

## 運用報告書

第9期<決算日2012年2月21日>

### DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>

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 海外ノ債券（インデックス型）	
信託期間	信託期間は2002年12月10日から無期限です。	
運用方針	主に外国債券バッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。	
主要投資対象	DIAM 外国債券 インデックス ファンド<DC年金>	外国債券バッシブ・ファンド・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 バッシブ・ファンド・ マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資制限	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使及び社債権者割当等により取得するものに限ります。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。	
分配方針	決算日（原則として2月21日）に、経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の中から基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。	

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>」は、2012年2月21日に第9期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-506-860

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客様のお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

**DIAMアセットマネジメント**

東京都千代田区丸の内3-3-1

(URL) <http://www.diam.co.jp>

## DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			シティグループ 世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース、 為替ヘッジなし)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
5期(2008年2月21日)	円 13,783	円 0	% 2.0	ポイント 86,944.29	% 1.9	% 95.7	% -	百万円 2,629
6期(2009年2月23日)	11,378	0	△17.4	71,764.42	△17.5	96.7	-	2,916
7期(2010年2月22日)	12,119	0	6.5	76,849.64	7.1	97.4	-	3,666
8期(2011年2月21日)	11,265	0	△7.0	71,790.80	△6.6	97.4	-	4,113
9期(2012年2月21日)	11,563	0	2.6	74,181.19	3.3	98.0	-	4,717

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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。

(注3) 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。なお、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし)はシティグループ世界国債インデックス(除く日本)に基づき、シティグループ証券株式会社の承諾を得た上で、当社が計算したものです。

(注4) シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産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。

### ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		シティグループ 世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース、 為替ヘッジなし)		債券組入 比率	債券先物 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2011年2月21日	11,265	-	71,790.80	-	97.4	-
2月 末	11,136	△1.1	71,199.90	△0.8	97.2	-
3月 末	11,481	1.9	73,252.08	2.0	97.7	-
4月 末	11,697	3.8	74,155.89	3.3	97.4	-
5月 末	11,526	2.3	73,441.26	2.3	97.2	-
6月 末	11,484	1.9	73,208.50	2.0	97.7	-
7月 末	11,118	△1.3	71,079.17	△1.0	97.6	-
8月 末	11,351	0.8	72,663.73	1.2	97.8	-
9月 末	11,009	△2.3	70,653.56	△1.6	97.6	-
10月 末	11,281	0.1	72,441.61	0.9	97.7	-
11月 末	10,987	△2.5	70,331.33	△2.0	97.8	-
12月 末	11,043	△2.0	70,618.11	△1.6	97.7	-
2012年1月 末	11,059	△1.8	70,665.74	△1.6	97.4	-
(期末)						
2012年2月21日	11,563	2.6	74,181.19	3.3	98.0	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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。

## ■当期の運用経過（2011年2月22日から2012年2月21日まで）



期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 2. 21	2011. 4. 7	2012. 1. 10	2012. 2. 21
11,265円	11,856円	10,801円	11,563円



## 《投資環境》

外国債券市場では、利回りは低下（価格は上昇）しました。期初から春先にかけては、景気回復期待や資源価格の高騰に伴うインフレ懸念などから、利回りに上昇（価格は下落）圧力が見られましたが、2011年5月以降は米国経済の減速懸念や欧州債務危機の深刻化を受けて低下基調が鮮明になりました。その後、8月にはFRB（米連邦準備理事会）が2013年半ばまでの実質ゼロ金利政策を表明し、9月にも追加金融緩和策を発表したことなどから、利回りは一段と低下（価格は上昇）しました。10月以降も、欧州債務危機が経済規模の大きいスペインやイタリアにまで拡大するとの懸念やギリシャ支援を巡ってユーロ加盟国間での協議が難航したことなどをを受けて、期末まで低水準で推移しました。

為替市場では、主要通貨に対して円高となりました。2011年前半には一時的に円が弱含む場面もありましたが、年半ば以降は米国の超低金利政策の長期化や欧州債務危機の先行き不透明感などを背景に円高が進行しました。2012年に入ると、米国の景気回復期待や日本の2011年貿易収支の赤字転落などを材料に円売り機運が高まりましたが、前期末と比べると円高となり当期末を迎えました。

## 《運用経過》

当ファンドの主要投資対象は外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドであり、組入比率については期を通じてほぼ100%となるよう運用を行いました。

## 基準価額の推移

当期末の基準価額は11,563円となり、前期末に比べ2.65%上昇しました。

### 基準価額の騰落要因

債券利回りが低下（価格は上昇）したことから、基準価額が上昇しました。

### ベンチマークの推移

ベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし）は3.33%上昇しました。

### ベンチマークとの差異およびその要因

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で▲0.68%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

### 収益分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準等を勘案して無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### 《今後の運用方針》

引き続き、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし）に連動する投資成果が得られるよう外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの高位組入れを維持します。

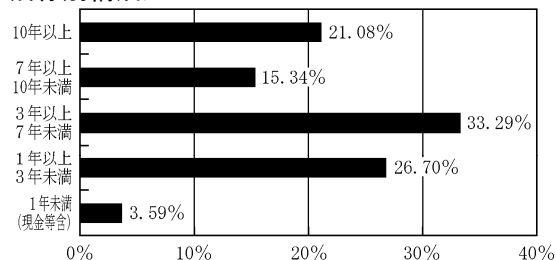
## 【D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>の運用状況】

※組入比率は純資産総額に対する割合です。

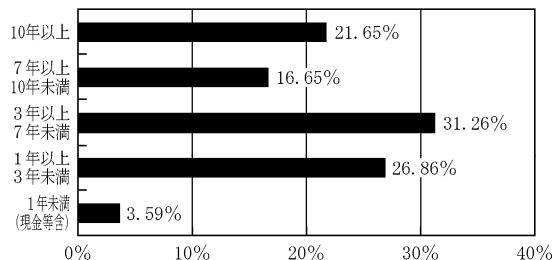
※外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを通じた実質組入比率を表示しています。

期首（前期末）

### 残存別構成比



期末



### 国別構成比

発行国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	38.88%	39.70%	-0.82%
カナダ	2.86%	2.86%	0.00%
計	41.73%	42.56%	-0.83%
中南米			
メキシコ	0.86%	0.90%	-0.05%
計	0.86%	0.90%	-0.05%
欧州			
オーストリア	1.78%	1.84%	-0.06%
ベルギー	2.68%	2.73%	-0.05%
フィンランド	0.60%	0.61%	-0.01%
フランス	9.42%	9.63%	-0.21%
ドイツ	9.46%	9.55%	-0.09%
アイルランド	0.66%	0.80%	-0.14%
イタリア	10.27%	10.42%	-0.15%
オランダ	2.39%	2.40%	-0.01%
ポルトガル	0.82%	0.98%	-0.16%
スペイン	4.20%	4.27%	-0.07%
ユーロ計	42.28%	43.23%	-0.95%
デンマーク	0.83%	0.86%	-0.03%
スウェーデン	0.68%	0.70%	-0.03%
スイス	0.00%	0.54%	-0.54%
英国	7.90%	7.93%	-0.03%
ポーランド	0.89%	0.92%	-0.03%
ノルウェー	0.26%	0.27%	-0.01%
計	52.85%	54.46%	-1.61%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.11%	1.12%	-0.01%
シンガポール	0.39%	0.39%	0.00%
マレーシア	0.49%	0.56%	-0.07%
計	1.99%	2.07%	-0.08%
現金など	2.58%	-	-
合計	100%	100%	-

発行国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	40.68%	41.55%	-0.87%
カナダ	2.96%	3.00%	-0.04%
計	43.64%	44.55%	-0.91%
中南米			
メキシコ	0.85%	0.90%	-0.05%
計	0.85%	0.90%	-0.05%
欧州			
オーストリア	1.72%	1.75%	-0.03%
ベルギー	2.56%	2.59%	-0.03%
フィンランド	0.60%	0.62%	-0.02%
フランス	9.45%	9.45%	0.00%
ドイツ	9.16%	9.23%	-0.07%
アイルランド	0.66%	0.73%	-0.06%
イタリア	9.19%	8.96%	0.23%
オランダ	2.50%	2.52%	-0.02%
スペイン	4.45%	4.54%	-0.09%
ユーロ計	40.29%	40.37%	-0.08%
デンマーク	0.85%	0.86%	-0.01%
スウェーデン	0.60%	0.62%	-0.02%
スイス	0.00%	0.45%	-0.45%
英国	8.38%	8.72%	-0.34%
ポーランド	0.75%	0.74%	0.01%
ノルウェー	0.31%	0.32%	-0.01%
計	51.17%	52.08%	-0.91%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.44%	1.50%	-0.06%
シンガポール	0.41%	0.39%	0.02%
マレーシア	0.49%	0.57%	-0.08%
計	2.34%	2.46%	-0.12%
現金など	1.99%	-	-
合計	100%	100%	-

(注) 世界国債インデックスとはシティグループ世界国債インデックス（除く日本）です。

## ■ 1 万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	30円 (13) (13) ( 4)
(b) 保 管 費 用 等	2
合 計	32

(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。なお、保管費用等は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

- (a) 信託報酬  
＝ 期中の平均基準価額 × 信託報酬率
- (b) 保管費用等  
＝  $\frac{\text{期中の保管費用等}}{\text{期中の平均受益権口数}}$

(注2) 保管費用等には、監査報酬等が含まれております。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

## ■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況（2011年2月22日から2012年2月21日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 603,206	千円 693,450	千口 195,076	千円 223,960

## ■ 利害関係人との取引状況等（2011年2月22日から2012年2月21日まで）

期中の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

	期首（前期末）	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 3,573,111	千口 3,981,240	千円 4,716,974

(注) 親投資信託合計の受益権口数は321,716,172千口です。

## ■投資信託財産の構成

2012年2月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,716,974	99.7
コール・ローン等、その他	12,972	0.3
投資信託財産総額	4,729,946	100.0

- (注1) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、381,040,196千円、99.9%です。  
(注2) 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、2012年2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル=79.75円、1カナダドル=80.17円、1英ポンド=126.18円、1スイスフラン=87.36円、1スウェーデンクローネ=11.95円、1デンマーククローネ=14.18円、1ノルウェークローネ=14.02円、1ポーランドズロチ=25.26円、1オーストラリアドル=85.56円、1シンガポールドル=63.56円、1マレーシアリングギット=26.38円、1メキシコペソ=6.25円、1ユーロ=105.43円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2012年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,729,946,274円
コール・ローン等	12,972,112
外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド(評価額)	4,716,974,162
(B) 負 債	12,804,835
未払解約金	6,859,980
未払信託報酬	5,834,097
その他未払費用	110,758
(C) 純資産総額(A-B)	4,717,141,439
元 本	4,079,550,674
次期繰越損益金	637,590,765
(D) 受益権総口数	4,079,550,674口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,563円

### <注記事項>

期首元本額	3,651,566,729円
期中追加設定元本額	823,555,611円
期中一部解約元本額	395,571,666円

## ■損益の状況

当期 自2011年2月22日 至2012年2月21日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,370円
受 取 利 息	4,370
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	135,522,905
売 買 損 益	140,360,575
売 買 損 益	△ 4,837,670
(C) 信 託 報 酬 等	△ 11,696,720
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	123,830,555
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 327,772,793
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	841,533,003
(配 当 等 相 当 額)	( 1,181,916,435)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 340,383,432)
(G) 計 (D+E+F)	637,590,765
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	637,590,765
追 加 信 託 差 損 益 金	841,533,003
(配 当 等 相 当 額)	( 1,181,916,435)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 340,383,432)
分 配 準 備 積 立 金	168,947,047
繰 越 損 益 金	△ 372,889,285

- (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4) 分配金の計算過程  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,370円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,181,916,435円)及び分配準備積立金(168,947,677円)より分配対象収益は1,350,863,482円(1万口当たり3,311.30円)であります。分配を行っておりません。

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額水準等を勘案して無分配とさせていただきます。

# 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第9期（決算日 2012年2月21日）

（計算期間 2011年2月22日～2012年2月21日）

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」は、「D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>」が投資対象とする親投資信託で、信託財産の実質的な運用を行っております。

以下、法令・諸規則に基づき、当親投資信託の第9期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2002年12月10日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要運用対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。</li> <li>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> </ul>

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティグループ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし)		債券組入率	債券先物比率	純資産総額
	期騰落率	騰落率	期騰落率	騰落率			
5期(2008年2月21日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
6期(2009年2月23日)	13,972	2.3	86,944.29	1.9	95.7	—	340,385
7期(2010年2月22日)	11,565	△17.2	71,764.42	△17.5	96.7	—	310,301
8期(2011年2月21日)	12,352	6.8	76,849.64	7.1	97.4	—	419,924
9期(2012年2月21日)	11,512	△6.8	71,790.80	△6.6	97.4	—	397,800
	11,848	2.9	74,181.19	3.3	98.0	—	381,158

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 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。なお、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし）はシティグループ世界国債インデックス（除く日本）に基づき、シティグループ証券株式会社の承諾を得た上で、当社が計算したものです。

(注3) シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産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。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティグループ世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース、 為替ヘッジなし)		債券組入 率	債券先物 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期首) 2011年2月21日	円 11,512	% —	ポイント 71,790.80	% —	% 97.4	% —
2月 末	11,381	△1.1	71,199.90	△0.8	97.2	—
3月 末	11,736	1.9	73,252.08	2.0	97.7	—
4月 末	11,959	3.9	74,155.89	3.3	97.4	—
5月 末	11,787	2.4	73,441.26	2.3	97.1	—
6月 末	11,747	2.0	73,208.50	2.0	97.6	—
7月 末	11,375	△1.2	71,079.17	△1.0	97.6	—
8月 末	11,616	0.9	72,663.73	1.2	97.8	—
9月 末	11,269	△2.1	70,653.56	△1.6	97.6	—
10月 末	11,550	0.3	72,441.61	0.9	97.7	—
11月 末	11,251	△2.3	70,331.33	△2.0	97.8	—
12月 末	11,311	△1.7	70,618.11	△1.6	97.7	—
2012年1月 末	11,330	△1.6	70,665.74	△1.6	97.4	—
(期末) 2012年2月21日	11,848	2.9	74,181.19	3.3	98.0	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2011年2月22日から2012年2月21日まで）



期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 2. 21	2011. 4. 7	2012. 1. 10	2012. 2. 21
11,512円	12,120円	11,064円	11,848円



### ベンチマークの推移

ベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし）は3.33%上昇しました。

### ベンチマークとの差異およびその要因

当マザーファンドの騰落率はベンチマーク比で▲0.41%となり、ベンチマークにはほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

### 《今後の運用方針》

当マザーファンドの運用では、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指したパッシブ運用を行います。

### 《投資環境》

外国債券市場では、利回りは低下（価格は上昇）しました。期初から春先にかけては、景気回復期待や資源価格の高騰に伴うインフレ懸念などから、利回りに上昇（価格は下落）圧力が見られましたが、2011年5月以降は米国経済の減速懸念や欧州債務危機の深刻化を受けて低下基調が鮮明になりました。その後、8月にはF R B（米連邦準備理事会）が2013年半ばまでの実質ゼロ金利政策を表明し、9月にも追加金融緩和策を発表したことなどから、利回りは一段と低下（価格は上昇）しました。10月以降も、欧州債務危機が経済規模の大きいスペインやイタリアにまで拡大するとの懸念やギリシャ支援を巡ってユーロ加盟国間での協議が難航したことなどをを受けて、期末まで低水準で推移しました。

為替市場では、主要通貨に対して円高となりました。2011年前半には一時的に円が弱含む場面もありましたが、年半ば以降は米国の超低金利政策の長期化や欧州債務危機の先行き不透明感などを背景に円高が進行しました。2012年に入ると、米国の景気回復期待や日本の2011年貿易収支の赤字転落などを材料に円売り機運が高まりましたが、前期末と比べると円高となり当期末を迎えました。

### 《運用経過》

#### 基準価額の推移

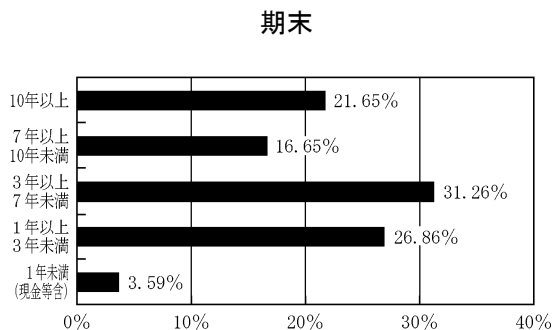
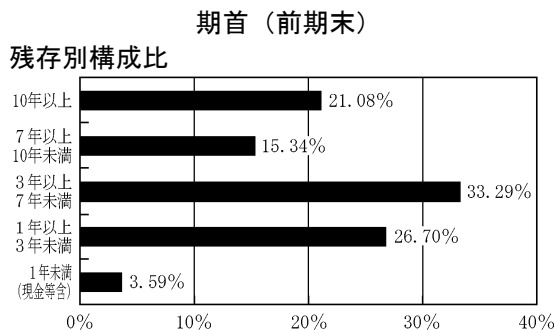
当期末の基準価額は11,848円となり、前期末に比べ2.92%上昇しました。

#### 基準価額の騰落要因

債券利回りが低下（価格は上昇）したことから、基準価額が上昇しました。

## 【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

※組入比率は純資産総額に対する割合です。



## 国別構成比

発行国	当ファンド	世界国債 インデックス	差
北米			
米国	38.88%	39.70%	-0.82%
カナダ	2.86%	2.86%	0.00%
計	41.74%	42.56%	-0.83%
中南米			
メキシコ	0.86%	0.90%	-0.05%
計	0.86%	0.90%	-0.05%
欧州			
オーストリア	1.78%	1.84%	-0.06%
ベルギー	2.68%	2.73%	-0.05%
フィンランド	0.60%	0.61%	-0.01%
フランス	9.42%	9.63%	-0.21%
ドイツ	9.46%	9.55%	-0.09%
アイルランド	0.66%	0.80%	-0.14%
イタリア	10.27%	10.42%	-0.15%
オランダ	2.39%	2.40%	-0.01%
ポルトガル	0.82%	0.98%	-0.16%
スペイン	4.20%	4.27%	-0.07%
ユーロ計	42.29%	43.23%	-0.95%
デンマーク	0.83%	0.86%	-0.03%
スウェーデン	0.68%	0.70%	-0.03%
スイス	0.00%	0.54%	-0.54%
英国	7.90%	7.93%	-0.03%
ポーランド	0.89%	0.92%	-0.03%
ノルウェー	0.26%	0.27%	-0.01%
計	52.85%	54.46%	-1.61%
アジア・ オセアニア			
オーストラリア	1.11%	1.12%	-0.01%
シンガポール	0.39%	0.39%	0.00%
マレーシア	0.49%	0.56%	-0.07%
計	1.99%	2.07%	-0.08%
現金など	2.57%	—	—
合計	100%	100%	—

発行国	当ファンド	世界国債 インデックス	差
北米			
米国	40.68%	41.55%	-0.87%
カナダ	2.96%	3.00%	-0.04%
計	43.64%	44.55%	-0.91%
中南米			
メキシコ	0.85%	0.90%	-0.05%
計	0.85%	0.90%	-0.05%
欧州			
オーストリア	1.72%	1.75%	-0.03%
ベルギー	2.56%	2.59%	-0.03%
フィンランド	0.60%	0.62%	-0.02%
フランス	9.45%	9.45%	0.00%
ドイツ	9.16%	9.23%	-0.07%
アイルランド	0.66%	0.73%	-0.06%
イタリア	9.19%	8.96%	0.23%
オランダ	2.50%	2.52%	-0.02%
スペイン	4.45%	4.54%	-0.09%
ユーロ計	40.29%	40.37%	-0.08%
デンマーク	0.85%	0.86%	-0.01%
スウェーデン	0.60%	0.62%	-0.02%
スイス	0.00%	0.45%	-0.45%
英国	8.38%	8.72%	-0.34%
ポーランド	0.75%	0.74%	0.01%
ノルウェー	0.31%	0.32%	-0.01%
計	51.17%	52.08%	-0.91%
アジア・ オセアニア			
オーストラリア	1.44%	1.50%	-0.06%
シンガポール	0.41%	0.39%	0.02%
マレーシア	0.49%	0.57%	-0.08%
計	2.34%	2.46%	-0.12%
現金など	1.99%	—	—
合計	100%	100%	—

(注) 世界国債インデックスとはシティグループ世界国債インデックス（除く日本）です。

■ 1万円（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	2円
合 計	2

(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) 保管費用等 =  $\frac{\text{期中の保管費用等}}{\text{期中の平均受益権口数}}$

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

■ 売買及び取引の状況（2011年2月22日から2012年2月21日まで）

公社債

			買 付 額	売 付 額	
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 509,766	千米ドル 550,527	
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 35,686	千カナダドル 38,937	
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 47,519	千英ポンド 55,522	
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローネ 12,733	千スウェーデンクローネ 45,686	
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 32,119	千デンマーククローネ 42,020	
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 16,510	千ノルウェークローネ 4,400	
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 35,006	千ポーランドズロチ 48,322	
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 19,430	千オーストラリアドル 10,808	
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 4,313	千シンガポールドル 4,607	
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリングット 18,294	千マレーシアリングット 20,186	
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 90,110	千メキシコペソ 89,010	
	国	ユ	フ ラ ン ス	国 債 証 券	千ユーロ 77,046
ド イ ツ			国 債 証 券	77,046	90,670
ロ		オ ラ ン ダ	国 債 証 券	19,273	18,521
		フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	3,091	3,711
		ス ペ イ ン	国 債 証 券	41,923	31,055
		イ タ リ ア	国 債 証 券	57,235	75,841
		ベルギー	国 債 証 券	16,703	21,853
		オーストリア	国 債 証 券	7,792	10,603
		ポルトガル	国 債 証 券	—	20,677
		アイルランド	国 債 証 券	—	1,962

(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）。

■主要な売買銘柄（2011年2月22日から2012年2月21日まで）

外国公社債

買		付	売		付
銘柄	柄	金額	銘柄	柄	金額
		千円			千円
US T N/B 1.0	07/15/13	3,187,984	US T N/B 4.0	11/15/12	3,551,482
US T N/B 0.125	08/31/13	2,684,097	US T N/B 4.5	04/30/12	3,355,357
US T N/B 3.125	05/15/21	2,022,834	US T N/B 0.875	02/29/12	3,322,122
US T N/B 1.75	03/31/14	2,016,355	US T N/B 1.5	07/15/12	2,793,498
US T N/B 3.625	02/15/21	2,003,602	US T N/B 4.375	08/15/12	2,792,136
US T N/B 0.75	12/15/13	1,961,486	US T N/B 1.875	06/15/12	2,774,448
US T N/B 0.625	01/31/13	1,662,373	US T N/B 4.5	03/31/12	2,709,546
US T N/B 1.75	05/31/16	1,565,840	US T N/B 1.125	12/15/12	2,704,608
US T N/B 1.0	08/31/16	1,558,370	US T N/B 1.375	09/15/12	2,590,762
US T N/B 2.125	08/15/21	1,534,735	DEUTSCHLAND 4.5	01/04/13	2,072,988

(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（2011年2月22日から2012年2月21日まで）

期中の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

### 公社債

#### (A) 債券種類別開示

#### 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	千米ドル 1,757,000	千米ドル 1,944,497	千円 155,073,666	% 40.7	% —	% 16.6	% 15.2	% 8.9
カ ナ ダ	千カナダドル 122,800	千カナダドル 140,695	千円 11,279,528	3.0	—	1.4	1.0	0.6
イ ギ リ ス	千英ポンド 218,300	千英ポンド 253,278	千円 31,958,623	8.4	—	5.7	2.3	0.4
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローネ 165,000	千スウェーデンクローネ 189,902	千円 2,269,335	0.6	—	0.4	0.2	—
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 189,500	千デンマーククローネ 227,355	千円 3,223,895	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 77,500	千ノルウェークローネ 85,263	千円 1,195,400	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 111,000	千ポーランドズロチ 112,700	千円 2,846,821	0.7	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 60,000	千オーストラリアドル 64,272	千円 5,499,118	1.4	—	0.6	0.7	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 21,800	千シンガポールドル 24,386	千円 1,549,993	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 68,000	千マレーシアリンギット 70,755	千円 1,866,522	0.5	—	0.2	0.2	0.1
メキシコ	千メキシコペソ 457,000	千メキシコペソ 520,883	千円 3,255,521	0.9	—	0.6	0.3	—
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
フ ラ ン ス	312,100	341,606	36,015,536	9.4	—	5.5	2.8	1.1
ド イ ツ	288,200	331,009	34,898,311	9.2	—	4.7	3.1	1.4
オ ラ ン ダ	79,000	90,210	9,510,913	2.5	—	1.4	0.8	0.3
フィンランド	19,800	21,633	2,280,835	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ス ペ イ ン	161,800	160,787	16,951,829	4.4	—	2.3	1.4	0.7
イ タ リ ア	339,500	332,408	35,045,820	9.2	—	5.4	2.6	1.2
ベルギー	87,000	92,597	9,762,504	2.6	—	1.5	0.8	0.3
オーストリア	56,600	62,293	6,567,643	1.7	—	1.1	0.5	0.1
アイルランド	26,000	23,985	2,528,782	0.7	—	0.4	0.1	0.2
合 計	—	—	千円 373,580,603	98.0	—	49.2	33.0	15.8

(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、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

## (B) 個別銘柄開示

## 外国(外貨建) 公社債銘柄別

銘柄名	当		期		末		償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千円ドル	千円ドル	千円		
US T N/B 0.625 01/31/13	国債証券	0.625	20,000	20,084	1,601,714	2013/01/31	
US T N/B 3.875 02/15/13	国債証券	3.875	32,000	33,167	2,645,096	2013/02/15	
US T N/B 1.375 03/15/13	国債証券	1.375	28,000	28,348	2,260,823	2013/03/15	
US T N/B 1.75 04/15/13	国債証券	1.750	25,000	25,439	2,028,780	2013/04/15	
US T N/B 3.625 05/15/13	国債証券	3.625	29,000	30,223	2,410,301	2013/05/15	
US T N/B 3.5 05/31/13	国債証券	3.500	32,000	33,360	2,660,536	2013/05/31	
US T N/B 1.0 07/15/13	国債証券	1.000	40,000	40,416	3,223,239	2013/07/15	
US T N/B 4.25 08/15/13	国債証券	4.250	35,000	37,058	2,955,431	2013/08/15	
US T N/B 0.125 08/31/13	国債証券	0.125	35,000	34,926	2,785,360	2013/08/31	
US T N/B 0.5 10/15/13	国債証券	0.500	30,000	30,110	2,401,280	2013/10/15	
US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	4.250	40,000	42,734	3,408,036	2013/11/15	
US T N/B 0.75 12/15/13	国債証券	0.750	25,000	25,207	2,010,258	2013/12/15	
US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	4.000	40,000	42,934	3,423,986	2014/02/15	
US T N/B 1.75 03/31/14	国債証券	1.750	25,000	25,758	2,054,260	2014/03/31	
US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	4.750	35,000	38,442	2,656,769	2014/05/15	
US T N/B 2.625 06/30/14	国債証券	2.625	30,000	31,601	2,520,235	2014/06/30	
US T N/B 0.75 06/15/14	国債証券	0.750	10,000	10,091	804,757	2014/06/15	
US T N/B 4.25 08/15/14	国債証券	4.250	28,000	30,703	2,448,618	2014/08/15	
US T N/B 2.375 09/30/14	国債証券	2.375	28,000	29,443	2,348,133	2014/09/30	
US T N/B 0.25 09/15/14	国債証券	0.250	20,000	19,924	1,588,954	2014/09/15	
US T N/B 4.25 11/15/14	国債証券	4.250	30,000	33,163	2,644,813	2014/11/15	
US T N/B 2.125 11/30/14	国債証券	2.125	25,000	26,179	2,087,815	2014/11/30	
US T N/B 2.625 12/31/14	国債証券	2.625	16,000	17,002	1,355,941	2014/12/31	
US T N/B 4.0 02/15/15	国債証券	4.000	20,000	22,117	1,763,830	2015/02/15	
US T N/B 2.375 02/28/15	国債証券	2.375	23,000	24,333	1,940,563	2015/02/28	
US T N/B 2.5 04/30/15	国債証券	2.500	20,000	21,286	1,697,606	2015/04/30	
US T N/B 4.125 05/15/15	国債証券	4.125	18,000	20,110	1,603,826	2015/05/15	
US T N/B 1.875 06/30/15	国債証券	1.875	15,000	15,682	1,250,679	2015/06/30	
US T N/B 1.75 07/31/15	国債証券	1.750	8,000	8,333	664,610	2015/07/31	
US T N/B 4.25 08/15/15	国債証券	4.250	15,000	16,923	1,349,609	2015/08/15	
US T N/B 1.25 08/31/15	国債証券	1.250	15,000	15,376	1,226,239	2015/08/31	
US T N/B 1.25 09/30/15	国債証券	1.250	13,000	13,318	1,062,181	2015/09/30	
US T N/B 4.5 11/15/15	国債証券	4.500	18,000	20,605	1,643,302	2015/11/15	
US T N/B 1.375 11/30/15	国債証券	1.375	15,000	15,431	1,230,678	2015/11/30	
US T N/B 4.5 02/15/16	国債証券	4.500	16,000	18,443	1,470,883	2016/02/15	
US T N/B 2.375 03/31/16	国債証券	2.375	20,000	21,379	1,705,023	2016/03/31	
US T N/B 2.0 04/30/16	国債証券	2.000	15,000	15,812	1,261,050	2016/04/30	
US T N/B 7.25 05/15/16	国債証券	7.250	10,000	12,742	1,016,182	2016/05/15	
US T N/B 1.75 05/31/16	国債証券	1.750	20,000	20,876	1,664,892	2016/05/31	
US T N/B 3.25 06/30/16	国債証券	3.250	25,000	27,689	2,208,217	2016/06/30	
US T N/B 4.875 08/15/16	国債証券	4.875	17,000	20,077	1,601,154	2016/08/15	
US T N/B 1.0 08/31/16	国債証券	1.000	20,000	20,200	1,610,997	2016/08/31	
US T N/B 3.0 09/30/16	国債証券	3.000	20,000	22,003	1,754,739	2016/09/30	
US T N/B 1.0 10/31/16	国債証券	1.000	15,000	15,133	1,206,896	2016/10/31	
US T N/B 7.5 11/15/16	国債証券	7.500	14,000	18,349	1,463,396	2016/11/15	
US T N/B 2.75 11/30/16	国債証券	2.750	20,000	21,785	1,737,417	2016/11/30	
US T N/B 3.25 12/31/16	国債証券	3.250	20,000	22,284	1,777,164	2016/12/31	
US T N/B 4.625 02/15/17	国債証券	4.625	12,000	14,194	1,132,025	2017/02/15	
US T N/B 3.0 02/28/17	国債証券	3.000	20,000	22,076	1,760,592	2017/02/28	
US T N/B 3.125 04/30/17	国債証券	3.125	10,000	11,116	886,532	2017/04/30	
US T N/B 8.75 05/15/17	国債証券	8.750	7,000	9,804	781,896	2017/05/15	

銘柄名	当期末					
	種類	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	
US T N/B 2.5 06/30/17	国債証券	2.500	13,000	14,036	1,119,441	2017/06/30
US T N/B 4.75 08/15/17	国債証券	4.750	15,000	18,004	1,435,870	2017/08/15
US T N/B 1.875 08/31/17	国債証券	1.875	8,000	8,360	666,754	2017/08/31
US T N/B 1.875 09/30/17	国債証券	1.875	8,000	8,357	666,505	2017/09/30
US T N/B 4.25 11/15/17	国債証券	4.250	14,000	16,471	1,313,629	2017/11/15
US T N/B 2.25 11/30/17	国債証券	2.250	14,000	14,908	1,188,983	2017/11/30
US T N/B 3.5 02/15/18	国債証券	3.500	14,000	15,903	1,268,265	2018/02/15
US T N/B 2.875 03/31/18	国債証券	2.875	5,000	5,502	438,840	2018/03/31
US T N/B 3.875 05/15/18	国債証券	3.875	8,000	9,290	740,877	2018/05/15
US T N/B 2.375 06/30/18	国債証券	2.375	18,000	19,227	1,533,401	2018/06/30
US T N/B 4.0 08/15/18	国債証券	4.000	12,000	14,070	1,122,082	2018/08/15
US T N/B 1.375 09/30/18	国債証券	1.375	12,000	12,030	959,459	2018/09/30
US T N/B 3.75 11/15/18	国債証券	3.750	20,000	23,125	1,844,218	2018/11/15
US T N/B 1.375 11/30/18	国債証券	1.375	15,000	15,005	1,196,716	2018/11/30
US T N/B 8.875 02/15/19	国債証券	8.875	4,000	6,024	480,442	2019/02/15
US T N/B 2.75 02/15/19	国債証券	2.750	11,000	11,987	955,991	2019/02/15
US T N/B 3.125 05/15/19	国債証券	3.125	15,000	16,733	1,334,464	2019/05/15
US T N/B 8.125 08/15/19	国債証券	8.125	4,000	5,907	471,121	2019/08/15
US T N/B 3.625 08/15/19	国債証券	3.625	9,000	10,359	826,137	2019/08/15
US T N/B 3.375 11/15/19	国債証券	3.375	14,000	15,863	1,265,128	2019/11/15
US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	3.625	20,000	23,043	1,837,727	2020/02/15
US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	3.500	16,000	18,282	1,458,021	2020/05/15
US T N/B 8.75 08/15/20	国債証券	8.750	7,000	10,953	873,571	2020/08/15
US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	2.625	17,000	18,220	1,453,079	2020/08/15
US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	2.625	22,000	23,515	1,875,385	2020/11/15
US T N/B 3.625 02/15/21	国債証券	3.625	24,000	27,616	2,202,439	2021/02/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.125	25,000	27,681	2,207,599	2021/05/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.125	20,000	20,345	1,622,529	2021/08/15
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.000	6,000	9,289	740,851	2021/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.000	19,000	19,041	1,518,553	2021/11/15
US T N/B 7.25 08/15/22	国債証券	7.250	3,000	4,496	358,592	2022/08/15
US T N/B 7.125 02/15/23	国債証券	7.125	3,000	4,491	358,219	2023/02/15
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.250	7,000	9,908	790,180	2023/08/15
US T N/B 7.5 11/15/24	国債証券	7.500	2,000	3,145	250,824	2024/11/15
US T N/B 7.625 02/15/25	国債証券	7.625	2,000	3,182	253,778	2025/02/15
US T N/B 6.875 08/15/25	国債証券	6.875	3,500	5,293	422,196	2025/08/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.000	4,000	5,651	450,734	2026/02/15
US T N/B 6.5 11/15/26	国債証券	6.500	3,000	4,452	355,116	2026/11/15
US T N/B 6.625 02/15/27	国債証券	6.625	1,000	1,503	119,929	2027/02/15
US T N/B 6.375 08/15/27	国債証券	6.375	2,000	2,960	236,071	2027/08/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.125	6,000	8,699	693,786	2027/11/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.500	3,000	4,123	328,837	2028/08/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.250	3,000	4,024	320,987	2028/11/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.250	3,000	4,031	321,508	2029/02/15
US T N/B 6.125 08/15/29	国債証券	6.125	2,000	2,946	234,999	2029/08/15
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.250	4,000	6,009	479,271	2030/05/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.375	5,000	6,909	551,020	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.500	8,000	10,058	802,182	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/37	国債証券	4.750	4,000	5,215	415,918	2037/02/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.000	4,000	5,400	430,672	2037/05/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.375	5,000	6,194	494,043	2038/02/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.500	6,000	7,579	604,479	2038/05/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.500	8,000	8,601	685,945	2039/02/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.250	9,500	11,569	922,703	2039/05/15

銘柄名	当期末					
	種類	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	
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.500	10,000	12,657	1,009,395	2039/08/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.375	13,000	16,143	1,287,425	2039/11/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.625	12,000	15,492	1,235,496	2040/02/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.375	13,000	16,155	1,288,400	2040/05/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.875	13,000	14,886	1,187,234	2040/08/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.250	14,000	17,067	1,361,169	2040/11/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.750	15,000	19,765	1,576,334	2041/02/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.375	14,000	17,412	1,388,646	2041/05/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.750	13,000	14,554	1,160,745	2041/08/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.125	11,000	10,938	872,381	2041/11/15
小計	—	—	1,757,000	1,944,497	155,073,666	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
CANADA 5.25 06/01/13	国債証券	5.250	7,500	7,894	632,932	2013/06/01
CANADA 2.5 09/01/13	国債証券	2.500	13,000	13,276	1,064,409	2013/09/01
CANADA 1.5 11/01/13	国債証券	1.500	7,000	7,047	564,972	2013/11/01
CANADA 2.0 03/01/14	国債証券	2.000	3,000	3,053	244,771	2014/03/01
CANADA 5.0 06/01/14	国債証券	5.000	10,000	10,865	871,071	2014/06/01
CANADA 2.0 12/01/14	国債証券	2.000	7,500	7,664	614,472	2014/12/01
CANADA 4.5 06/01/15	国債証券	4.500	8,000	8,831	708,022	2015/06/01
CANADA 3.0 12/01/15	国債証券	3.000	4,000	4,249	340,651	2015/12/01
CANADA 4.0 06/01/16	国債証券	4.000	7,500	8,313	666,495	2016/06/01
CANADA 2.75 09/01/16	国債証券	2.750	4,000	4,232	339,349	2016/09/01
CANADA 1.5 03/01/17	国債証券	1.500	2,500	2,503	200,725	2017/03/01
CANADA 4.0 06/01/17	国債証券	4.000	3,500	3,941	315,975	2017/06/01
CANADA 4.25 06/01/18	国債証券	4.250	3,500	4,045	324,345	2018/06/01
CANADA 3.75 06/01/19	国債証券	3.750	6,500	7,371	590,953	2019/06/01
CANADA 3.5 06/01/20	国債証券	3.500	5,000	5,595	448,583	2020/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.250	4,000	4,401	352,892	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.750	1,500	1,581	126,763	2022/06/01
CANADA 8.0 06/01/23	国債証券	8.000	1,200	1,892	151,745	2023/06/01
CANADA 9.0 06/01/25	国債証券	9.000	1,200	2,115	169,595	2025/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.000	1,700	2,911	233,424	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.750	4,500	6,519	522,669	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.750	4,500	6,768	542,630	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.000	5,200	7,408	593,972	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.000	5,500	7,020	562,853	2041/06/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.500	1,000	1,188	95,249	2045/12/01
小計	—	—	122,800	140,695	11,279,528	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UK TREASURY 4.5 03/07/13	国債証券	4.500	6,000	6,255	789,255	2013/03/07
UK TREASURY 8.0 09/27/13	国債証券	8.000	3,000	3,361	424,191	2013/09/27
UK TREASURY 2.25 03/07/14	国債証券	2.250	10,000	10,368	1,308,234	2014/03/07
UK TREASURY 5.0 09/07/14	国債証券	5.000	9,000	10,032	1,265,875	2014/09/07
UK TREASURY 2.75 01/22/15	国債証券	2.750	9,000	9,565	1,206,936	2015/01/22
UK TREASURY 4.75 09/07/15	国債証券	4.750	8,000	9,148	1,154,395	2015/09/07
UK TREASURY 8.0 12/07/15	国債証券	8.000	3,000	3,821	482,222	2015/12/07
UK TREASURY 2.0 01/22/16	国債証券	2.000	10,500	10,973	1,384,642	2016/01/22
UK TREASURY 4.0 09/07/16	国債証券	4.000	9,000	10,219	1,289,496	2016/09/07
UK TREASURY 1.75 01/22/17	国債証券	1.750	6,000	6,189	781,003	2017/01/22
UK TREASURY 8.75 08/25/17	国債証券	8.750	3,000	4,222	532,757	2017/08/25
UK TREASURY 5.0 03/07/18	国債証券	5.000	5,500	6,668	841,462	2018/03/07
UK TREASURY 4.5 03/07/19	国債証券	4.500	7,000	8,347	1,053,287	2019/03/07
UK TREASURY 3.75 09/07/19	国債証券	3.750	9,000	10,261	1,294,833	2019/09/07
UK TREASURY 4.75 03/07/20	国債証券	4.750	6,500	7,888	995,358	2020/03/07

銘柄名	当期末					
	種類	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)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国債証券	3.750	9,000	10,231	1,290,972	2020/09/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	8.000	4,000	5,991	755,969	2021/06/07
UK TREASURY 3.75 09/07/21	国債証券	3.750	8,500	9,609	1,212,548	2021/09/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4.000	4,500	5,179	653,606	2022/03/07
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.000	6,000	7,563	954,375	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.250	6,000	7,014	885,026	2027/12/07
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.000	4,000	5,640	711,705	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.750	6,000	7,390	932,571	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.250	6,000	6,939	875,638	2032/06/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.500	5,000	5,973	753,736	2034/09/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.250	7,000	8,092	1,021,048	2036/03/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.750	6,000	7,483	944,230	2038/12/07
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.250	5,000	5,775	728,689	2039/09/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.250	7,000	8,093	1,021,225	2040/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.500	6,000	7,263	916,445	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.250	6,000	7,027	886,692	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.250	5,300	6,237	787,056	2049/12/07
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.750	2,000	2,139	269,924	2052/07/22
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.250	6,000	7,152	902,439	2055/12/07
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.000	4,500	5,157	650,767	2060/01/22
小計	—	—	218,300	253,278	31,958,623	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円	
SWEDEN 6.75 05/05/14	国債証券	6.750	26,000	29,171	348,596	2014/05/05
SWEDEN 4.5 08/12/15	国債証券	4.500	23,000	25,513	304,882	2015/08/12
SWEDEN 3.0 07/12/16	国債証券	3.000	18,000	19,253	230,079	2016/07/12
SWEDEN 3.75 08/12/17	国債証券	3.750	19,000	21,224	253,635	2017/08/12
SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	4.250	25,000	29,205	349,002	2019/03/12
SWEDEN 5.0 12/01/20	国債証券	5.000	27,000	33,761	403,444	2020/12/01
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.500	11,000	12,535	149,799	2022/06/01
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.500	16,000	19,238	229,895	2039/03/30
小計	—	—	165,000	189,902	2,269,335	—
(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	千円	
DENMARK 5.0 11/15/13	国債証券	5.000	30,000	32,484	460,623	2013/11/15
DENMARK 2.0 11/15/14	国債証券	2.000	6,000	6,244	88,542	2014/11/15
DENMARK 4.0 11/15/15	国債証券	4.000	35,000	39,200	555,856	2015/11/15
DENMARK 4.0 11/15/17	国債証券	4.000	21,000	24,299	344,561	2017/11/15
DENMARK 4.0 11/15/19	国債証券	4.000	33,000	38,907	551,701	2019/11/15
DENMARK 3.0 11/15/21	国債証券	3.000	19,000	20,833	295,419	2021/11/15
DENMARK 7.0 11/10/24	国債証券	7.000	9,000	13,814	195,886	2024/11/10
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.500	36,500	51,573	731,305	2039/11/15
小計	—	—	189,500	227,355	3,223,895	—
(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	千円	
NORWAY 6.5 05/15/13	国債証券	6.500	22,000	23,267	326,206	2013/05/15
NORWAY 5.0 05/15/15	国債証券	5.000	20,000	22,048	309,112	2015/05/15
NORWAY 4.25 05/19/17	国債証券	4.250	15,000	16,710	234,274	2017/05/19
NORWAY 4.5 05/22/19	国債証券	4.500	10,000	11,505	161,300	2019/05/22
NORWAY 3.75 05/25/21	国債証券	3.750	10,500	11,733	164,507	2021/05/25
小計	—	—	77,500	85,263	1,195,400	—
(ポーランド)		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
POLAND 5.25 04/25/13	国債証券	5.250	11,000	11,091	280,171	2013/04/25
POLAND 5.0 10/24/13	国債証券	5.000	15,000	15,097	381,362	2013/10/24
POLAND 5.75 04/25/14	国債証券	5.750	13,000	13,295	335,844	2014/04/25
POLAND 5.5 04/25/15	国債証券	5.500	4,500	4,596	116,113	2015/04/25

銘柄名	当期末					
	種類	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	
(ポーランド)		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
POLAND 6.25 10/24/15	国債証券	6.250	17,000	17,799	449,602	2015/10/24
POLAND 5.0 04/25/16	国債証券	5.000	4,000	4,014	101,413	2016/04/25
POLAND 5.25 10/25/17	国債証券	5.250	12,000	12,144	306,757	2017/10/25
POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	5.500	9,000	9,091	229,640	2019/10/25
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.250	11,000	10,859	274,317	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.750	2,500	2,542	64,233	2021/10/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.750	9,000	9,157	231,318	2022/09/23
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.750	3,000	3,010	76,045	2029/04/25
小計	—	—	111,000	112,700	2,846,821	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	国債証券	6.500	6,500	6,703	573,536	2013/05/15
AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	国債証券	6.250	8,500	8,973	767,775	2014/06/15
AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	国債証券	6.250	8,000	8,598	735,727	2015/04/15
AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	国債証券	4.750	4,500	4,674	399,978	2016/06/15
AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	国債証券	6.000	6,500	7,152	611,965	2017/02/15
AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	国債証券	5.500	3,500	3,795	324,713	2018/01/21
AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	国債証券	5.250	6,000	6,471	553,725	2019/03/15
AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	4.500	5,500	5,668	484,965	2020/04/15
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.750	5,000	5,619	480,787	2021/05/15
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.750	3,000	3,383	289,452	2022/07/15
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.500	2,000	2,207	188,887	2023/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.750	1,000	1,023	87,604	2027/04/21
小計	—	—	60,000	64,272	5,499,118	—
(シンガポール)		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE 2.25 07/01/13	国債証券	2.250	1,500	1,540	97,929	2013/07/01
SINGAPORE 3.625 07/01/14	国債証券	3.625	4,000	4,312	274,098	2014/07/01
SINGAPORE 2.875 07/01/15	国債証券	2.875	3,000	3,247	206,441	2015/07/01
SINGAPORE 3.75 09/01/16	国債証券	3.750	3,000	3,427	217,842	2016/09/01
SINGAPORE 4.0 09/01/18	国債証券	4.000	2,500	2,990	190,049	2018/09/01
SINGAPORE 3.25 09/01/20	国債証券	3.250	2,800	3,203	203,588	2020/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.125	2,200	2,506	159,320	2022/09/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.500	2,000	2,296	145,941	2027/03/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.875	800	861	54,782	2030/09/01
小計	—	—	21,800	24,386	1,549,993	—
(マレーシア)		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
MALAYSIA 3.702 02/25/13	国債証券	3.702	9,000	9,079	239,518	2013/02/25
MALAYSIA 5.094 04/30/14	国債証券	5.094	13,000	13,603	358,862	2014/04/30
MALAYSIA 3.835 08/12/15	国債証券	3.835	6,000	6,154	162,360	2015/08/12
MALAYSIA 4.262 09/15/16	国債証券	4.262	7,000	7,325	193,257	2016/09/15
MALAYSIA 3.814 02/15/17	国債証券	3.814	7,000	7,194	189,795	2017/02/15
MALAYSIA 4.24 02/07/18	国債証券	4.240	7,000	7,358	194,121	2018/02/07
MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	4.378	8,000	8,559	225,806	2019/11/29
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.160	4,000	4,239	111,842	2021/07/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.502	5,000	4,875	128,603	2027/05/31
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.248	2,000	2,363	62,352	2028/09/15
小計	—	—	68,000	70,755	1,866,522	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	国債証券	9.500	145,000	162,365	1,014,782	2014/12/18
MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	国債証券	7.750	70,000	77,910	486,941	2017/12/14
MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	8.000	70,000	78,808	492,555	2020/06/11
MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	6.500	25,000	25,466	159,162	2021/06/10
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.000	55,000	71,864	449,154	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.500	50,000	57,499	359,371	2029/05/31

銘柄名	当期末					
	種類	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	
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.500	42,000	46,968	293,553	2038/11/18
小計	—	—	457,000	520,883	3,255,521	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債証券	4.000	10,000	10,397	1,096,155	2013/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債証券	4.000	19,000	20,024	2,111,140	2013/10/25
FR TREASURY 2.5 01/12/14	国債証券	2.500	10,000	10,316	1,087,668	2014/01/12
FRANCE OAT 4.0 04/25/14	国債証券	4.000	14,000	14,938	1,574,913	2014/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/14	国債証券	4.000	14,000	15,080	1,589,968	2014/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/15	国債証券	3.500	16,000	17,158	1,809,010	2015/04/25
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	国債証券	3.000	17,000	17,935	1,890,958	2015/10/25
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	国債証券	3.250	17,000	18,115	1,909,885	2016/04/25
FR TREASURY 2.5 07/25/16	国債証券	2.500	8,000	8,266	871,484	2016/07/25
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	国債証券	5.000	10,000	11,417	1,203,736	2016/10/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	国債証券	3.750	10,000	10,878	1,146,920	2017/04/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	国債証券	4.250	8,000	8,903	938,714	2017/10/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	国債証券	4.000	9,000	9,920	1,045,891	2018/04/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	国債証券	4.250	8,000	8,913	939,718	2018/10/25
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	国債証券	4.250	10,500	11,690	1,232,528	2019/04/25
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	国債証券	8.500	3,000	4,224	445,431	2019/10/25
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	国債証券	3.750	9,000	9,690	1,021,619	2019/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	国債証券	3.500	11,000	11,600	1,223,051	2020/04/25
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	国債証券	2.500	10,000	9,735	1,026,361	2020/10/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	国債証券	3.750	11,000	11,723	1,235,970	2021/04/25
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.250	11,000	11,241	1,185,209	2021/10/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.500	4,000	5,964	628,868	2023/04/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.250	11,000	12,110	1,276,781	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.000	6,000	7,718	813,776	2025/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.500	8,000	8,053	849,091	2026/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.500	9,000	11,214	1,182,310	2029/04/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.750	8,000	10,492	1,106,213	2032/10/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.750	7,000	8,219	866,600	2035/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.000	8,300	8,801	927,923	2038/10/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.500	7,000	8,064	850,261	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.000	5,500	5,802	611,757	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.000	2,800	2,993	315,611	2060/04/25
小計	—	—	312,100	341,606	36,015,536	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESSCHAT 1.5 03/15/13	国債証券	1.500	5,000	5,070	534,582	2013/03/15
DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	国債証券	3.750	14,500	15,196	1,602,190	2013/07/04
BUNDESSCHAT 0.75 09/13/13	国債証券	0.750	8,000	8,063	850,145	2013/09/13
DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債証券	4.250	20,000	21,491	2,265,796	2014/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債証券	4.250	19,000	20,760	2,188,763	2014/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債証券	3.750	17,000	18,620	1,963,117	2015/01/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	国債証券	3.250	18,000	19,640	2,070,719	2015/07/04
DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	国債証券	3.500	14,000	15,533	1,637,717	2016/01/04
BUNDESUBL 2.75 04/08/16	国債証券	2.750	13,000	14,079	1,484,348	2016/04/08
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	国債証券	4.000	10,000	11,386	1,200,478	2016/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	国債証券	3.750	10,000	11,352	1,196,894	2017/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	国債証券	4.250	7,000	8,178	862,253	2017/07/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	国債証券	4.000	7,000	8,132	857,420	2018/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	国債証券	4.250	8,000	9,465	997,958	2018/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	国債証券	3.750	8,000	9,234	973,624	2019/01/04
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	国債証券	3.500	9,000	10,266	1,082,376	2019/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債証券	3.250	8,000	8,986	947,436	2020/01/04

銘柄名	当期末					
	種類	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…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.000	7,000	7,717	813,656	2020/07/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.250	6,000	6,251	659,085	2020/09/04
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	国債証券	2.500	7,000	7,418	782,142	2021/01/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.250	6,500	7,279	767,461	2021/07/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.250	6,000	6,189	652,569	2021/09/04
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.000	4,000	4,022	424,039	2022/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.250	3,500	4,979	525,020	2024/01/04
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.500	4,000	6,046	637,429	2027/07/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.625	5,000	7,005	738,537	2028/01/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.750	4,000	5,161	544,145	2028/07/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.250	3,500	5,290	557,787	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.500	6,100	8,680	915,164	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.750	7,000	9,509	1,002,586	2034/07/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.000	8,000	10,050	1,059,655	2037/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.250	5,000	6,650	701,109	2039/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.750	5,800	8,349	880,245	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.250	4,300	4,949	521,850	2042/07/04
小計	—	—	288,200	331,009	34,898,311	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 4.25 07/15/13	国債証券	4.250	5,000	5,269	555,510	2013/07/15
NETHERLANDS 1.0 01/15/14	国債証券	1.000	4,000	4,041	426,072	2014/01/15
NETHERLANDS 3.75 07/15/14	国債証券	3.750	7,000	7,532	794,098	2014/07/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/15	国債証券	2.750	5,000	5,286	557,355	2015/01/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/15	国債証券	3.250	6,000	6,458	680,909	2015/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/16	国債証券	4.000	5,000	5,587	589,090	2016/07/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	国債証券	2.500	3,000	3,152	332,316	2017/01/15
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	国債証券	4.500	5,000	5,753	606,538	2017/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債証券	4.000	6,000	6,798	716,713	2018/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	国債証券	4.000	4,500	5,113	539,100	2019/07/15
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	国債証券	3.500	6,000	6,615	697,482	2020/07/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	国債証券	3.250	5,000	5,403	569,691	2021/07/15
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.500	4,500	6,642	700,266	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.500	4,500	6,093	642,432	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.000	4,500	5,564	586,686	2037/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.750	4,000	4,900	516,649	2042/01/15
小計	—	—	79,000	90,210	9,510,913	—
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 5.375 07/04/13	国債証券	5.375	2,500	2,669	281,471	2013/07/04
FINLAND 3.125 09/15/14	国債証券	3.125	1,500	1,598	168,550	2014/09/15
FINLAND 4.25 07/04/15	国債証券	4.250	2,500	2,772	292,317	2015/07/04
FINLAND 1.75 04/15/16	国債証券	1.750	3,000	3,078	324,513	2016/04/15
FINLAND 3.875 09/15/17	国債証券	3.875	2,000	2,232	235,319	2017/09/15
FINLAND 4.375 07/04/19	国債証券	4.375	2,000	2,307	243,321	2019/07/04
FINLAND 3.375 04/15/20	国債証券	3.375	2,000	2,164	228,203	2020/04/15
FINLAND 3.5 04/15/21	国債証券	3.500	1,500	1,633	172,227	2021/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.000	2,800	3,176	334,908	2025/07/04
小計	—	—	19,800	21,633	2,280,835	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.15 01/31/13	国債証券	6.150	6,000	6,273	661,362	2013/01/31
SPAIN 4.2 07/30/13	国債証券	4.200	10,000	10,274	1,083,187	2013/07/30
SPAIN 4.25 01/31/14	国債証券	4.250	12,000	12,367	1,303,937	2014/01/31
SPAIN 4.75 07/30/14	国債証券	4.750	8,000	8,323	877,514	2014/07/30
SPAIN 3.3 10/31/14	国債証券	3.300	5,500	5,562	586,475	2014/10/31

銘柄名	当期末					
	種類	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…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 4.4 01/31/15	国債証券	4.400	7,000	7,175	756,534	2015/01/31
SPAIN 3.0 04/30/15	国債証券	3.000	6,000	5,983	630,840	2015/04/30
SPAIN 4.0 07/30/15	国債証券	4.000	1,500	1,541	162,519	2015/07/30
SPAIN 3.15 01/31/16	国債証券	3.150	6,000	5,928	624,989	2016/01/31
SPAIN 3.25 04/30/16	国債証券	3.250	6,000	5,917	623,901	2016/04/30
SPAIN 4.25 10/31/16	国債証券	4.250	4,000	4,086	430,867	2016/10/31
SPAIN 3.8 01/31/17	国債証券	3.800	6,000	5,938	626,096	2017/01/31
SPAIN 5.5 07/30/17	国債証券	5.500	5,500	5,867	618,646	2017/07/30
SPAIN 4.1 07/30/18	国債証券	4.100	6,000	5,940	626,254	2018/07/30
SPAIN 4.6 07/30/19	国債証券	4.600	6,000	6,039	636,723	2019/07/30
SPAIN 4.3 10/31/19	国債証券	4.300	5,500	5,412	570,645	2019/10/31
SPAIN 4.0 04/30/20	国債証券	4.000	7,000	6,702	706,681	2020/04/30
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.850	6,000	6,019	634,604	2020/10/31
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.500	7,500	7,709	812,786	2021/04/30
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.850	2,000	2,098	221,213	2022/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.800	5,500	5,231	551,538	2024/01/31
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.650	5,000	4,577	482,605	2025/07/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.900	2,500	2,559	269,795	2026/07/30
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.000	6,500	6,708	707,292	2029/01/31
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.750	5,000	5,030	530,402	2032/07/30
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.200	5,500	4,417	465,782	2037/01/31
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.900	4,500	3,870	408,014	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.700	3,800	3,230	340,619	2041/07/30
小計	—	—	161,800	160,787	16,951,829	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 4.75 02/01/13	国債証券	4.750	11,000	11,256	1,186,809	2013/02/01
ITALY BTPS 4.25 08/01/13	国債証券	4.250	16,000	16,315	1,720,111	2013/08/01
ITALY BTPS 3.75 12/15/13	国債証券	3.750	18,000	18,228	1,921,841	2013/12/15
ITALY BTPS 3.5 06/01/14	国債証券	3.500	4,000	4,026	424,461	2014/06/01
ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債証券	4.250	19,000	19,425	2,048,041	2014/08/01
ITALY BTPS 4.25 02/01/15	国債証券	4.250	11,000	11,253	1,186,403	2015/02/01
ITALY BTPS 3.0 04/15/15	国債証券	3.000	10,000	9,873	1,040,910	2015/04/15
ITALY BTPS 3.75 08/01/15	国債証券	3.750	15,000	15,060	1,587,775	2015/08/01
ITALY BTPS 3.75 04/15/16	国債証券	3.750	10,000	9,921	1,045,971	2016/04/15
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	国債証券	3.750	14,000	13,850	1,460,226	2016/08/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	国債証券	4.000	9,000	8,906	939,001	2017/02/01
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	国債証券	5.250	8,000	8,280	873,044	2017/08/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	国債証券	4.500	9,000	8,989	947,731	2018/02/01
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	国債証券	4.500	9,000	8,942	942,797	2018/08/01
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	国債証券	4.250	8,000	7,795	821,847	2019/02/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	国債証券	4.500	8,500	8,355	880,920	2019/03/01
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	国債証券	4.250	9,000	8,652	912,243	2019/09/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	国債証券	4.500	7,500	7,278	767,398	2020/02/01
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	国債証券	4.250	9,000	8,587	905,411	2020/03/01
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債証券	4.000	8,000	7,416	781,868	2020/09/01
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.750	8,000	7,237	763,017	2021/03/01
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.750	10,000	8,943	942,860	2021/08/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.750	9,000	8,681	915,280	2021/09/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.000	5,500	5,335	562,469	2022/03/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.750	8,000	7,509	791,737	2023/08/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.000	4,000	5,012	528,499	2023/11/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.000	7,500	7,116	750,295	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.500	6,000	5,368	566,032	2026/03/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.250	3,500	4,008	422,584	2026/11/01

銘 柄 名	当 期 末					
	種 類	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…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.500	9,000	9,502	1,001,816	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.250	10,000	9,429	994,099	2029/11/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.000	10,500	10,654	1,123,288	2031/05/01
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.750	5,000	4,927	519,506	2033/02/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.000	8,000	7,188	757,915	2034/08/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.000	9,000	7,079	746,381	2037/02/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.000	6,500	5,790	610,529	2039/08/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.000	7,000	6,209	654,688	2040/09/01
小 計	—	—	339,500	332,408	35,045,820	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/13	国債証券	4.000	4,000	4,132	435,640	2013/03/28
BELGIUM 4.25 09/28/13	国債証券	4.250	5,000	5,200	548,236	2013/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/14	国債証券	4.000	5,000	5,249	553,496	2014/03/28
BELGIUM 4.25 09/28/14	国債証券	4.250	5,000	5,309	559,780	2014/09/28
BELGIUM 3.5 03/28/15	国債証券	3.500	5,000	5,235	551,926	2015/03/28
BELGIUM 3.75 09/28/15	国債証券	3.750	5,000	5,305	559,385	2015/09/28
BELGIUM 2.75 03/28/16	国債証券	2.750	3,000	3,069	323,621	2016/03/28
BELGIUM 3.25 09/28/16	国債証券	3.250	5,000	5,191	547,287	2016/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/17	国債証券	4.000	5,500	5,883	620,287	2017/03/28
BELGIUM 5.5 09/28/17	国債証券	5.500	3,500	3,987	420,444	2017/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/18	国債証券	4.000	4,000	4,261	449,287	2018/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/19	国債証券	4.000	3,500	3,711	391,311	2019/03/28
BELGIUM 3.75 09/28/20	国債証券	3.750	6,500	6,723	708,882	2020/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.250	4,500	4,745	500,358	2021/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.000	5,000	5,176	545,732	2022/03/28
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.250	1,500	1,572	165,794	2022/09/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.500	1,500	1,592	167,886	2026/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.500	5,500	6,469	682,060	2028/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.000	5,500	6,208	654,592	2035/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.250	3,500	3,571	376,492	2041/03/28
小 計	—	—	87,000	92,597	9,762,504	—
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 10/20/13	国債証券	3.800	2,500	2,623	276,621	2013/10/20
AUSTRIA 4.3 07/15/14	国債証券	4.300	6,000	6,490	684,325	2014/07/15
AUSTRIA 3.4 10/20/14	国債証券	3.400	3,000	3,190	336,374	2014/10/20
AUSTRIA 3.5 07/15/15	国債証券	3.500	5,000	5,352	564,314	2015/07/15
AUSTRIA 4.0 09/15/16	国債証券	4.000	4,500	4,932	519,980	2016/09/15
AUSTRIA 3.2 02/20/17	国債証券	3.200	1,000	1,059	111,671	2017/02/20
AUSTRIA 4.3 09/15/17	国債証券	4.300	4,000	4,442	468,320	2017/09/15
AUSTRIA 4.65 01/15/18	国債証券	4.650	4,000	4,510	475,489	2018/01/15
AUSTRIA 4.35 03/15/19	国債証券	4.350	4,000	4,460	470,259	2019/03/15
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.900	5,000	5,402	569,585	2020/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.500	4,500	4,711	496,733	2021/09/15
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.650	2,500	2,637	278,071	2022/04/20
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.400	1,000	1,030	108,645	2022/11/22
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.850	2,800	3,287	346,569	2026/03/15
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.250	2,500	3,356	353,836	2027/07/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.150	4,300	4,807	506,844	2037/03/15
小 計	—	—	56,600	62,293	6,567,643	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 5.0 04/18/13	国債証券	5.000	3,000	2,997	316,040	2013/04/18
IRISH 4.0 01/15/14	国債証券	4.000	3,000	2,980	314,281	2014/01/15
IRISH 4.6 04/18/16	国債証券	4.600	3,000	2,909	306,788	2016/04/18

銘柄名	当 期 末					
	種類	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…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 4.5 10/18/18	国債証券	4.500	3,000	2,690	283,683	2018/10/18
IRISH 4.4 06/18/19	国債証券	4.400	3,000	2,606	274,764	2019/06/18
IRISH 5.9 10/18/19	国債証券	5.900	3,000	2,838	299,226	2019/10/18
IRISH 4.5 04/18/20	国債証券	4.500	3,000	2,602	274,381	2020/04/18
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5.000	2,000	1,740	183,511	2020/10/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.400	3,000	2,618	276,105	2025/03/13
小計	—	—	26,000	23,985	2,528,782	—
合計	—	—	—	—	373,580,603	—

## ■投資信託財産の構成

2012年2月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 373,580,603	% 98.0
コール・ローン等、その他	7,704,988	2.0
投資信託財産総額	381,285,591	100.0

(注1) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、381,040,196千円、99.9%です。

(注2) 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、2012年2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル=79.75円、1カナダドル=80.17円、1英ポンド=126.18円、1スイスフラン=87.36円、1スウェーデンクローネ=11.95円、1デンマーククローネ=14.18円、1ノルウェークローネ=14.02円、1ポーランドズロチ=25.26円、1オーストラリアドル=85.56円、1シンガポールドル=63.56円、1マレーシアリンギット=26.38円、1メキシコペソ=6.25円、1ユーロ=105.43円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2012年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	381,331,366,486円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,558,371,468
社 債 (評価額)	373,580,603,903
未 収 入 金	45,775,462
未 収 利 息	3,931,033,806
前 払 費 用	215,581,847
(B) 負 債	173,250,500
未 払 金	45,850,500
未 払 解 約 金	127,400,000
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	381,158,115,986
元 本	321,716,172,627
次 期 繰 越 損 益 金	59,441,943,359
(D) 受 益 権 総 口 数	321,716,172,627口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,848円

<注記事項>

※ 期首元本額	345,553,272,555円
期中追加設定元本額	35,225,146,148円
期中一部解約元本額	59,062,246,076円
※ 期末における元本の内訳	
D I AM外国債券バッシブ・ファンド	: 1,956,763,757円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	: 3,981,240,853円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	: 336,794,400円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	: 1,173,586,371円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	: 1,199,564,903円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	: 337,866,678円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	: 657,766,156円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	: 412,227,678円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	: 159,227,179円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	: 1,774,416,671円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	: 8,527,564円
D I AMバッシブ資産分散ファンド	: 6,097,618,079円
D I AM為替フルヘッジ型外国債券バッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	: 8,286,867,956円
D I AM外国債券バッシブファンド(適格機関投資家向け)	: 6,668,324,646円
外国債券バッシブファンド(適格機関投資家限定)	: 945,973,519円
D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	: 234,380,345円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	: 46,273,190,341円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	: 2,542,043,147円
D I AM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	: 446,459,139円
D I AM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	: 732,462,963円
D I AM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	: 201,502,310円
D I AM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	: 89,205,716円
D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	: 27,514,459,936円
D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	: 6,060,367,170円
D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	: 11,077,009,468円
D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	: 5,031,177,637円
D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	: 7,157,893,875円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	: 2,782,261,002円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	: 8,470,049,114円
D I AM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	: 9,850,510,284円
D I AM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	: 50,787,878,207円
D I AMグローバルβ私募ファンド(適格機関投資家向け)	: 258,963,813円
D I AM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	: 6,770,841,164円
D I AMアイエスエー世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	: 14,994,966,188円
D I AMグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	: 290,931,174円
D I AM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	: 25,685,173,449円
D I AM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	: 31,308,875,110円
D I AMバランス30VA(適格機関投資家限定)	: 813,323,704円
D I AMバランス50VA(適格機関投資家限定)	: 234,507円
D I AMバランス70VA(適格機関投資家限定)	: 145,038円
D I AM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	: 27,443,768,049円
D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	: 277,005,886円
D I AMバランス20VA(適格機関投資家限定)	: 623,971,077円
D I AMバランス40VA(適格機関投資家限定)	: 222,335円
D I AMバランス60VA(適格機関投資家限定)	: 134,069円
期末元本合計	: 321,716,172,627円

## ■損益の状況

当期 自2011年2月22日 至2012年2月21日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	13,607,819,122円
受 取 利 息	13,607,819,122
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,294,371,171
売 買 損 益	22,876,325,093
売 買 損 益	△25,170,696,264
(C) そ の 他 費 用	△ 57,151,920
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	11,256,296,031
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	52,247,594,110
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 9,216,684,634
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,154,737,852
(H) 計 (D+E+F+G)	59,441,943,359
次 期 繰 越 損 益 金	59,441,943,359

(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) (F)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3) (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。