15	MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	13,500	15,012	110,791	2022/6/9
T 8.0% 11/15/21	8.0	6,100	9,266	866,823	2021/11/15	MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	30,530	33,861	249,896	2021/6/10
T 8.75% 05/15/17	8.75	2,700	3,621	338,728	2017/5/15	MBONO 7% 06/19/14	7.0	30,450	31,545	232,807	2014/6/19
T 8.75% 08/15/20	8.75	1,800	2,748	257,129	2020/8/15	MBONO 7.25% 12/15/16	7.25	25,290	27,759	204,866	2016/12/15
小 計				184,002,093		MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	36,430	43,897	323,960	2027/6/3
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル			MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	17,550	21,348	157,550	2031/5/29
CAN 0.75% 05/01/14	0.75	3,340	3,325	312,336	2014/5/1	MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	9,420	11,559	85,312	2042/11/13
CAN 1% 02/01/14	1.0	1,390	1,389	130,466	2014/2/1	MBONO 7.75% 12/14/17	7.75	28,200	32,163	237,366	2017/12/14
CAN 1% 02/01/15	1.0	3,850	3,838	360,499	2015/2/1	MBONO 8% 06/11/20	8.0	38,260	46,102	340,239	2020/6/11
CAN 1% 05/01/15	1.0	1,000	995	93,542	2015/5/1	MBONO 8% 12/07/23	8.0	10,140	12,622	93,152	2023/12/7
CAN 1% 11/01/14	1.0	2,100	2,094	196,700	2014/11/1	MBONO 8% 12/17/15	8.0	29,700	32,548	240,210	2015/12/17
CAN 1.25% 02/01/16	1.25	850	848	79,681	2016/2/1	MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	37,540	48,974	361,433	2029/5/31
CAN 1.5% 03/01/17	1.5	3,930	3,936	369,758	2017/3/1	MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	36,630	48,213	355,814	2038/11/18
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,190	1,124	105,603	2023/6/1	MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	13,000	15,600	115,130	2018/12/13
CAN 1.5% 08/01/15	1.5	1,400	1,409	132,346	2015/8/1	MBONO 9.5% 12/18/14	9.5	38,070	41,608	307,068	2014/12/18
CAN 1.5% 09/01/17	1.5	2,000	2,001	187,946	2017/9/1	小 計				4,574,742	
CAN 2% 03/01/14	2.0	3,380	3,412	320,539	2014/3/1	(ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
CAN 2% 06/01/16	2.0	1,200	1,225	115,075	2016/6/1	BKO 0% 06/13/14	-	3,100	3,093	391,005	2014/6/13
CAN 2% 12/01/14	2.0	8,360	8,485	796,988	2014/12/1	BKO 0% 12/12/14	-	7,200	7,172	906,567	2014/12/12
CAN 2.25% 08/01/14	2.25	3,800	3,861	362,704	2014/8/1	BKO 0.25% 03/14/14	0.25	2,810	2,813	355,645	2014/3/14
CAN 2.5% 06/01/15	2.5	4,080	4,202	394,674	2015/6/1	DBR 1.5% 09/04/22	1.5	4,000	3,975	502,475	2022/9/4
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	4,500	4,788	449,748	2022/6/1	DBR 1.75% 07/04/22	1.75	8,740	8,899	1,124,897	2022/7/4
CAN 2.75% 09/01/16	2.75	4,910	5,139	482,728	2016/9/1	DBR 2% 01/04/22	2.0	5,690	5,945	751,519	2022/1/4
CAN 3% 12/01/15	3.0	2,310	2,419	227,235	2015/12/1	DBR 2.25% 09/04/20	2.25	13,530	14,578	1,842,740	2020/9/4
CAN 3.0% 06/01/14	3.0	8,100	8,297	779,291	2014/6/1	DBR 2.25% 09/04/21	2.25	3,820	4,088	516,787	2021/9/4
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	3,980	3,928	368,940	2021/6/1	DBR 2.5% 01/04/21	2.5	5,000	5,468	691,218	2021/1/4
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	4,260	4,773	448,371	2020/6/1	DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,100	2,155	272,516	2044/7/4
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	2,550	3,060	287,405	2045/12/1	DBR 3% 07/04/20	3.0	6,720	7,603	961,062	2020/7/4
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	7,070	7,937	745,479	2019/6/1	DBR 3.25% 01/04/20	3.25	8,050	9,229	1,166,596	2020/1/4
CAN 4% 06/01/16	4.0	5,650	6,133	576,023	2016/6/1	DBR 3.25% 07/04/15	3.25	7,850	8,410	1,063,115	2015/7/4
CAN 4% 06/01/17	4.0	4,640	4,641	435,918	2017/6/1	DBR 3.25% 07/04/21	3.25	4,250	4,888	617,868	2021/7/4
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	5,290	7,156	672,110	2041/6/1	DBR 3.25% 07/04/42	3.25	5,200	6,191	782,633	2042/7/4
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	3,150	3,581	336,382	2018/6/1	DBR 3.25% 07/04/42	3.25	5,200	6,191	782,633	2042/7/4
CAN 4.5% 06/01/15	4.5	3,100	3,333	313,112	2015/6/1	DBR 3.5% 01/04/16	3.5	11,440	12,490	1,578,825	2016/1/4
CAN 5% 06/01/14	5.0	2,790	2,930	275,226	2014/6/1	DBR 3.5% 07/04/19	3.5	6,060	7,024	887,852	2019/7/4
CAN 5% 06/01/37	5.0	4,700	6,698	629,146	2037/6/1	DBR 3.75% 01/04/15	3.75	6,140	6,551	828,133	2015/1/4
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	4,250	6,135	576,267	2029/6/1	DBR 3.75% 01/04/17	3.75	7,400	8,338	1,054,001	2017/1/4
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	4,370	6,566	616,679	2033/6/1	DBR 3.75% 01/04/19	3.75	9,190	10,727	1,355,971	2019/1/4
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	1,690	2,851	267,856	2027/6/1	DBR 4% 07/04/16	4.0	7,600	8,526	1,077,727	2016/7/4
CAN 9% 06/01/25	9.0	860	1,488	139,761	2025/6/1	DBR 4.0% 01/04/18	4.0	5,820	6,758	854,256	2018/1/4
小 計				12,586,551		DBR 4.0% 01/04/37	4.0	7,300	9,532	1,204,929	2037/1/4
						DBR 4.25% 07/04/14	4.25	4,610	4,871	615,696	2014/7/4
						DBR 4.25% 07/04/17	4.25	7,010	8,132	1,028,007	2017/7/4
						DBR 4.25% 07/04/18	4.25	8,830	10,464	1,322,704	2018/7/4

当 期 末					当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日		
		千ユーロ	千ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	%	千ユーロ	外貨建金額 千ユーロ	邦貨換算金額 千円		%	千ユーロ	外貨建金額 千ユーロ	邦貨換算金額 千円		
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	4,690	6,454	815,854	2039/7/4	BTPS 4.5% 08/01/18	4.5	6,130	6,450	815,340	2018/8/1
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	7,140	9,631	1,217,372	2028/7/4	BTPS 4.75% 05/01/17	4.75	3,160	3,364	425,276	2017/5/1
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	6,630	9,380	1,185,664	2034/7/4	BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	6,130	6,243	789,185	2023/8/1
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	5,470	8,131	1,027,767	2040/7/4	BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	9,980	10,437	1,319,278	2021/9/1
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	5,330	7,899	998,451	2031/1/4	BTPS 4.75% 09/15/16	4.75	8,560	9,142	1,156,672	2016/9/15
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,910	2,781	351,535	2028/1/4	BTPS 5% 03/01/22	5.0	8,340	8,775	1,109,283	2022/3/1
DBR 6% 06/20/16	6.0	1,850	2,195	277,538	2016/6/20	BTPS 5% 03/01/25	5.0	8,470	8,741	1,104,969	2025/3/1
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	3,730	5,419	685,022	2024/1/4	BTPS 5% 08/01/34	5.0	7,520	7,461	943,142	2034/8/1
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	2,950	4,646	587,319	2030/1/4	BTPS 5% 09/01/40	5.0	6,140	6,058	765,781	2040/9/1
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	3,850	6,025	761,679	2027/7/4	BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	6,830	6,762	854,795	2039/8/1
OBL 0.5% 04/07/17	0.5	4,860	4,856	613,883	2017/4/7	BTPS 5.25% 08/01/17	5.25	11,070	12,029	1,520,548	2017/8/1
OBL 0.5% 10/13/17	0.5	1,800	1,791	226,435	2017/10/13	BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	9,580	9,864	1,246,851	2029/11/1
OBL 0.75% 02/24/17	0.75	6,570	6,636	838,877	2017/2/24	BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	2,450	2,645	334,421	2022/9/1
OBL 1.25% 10/14/16	1.25	5,620	5,790	731,966	2016/10/14	BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	4,350	4,680	591,600	2022/11/1
OBL 1.75% 10/09/15	1.75	4,980	5,175	654,169	2015/10/9	BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	5,250	5,704	721,027	2033/2/1
OBL 2% 02/26/16	2.0	6,180	6,494	820,963	2016/2/26	BTPS 6% 05/01/31	6.0	10,070	11,257	1,422,923	2031/5/1
OBL 2.25% 04/10/15	2.25	9,650	10,070	1,272,953	2015/4/10	BTPS 6% 11/15/14	6.0	2,700	2,901	366,698	2014/11/15
OBL 2.25% 04/11/14	2.25	10,940	11,207	1,416,612	2014/4/11	BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	8,310	9,681	1,223,770	2027/11/1
OBL 2.5% 02/27/15	2.5	6,970	7,294	922,080	2015/2/27	BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	4,000	4,956	626,544	2026/11/1
OBL 2.5% 10/10/14	2.5	4,000	4,152	524,815	2014/10/10	BTPS 9% 11/01/23	9.0	3,920	5,347	675,924	2023/11/1
OBL 2.75% 04/08/16	2.75	2,450	2,635	333,133	2016/4/8						
(イタリア)					(フランス)						
国債証券					国債証券						
BTPS 2.5% 03/01/15	2.5	2,000	2,020	255,445	2015/3/1	BTNS 0.75% 09/25/14	0.75	470	473	59,831	2014/9/25
BTPS 3% 04/01/14	3.0	240	244	30,912	2014/4/1	BTNS 1% 07/25/17	1.0	3,890	3,893	492,199	2017/7/25
BTPS 3% 04/15/15	3.0	13,970	14,232	1,798,943	2015/4/15	BTNS 1.75% 02/25/17	1.75	8,340	8,634	1,091,451	2017/2/25
BTPS 3% 06/15/15	3.0	8,510	8,667	1,096,612	2015/6/15	BTNS 2% 07/12/15	2.0	9,390	9,739	1,231,024	2015/7/12
BTPS 3% 11/01/15	3.0	8,200	8,345	1,054,856	2015/11/1	BTNS 2.25% 02/25/16	2.25	7,740	8,124	1,026,944	2016/2/25
BTPS 3.5% 06/01/14	3.5	8,620	8,844	1,118,000	2014/6/1	BTNS 2.5% 01/15/15	2.5	9,250	9,627	1,216,955	2015/1/15
BTPS 3.5% 11/01/17	3.5	2,900	2,928	370,130	2017/11/1	BTNS 2.5% 07/25/16	2.5	8,160	8,656	1,094,196	2016/7/25
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	5,240	5,173	653,964	2021/3/1	BTNS 3% 07/12/14	3.0	12,730	13,217	1,670,715	2014/7/12
BTPS 3.75% 04/15/16	3.75	5,330	5,532	699,289	2016/4/15	FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	2,650	2,643	334,177	2022/10/25
BTPS 3.75% 08/01/15	3.75	9,130	9,444	1,193,823	2015/8/1	FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	11,690	12,267	1,550,632	2020/10/25
BTPS 3.75% 08/01/16	3.75	8,430	8,735	1,104,226	2016/8/1	FRTR 3% 04/25/22	3.0	7,900	8,449	1,067,984	2022/4/25
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	14,100	13,899	1,756,860	2021/8/1	FRTR 3% 10/25/15	3.0	14,210	15,162	1,916,512	2015/10/25
BTPS 4% 02/01/17	4.0	9,650	10,037	1,268,702	2017/2/1	FRTR 3.25% 04/25/16	3.25	9,100	10,065	1,272,271	2016/4/25
BTPS 4% 02/01/37	4.0	7,070	6,102	771,347	2037/2/1	FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	4,350	4,546	574,734	2021/10/25
BTPS 4% 09/01/20	4.0	5,250	5,286	668,235	2020/9/1	FRTR 3.5% 04/25/15	3.5	8,400	8,967	1,133,545	2015/4/25
BTPS 4.25% 02/01/15	4.25	12,230	12,794	1,617,252	2015/2/1	FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	9,960	11,186	1,413,976	2020/4/25
BTPS 4.25% 02/01/19	4.25	9,230	9,854	1,245,618	2019/2/1	FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	10,610	11,543	1,459,054	2026/4/25
BTPS 4.25% 03/01/20	4.25	10,310	10,570	1,336,095	2020/3/1	FRTR 3.75% 04/25/17	3.75	10,840	12,116	1,531,548	2017/4/25
BTPS 4.25% 07/01/14	4.25	5,490	5,698	720,281	2014/7/1	FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	12,220	13,905	1,757,632	2021/4/25
BTPS 4.25% 08/01/14	4.25	4,170	4,332	547,686	2014/8/1	FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	11,400	12,995	1,642,579	2019/10/25
BTPS 4.25% 09/01/19	4.25	11,730	12,121	1,532,156	2019/9/1	FRTR 4% 04/25/14	4.0	8,560	8,945	1,130,738	2014/4/25
BTPS 4.5% 02/01/18	4.5	6,360	6,710	848,154	2018/2/1	FRTR 4% 04/25/18	4.0	9,810	11,221	1,418,386	2018/4/25
BTPS 4.5% 02/01/20	4.5	5,620	5,856	740,238	2020/2/1	FRTR 4% 04/25/55	4.0	4,710	5,386	680,790	2055/4/25
BTPS 4.5% 03/01/19	4.5	11,020	11,539	1,458,576	2019/3/1	FRTR 4% 04/25/60	4.0	3,130	3,585	453,180	2060/4/25
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	5,600	5,533	699,374	2026/3/1	FRTR 4% 10/25/14	4.0	3,960	4,207	531,772	2014/10/25
BTPS 4.5% 07/15/15	4.5	1,410	1,483	187,522	2015/7/15	FRTR 4% 10/25/38	4.0	8,690	9,920	1,253,907	2038/10/25
						FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	10,400	12,150	1,535,853	2019/4/25

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
FRTR 4.25% 10/25/17	4.25	8,230	9,447	1,194,221	2017/10/25	SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	5,950	5,994	757,671	2019/7/30		
FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	8,470	9,856	1,245,904	2018/10/25	SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	5,400	4,923	622,382	2025/7/30		
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	13,500	15,821	1,999,875	2023/10/25	SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	3,590	2,992	378,242	2041/7/30		
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	7,680	9,488	1,199,296	2041/4/25	SPGB 4.75% 07/30/14	4.75	3,920	4,062	513,558	2014/7/30		
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	6,920	8,719	1,102,120	2035/4/25	SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	5,410	5,101	644,798	2024/1/31		
FRTR 5% 10/25/16	5.0	11,210	12,940	1,635,727	2016/10/25	SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	7,220	7,201	910,221	2020/10/31		
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	9,050	12,090	1,528,197	2029/4/25	SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	4,380	3,761	475,459	2040/7/30		
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	7,730	10,881	1,375,438	2032/10/25	SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	1,400	1,396	176,565	2023/1/31		
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	5,040	6,880	869,632	2025/10/25	SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	8,080	8,337	1,053,856	2021/4/30		
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	4,090	6,393	808,090	2023/4/25	SPGB 5.5% 07/30/17	5.5	5,390	5,731	724,486	2017/7/30		
FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	4,010	5,791	731,982	2019/10/25	SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	5,500	5,456	689,721	2032/7/30		
(オランダ)						SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	2,960	3,092	390,946	2022/1/31		
国債証券						SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,900	1,931	244,204	2026/7/30		
NETHER 0% 04/15/16	-	1,500	1,474	186,373	2016/4/15	SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	5,660	5,796	732,676	2029/1/31		
NETHER 0.75% 04/15/15	0.75	3,320	3,350	423,561	2015/4/15	(ベルギー)							
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	4,890	5,002	632,273	2022/7/15	国債証券							
NETHER 2.5% 01/15/17	2.5	4,140	4,425	559,379	2017/1/15	BGB 2.25% 06/22/23	2.25	450	440	55,620	2023/6/22		
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	2,510	2,516	318,085	2033/1/15	BGB 2.75% 03/28/16	2.75	1,740	1,849	233,745	2016/3/28		
NETHER 2.75% 01/15/15	2.75	5,740	6,011	759,824	2015/1/15	BGB 3% 09/28/19	3.0	1,890	2,047	258,815	2019/9/28		
NETHER 3.25% 07/15/15	3.25	5,040	5,390	681,353	2015/7/15	BGB 3.25% 09/28/16	3.25	4,600	4,994	631,344	2016/9/28		
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	4,210	4,732	598,244	2021/7/15	BGB 3.5% 03/28/15	3.5	1,780	1,892	239,240	2015/3/28		
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	5,450	6,228	787,320	2020/7/15	BGB 3.5% 06/28/17	3.5	3,670	4,049	511,837	2017/6/28		
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	3,200	3,730	471,510	2023/1/15	BGB 3.75% 09/28/15	3.75	5,300	5,737	725,175	2015/9/28		
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	4,500	5,620	710,453	2042/1/15	BGB 3.75% 09/28/20	3.75	7,500	8,482	1,072,206	2020/9/28		
NETHER 3.75% 07/15/14	3.75	6,000	6,300	796,388	2014/7/15	BGB 4% 03/28/14	4.0	4,880	5,083	642,590	2014/3/28		
NETHER 4% 01/15/37	4.0	4,480	5,673	717,160	2037/1/15	BGB 4% 03/28/18	4.0	4,590	5,222	660,150	2018/3/28		
NETHER 4% 07/15/16	4.0	5,050	5,633	712,074	2016/7/15	BGB 4% 03/28/22	4.0	5,340	6,122	773,853	2022/3/28		
NETHER 4% 07/15/19	4.0	6,780	7,921	1,001,318	2019/7/15	BGB 4% 03/28/32	4.0	1,900	2,138	270,256	2032/3/28		
NETHER 4.0% 07/15/18	4.0	5,150	5,946	751,653	2018/7/15	BGB 4.0% 03/28/17	4.0	5,110	5,727	723,961	2017/3/28		
NETHER 4.5% 07/15/17	4.5	5,310	6,156	778,221	2017/7/15	BGB 4.0% 03/28/19	4.0	3,420	3,921	495,659	2019/3/28		
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	4,410	6,177	780,822	2028/1/15	BGB 4.25% 03/28/41	4.25	3,950	4,637	586,227	2041/3/28		
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	1,120	1,688	213,381	2023/1/15	BGB 4.25% 09/28/14	4.25	3,800	4,038	510,460	2014/9/28		
(スペイン)						BGB 4.25% 09/28/21	4.25	3,560	4,157	525,540	2021/9/28		
国債証券						BGB 4.25% 09/28/22	4.25	3,500	4,072	514,747	2022/9/28		
SPGB 3% 04/30/15	3.0	5,360	5,377	679,682	2015/4/30	BGB 4.5% 03/28/26	4.5	2,500	2,971	375,591	2026/3/28		
SPGB 3.15% 01/31/16	3.15	9,820	9,780	1,236,220	2016/1/31	BGB 5% 03/28/35	5.0	5,930	7,616	962,773	2035/3/28		
SPGB 3.25% 04/30/16	3.25	4,310	4,287	541,997	2016/4/30	BGB 5.5% 03/28/28	5.5	4,970	6,558	828,955	2028/3/28		
SPGB 3.3% 10/31/14	3.3	12,470	12,648	1,598,716	2014/10/31	BGB 5.5% 09/28/17	5.5	2,380	2,850	360,252	2017/9/28		
SPGB 3.4% 04/30/14	3.4	6,380	6,493	820,790	2014/4/30	BGB 8.0% 03/28/15	8.0	2,010	2,328	294,282	2015/3/28		
SPGB 3.75% 10/31/15	3.75	3,150	3,195	403,879	2015/10/31	(オーストリア)							
SPGB 3.8% 01/31/17	3.8	7,790	7,795	985,394	2017/1/31	国債証券							
SPGB 4% 04/30/20	4.0	8,250	7,899	998,470	2020/4/30	RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	850	882	111,501	2019/6/18		
SPGB 4% 07/30/15	4.0	5,250	5,371	678,988	2015/7/30	RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	580	626	79,211	2044/6/20		
SPGB 4.1% 07/30/18	4.1	5,570	5,540	700,316	2018/7/30	RAGB 3.2% 02/20/17	3.2	3,270	3,586	453,323	2017/2/20		
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	5,600	4,384	554,196	2037/1/31	RAGB 3.4% 10/20/14	3.4	2,650	2,790	352,719	2014/10/20		
SPGB 4.25% 01/31/14	4.25	4,740	4,861	614,551	2014/1/31	RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	990	1,115	140,977	2022/11/22		
SPGB 4.25% 10/31/16	4.25	6,770	6,904	872,692	2016/10/31	RAGB 3.5% 07/15/15	3.5	4,730	5,084	642,709	2015/7/15		
SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	5,850	5,772	729,679	2019/10/31	RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	5,190	5,903	746,247	2021/9/15		
SPGB 4.4% 01/31/15	4.4	7,420	7,676	970,249	2015/1/31	RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	2,200	2,528	319,655	2022/4/20		
SPGB 4.5% 01/31/18	4.5	2,000	2,031	256,786	2018/1/31	RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	1,000	1,246	157,516	2062/1/26		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	千イギリスポンド	千イギリスポンド	
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	4,410	5,130	648,518	2020/7/15	UKT 4.25% 06/07/32	4.25	6,320	7,512	1,099,781	2032/6/7		
RAGB 4% 09/15/16	4.0	3,960	4,426	559,545	2016/9/15	UKT 4.25% 09/07/39	4.25	6,130	7,202	1,054,424	2039/9/7		
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	4,250	5,329	673,600	2037/3/15	UKT 4.25% 12/07/27	4.25	4,350	5,213	763,156	2027/12/7		
RAGB 4.3% 07/15/14	4.3	3,600	3,809	481,466	2014/7/15	UKT 4.25% 12/07/40	4.25	5,650	6,635	971,354	2040/12/7		
RAGB 4.3% 09/15/17	4.3	2,150	2,478	313,248	2017/9/15	UKT 4.25% 12/07/46	4.25	6,050	7,115	1,041,575	2046/12/7		
RAGB 4.35% 03/15/19	4.35	4,260	5,028	635,578	2019/3/15	UKT 4.25% 12/07/49	4.25	5,500	6,485	949,362	2049/12/7		
RAGB 4.65% 01/15/18	4.65	3,960	4,658	588,829	2018/1/15	UKT 4.25% 12/07/55	4.25	5,920	7,045	1,031,448	2055/12/7		
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	3,350	4,330	547,399	2026/3/15	UKT 4.5% 03/07/19	4.5	5,090	6,046	885,108	2019/3/7		
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	2,540	3,753	474,493	2027/7/15	UKT 4.5% 09/07/34	4.5	3,980	4,862	711,813	2034/9/7		
(フィンランド) 国債証券						UKT 4.5% 12/07/42	4.5	5,170	6,339	928,400	2042/12/7		
RFIG 1.625% 09/15/22	1.625	1,200	1,179	149,040	2022/9/15	UKT 4.75% 03/07/20	4.75	2,870	3,491	511,147	2020/3/7		
RFIG 1.75% 04/15/16	1.75	2,010	2,088	263,992	2016/4/15	UKT 4.75% 09/07/15	4.75	5,090	5,659	828,456	2015/9/7		
RFIG 1.875% 04/15/17	1.875	1,830	1,915	242,115	2017/4/15	UKT 4.75% 12/07/30	4.75	5,280	6,671	976,597	2030/12/7		
RFIG 2.75% 07/04/28	2.75	1,050	1,107	139,934	2028/7/4	UKT 4.75% 12/07/38	4.75	5,360	6,804	996,152	2038/12/7		
RFIG 3.125% 09/15/14	3.125	2,110	2,208	279,160	2014/9/15	UKT 5% 03/07/18	5.0	7,020	8,393	1,228,770	2018/3/7		
RFIG 3.375% 04/15/20	3.375	2,520	2,858	361,349	2020/4/15	UKT 5% 03/07/25	5.0	5,580	7,156	1,047,679	2025/3/7		
RFIG 3.5% 04/15/21	3.5	1,920	2,198	277,929	2021/4/15	UKT 5.0% 09/07/14	5.0	8,640	9,275	1,357,804	2014/9/7		
RFIG 3.875% 09/15/17	3.875	1,750	1,990	251,547	2017/9/15	UKT 6.0% 12/07/28	6.0	3,500	5,019	734,754	2028/12/7		
RFIG 4% 07/04/25	4.0	2,050	2,470	312,277	2025/7/4	UKT 8% 06/07/21	8.0	5,970	8,870	1,298,564	2021/6/7		
RFIG 4.25% 07/04/15	4.25	1,650	1,803	227,946	2015/7/4	UKT 8% 12/07/15	8.0	3,080	3,741	547,737	2015/12/7		
RFIG 4.375% 07/04/19	4.375	1,650	1,969	248,994	2019/7/4	UKT 8.75% 08/25/17	8.75	1,920	2,595	380,007	2017/8/25		
(アイルランド) 国債証券						小 計					34,235,103		
IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	2,670	2,763	349,259	2019/6/18	(スイス) 国債証券		千スイスフラン	千スイスフラン				
IRISH 4.5% 02/18/15	4.5	1,700	1,807	228,518	2015/2/18	SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	1,400	1,582	162,617	2020/7/6		
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	3,900	4,022	508,389	2020/4/18	SWISS 2.5% 03/12/16	2.5	2,390	2,571	264,324	2016/3/12		
IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	2,840	3,012	380,760	2018/10/18	SWISS 3% 01/08/18	3.0	2,260	2,566	263,780	2018/1/8		
IRISH 4.6% 04/18/16	4.6	3,590	3,859	487,859	2016/4/18	SWISS 3% 05/12/19	3.0	1,960	2,283	234,707	2019/5/12		
IRISH 5% 10/18/20	5.0	3,060	3,244	410,050	2020/10/18	SWISS 3.75% 06/10/15	3.75	1,400	1,522	156,519	2015/6/10		
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	4,110	4,321	546,209	2025/3/13	SWISS 4% 02/11/23	4.0	1,510	1,984	203,941	2023/2/11		
IRISH 5.5% 10/18/17	5.5	1,010	1,117	141,244	2017/10/18	SWISS 4% 04/08/28	4.0	1,820	2,570	264,159	2028/4/8		
IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	2,220	2,487	314,446	2019/10/18	SWISS 4.25% 06/05/17	4.25	1,670	1,963	201,757	2017/6/5		
小 計				186,175,955		小 計					1,751,808		
(イギリス) 国債証券		千イギリスポンド	千イギリスポンド			(スウェーデン) 国債証券		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ				
UKT 1% 09/07/17	1.0	5,650	5,666	829,473	2017/9/7	SGB 1.5% 11/13/23	1.5	11,350	10,727	157,691	2023/11/13		
UKT 1.75% 01/22/17	1.75	9,820	10,200	1,493,276	2017/1/22	SGB 3% 07/12/16	3.0	16,150	17,124	251,730	2016/7/12		
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	3,560	3,457	506,170	2022/9/7	SGB 3.5% 03/30/39	3.5	14,290	16,417	241,339	2039/3/30		
UKT 2% 01/22/16	2.0	6,060	6,324	925,775	2016/1/22	SGB 3.5% 06/01/22	3.5	22,720	25,655	377,141	2022/6/1		
UKT 2.25% 03/07/14	2.25	9,400	9,596	1,404,880	2014/3/7	SGB 3.75% 08/12/17	3.75	19,170	21,157	311,020	2017/8/12		
UKT 2.75% 01/22/15	2.75	10,690	11,188	1,637,943	2015/1/22	SGB 4.25% 03/12/19	4.25	21,700	24,999	367,497	2019/3/12		
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	3,970	4,244	621,324	2052/7/22	SGB 4.5% 08/12/15	4.5	20,050	21,762	319,906	2015/8/12		
UKT 3.75% 09/07/19	3.75	6,630	7,606	1,113,578	2019/9/7	SGB 5% 12/01/20	5.0	20,200	24,874	365,654	2020/12/1		
UKT 3.75% 09/07/20	3.75	8,920	10,253	1,500,950	2020/9/7	SGB 6.75% 05/05/14	6.75	26,600	28,523	419,302	2014/5/5		
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	8,140	9,354	1,369,379	2021/9/7	小 計					2,811,284		
UKT 4% 01/22/60	4.0	2,550	2,910	426,057	2060/1/22	(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ				
UKT 4% 03/07/22	4.0	5,100	5,975	874,699	2022/3/7	NOB 2% 05/24/23	2.0	6,550	6,254	106,380	2023/5/24		
UKT 4% 09/07/16	4.0	5,690	6,375	933,280	2016/9/7	NOB 3.75% 05/25/21	3.75	14,400	15,971	271,678	2021/5/25		
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	7,270	8,570	1,254,576	2036/3/7								

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千/ルウェー クロネ	外貨建金額	千/ルウェー クロネ	邦貨換算金額				千/ルウェー クロネ	千円	千オースト リアドル	外貨建金額	
NGB 4.25% 05/19/17	4.25	17,000	18,637	317,022	2017/5/19	ACGB 6.25% 04/15/15	6.25	4,850	5,204	501,698	2015/4/15		
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	15,750	17,964	305,580	2019/5/22	ACGB 6.25% 06/15/14	6.25	5,150	5,386	519,294	2014/6/15		
NGB 5% 05/15/15	5.0	21,950	23,568	400,899	2015/5/15	小 計				6,814,067			
小 計				1,401,562		(シンガポール) 国債証券		千シンガ ポールドル	千シンガ ポールドル				
(デンマーク) 国債証券		千デンマーク クロネ	千デンマーク クロネ			SIGB 0.25% 02/01/14	0.25	820	820	61,905	2014/2/1		
DGB 2% 11/15/14	2.0	12,170	12,573	213,112	2014/11/15	SIGB 1.125% 04/01/16	1.125	780	799	60,342	2016/4/1		
DGB 2.5% 11/15/16	2.5	11,000	11,826	200,463	2016/11/15	SIGB 1.375% 10/01/14	1.375	1,490	1,516	114,500	2014/10/1		
DGB 3% 11/15/21	3.0	27,620	31,246	529,625	2021/11/15	SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	670	713	53,844	2021/6/1		
DGB 4% 11/15/15	4.0	30,820	34,000	576,302	2015/11/15	SIGB 2.375% 04/01/17	2.375	1,510	1,630	123,085	2017/4/1		
DGB 4% 11/15/17	4.0	18,960	21,957	372,172	2017/11/15	SIGB 2.5% 06/01/19	2.5	1,240	1,359	102,625	2019/6/1		
DGB 4% 11/15/19	4.0	31,830	38,050	644,948	2019/11/15	SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	624	47,139	2042/4/1		
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	37,500	54,667	926,620	2039/11/15	SIGB 2.875% 07/01/15	2.875	2,190	2,323	175,357	2015/7/1		
DGB 7% 11/10/24	7.0	7,280	11,466	194,354	2024/11/10	SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	930	992	74,915	2030/9/1		
小 計				3,657,600		SIGB 3% 09/01/24	3.0	1,150	1,279	96,556	2022/9/1		
(ポーランド) 国債証券		千ポーランド ズロチ	千ポーランド ズロチ			SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	1,500	1,712	129,293	2024/9/1		
POLGB 0% 07/25/14	—	1,950	1,859	56,320	2014/7/25	SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	1,710	1,947	147,029	2020/9/1		
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	3,500	3,542	107,258	2018/4/25	SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	1,740	2,003	151,212	2027/3/1		
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,300	3,305	100,093	2023/10/25	SIGB 3.625% 07/01/14	3.625	2,110	2,210	166,828	2014/7/1		
POLGB 4.75% 04/25/17	4.75	4,720	4,958	150,141	2017/4/25	SIGB 3.75% 09/01/16	3.75	1,390	1,555	117,405	2016/9/1		
POLGB 4.75% 10/25/16	4.75	5,540	5,793	175,438	2016/10/25	SIGB 4% 09/01/18	4.0	1,390	1,639	123,714	2018/9/1		
POLGB 5% 04/25/16	5.0	8,960	9,391	284,375	2016/4/25	小 計				1,745,756			
POLGB 5.25% 10/25/17	5.25	9,170	9,869	298,836	2017/10/25	(マレーシア) 国債証券		千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット				
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	8,760	9,640	291,906	2020/10/25	MCS 3.172% 07/15/16	3.172	1,050	1,051	31,702	2016/7/15		
POLGB 5.5% 04/25/15	5.5	9,600	10,028	303,674	2015/4/25	MCS 3.197% 10/15/15	3.197	2,960	2,968	89,494	2015/10/15		
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	9,740	10,830	327,953	2019/10/25	MCS 3.418% 08/15/22	3.418	1,800	1,791	54,013	2022/8/15		
POLGB 5.75% 04/25/14	5.75	12,190	12,534	379,546	2014/4/25	MCS 3.434% 08/15/14	3.434	2,280	2,296	69,229	2014/8/15		
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	3,170	3,780	114,486	2029/4/25	MCS 3.492% 03/31/20	3.492	4,750	4,763	143,606	2020/3/31		
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	9,310	10,665	322,943	2022/9/23	MCS 3.502% 05/31/27	3.502	1,680	1,638	49,410	2027/5/31		
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	6,220	7,065	213,931	2021/10/25	MCS 3.58% 09/28/18	3.58	6,570	6,648	200,443	2018/9/28		
POLGB 6.25% 10/24/15	6.25	9,550	10,248	310,337	2015/10/24	MCS 3.741% 02/27/15	3.741	5,080	5,149	155,261	2015/2/27		
小 計				3,437,244		MCS 3.814% 02/15/17	3.814	3,530	3,608	108,798	2017/2/15		
(オーストラリア) 国債証券		千オースト リアドル	千オースト リアドル			MCS 3.835% 08/12/15	3.835	5,230	5,320	160,423	2015/8/12		
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,650	1,520	146,572	2024/4/21	MCS 3.892% 03/15/27	3.892	1,590	1,622	48,919	2027/3/15		
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,100	1,000	96,419	2029/4/21	MCS 4.16% 07/15/21	4.16	4,610	4,829	145,595	2021/7/15		
ACGB 4.25% 07/21/17	4.25	3,290	3,469	334,450	2017/7/21	MCS 4.24% 02/07/18	4.24	9,470	9,877	297,809	2018/2/7		
ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	6,160	6,663	642,398	2020/4/15	MCS 4.262% 09/15/16	4.262	8,060	8,357	251,982	2016/9/15		
ACGB 4.5% 10/21/14	4.5	3,800	3,909	376,829	2014/10/21	MCS 4.378% 11/29/19	4.378	9,560	10,101	304,548	2019/11/29		
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	1,820	1,998	192,633	2027/4/21	MCS 4.392% 04/15/26	4.392	3,910	4,202	126,715	2026/4/15		
ACGB 4.75% 06/15/16	4.75	4,100	4,350	419,424	2016/6/15	MCS 5.094% 04/30/14	5.094	4,530	4,646	140,100	2014/4/30		
ACGB 4.75% 10/15/15	4.75	2,600	2,731	263,328	2015/10/21	MCS 5.248% 09/15/28	5.248	1,810	2,126	64,100	2028/9/15		
ACGB 5.25% 03/15/19	5.25	6,130	6,854	660,750	2019/3/15	小 計				2,442,154			
ACGB 5.5% 01/21/18	5.5	3,190	3,554	342,689	2018/1/21	(南アフリカ) 国債証券		千南アフリ カランド	千南アフリ カランド				
ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	4,400	5,156	497,100	2023/4/21	SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	41,950	53,436	561,083	2026/12/21		
ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	5,340	6,268	604,238	2021/5/15	SAGB 13.5% 09/15/15	13.5	19,400	23,202	243,624	2015/9/15		
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	4,680	5,548	534,881	2022/7/15	SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	21,150	16,894	177,393	2036/3/31		
ACGB 6% 02/15/17	6.0	6,320	7,068	681,355	2017/2/15	SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	15,000	12,164	127,723	2041/2/28		

銘柄	利率	当 期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	評価額	額	
	%	千南アフリ カランド	千南アフリ カランド	千円		
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	28,150	28,716	301,521		2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	15,350	14,030	147,324		2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	30,350	31,970	335,695		2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	5,100	5,463	57,368		2023/2/28
SAGB 8% 12/21/18	8.0	25,300	27,781	291,702		2018/12/21
SAGB 8.25% 09/15/17	8.25	27,700	30,492	320,167		2017/9/15
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	6,350	6,607	69,376		2048/2/28
SAGB 8.75% 12/21/14	8.75	10,900	11,591	121,707		2014/12/21
小 計				2,754,689		
合 計				448,390,615		

(注) 邦貨換算金額は、当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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期		末
	買 建 額	売 建 額	額
	百万円		百万円
外 国	EURO-SCHATZ	292	—
	US 5YR NOTE	428	—
	EURO-BOBL FU	334	—
	EURO-BOND FU	576	—
	US 10YR NOTE	233	—
	US LONG BOND	174	—

(注) 外貨建の評価額は、当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

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	率
公 社 債	千円		%
	448,390,615		98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,994,752		2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	457,385,367		100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(453,756,531千円)の投資信託財産総額(457,385,367千円)に対する比率は99.2%です。

(注2) 外貨建資産は、当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=93.54円、1カナダドル=93.92円、1メキシコペソ=7.38円、1ユーロ=126.40円、1イギリスポンド=146.39円、1スイスフラン=102.78円、1スウェーデンクローナ=14.70円、1ノルウェークローネ=17.01円、1デンマーククローネ=16.95円、1ポーランドズロチ=30.28円、1オーストラリアドル=96.40円、1シンガポールドル=75.48円、1マレーシアリングット=30.15円、1南アフリカランド=10.50円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2013年2月7日現在
(A) 資 産	460,000,005,155円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,815,575,150
公 社 債(評価額)	448,390,615,529
未 収 入 金	2,831,723,519
未 収 利 息	4,669,555,758
前 払 費 用	143,926,768
差 入 委 託 証 拠 金	148,608,431
(B) 負 債	3,192,293,796
未 払 金	2,651,706,099
未 払 解 約 金	540,587,697
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	456,807,711,359
元 本	241,811,908,302
次 期 繰 越 損 益 金	214,995,803,057
(D) 受 益 権 総 口 数	241,811,908,302口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,891円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2012年2月8日 至 2013年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	14,343,540,732円
受 取 利 息	14,343,601,067
支 払 利 息	△60,335
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	90,959,239,414
売 買 益	96,706,649,644
売 買 損	△5,747,410,230
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	97,018,710
取 引 益	213,929,583
取 引 損	△116,910,873
(D) 保 管 費 用 等	△124,473,833
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	105,275,325,023
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	127,343,907,642
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,290,598,769
(H) 解 約 差 損 益 金	△22,914,028,377
(I) 計 (E+F+G+H)	214,995,803,057
次 期 繰 越 損 益 金(I)	214,995,803,057

(注1) (B)有価証券売買損益及び(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) (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3) (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。

<注記事項>

※当マザーファンドの期首元本額は270,223,866,822円、期中追加設定元本額は9,383,261,962円、期中一部解約元本額は37,795,220,482円です。

※1口当たり純資産額は、1.8891円です。

※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は次の通りです。

V A バランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	81,580,843,001円
V A バランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	29,365,620,656円
バランスV A 5 0 (適格機関投資家専用)	23,408,968,406円
バランスV A 5 0 L (適格機関投資家専用)	17,663,796,696円
外国債券インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	15,493,778,516円
D C 外国債券インデックスファンドL	9,199,592,029円
V A バランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	8,298,538,410円
バランスV A 3 0 (適格機関投資家専用)	7,096,666,932円
バランスV A 2 5 (適格機関投資家専用)	6,730,951,665円
V A ファンド25(適格機関投資家専用)	6,054,776,792円
外国債券インデックスファンド	5,208,679,847円

VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	4,991,619,538円
VAバランスファンド(株50/100) (適格機関投資家専用)	4,522,017,250円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	3,653,368,251円
バランスVA20 (適格機関投資家専用)	3,334,163,553円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	2,348,401,031円
VAバランス株式40 (適格機関投資家専用)	2,241,952,376円
DC外国債券インデックスファンド	1,922,192,873円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	1,881,283,155円
インデックスコレクション(外国債券)	1,116,691,639円
外国債券インデックスe	893,078,503円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	814,699,015円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	709,514,262円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	428,260,849円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	424,254,154円
外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)	352,365,721円
VAバランスファンド2(株40/100) (適格機関投資家専用)	332,298,762円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	270,119,020円
DCバランスファンド50	180,032,683円
インデックスコレクション(バランス株式50)	152,684,091円
インデックスコレクション(バランス株式30)	139,888,172円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	135,313,452円
DCバランスファンド30	122,351,952円
VAバランス株式30 (適格機関投資家専用)	119,572,276円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	100,553,593円
新生・4分散ファンド	93,453,897円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	80,672,516円
物価連動債組入世界債券ファンド	70,853,023円
私募外国債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	63,521,784円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	63,356,896円
インデックスコレクション(バランス株式70)	48,796,368円
バランスVA20L (適格機関投資家専用)	43,132,006円
DCバランスファンド70	36,613,901円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	20,884,745円
世界バランスVA20 (適格機関投資家専用)	1,734,045円

約款変更のお知らせ

当ファンドの委託会社の合併に伴い、委託会社名及び当ファンドの名称を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。また、当ファンドの受託会社の合併に伴い、受託会社名を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。また、投資助言会社の合併に伴い、投資助言会社名を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2012年4月1日)