

運用報告書

第3期<決算日2011年10月12日>

DIAM外国債券パッシブ・ファンド

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2009年1月30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、円換算ベース、為替ヘッジなし）の動き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	DIAM外国債券パッシブ・ファンド	外国債券パッシブ・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。
	外国債券パッシブ・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。
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 ・株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 	
分配方針	決算日（原則として10月12日）に、経費控除後の利子配当等収益および売買益（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場合があります。	

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外国債券パッシブ・ファンド」は、2011年10月12日に第3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外国債券パッシブ・ファンド

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			シティグループ 世界国債インデックス		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(除く日本、円換算ベース、 為替ヘッジなし)	期中 騰落率			
(設定日) 2009年1月30日	円 10,000	円 —	% —	ポイント (1月29日) 70,980.29	% —	% —	% —	百万円 —
1期(2009年10月13日)	11,351	0	13.5	79,008.84	11.3	96.8	—	954
2期(2010年10月12日)	10,670	0	△6.0	74,594.08	△5.6	97.6	—	4,761
3期(2011年10月12日)	10,010	0	△6.2	70,384.88	△5.6	97.6	—	2,402

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の投資元本です。

(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。

(注4) 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5) 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		債券組入 比率	債券先物 比率
	騰落率	(除く日本、円換算ベース、 為替ヘッジなし)	騰落率			
(期首) 2010年10月12日	円 10,670	% —	ポイント 74,594.08	% —	% 97.6	% —
10月 末	10,397	△2.6	72,533.58	△2.8	97.6	—
11月 末	10,360	△2.9	72,209.42	△3.2	97.8	—
12月 末	9,960	△6.7	69,351.84	△7.0	97.5	—
2011年1月 末	10,157	△4.8	71,137.59	△4.6	97.1	—
2月 末	10,169	△4.7	71,199.90	△4.6	97.2	—
3月 末	10,481	△1.8	73,252.08	△1.8	97.6	—
4月 末	10,676	0.1	74,155.89	△0.6	97.2	—
5月 末	10,518	△1.4	73,441.26	△1.5	97.1	—
6月 末	10,477	△1.8	73,208.50	△1.9	97.6	—
7月 末	10,141	△5.0	71,079.17	△4.7	97.5	—
8月 末	10,351	△3.0	72,663.73	△2.6	97.7	—
9月 末	10,038	△5.9	70,653.56	△5.3	97.6	—
(期末) 2011年10月12日	10,010	△6.2	70,384.88	△5.6	97.6	—

(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（2010年10月13日から2011年10月12日まで）



期首	期中高値	期中安値	期末
2010.10.12	2011.4.7	2010.12.30	2011.10.12
10,670円	10,823円	9,960円	10,010円



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,010円となり、前期末に比べ6.19%下落しました。

基準価額の騰落要因

〔下落要因〕 主要通貨に対して円高になったこと。

〔上昇要因〕 債券の利回りが低下（価格は上昇）したこと。

《投資環境》

債券市場では、債券利回りが低下（価格は上昇）しました。米国の追加の量的緩和に伴うインフレ懸念や堅調なドイツ経済などを背景に、期初から2010年12月にかけては債券利回りが上昇（価格は下落）しました。その後は、各国の景気動向、ユーロ圏の財政問題の進展、ECB（欧州中央銀行）の利上げ観測などを背景に、2011年6月までは小幅な値動きで推移しました。その後は、米国では景気減速懸念や株式市場の急落を受けて金融緩和政策が長期化する見通しが強まり、欧州では債務危機が深刻化して経済規模の大きいイタリアやスペインに波及するとの懸念も高まり、期末にかけて債券利回りは大きく低下しました。

為替市場では、主要通貨に対して円高になりました。欧米の金利先高観を受けて円が売られる局面もありましたが、5月以降は、世界的な景気減速懸念と欧州債務危機の拡大懸念などを受けた投資家のリスク回避的な動きから、期末まで円高ドル安、円高ユーロ安の流れが続きました。ドル/円は1ドル＝76円台後半、ユーロ/円は1ユーロ＝104円台前半で期末を迎えました。

《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・マザーファンド受益証券であり、組入比率については期を通じて高位となるよう運用を行いました。

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、前期末に比べ5.64%下落しました。

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▲0.54%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、運用実績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》

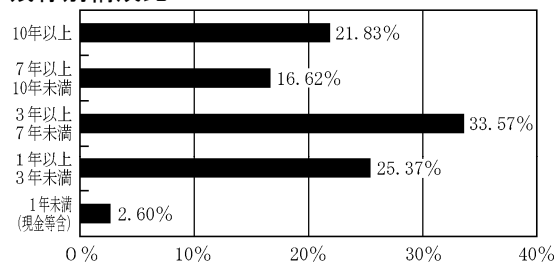
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券の高位組入れを維持します。また、マザーファンドの運用では、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指したパッシブ運用を行います。

【D I A M外国債券パッシブ・ファンドの運用状況】

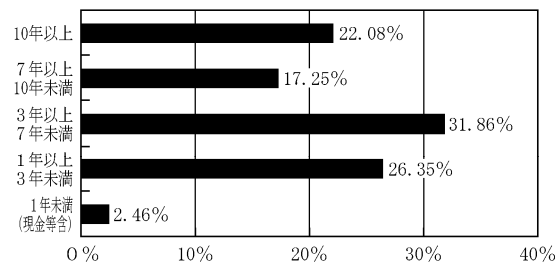
※比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

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	39.14%	-0.76%
	カナダ	2.69%	-0.03%
	計	41.83%	-0.79%
中南米	メキシコ	0.84%	-0.09%
	計	0.84%	-0.09%
欧州	オーストリア	1.74%	-0.05%
	ベルギー	2.67%	-0.02%
	フィンランド	0.55%	-0.03%
	フランス	9.51%	-0.18%
	ドイツ	9.78%	-0.17%
	アイルランド	0.79%	-0.13%
	イタリア	10.13%	0.05%
	オランダ	2.50%	-0.03%
	ポルトガル	0.87%	-0.08%
	スペイン	4.31%	0.01%
	ユーロ計	42.84%	-0.64%
	デンマーク	0.93%	-0.03%
	スウェーデン	0.65%	-0.02%
	スイス	0.00%	-0.52%
英国	7.65%	-0.14%	
ポーランド	0.90%	-0.03%	
ノルウェー	0.25%	-0.01%	
計	53.21%	-1.39%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	0.93%	-0.04%
	シンガポール	0.37%	0.00%
	マレーシア	0.48%	-0.03%
計	1.77%	-0.07%	
現金など	2.35%	-	
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	39.42%	-0.89%
	カナダ	2.80%	-0.03%
	計	42.21%	-0.93%
中南米	メキシコ	0.82%	-0.03%
	計	0.82%	-0.03%
欧州	オーストリア	1.73%	-0.05%
	ベルギー	2.56%	-0.09%
	フィンランド	0.60%	-0.03%
	フランス	9.93%	-0.22%
	ドイツ	9.57%	-0.06%
	アイルランド	0.64%	-0.09%
	イタリア	9.19%	0.05%
	オランダ	2.55%	-0.05%
	ポルトガル	0.44%	-0.22%
	スペイン	4.32%	-0.02%
	ユーロ計	41.53%	-0.78%
	デンマーク	0.90%	-0.05%
	スウェーデン	0.68%	-0.01%
	スイス	0.00%	-0.47%
英国	8.17%	-0.11%	
ポーランド	0.78%	0.00%	
ノルウェー	0.30%	-0.00%	
計	52.36%	-1.43%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	1.30%	-0.02%
	シンガポール	0.43%	0.03%
	マレーシア	0.49%	-0.01%
計	2.22%	-0.00%	
現金など	2.39%	-	
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)	54円 (49) (2) (3)
(b) 保 管 費 用 等	2
合 計	56

(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（2010年10月13日から2011年10月12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 1,264,768	千円 1,464,650	千口 3,121,680	千円 3,694,550

■ 利害関係人との取引状況等（2010年10月13日から2011年10月12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

	前 期 末		当 期 末	
	口 数	評 価 額	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 3,993,167	千円 2,401,151	千口 2,136,255	千円 2,401,151

(注) 親投資信託合計の受益権口数は323,279,500千口です。

<補足情報>

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	2011年10月12日現在							
	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 1,677,500	千米ドル 1,868,154	千円 143,306,107	% 39.5	% —	% 17.7	% 14.4	% 7.4
カ ナ ダ	千カナダドル 119,300	千カナダドル 136,735	千円 10,167,616	2.8	—	1.3	1.0	0.5
イ ギ リ ス	千英ポンド 217,000	千英ポンド 248,970	千円 29,707,201	8.2	—	5.8	2.0	0.4
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローネ 188,000	千スウェーデンクローネ 214,194	千円 2,454,666	0.7	—	0.4	0.2	0.1
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 200,500	千デンマーククローネ 233,758	千円 3,277,288	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 73,000	千ノルウェークローネ 80,190	千円 1,077,765	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 116,500	千ポーランドズロチ 117,259	千円 2,847,058	0.8	—	0.3	0.4	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 58,000	千オーストラリアドル 61,948	千円 4,715,541	1.3	—	0.6	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 23,300	千シンガポールドル 26,114	千円 1,553,825	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 71,500	千マレーシアリンギット 73,585	千円 1,788,133	0.5	—	0.2	0.2	0.1
メキシコ	千メキシコペソ 456,000	千メキシコペソ 519,335	千円 2,970,598	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
フ ラ ン ス	315,800	345,787	36,089,839	9.9	—	5.8	3.2	0.9
ド イ ツ	293,300	333,293	34,785,810	9.6	—	5.0	3.3	1.3
オ ラ ン ダ	79,000	88,895	9,277,997	2.6	—	1.5	0.8	0.3
フィンランド	19,300	20,917	2,183,150	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ス ペ イ ン	153,800	150,645	15,722,867	4.3	—	2.3	1.4	0.6
イ タ リ ア	339,500	320,169	33,416,087	9.2	—	5.4	2.7	1.1
ベルギー	87,300	89,285	9,318,733	2.6	—	1.4	0.8	0.4
オーストリア	54,800	60,309	6,294,477	1.7	—	1.1	0.6	—
ポルトガル	24,000	15,183	1,584,689	0.4	—	0.3	0.0	0.1
アイルランド	26,000	22,286	2,326,032	0.6	—	0.4	0.2	0.0
合 計	—	—	千円 354,865,490	97.7	—	51.1	32.7	13.9

(注1) 邦貨換算金額は、2011年10月12日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、2011年10月12日現在のマザーファンド純資産総額(363,374,403千円)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	2011年10月12日現在					
	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 4.0 11/15/12	国債証券	4.000	44,000	45,845	3,516,831	2012/11/15
US T N/B 1.125 12/15/12	国債証券	1.125	35,000	35,362	2,712,638	2012/12/15
US T N/B 0.625 01/31/13	国債証券	0.625	20,000	20,093	1,541,380	2013/01/31
US T N/B 3.875 02/15/13	国債証券	3.875	32,000	33,560	2,574,387	2013/02/15
US T N/B 1.375 03/15/13	国債証券	1.375	28,000	28,432	2,181,086	2013/03/15
US T N/B 1.75 04/15/13	国債証券	1.750	25,000	25,543	1,959,461	2013/04/15
US T N/B 3.625 05/15/13	国債証券	3.625	29,000	30,524	2,341,536	2013/05/15
US T N/B 3.5 05/31/13	国債証券	3.500	32,000	33,657	2,581,849	2013/05/31
US T N/B 1.0 07/15/13	国債証券	1.000	40,000	40,473	3,104,699	2013/07/15
US T N/B 4.25 08/15/13	国債証券	4.250	35,000	37,523	2,878,427	2013/08/15
US T N/B 0.125 08/31/13	国債証券	0.125	20,000	19,932	1,529,045	2013/08/31
US T N/B 0.5 10/15/13	国債証券	0.500	30,000	30,092	2,308,388	2013/10/15
US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	4.250	40,000	43,246	3,317,462	2013/11/15
US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	4.000	40,000	43,315	3,322,739	2014/02/15
US T N/B 1.75 03/31/14	国債証券	1.750	25,000	25,791	1,978,427	2014/03/31
US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	4.750	35,000	38,850	2,980,183	2014/05/15
US T N/B 2.625 06/30/14	国債証券	2.625	30,000	31,716	2,432,980	2014/06/30
US T N/B 4.25 08/15/14	国債証券	4.250	28,000	30,950	2,374,245	2014/08/15
US T N/B 2.375 09/30/14	国債証券	2.375	28,000	29,511	2,263,822	2014/09/30
US T N/B 4.25 11/15/14	国債証券	4.250	30,000	33,379	2,560,541	2014/11/15
US T N/B 2.125 11/30/14	国債証券	2.125	25,000	26,199	2,009,725	2014/11/30
US T N/B 2.625 12/31/14	国債証券	2.625	12,000	12,773	979,884	2014/12/31
US T N/B 4.0 02/15/15	国債証券	4.000	20,000	22,201	1,703,069	2015/02/15
US T N/B 2.375 02/28/15	国債証券	2.375	23,000	24,308	1,864,738	2015/02/28
US T N/B 2.5 04/30/15	国債証券	2.500	20,000	21,257	1,630,685	2015/04/30
US T N/B 4.125 05/15/15	国債証券	4.125	18,000	20,169	1,547,219	2015/05/15
US T N/B 1.875 06/30/15	国債証券	1.875	15,000	15,611	1,197,573	2015/06/30
US T N/B 1.75 07/31/15	国債証券	1.750	8,000	8,290	635,993	2015/07/31
US T N/B 4.25 08/15/15	国債証券	4.250	15,000	16,954	1,300,591	2015/08/15
US T N/B 1.25 08/31/15	国債証券	1.250	15,000	15,258	1,170,464	2015/08/31
US T N/B 1.25 09/30/15	国債証券	1.250	13,000	13,209	1,013,315	2015/09/30
US T N/B 4.5 11/15/15	国債証券	4.500	18,000	20,619	1,581,738	2015/11/15
US T N/B 1.375 11/30/15	国債証券	1.375	15,000	15,287	1,172,707	2015/11/30
US T N/B 4.5 02/15/16	国債証券	4.500	16,000	18,403	1,411,746	2016/02/15
US T N/B 2.375 03/31/16	国債証券	2.375	20,000	21,214	1,627,325	2016/03/31
US T N/B 7.25 05/15/16	国債証券	7.250	10,000	12,820	983,445	2016/05/15
US T N/B 1.75 05/31/16	国債証券	1.750	20,000	20,635	1,582,972	2016/05/31
US T N/B 3.25 06/30/16	国債証券	3.250	25,000	27,533	2,112,056	2016/06/30
US T N/B 4.875 08/15/16	国債証券	4.875	17,000	20,046	1,537,772	2016/08/15
US T N/B 3.0 09/30/16	国債証券	3.000	20,000	21,804	1,672,630	2016/09/30
US T N/B 7.5 11/15/16	国債証券	7.500	14,000	18,398	1,411,382	2016/11/15
US T N/B 2.75 11/30/16	国債証券	2.750	20,000	21,568	1,654,527	2016/11/30
US T N/B 3.25 12/31/16	国債証券	3.250	20,000	22,071	1,693,127	2016/12/31
US T N/B 4.625 02/15/17	国債証券	4.625	12,000	14,114	1,082,688	2017/02/15
US T N/B 3.0 02/28/17	国債証券	3.000	20,000	21,826	1,674,303	2017/02/28
US T N/B 3.125 04/30/17	国債証券	3.125	10,000	10,992	843,203	2017/04/30
US T N/B 8.75 05/15/17	国債証券	8.750	7,000	9,836	754,523	2017/05/15
US T N/B 2.5 06/30/17	国債証券	2.500	13,000	13,834	1,061,262	2017/06/30
US T N/B 4.75 08/15/17	国債証券	4.750	15,000	17,874	1,371,160	2017/08/15
US T N/B 1.875 08/31/17	国債証券	1.875	8,000	8,218	630,408	2017/08/31
US T N/B 1.875 09/30/17	国債証券	1.875	8,000	8,211	629,881	2017/09/30
US T N/B 4.25 11/15/17	国債証券	4.250	11,000	12,816	983,165	2017/11/15

銘柄名	2011年10月12日現在					
	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 2.25 11/30/17	国債証券	2.250	11,000	11,509	882,895	2017/11/30
US T N/B 3.5 02/15/18	国債証券	3.500	14,000	15,710	1,205,153	2018/02/15
US T N/B 2.875 03/31/18	国債証券	2.875	5,000	5,416	415,461	2018/03/31
US T N/B 3.875 05/15/18	国債証券	3.875	8,000	9,168	703,283	2018/05/15
US T N/B 2.375 06/30/18	国債証券	2.375	18,000	18,881	1,448,410	2018/06/30
US T N/B 4.0 08/15/18	国債証券	4.000	12,000	13,867	1,063,771	2018/08/15
US T N/B 3.75 11/15/18	国債証券	3.750	11,000	12,529	961,150	2018/11/15
US T N/B 8.875 02/15/19	国債証券	8.875	7,000	10,502	805,621	2019/02/15
US T N/B 2.75 02/15/19	国債証券	2.750	15,000	16,046	1,230,919	2019/02/15
US T N/B 3.125 05/15/19	国債証券	3.125	16,000	17,533	1,345,002	2019/05/15
US T N/B 8.125 08/15/19	国債証券	8.125	7,000	10,268	787,665	2019/08/15
US T N/B 3.625 08/15/19	国債証券	3.625	15,000	16,986	1,303,019	2019/08/15
US T N/B 3.375 11/15/19	国債証券	3.375	17,000	18,957	1,454,233	2019/11/15
US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	3.625	22,000	24,961	1,914,773	2020/02/15
US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	3.500	19,000	21,363	1,638,758	2020/05/15
US T N/B 8.75 08/15/20	国債証券	8.750	7,000	10,874	834,145	2020/08/15
US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	2.625	23,000	24,166	1,853,781	2020/08/15
US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	2.625	22,000	23,060	1,768,963	2020/11/15
US T N/B 3.625 02/15/21	国債証券	3.625	24,000	27,181	2,085,106	2021/02/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.125	25,000	27,195	2,086,147	2021/05/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.125	15,000	14,953	1,147,048	2021/08/15
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.000	6,000	9,204	706,103	2021/11/15
US T N/B 7.25 08/15/22	国債証券	7.250	3,000	4,444	340,914	2022/08/15
US T N/B 7.125 02/15/23	国債証券	7.125	3,000	4,437	340,394	2023/02/15
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.250	7,000	9,780	750,286	2023/08/15
US T N/B 7.5 11/15/24	国債証券	7.500	2,000	3,117	239,178	2024/11/15
US T N/B 7.625 02/15/25	国債証券	7.625	3,000	4,737	363,442	2025/02/15
US T N/B 6.875 08/15/25	国債証券	6.875	3,500	5,255	403,167	2025/08/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.000	4,000	5,610	430,389	2026/02/15
US T N/B 6.75 08/15/26	国債証券	6.750	1,000	1,504	115,400	2026/08/15
US T N/B 6.5 11/15/26	国債証券	6.500	3,000	4,430	339,835	2026/11/15
US T N/B 6.625 02/15/27	国債証券	6.625	1,000	1,497	114,884	2027/02/15
US T N/B 6.375 08/15/27	国債証券	6.375	2,000	2,946	226,041	2027/08/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.125	6,000	8,655	663,957	2027/11/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.500	3,000	4,100	314,557	2028/08/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.250	3,000	4,000	306,862	2028/11/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.250	3,000	4,006	307,366	2029/02/15
US T N/B 6.125 08/15/29	国債証券	6.125	3,000	4,396	337,246	2029/08/15
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.250	4,000	5,977	458,557	2030/05/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.375	5,000	6,868	526,901	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.500	8,000	10,047	770,739	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/37	国債証券	4.750	6,000	7,816	599,631	2037/02/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.000	4,000	5,402	414,424	2037/05/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.375	5,000	6,184	474,401	2038/02/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.500	6,000	7,565	580,355	2038/05/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.500	8,000	8,582	658,362	2039/02/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.250	10,500	12,774	979,948	2039/05/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.500	12,000	15,190	1,165,240	2039/08/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.375	14,000	17,393	1,334,284	2039/11/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.625	14,500	18,727	1,436,595	2040/02/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.375	14,000	17,412	1,335,712	2040/05/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.875	15,000	17,198	1,319,289	2040/08/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.250	14,000	17,080	1,310,206	2040/11/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.750	15,000	19,804	1,519,214	2041/02/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.375	14,000	17,460	1,339,396	2041/05/15

銘柄名	2011年10月12日現在					
	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 3.75 08/15/41	国債証券	3.750	10,000	11,238	862,082	2041/08/15
小計	—	—	1,677,500	1,868,154	143,306,107	—
(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	12,000	12,830	954,086	2013/06/01
CANADA 2.5 09/01/13	国債証券	2.500	13,000	13,367	993,988	2013/09/01
CANADA 1.5 11/01/13	国債証券	1.500	7,000	7,071	525,870	2013/11/01
CANADA 5.0 06/01/14	国債証券	5.000	10,000	11,005	818,339	2014/06/01
CANADA 2.0 12/01/14	国債証券	2.000	7,000	7,167	532,986	2014/12/01
CANADA 4.5 06/01/15	国債証券	4.500	8,000	8,899	661,798	2015/06/01
CANADA 3.0 12/01/15	国債証券	3.000	4,000	4,252	316,235	2015/12/01
CANADA 4.0 06/01/16	国債証券	4.000	7,500	8,337	620,006	2016/06/01
CANADA 2.75 09/01/16	国債証券	2.750	4,000	4,225	314,200	2016/09/01
CANADA 4.0 06/01/17	国債証券	4.000	3,500	3,935	292,675	2017/06/01
CANADA 4.25 06/01/18	国債証券	4.250	3,500	4,025	299,304	2018/06/01
CANADA 3.75 06/01/19	国債証券	3.750	6,500	7,286	541,799	2019/06/01
CANADA 3.5 06/01/20	国債証券	3.500	5,000	5,507	409,567	2020/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.250	4,000	4,327	321,755	2021/06/01
CANADA 8.0 06/01/23	国債証券	8.000	1,200	1,872	139,250	2023/06/01
CANADA 9.0 06/01/25	国債証券	9.000	1,200	2,088	155,308	2025/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.000	2,200	3,705	275,516	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.750	4,500	6,364	473,273	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.750	4,500	6,578	489,174	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.000	5,200	7,155	532,091	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.000	5,500	6,729	500,387	2041/06/01
小計	—	—	119,300	136,735	10,167,616	—
(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	7,000	7,378	880,342	2013/03/07
UK TREASURY 8.0 09/27/13	国債証券	8.000	3,000	3,427	408,969	2013/09/27
UK TREASURY 2.25 03/07/14	国債証券	2.250	8,500	8,792	1,049,109	2014/03/07
UK TREASURY 5.0 09/07/14	国債証券	5.000	9,000	10,050	1,199,201	2014/09/07
UK TREASURY 2.75 01/22/15	国債証券	2.750	10,000	10,560	1,260,019	2015/01/22
UK TREASURY 4.75 09/07/15	国債証券	4.750	8,000	9,102	1,086,098	2015/09/07
UK TREASURY 8.0 12/07/15	国債証券	8.000	3,000	3,827	456,649	2015/12/07
UK TREASURY 2.0 01/22/16	国債証券	2.000	10,500	10,803	1,289,067	2016/01/22
UK TREASURY 4.0 09/07/16	国債証券	4.000	8,000	8,975	1,070,920	2016/09/07
UK TREASURY 1.75 01/22/17	国債証券	1.750	3,500	3,531	421,420	2017/01/22
UK TREASURY 8.75 08/25/17	国債証券	8.750	3,000	4,182	499,103	2017/08/25
UK TREASURY 5.0 03/07/18	国債証券	5.000	5,000	5,958	710,908	2018/03/07
UK TREASURY 4.5 03/07/19	国債証券	4.500	7,000	8,152	972,804	2019/03/07
UK TREASURY 3.75 09/07/19	国債証券	3.750	9,000	9,994	1,192,543	2019/09/07
UK TREASURY 4.75 03/07/20	国債証券	4.750	6,500	7,694	918,131	2020/03/07
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国債証券	3.750	9,000	9,942	1,186,315	2020/09/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	8.000	4,000	5,884	702,126	2021/06/07
UK TREASURY 3.75 09/07/21	国債証券	3.750	6,000	6,613	789,122	2021/09/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4.000	5,500	6,201	739,998	2022/03/07
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.000	7,000	8,684	1,036,198	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.250	6,000	6,930	826,959	2027/12/07
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.000	4,500	6,286	750,158	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.750	6,000	7,333	874,997	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.250	6,000	6,854	817,867	2032/06/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.500	5,500	6,498	775,436	2034/09/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.250	7,500	8,550	1,020,186	2036/03/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.750	6,000	7,374	879,937	2038/12/07
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.250	5,000	5,681	677,856	2039/09/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.250	7,500	8,522	1,016,874	2040/12/07

銘柄名	2011年10月12日現在					
	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 4.5 12/07/42	国債証券	4.500	6,500	7,751	924,956	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.250	6,500	7,484	893,080	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.250	6,000	6,923	826,100	2049/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.250	6,000	6,954	829,751	2055/12/07
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.000	5,500	6,067	723,986	2060/01/22
小計	—	—	217,000	248,970	29,707,201	—
(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 5.5 10/08/12	国債証券	5.500	21,000	21,868	250,616	2012/10/08
SWEDEN 6.75 05/05/14	国債証券	6.750	28,000	31,795	364,378	2014/05/05
SWEDEN 4.5 08/12/15	国債証券	4.500	23,000	25,578	293,127	2015/08/12
SWEDEN 3.0 07/12/16	国債証券	3.000	18,000	19,137	219,310	2016/07/12
SWEDEN 3.75 08/12/17	国債証券	3.750	19,000	21,089	241,684	2017/08/12
SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	4.250	25,000	29,056	332,987	2019/03/12
SWEDEN 5.0 12/01/20	国債証券	5.000	27,000	33,939	388,947	2020/12/01
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.500	11,000	12,614	144,563	2022/06/01
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.500	16,000	19,114	219,051	2039/03/30
小計	—	—	188,000	214,194	2,454,666	—
(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 4.0 11/15/12	国債証券	4.000	19,000	19,673	275,823	2012/11/15
DENMARK 5.0 11/15/13	国債証券	5.000	30,000	32,643	457,654	2013/11/15
DENMARK 2.0 11/15/14	国債証券	2.000	6,000	6,203	86,975	2014/11/15
DENMARK 4.0 11/15/15	国債証券	4.000	35,000	38,972	546,394	2015/11/15
DENMARK 4.0 11/15/17	国債証券	4.000	21,000	23,893	334,991	2017/11/15
DENMARK 4.0 11/15/19	国債証券	4.000	33,000	37,941	531,943	2019/11/15
DENMARK 3.0 11/15/21	国債証券	3.000	12,000	12,793	179,360	2021/11/15
DENMARK 7.0 11/10/24	国債証券	7.000	9,000	13,500	189,270	2024/11/10
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.500	35,500	48,136	674,874	2039/11/15
小計	—	—	200,500	233,758	3,277,288	—
(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	20,000	21,498	288,933	2013/05/15
NORWAY 5.0 05/15/15	国債証券	5.000	20,000	22,070	296,620	2015/05/15
NORWAY 4.25 05/19/17	国債証券	4.250	15,000	16,512	221,921	2017/05/19
NORWAY 4.5 05/22/19	国債証券	4.500	10,000	11,350	152,550	2019/05/22
NORWAY 3.75 05/25/21	国債証券	3.750	8,000	8,760	117,739	2021/05/25
小計	—	—	73,000	80,190	1,077,765	—
(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 10/25/12	国債証券	—	7,000	6,691	162,464	2012/10/25
POLAND 5.25 04/25/13	国債証券	5.250	14,000	14,153	343,655	2013/04/25
POLAND 5.0 10/24/13	国債証券	5.000	15,000	15,150	367,842	2013/10/24
POLAND 5.75 04/25/14	国債証券	5.750	13,000	13,325	323,534	2014/04/25
POLAND 5.5 04/25/15	国債証券	5.500	4,500	4,580	111,221	2015/04/25
POLAND 6.25 10/24/15	国債証券	6.250	17,000	17,765	431,334	2015/10/24
POLAND 5.0 04/25/16	国債証券	5.000	3,000	2,985	72,490	2016/04/25
POLAND 5.25 10/25/17	国債証券	5.250	12,000	11,940	289,903	2017/10/25
POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	5.500	9,000	8,913	216,415	2019/10/25
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.250	7,500	7,284	176,873	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.750	2,500	2,507	60,885	2021/10/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.750	9,000	9,004	218,618	2022/09/23
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.750	3,000	2,958	71,820	2029/04/25
小計	—	—	116,500	117,259	2,847,058	—
(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	9,000	9,375	713,627	2013/05/15
AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	国債証券	6.250	8,000	8,513	648,036	2014/06/15
AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	国債証券	6.250	8,000	8,641	657,768	2015/04/15

銘柄名	2011年10月12日現在					
	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	
(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 4.75 06/15/16	国債証券	4.750	4,500	4,663	355,011	2016/06/15
AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	国債証券	6.000	6,500	7,136	543,194	2017/02/15
AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	国債証券	5.500	2,500	2,698	205,417	2018/01/21
AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	国債証券	5.250	5,000	5,346	406,986	2019/03/15
AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	4.500	5,500	5,589	425,467	2020/04/15
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.750	5,000	5,552	422,644	2021/05/15
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.750	3,000	3,340	254,283	2022/07/15
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.500	1,000	1,091	83,103	2023/04/21
小計	—	—	58,000	61,948	4,715,541	—
(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	3,000	3,105	184,777	2013/07/01
SINGAPORE 3.625 07/01/14	国債証券	3.625	4,000	4,362	259,539	2014/07/01
SINGAPORE 2.875 07/01/15	国債証券	2.875	3,000	3,274	194,847	2015/07/01
SINGAPORE 3.75 09/01/16	国債証券	3.750	3,000	3,446	205,091	2016/09/01
SINGAPORE 4.0 09/01/18	国債証券	4.000	2,500	2,972	176,890	2018/09/01
SINGAPORE 3.25 09/01/20	国債証券	3.250	2,800	3,188	189,740	2020/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.125	2,200	2,516	149,726	2022/09/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.500	2,000	2,357	140,255	2027/03/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.875	800	890	52,957	2030/09/01
小計	—	—	23,300	26,114	1,553,825	—
(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	14,000	14,145	343,734	2013/02/25
MALAYSIA 5.094 04/30/14	国債証券	5.094	13,000	13,622	331,034	2014/04/30
MALAYSIA 3.835 08/12/15	国債証券	3.835	6,000	6,118	148,683	2015/08/12
MALAYSIA 4.262 09/15/16	国債証券	4.262	7,000	7,286	177,055	2016/09/15
MALAYSIA 3.814 02/15/17	国債証券	3.814	7,000	7,138	173,469	2017/02/15
MALAYSIA 4.24 02/07/18	国債証券	4.240	7,000	7,273	176,377	2018/02/07
MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	4.378	8,000	8,383	203,719	2019/11/29
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.160	2,500	2,592	63,003	2021/07/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.502	5,000	4,719	114,693	2027/05/31
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.248	2,000	2,304	56,001	2028/09/15
小計	—	—	71,500	73,585	1,788,133	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
MEXICAN BONDS 9.0 12/20/12	国債証券	9.000	49,000	51,599	295,148	2012/12/20
MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	国債証券	9.500	120,000	136,864	782,866	2014/12/18
MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	国債証券	7.750	70,000	78,611	449,657	2017/12/14
MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	8.000	70,000	78,647	449,861	2020/06/11
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.000	55,000	71,436	408,615	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.500	50,000	56,268	321,852	2029/05/31
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.500	42,000	45,908	262,596	2038/11/18
小計	—	—	456,000	519,335	2,970,598	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 4.75 10/25/12	国債証券	4.750	9,000	9,361	977,091	2012/10/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債証券	4.000	20,000	20,916	2,183,002	2013/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債証券	4.000	19,000	20,074	2,095,170	2013/10/25
FR TREASURY 2.5 01/12/14	国債証券	2.500	10,000	10,210	1,065,617	2014/01/12
FRANCE OAT 4.0 04/25/14	国債証券	4.000	11,000	11,749	1,226,253	2014/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/14	国債証券	4.000	14,000	15,036	1,569,380	2014/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/15	国債証券	3.500	16,000	17,064	1,780,969	2015/04/25
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	国債証券	3.000	17,000	17,836	1,861,585	2015/10/25
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	国債証券	3.250	14,000	14,831	1,547,974	2016/04/25
FR TREASURY 2.5 07/25/16	国債証券	2.500	5,000	5,118	534,191	2016/07/25
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	国債証券	5.000	10,000	11,408	1,190,652	2016/10/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	国債証券	3.750	10,000	10,826	1,129,909	2017/04/25

銘柄名	2011年10月12日現在					
	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…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	国債証券	4.250	8,000	8,890	927,891	2017/10/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	国債証券	4.000	9,000	9,885	1,031,760	2018/04/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	国債証券	4.250	8,000	8,926	931,648	2018/10/25
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	国債証券	4.250	10,500	11,722	1,223,446	2019/04/25
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	国債証券	8.500	3,000	4,280	446,714	2019/10/25
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	国債証券	3.750	9,000	9,732	1,015,791	2019/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	国債証券	3.500	11,000	11,660	1,216,954	2020/04/25
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	国債証券	2.500	11,000	10,766	1,123,673	2020/10/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	国債証券	3.750	11,000	11,855	1,237,389	2021/04/25
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.250	5,000	5,158	538,392	2021/10/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.500	4,000	6,083	634,945	2023/04/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.250	11,000	12,217	1,275,161	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.000	6,000	7,812	815,401	2025/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.500	7,500	7,629	796,317	2026/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.500	9,000	11,288	1,178,201	2029/04/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.750	8,500	11,156	1,164,377	2032/10/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.750	6,000	7,069	737,875	2035/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.000	9,000	9,556	997,380	2038/10/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.500	6,000	6,923	722,563	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.000	5,500	5,775	602,794	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.000	2,800	2,964	309,361	2060/04/25
小計	—	—	315,800	345,787	36,089,839	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESUBL 4.25 10/12/12	国債証券	4.250	7,500	7,780	812,050	2012/10/12
DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	国債証券	4.500	17,000	17,834	1,861,407	2013/01/04
BUNDESSCHAT 1.5 03/15/13	国債証券	1.500	5,000	5,067	528,921	2013/03/15
DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	国債証券	3.750	14,500	15,291	1,595,994	2013/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債証券	4.250	18,000	19,425	2,027,449	2014/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債証券	4.250	19,000	20,789	2,169,831	2014/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債証券	3.750	16,000	17,471	1,823,469	2015/01/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	国債証券	3.250	18,000	19,489	2,034,119	2015/07/04
DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	国債証券	3.500	14,000	15,383	1,605,544	2016/01/04
BUNDESUBL 2.75 04/08/16	国債証券	2.750	11,000	11,752	1,226,597	2016/04/08
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	国債証券	4.000	10,000	11,264	1,175,623	2016/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	国債証券	3.750	8,000	8,962	935,447	2017/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	国債証券	4.250	7,000	8,074	842,699	2017/07/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	国債証券	4.000	7,000	8,026	837,767	2018/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	国債証券	4.250	8,000	9,344	975,275	2018/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	国債証券	3.750	8,000	9,124	952,271	2019/01/04
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	国債証券	3.500	9,000	10,125	1,056,746	2019/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債証券	3.250	8,000	8,863	925,052	2020/01/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.000	8,000	8,703	908,352	2020/07/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.250	6,000	6,150	641,938	2020/09/04
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	国債証券	2.500	7,000	7,308	762,809	2021/01/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.250	6,500	7,198	751,333	2021/07/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.250	4,000	4,072	424,994	2021/09/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.250	4,000	5,660	590,734	2024/01/04
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.500	4,000	5,967	622,796	2027/07/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.625	5,500	7,634	796,817	2028/01/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.750	4,000	5,074	529,615	2028/07/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.250	3,500	5,273	550,426	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.500	5,800	8,124	847,908	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.750	7,500	9,941	1,037,568	2034/07/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.000	8,500	10,287	1,073,720	2037/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.250	5,000	6,386	666,559	2039/07/04

銘柄名	2011年10月12日現在					
	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 4.75 07/04/40	国債証券	4.750	5,500	7,603	793,603	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.250	3,500	3,836	400,363	2042/07/04
小計	—	—	293,300	333,293	34,785,810	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 1.75 01/15/13	国債証券	1.750	2,500	2,532	264,317	2013/01/15
NETHERLANDS 4.25 07/15/13	国債証券	4.250	7,000	7,420	774,425	2013/07/15
NETHERLANDS 1.0 01/15/14	国債証券	1.000	3,000	3,003	313,517	2014/01/15
NETHERLANDS 3.75 07/15/14	国債証券	3.750	7,000	7,501	782,900	2014/07/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/15	国債証券	2.750	5,000	5,235	546,376	2015/01/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/15	国債証券	3.250	6,000	6,402	668,239	2015/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/16	国債証券	4.000	5,000	5,540	578,261	2016/07/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	国債証券	2.500	2,000	2,068	215,899	2017/01/15
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	国債証券	4.500	5,000	5,697	594,595	2017/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債証券	4.000	5,000	5,603	584,785	2018/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	国債証券	4.000	4,500	5,057	527,809	2019/07/15
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	国債証券	3.500	6,000	6,528	681,327	2020/07/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	国債証券	3.250	4,000	4,258	444,407	2021/07/15
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.500	4,500	6,629	691,957	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.500	4,000	5,348	558,254	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.000	4,500	5,367	560,216	2037/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.750	4,000	4,701	490,705	2042/01/15
小計	—	—	79,000	88,895	9,277,997	—
(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	2,697	281,525	2013/07/04
FINLAND 3.125 09/15/14	国債証券	3.125	1,500	1,588	165,807	2014/09/15
FINLAND 4.25 07/04/15	国債証券	4.250	2,500	2,756	287,695	2015/07/04
FINLAND 1.75 04/15/16	国債証券	1.750	3,000	3,022	315,442	2016/04/15
FINLAND 3.875 09/15/17	国債証券	3.875	2,000	2,205	230,135	2017/09/15
FINLAND 4.375 07/04/19	国債証券	4.375	2,000	2,292	239,236	2019/07/04
FINLAND 3.375 04/15/20	国債証券	3.375	1,500	1,609	167,983	2020/04/15
FINLAND 3.5 04/15/21	国債証券	3.500	1,500	1,621	169,275	2021/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.000	2,800	3,123	326,047	2025/07/04
小計	—	—	19,300	20,917	2,183,150	—
(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	11,000	11,349	1,184,578	2013/01/31
SPAIN 4.2 07/30/13	国債証券	4.200	10,000	10,121	1,056,328	2013/07/30
SPAIN 4.25 01/31/14	国債証券	4.250	12,000	12,222	1,275,610	2014/01/31
SPAIN 4.75 07/30/14	国債証券	4.750	6,000	6,194	646,565	2014/07/30
SPAIN 3.3 10/31/14	国債証券	3.300	5,500	5,464	570,332	2014/10/31
SPAIN 4.4 01/31/15	国債証券	4.400	7,000	7,112	742,279	2015/01/31
SPAIN 3.0 04/30/15	国債証券	3.000	6,000	5,867	612,411	2015/04/30
SPAIN 3.15 01/31/16	国債証券	3.150	6,000	5,778	603,112	2016/01/31
SPAIN 3.25 04/30/16	国債証券	3.250	5,000	4,833	504,514	2016/04/30
SPAIN 4.25 10/31/16	国債証券	4.250	1,000	999	104,307	2016/10/31
SPAIN 3.8 01/31/17	国債証券	3.800	6,000	5,850	610,564	2017/01/31
SPAIN 5.5 07/30/17	国債証券	5.500	5,000	5,292	552,336	2017/07/30
SPAIN 4.1 07/30/18	国債証券	4.100	6,000	5,869	612,568	2018/07/30
SPAIN 4.6 07/30/19	国債証券	4.600	5,000	4,990	520,858	2019/07/30
SPAIN 4.3 10/31/19	国債証券	4.300	5,500	5,372	560,774	2019/10/31
SPAIN 4.0 04/30/20	国債証券	4.000	6,000	5,724	597,413	2020/04/30
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.850	7,000	7,006	731,247	2020/10/31
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.500	5,000	5,207	543,454	2021/04/30
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.800	5,500	5,234	546,366	2024/01/31
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.650	5,000	4,583	478,379	2025/07/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.900	2,500	2,541	265,204	2026/07/30

銘柄名	2011年10月12日現在					
	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 6.0 01/31/29	国債証券	6.000	6,500	6,543	682,950	2029/01/31
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.750	5,000	4,885	509,899	2032/07/30
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.200	6,000	4,639	484,193	2037/01/31
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.900	4,500	3,825	399,215	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.700	3,800	3,136	327,398	2041/07/30
小計	—	—	153,800	150,645	15,722,867	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 4.25 10/15/12	国債証券	4.250	7,000	7,042	734,973	2012/10/15
ITALY BTPS 4.75 02/01/13	国債証券	4.750	16,000	16,160	1,686,619	2013/02/01
ITALY BTPS 4.25 08/01/13	国債証券	4.250	16,000	16,045	1,674,712	2013/08/01
ITALY BTPS 3.75 12/15/13	国債証券	3.750	18,000	17,834	1,861,376	2013/12/15
ITALY BTPS 3.5 06/01/14	国債証券	3.500	3,000	2,942	307,098	2014/06/01
ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債証券	4.250	19,000	18,950	1,977,874	2014/08/01
ITALY BTPS 4.25 02/01/15	国債証券	4.250	8,000	7,944	829,198	2015/02/01
ITALY BTPS 3.0 04/15/15	国債証券	3.000	8,000	7,608	794,046	2015/04/15
ITALY BTPS 3.75 08/01/15	国債証券	3.750	15,000	14,649	1,528,916	2015/08/01
ITALY BTPS 3.75 04/15/16	国債証券	3.750	10,000	9,582	1,000,073	2016/04/15
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	国債証券	3.750	12,500	11,972	1,249,569	2016/08/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	国債証券	4.000	9,000	8,653	903,165	2017/02/01
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	国債証券	5.250	9,000	9,070	946,656	2017/08/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	国債証券	4.500	9,000	8,642	902,038	2018/02/01
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	国債証券	4.500	9,000	8,614	899,126	2018/08/01
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	国債証券	4.250	8,000	7,483	781,021	2019/02/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	国債証券	4.500	8,500	8,055	840,747	2019/03/01
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	国債証券	4.250	8,000	7,417	774,174	2019/09/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	国債証券	4.500	7,500	7,033	734,086	2020/02/01
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	国債証券	4.250	9,000	8,287	864,935	2020/03/01
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債証券	4.000	8,000	7,204	751,964	2020/09/01
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.750	8,000	7,020	732,760	2021/03/01
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.750	10,000	8,725	910,628	2021/08/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.750	8,000	7,526	785,530	2021/09/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.000	1,500	1,418	148,007	2022/03/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.750	8,000	7,207	752,215	2023/08/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.000	4,000	4,840	505,150	2023/11/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.000	7,500	6,731	702,571	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.500	6,000	5,018	523,770	2026/03/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.250	3,500	3,745	390,938	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.500	9,000	8,955	934,633	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.250	10,000	8,778	916,159	2029/11/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.000	10,500	9,852	1,028,268	2031/05/01
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.750	5,000	4,542	474,048	2033/02/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.000	8,000	6,619	690,845	2034/08/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.000	9,000	6,557	684,395	2037/02/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.000	7,000	5,726	597,622	2039/08/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.000	7,000	5,712	596,161	2040/09/01
小計	—	—	339,500	320,169	33,416,087	—
(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	7,000	7,196	751,046	2013/03/28
BELGIUM 4.25 09/28/13	国債証券	4.250	5,000	5,182	540,897	2013/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/14	国債証券	4.000	5,000	5,151	537,609	2014/03/28
BELGIUM 4.25 09/28/14	国債証券	4.250	5,000	5,192	541,889	2014/09/28
BELGIUM 3.5 03/28/15	国債証券	3.500	5,000	5,063	528,477	2015/03/28
BELGIUM 3.75 09/28/15	国債証券	3.750	5,000	5,107	533,069	2015/09/28
BELGIUM 2.75 03/28/16	国債証券	2.750	3,000	2,925	305,344	2016/03/28
BELGIUM 3.25 09/28/16	国債証券	3.250	5,000	4,942	515,848	2016/09/28

銘柄名	2011年10月12日現在					
	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…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/17	国債証券	4.000	5,500	5,580	582,473	2017/03/28
BELGIUM 5.5 09/28/17	国債証券	5.500	3,500	3,827	399,486	2017/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/18	国債証券	4.000	4,000	4,050	422,698	2018/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/19	国債証券	4.000	4,000	4,031	420,736	2019/03/28
BELGIUM 3.75 09/28/20	国債証券	3.750	6,500	6,368	664,701	2020/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.250	4,000	4,032	420,861	2021/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.000	4,500	4,449	464,404	2022/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.500	1,500	1,517	158,371	2026/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.500	5,500	6,193	646,420	2028/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.000	5,300	5,638	588,474	2035/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.250	3,000	2,835	295,920	2041/03/28
小計	—	—	87,300	89,285	9,318,733	—
(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	2,631	274,623	2013/10/20
AUSTRIA 4.3 07/15/14	国債証券	4.300	6,000	6,494	677,820	2014/07/15
AUSTRIA 3.4 10/20/14	国債証券	3.400	3,000	3,166	330,487	2014/10/20
AUSTRIA 3.5 07/15/15	国債証券	3.500	4,500	4,781	499,019	2015/07/15
AUSTRIA 4.0 09/15/16	国債証券	4.000	4,500	4,900	511,465	2016/09/15
AUSTRIA 3.2 02/20/17	国債証券	3.200	1,000	1,049	109,515	2017/02/20
AUSTRIA 4.3 09/15/17	国債証券	4.300	4,000	4,424	461,732	2017/09/15
AUSTRIA 4.65 01/15/18	国債証券	4.650	4,000	4,510	470,708	2018/01/15
AUSTRIA 4.35 03/15/19	国債証券	4.350	4,000	4,469	466,513	2019/03/15
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.900	5,000	5,412	564,902	2020/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.500	4,500	4,725	493,148	2021/09/15
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.650	2,500	2,645	276,058	2022/04/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.850	2,800	3,273	341,682	2026/03/15
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.250	2,500	3,372	351,935	2027/07/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.150	4,000	4,454	464,863	2037/03/15
小計	—	—	54,800	60,309	6,294,477	—
(ユーロ…ポルトガル)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
PORTUGUESE 5.45 09/23/13	国債証券	5.450	3,000	2,510	261,982	2013/09/23
PORTUGUESE 3.35 10/15/15	国債証券	3.350	2,000	1,416	147,865	2015/10/15
PORTUGUESE 4.2 10/15/16	国債証券	4.200	5,000	3,300	344,421	2016/10/15
PORTUGUESE 4.35 10/16/17	国債証券	4.350	2,000	1,260	131,506	2017/10/16
PORTUGUESE 4.45 06/15/18	国債証券	4.450	3,000	1,868	195,058	2018/06/15
PORTUGUESE 3.85 04/15/21	国債証券	3.850	3,000	1,665	173,869	2021/04/15
PORTUGUESE 4.95 10/25/23	国債証券	4.950	3,000	1,718	179,318	2023/10/25
PORTUGUESE 4.1 04/15/37	国債証券	4.100	3,000	1,443	150,668	2037/04/15
小計	—	—	24,000	15,183	1,584,689	—
(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	2,902	302,905	2013/04/18
IRISH 4.0 01/15/14	国債証券	4.000	3,000	2,766	288,703	2014/01/15
IRISH 4.6 04/18/16	国債証券	4.600	3,000	2,714	283,339	2016/04/18
IRISH 4.5 10/18/18	国債証券	4.500	3,000	2,471	257,971	2018/10/18
IRISH 4.4 06/18/19	国債証券	4.400	3,000	2,385	248,981	2019/06/18
IRISH 5.9 10/18/19	国債証券	5.900	3,000	2,623	273,846	2019/10/18
IRISH 4.5 04/18/20	国債証券	4.500	3,000	2,401	250,644	2020/04/18
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5.000	2,000	1,602	167,242	2020/10/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.400	3,000	2,418	252,397	2025/03/13
小計	—	—	26,000	22,286	2,326,032	—
合計	—	—	—	—	354,865,490	—

■投資信託財産の構成

2011年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千円	%
	2,401,151	99.5
コール・ローン等、その他	11,875	0.5
投資信託財産総額	2,413,026	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、2011年10月12日現在、363,228,880千円、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、2011年10月12日における邦貨換算レートは、1米ドル=76.71円、1カナダドル=74.36円、1英ポンド=119.32円、1スイスフラン=84.27円、1スウェーデンクローネ=11.46円、1デンマーククローネ=14.02円、1ノルウェークローネ=13.44円、1ポーランドズロチ=24.28円、1オーストラリアドル=76.12円、1シンガポールドル=59.50円、1マレーシアリンギット=24.30円、1メキシコペソ=5.72円、1ユーロ=104.37円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2011年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,413,026,409円
コール・ローン等	10,075,232
外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド(評価額)	2,401,151,177
未 収 入 金	1,800,000
(B) 負 債	10,633,641
未 払 解 約 金	3,737,415
未 払 信 託 報 酬	6,831,412
そ の 他 未 払 費 用	64,814
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,402,392,768
元 本	2,399,939,702
次 期 繰 越 損 益 金	2,453,066
(D) 受 益 権 総 口 数	2,399,939,702口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	10,010円

<注記事項>

期首元本額	4,462,192,312円
期中追加設定元本額	1,496,090,336円
期中一部解約元本額	3,558,342,946円

■損益の状況

当期 自2010年10月13日 至2011年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	19,566円
受 取 利 息	19,566
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△116,117,659
売 買 益	24,012,681
売 買 損	△140,130,340
(C) 信 託 報 酬 等	△20,551,817
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△136,649,910
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△55,262,147
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	194,365,123
(配 当 等 相 当 額)	(43,558,055)
(売 買 損 益 相 当 額)	(150,807,068)
(G) 計 (D + E + F)	2,453,066
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	2,453,066
追 加 信 託 差 損 益 金	194,365,123
(配 当 等 相 当 額)	(43,558,055)
(売 買 損 益 相 当 額)	(150,807,068)
分 配 準 備 積 立 金	107,397,143
繰 越 損 益 金	△299,309,200

(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(72,765,350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(43,558,055円)及び分配準備積立金(34,631,793円)より分配対象収益は150,955,198円(1万口当たり629.00円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、運用実績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8期（決算日 2011年2月21日）

（計算期間 2010年2月23日～2011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外国債券パッシブ・ファンド」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8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"> ・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します。 ・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。 ・外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■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 比	債券先物率 比	純資産総額
	期騰落率	騰落率	期騰落率	騰落率			
4期(2007年2月21日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
5期(2008年2月21日)	13,661	9.7	85,326.38	9.7	95.2	—	294,925
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
	11,512	△6.8	71,790.80	△6.6	97.4	—	397,800

(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) 2010年2月22日	円 12,352	% —	ポイント 76,849.64	% —	% 97.4	% —
2月 末	12,062	△2.3	75,356.80	△1.9	96.9	—
3月 末	12,512	1.3	78,285.12	1.9	97.0	—
4月 末	12,594	2.0	78,823.71	2.6	97.3	—
5月 末	11,927	△3.4	74,738.46	△2.7	97.7	—
6月 末	11,610	△6.0	72,569.50	△5.6	96.6	—
7月 末	11,842	△4.1	74,156.85	△3.5	97.7	—
8月 末	11,675	△5.5	73,062.96	△4.9	97.9	—
9月 末	11,983	△3.0	74,801.30	△2.7	97.3	—
10月 末	11,616	△6.0	72,533.58	△5.6	97.7	—
11月 末	11,580	△6.3	72,209.42	△6.0	97.8	—
12月 末	11,138	△9.8	69,351.84	△9.8	97.5	—
2011年1月 末	11,363	△8.0	71,137.59	△7.4	97.1	—
(期末) 2011年2月21日	11,512	△6.8	71,790.80	△6.6	97.4	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2010年2月23日から2011年2月21日まで）



期首	期中高値	期中安値	期末
2010. 2. 22	2010. 4. 5	2010. 12. 30	2011. 2. 21
12,352円	12,793円	11,138円	11,512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6.58%下落しました。

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▲0.22%となり、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。

《投資環境》

債券市場では、利回りは前期末とほぼ同水準となりました。期初から春先にかけては、欧米中央銀行が「出口政策」を模索する中、利回りは狭いレンジで推移しました。しかし2010年4月以降は、南欧諸国の財政危機から金融システム不安が広がるとともに、米国経済の脆弱さから追加金融緩和に対する期待も高まり、10月まで利回りの低下（価格は上昇）が続きました。11月に入ると米国の追加量的緩和によりインフレ懸念が高まり、加えて12月には米国の大型減税措置の延長や欧州周辺国救済コスト負担に伴うドイツの財政悪化懸念も浮上して、利回りが早いペースで上昇（価格は下落）しました。年明け以降も経済指標の改善と企業の好決算を受けて利回りは上昇基調が継続し、前期末とほぼ同水準で当期末を迎えました。

為替市場では、主要通貨に対して円高となりました。対ドルでは、米国の景気減速懸念や低金利政策の長期化観測を背景に、4月以降はほぼ一貫して円高ドル安が進行しました。11月のFOMC（米連邦公開市場委員会）後は米国の景気回復期待や金利の上昇が材料視され小幅にドルが上昇しました。また対ユーロでも、欧州債務問題の深刻化から信用不安が燃り続け、円高ユーロ安が進行しました。

《運用経過》

基準価額の推移

当期末の基準価額は11,512円となり、前期末に比べ6.80%下落しました。

基準価額の騰落要因

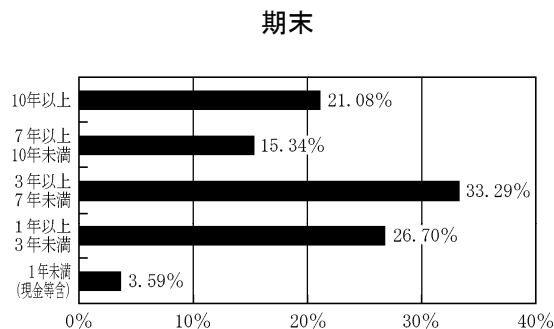
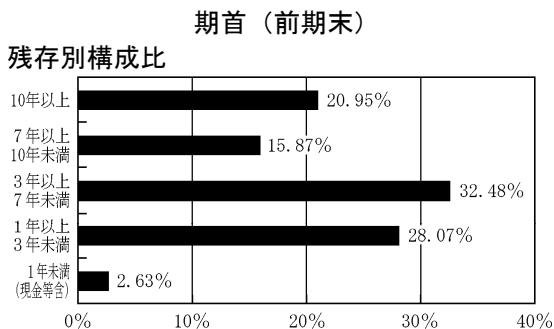
主要通貨に対して円高が進行したことから基準価額が下落しました。

《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。

【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	34.97%	35.28%	-0.31%
カナダ	2.75%	2.71%	0.04%
計	37.72%	37.99%	-0.27%
欧州			
オーストリア	1.77%	1.82%	-0.05%
ベルギー	2.98%	3.07%	-0.09%
フィンランド	0.61%	0.61%	0.00%
フランス	9.74%	9.95%	-0.21%
ドイツ	10.39%	10.50%	-0.11%
アイルランド	0.84%	1.02%	-0.18%
イタリア	11.40%	11.57%	-0.17%
オランダ	2.39%	2.49%	-0.10%
ポルトガル	1.08%	1.15%	-0.07%
スペイン	4.62%	4.70%	-0.08%
ギリシャ	2.26%	2.35%	-0.09%
ユーロ計	48.08%	49.23%	-1.15%
デンマーク	0.85%	0.86%	-0.01%
スウェーデン	0.70%	0.71%	-0.01%
スイス	0.00%	0.61%	-0.61%
英国	7.17%	7.61%	-0.44%
ポーランド	0.89%	0.92%	-0.03%
ノルウェー	0.34%	0.36%	-0.02%
計	58.04%	60.30%	-2.26%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	0.74%	0.78%	-0.04%
シンガポール	0.38%	0.38%	0.00%
マレーシア	0.50%	0.54%	-0.04%
計	1.61%	1.70%	-0.09%
現金など	2.63%	-	-
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。

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%	-

(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（2010年2月23日から2011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 609,225	千米ドル 349,313
	カナダ	国債証券	千カナダドル 26,278	千カナダドル 21,814
	イギリス	国債証券	千英ポンド 48,714	千英ポンド 30,508
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 15,791	千スウェーデンクローネ 34,981
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 31,661	千デンマーククローネ 29,562
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 2,170	千ノルウェークローネ 24,491
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 25,792	千ポーランドズロチ 23,310
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 19,822	千オーストラリアドル 4,137
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 3,769	千シンガポールドル 4,128
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングット 11,367	千マレーシアリングット 17,683
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 559,138	千メキシコペソ 32,172
	国	ユ ー ロ	フランス	国債証券 千ユーロ 62,498
ドイツ			国債証券 78,251	94,880
オランダ			国債証券 15,952	11,920
フィンランド			国債証券 5,050	4,298
スペイン			国債証券 29,535	26,378
イタリア			国債証券 55,666	61,512
ベルギー			国債証券 10,923	13,489
オーストリア			国債証券 5,785	2,551
ポルトガル			国債証券 1,041	4,106
アイルランド			国債証券 2,047	1,483
	ギリシャ	国債証券 -	62,887	

(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（2010年2月23日から2011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	0.875 02/29/12	3,657,605	US T N/B	4.875 04/30/11	3,798,605
US T N/B	1.5 07/15/12	3,144,725	US T N/B	5.0 08/15/11	3,158,420
US T N/B	1.375 03/15/13	2,606,585	US T N/B	1.125 06/30/11	2,980,909
US T N/B	0.5 10/15/13	2,420,199	US T N/B	1.0 09/30/11	2,891,118
US T N/B	3.625 02/15/20	2,412,680	US T N/B	0.875 03/31/11	2,750,038
US T N/B	2.375 02/28/15	2,148,831	US T N/B	4.5 11/30/11	2,384,190
US T N/B	1.75 04/15/13	2,119,747	US T N/B	1.125 01/15/12	2,253,959
US T N/B	2.625 08/15/20	2,090,945	US T N/B	0.875 05/31/11	2,177,405
US T N/B	4.5 04/30/12	1,958,034	DEUTSCHLAND	5.0 01/04/12	1,994,719
US T N/B	3.25 12/31/16	1,883,244	DEUTSCHLAND	5.0 07/04/11	1,932,549

(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（2010年2月23日から2011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 1,775,500	千米ドル 1,861,426	千円 154,665,966	% 38.9	% —	% 16.8	% 13.7	% 8.4
カ ナ ダ	千カナダドル 124,000	千カナダドル 134,784	千円 11,359,634	2.8	—	1.4	1.0	0.4
イ ギ リ ス	千英ポンド 223,700	千英ポンド 232,802	千円 31,419,087	7.8	—	5.2	2.0	0.6
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローネ 195,000	千スウェーデンクローネ 207,212	千円 2,693,761	0.7	—	0.4	0.2	0.1
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 198,000	千デンマーククローネ 217,344	千円 3,316,679	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 66,000	千ノルウェークローネ 70,447	千円 1,031,355	0.3	—	0.1	0.2	—
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 124,000	千ポーランドズロチ 122,051	千円 3,552,909	0.9	—	0.3	0.4	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 52,000	千オーストラリアドル 52,417	千円 4,413,572	1.1	—	0.5	0.5	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 22,300	千シンガポールドル 23,776	千円 1,550,708	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 70,000	千マレーシアリンギット 71,202	千円 1,943,841	0.4	—	0.2	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコペソ 458,000	千メキシコペソ 491,624	千円 3,402,041	0.9	—	0.5	0.2	0.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
フ ラ ン ス	311,000	329,438	37,467,069	9.4	—	5.6	3.0	0.8
ド イ ツ	308,000	331,054	37,650,779	9.5	—	4.6	3.2	1.7
オ ラ ン ダ	77,800	83,546	9,501,741	2.4	—	1.4	0.7	0.3
フィンランド	20,300	21,124	2,402,526	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ス ペ イ ン	151,000	146,976	16,715,589	4.2	—	2.1	1.4	0.7
イ タ リ ア	355,800	359,107	40,841,264	10.3	—	6.3	2.5	1.5
ベルギー	91,600	93,747	10,661,854	2.7	—	1.4	1.0	0.3
オーストリア	59,000	62,394	7,096,101	1.8	—	1.2	0.5	0.1
ポルトガル	33,000	28,694	3,263,445	0.8	—	0.5	0.2	0.1
アイルランド	28,000	22,969	2,612,359	0.7	—	0.4	0.2	0.1
合 計	—	—	千円 387,562,288	97.4	—	49.8	31.6	16.0

(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		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)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US T N/B 4.75 01/31/12	国債証券	4.750	7,000	7,291	605,849	2012/01/31
US T N/B 4.875 02/15/12	国債証券	4.875	22,000	22,991	1,910,367	2012/02/15
US T N/B 0.875 02/29/12	国債証券	0.875	40,000	40,221	3,342,012	2012/02/29
US T N/B 4.5 03/31/12	国債証券	4.500	32,000	33,456	2,779,859	2012/03/31
US T N/B 4.5 04/30/12	国債証券	4.500	40,000	41,976	3,487,819	2012/04/30
US T N/B 1.875 06/15/12	国債証券	1.875	35,000	35,679	2,964,597	2012/06/15
US T N/B 1.5 07/15/12	国債証券	1.500	36,000	36,537	3,035,869	2012/07/15
US T N/B 4.375 08/15/12	国債証券	4.375	35,000	36,990	3,073,536	2012/08/15
US T N/B 1.375 09/15/12	国債証券	1.375	33,000	33,417	2,776,655	2012/09/15
US T N/B 4.0 11/15/12	国債証券	4.000	44,000	46,547	3,867,603	2012/11/15
US T N/B 1.125 12/15/12	国債証券	1.125	35,000	35,262	2,929,961	2012/12/15
US T N/B 3.875 02/15/13	国債証券	3.875	32,000	33,994	2,824,634	2013/02/15
US T N/B 1.375 03/15/13	国債証券	1.375	28,000	28,318	2,352,949	2013/03/15
US T N/B 1.75 04/15/13	国債証券	1.750	25,000	25,490	2,117,964	2013/04/15
US T N/B 3.625 05/15/13	国債証券	3.625	29,000	30,771	2,556,813	2013/05/15
US T N/B 3.5 05/31/13	国債証券	3.500	20,000	21,175	1,759,480	2013/05/31
US T N/B 4.25 08/15/13	国債証券	4.250	35,000	37,794	3,140,336	2013/08/15
US T N/B 0.5 10/15/13	国債証券	0.500	30,000	29,524	2,453,165	2013/10/15
US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	4.250	40,000	43,418	3,607,634	2013/11/15
US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	4.000	40,000	43,250	3,593,642	2014/02/15
US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	4.750	35,000	38,743	3,219,176	2014/05/15
US T N/B 2.625 06/30/14	国債証券	2.625	30,000	31,143	2,587,721	2014/06/30
US T N/B 4.25 08/15/14	国債証券	4.250	28,000	30,613	2,543,700	2014/08/15
US T N/B 2.375 09/30/14	国債証券	2.375	28,000	28,740	2,388,033	2014/09/30
US T N/B 4.25 11/15/14	国債証券	4.250	30,000	32,889	2,732,796	2014/11/15
US T N/B 2.125 11/30/14	国債証券	2.125	25,000	25,386	2,109,364	2014/11/30
US T N/B 2.625 12/31/14	国債証券	2.625	12,000	12,407	1,030,920	2014/12/31
US T N/B 4.0 02/15/15	国債証券	4.000	20,000	21,728	1,805,379	2015/02/15
US T N/B 2.375 02/28/15	国債証券	2.375	23,000	23,507	1,953,247	2015/02/28
US T N/B 2.5 04/30/15	国債証券	2.500	20,000	20,489	1,702,431	2015/04/30
US T N/B 4.125 05/15/15	国債証券	4.125	18,000	19,639	1,631,856	2015/05/15
US T N/B 1.875 06/30/15	国債証券	1.875	15,000	14,933	1,240,841	2015/06/30
US T N/B 1.75 07/31/15	国債証券	1.750	8,000	7,906	656,976	2015/07/31
US T N/B 4.25 08/15/15	国債証券	4.250	15,000	16,442	1,366,211	2015/08/15
US T N/B 1.25 08/31/15	国債証券	1.250	15,000	14,464	1,201,892	2015/08/31
US T N/B 1.25 09/30/15	国債証券	1.250	8,000	7,697	639,580	2015/09/30
US T N/B 4.5 11/15/15	国債証券	4.500	18,000	19,915	1,654,753	2015/11/15
US T N/B 1.375 11/30/15	国債証券	1.375	10,000	9,628	800,032	2015/11/30
US T N/B 4.5 02/15/16	国債証券	4.500	16,000	17,700	1,470,693	2016/02/15
US T N/B 2.375 03/31/16	国債証券	2.375	20,000	20,023	1,663,744	2016/03/31
US T N/B 7.25 05/15/16	国債証券	7.250	15,000	18,637	1,548,589	2016/05/15
US T N/B 3.25 06/30/16	国債証券	3.250	20,000	20,826	1,730,465	2016/06/30
US T N/B 4.875 08/15/16	国債証券	4.875	18,000	20,252	1,682,796	2016/08/15
US T N/B 3.0 09/30/16	国債証券	3.000	20,000	20,493	1,702,813	2016/09/30
US T N/B 7.5 11/15/16	国債証券	7.500	14,000	17,720	1,472,431	2016/11/15
US T N/B 2.75 11/30/16	国債証券	2.750	20,000	20,151	1,674,379	2016/11/30
US T N/B 3.25 12/31/16	国債証券	3.250	20,000	20,670	1,717,486	2016/12/31
US T N/B 4.625 02/15/17	国債証券	4.625	12,000	13,329	1,107,536	2017/02/15
US T N/B 3.0 02/28/17	国債証券	3.000	20,000	20,359	1,691,645	2017/02/28
US T N/B 3.125 04/30/17	国債証券	3.125	10,000	10,217	849,005	2017/04/30
US T N/B 8.75 05/15/17	国債証券	8.750	7,000	9,447	784,967	2017/05/15
US T N/B 4.5 05/15/17	国債証券	4.500	15,000	16,535	1,373,901	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	12,764	1,060,586	2017/06/30
US T N/B 4.75 08/15/17	国 債 証 券	4.750	15,000	16,754	1,392,110	2017/08/15
US T N/B 1.875 08/31/17	国 債 証 券	1.875	8,000	7,525	625,302	2017/08/31
US T N/B 1.875 09/30/17	国 債 証 券	1.875	8,000	7,504	623,533	2017/09/30
US T N/B 4.25 11/15/17	国 債 証 券	4.250	11,000	11,932	991,459	2017/11/15
US T N/B 2.25 11/30/17	国 債 証 券	2.250	8,000	7,666	636,987	2017/11/30
US T N/B 3.5 02/15/18	国 債 証 券	3.500	14,000	14,484	1,203,508	2018/02/15
US T N/B 3.875 05/15/18	国 債 証 券	3.875	15,000	15,853	1,317,229	2018/05/15
US T N/B 4.0 08/15/18	国 債 証 券	4.000	10,000	10,624	882,764	2018/08/15
US T N/B 3.75 11/15/18	国 債 証 券	3.750	17,000	17,723	1,472,661	2018/11/15
US T N/B 8.875 02/15/19	国 債 証 券	8.875	7,000	9,870	820,139	2019/02/15
US T N/B 2.75 02/15/19	国 債 証 券	2.750	22,000	21,281	1,768,278	2019/02/15
US T N/B 3.125 05/15/19	国 債 証 券	3.125	20,000	19,801	1,645,298	2019/05/15
US T N/B 8.125 08/15/19	国 債 証 券	8.125	7,000	9,559	794,332	2019/08/15
US T N/B 3.625 08/15/19	国 債 証 券	3.625	22,000	22,534	1,872,381	2019/08/15
US T N/B 3.375 11/15/19	国 債 証 券	3.375	25,000	25,029	2,079,680	2019/11/15
US T N/B 3.625 02/15/20	国 債 証 券	3.625	26,000	26,430	2,196,115	2020/02/15
US T N/B 3.5 05/15/20	国 債 証 券	3.500	19,000	19,051	1,583,019	2020/05/15
US T N/B 8.75 08/15/20	国 債 証 券	8.750	7,000	10,027	833,225	2020/08/15
US T N/B 2.625 08/15/20	国 債 証 券	2.625	25,000	23,167	1,925,008	2020/08/15
US T N/B 2.625 11/15/20	国 債 証 券	2.625	22,000	20,282	1,685,306	2020/11/15
US T N/B 8.125 05/15/21	国 債 証 券	8.125	5,000	6,962	578,514	2021/05/15
US T N/B 8.0 11/15/21	国 債 証 券	8.000	11,000	15,258	1,267,795	2021/11/15
US T N/B 7.25 08/15/22	国 債 証 券	7.250	3,000	3,975	330,340	2022/08/15
US T N/B 7.125 02/15/23	国 債 証 券	7.125	4,000	5,257	436,817	2023/02/15
US T N/B 6.25 08/15/23	国 債 証 券	6.250	8,000	9,828	816,615	2023/08/15
US T N/B 7.5 11/15/24	国 債 証 券	7.500	3,000	4,092	340,056	2024/11/15
US T N/B 7.625 02/15/25	国 債 証 券	7.625	3,000	4,141	344,089	2025/02/15
US T N/B 6.875 08/15/25	国 債 証 券	6.875	3,500	4,546	377,809	2025/08/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国 債 証 券	6.000	5,000	5,997	498,311	2026/02/15
US T N/B 6.75 08/15/26	国 債 証 券	6.750	2,000	2,575	214,033	2026/08/15
US T N/B 6.5 11/15/26	国 債 証 券	6.500	3,000	3,776	313,825	2026/11/15
US T N/B 6.625 02/15/27	国 債 証 券	6.625	1,000	1,274	105,933	2027/02/15
US T N/B 6.375 08/15/27	国 債 証 券	6.375	2,000	2,492	207,088	2027/08/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国 債 証 券	6.125	6,000	7,294	606,075	2027/11/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国 債 証 券	5.500	3,000	3,411	283,464	2028/08/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国 債 証 券	5.250	4,000	4,419	367,231	2028/11/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国 債 証 券	5.250	4,000	4,419	367,178	2029/02/15
US T N/B 6.125 08/15/29	国 債 証 券	6.125	3,000	3,653	303,583	2029/08/15
US T N/B 6.25 05/15/30	国 債 証 券	6.250	5,000	6,182	513,695	2030/05/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国 債 証 券	5.375	6,000	6,712	557,776	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国 債 証 券	4.500	9,000	8,829	733,609	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/37	国 債 証 券	4.750	6,000	6,099	506,835	2037/02/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国 債 証 券	5.000	4,000	4,219	350,586	2037/05/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国 債 証 券	4.375	6,000	5,727	475,906	2038/02/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国 債 証 券	4.500	8,000	7,789	647,217	2038/05/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国 債 証 券	3.500	10,000	8,115	674,325	2039/02/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国 債 証 券	4.250	13,000	12,080	1,003,791	2039/05/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国 債 証 券	4.500	14,000	13,567	1,127,361	2039/08/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国 債 証 券	4.375	16,000	15,171	1,260,575	2039/11/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国 債 証 券	4.625	18,000	17,793	1,478,435	2040/02/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国 債 証 券	4.375	13,000	12,308	1,022,694	2040/05/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国 債 証 券	3.875	16,000	13,866	1,152,145	2040/08/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国 債 証 券	4.250	14,000	12,964	1,077,190	2040/11/15
小 計	—	—	1,775,500	1,861,426	154,665,966	—

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	
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
CANADA 1.5 03/01/12	国債証券	1.500	3,000	3,002	253,009	2012/03/01
CANADA 5.25 06/01/12	国債証券	5.250	9,500	9,940	837,762	2012/06/01
CANADA 2.0 09/01/12	国債証券	2.000	9,500	9,545	804,535	2012/09/01
CANADA 5.25 06/01/13	国債証券	5.250	10,000	10,726	904,046	2013/06/01
CANADA 2.5 09/01/13	国債証券	2.500	8,000	8,083	681,265	2013/09/01
CANADA 5.0 06/01/14	国債証券	5.000	10,000	10,840	913,654	2014/06/01
CANADA 2.0 12/01/14	国債証券	2.000	7,000	6,881	579,936	2014/12/01
CANADA 4.5 06/01/15	国債証券	4.500	8,000	8,611	725,772	2015/06/01
CANADA 3.0 12/01/15	国債証券	3.000	3,000	3,033	255,646	2015/12/01
CANADA 4.0 06/01/16	国債証券	4.000	6,000	6,336	534,018	2016/06/01
CANADA 4.0 06/01/17	国債証券	4.000	5,000	5,272	444,370	2017/06/01
CANADA 4.25 06/01/18	国債証券	4.250	4,500	4,800	404,564	2018/06/01
CANADA 3.75 06/01/19	国債証券	3.750	7,000	7,189	605,959	2019/06/01
CANADA 3.5 06/01/20	国債証券	3.500	4,500	4,511	380,227	2020/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.250	1,000	973	82,038	2021/06/01
CANADA 8.0 06/01/23	国債証券	8.000	2,300	3,282	276,679	2023/06/01
CANADA 9.0 06/01/25	国債証券	9.000	1,700	2,689	226,679	2025/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.000	2,500	3,774	318,121	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.750	5,000	6,255	527,184	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.750	5,000	6,385	538,136	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.000	5,500	6,488	546,819	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.000	6,000	6,160	519,206	2041/06/01
小計	—	—	124,000	134,784	11,359,634	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UK TREASURY 5.0 03/07/12	国債証券	5.000	9,000	9,372	1,264,926	2012/03/07
UK TREASURY 5.25 06/07/12	国債証券	5.250	10,500	11,053	1,491,760	2012/06/07
UK TREASURY 4.5 03/07/13	国債証券	4.500	10,000	10,594	1,429,766	2013/03/07
UK TREASURY 8.0 09/27/13	国債証券	8.000	3,000	3,488	470,834	2013/09/27
UK TREASURY 2.25 03/07/14	国債証券	2.250	10,000	10,065	1,358,372	2014/03/07
UK TREASURY 5.0 09/07/14	国債証券	5.000	9,000	9,831	1,326,872	2014/09/07
UK TREASURY 2.75 01/22/15	国債証券	2.750	9,500	9,592	1,294,556	2015/01/22
UK TREASURY 4.75 09/07/15	国債証券	4.750	8,000	8,700	1,174,259	2015/09/07
UK TREASURY 8.0 12/07/15	国債証券	8.000	3,000	3,712	500,998	2015/12/07
UK TREASURY 2.0 01/22/16	国債証券	2.000	2,000	1,921	259,312	2016/01/22
UK TREASURY 4.0 09/07/16	国債証券	4.000	9,000	9,467	1,277,679	2016/09/07
UK TREASURY 8.75 08/25/17	国債証券	8.750	3,000	3,990	538,611	2017/08/25
UK TREASURY 5.0 03/07/18	国債証券	5.000	5,000	5,498	742,010	2018/03/07
UK TREASURY 4.5 03/07/19	国債証券	4.500	7,500	7,938	1,071,413	2019/03/07
UK TREASURY 3.75 09/07/19	国債証券	3.750	10,000	9,999	1,349,465	2019/09/07
UK TREASURY 4.75 03/07/20	国債証券	4.750	8,000	8,568	1,156,445	2020/03/07
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国債証券	3.750	7,000	6,919	933,855	2020/09/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	8.000	5,000	6,719	906,796	2021/06/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4.000	5,000	4,980	672,100	2022/03/07
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.000	6,000	6,497	876,889	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.250	6,000	5,920	798,990	2027/12/07
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.000	4,500	5,414	730,727	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.750	6,500	6,752	911,364	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.250	6,500	6,306	851,098	2032/06/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.500	5,500	5,492	741,315	2034/09/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.250	8,000	7,698	1,038,976	2036/03/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.750	6,700	6,993	943,837	2038/12/07
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.250	5,500	5,303	715,780	2039/09/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.250	5,000	4,810	649,157	2040/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.500	7,000	7,048	951,238	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.250	7,000	6,771	913,922	2046/12/07

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 4.25 12/07/49	国債証券	4.250	6,500	6,303	850,659	2049/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.250	5,500	5,367	724,391	2055/12/07	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.000	4,000	3,710	500,701	2060/01/22	
小計	—	—	223,700	232,802	31,419,087	—	
(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 5.5 10/08/12	国債証券	5.500	23,000	24,229	314,981	2012/10/08	
SWEDEN 6.75 05/05/14	国債証券	6.750	30,000	33,629	437,186	2014/05/05	
SWEDEN 4.5 08/12/15	国債証券	4.500	23,000	24,404	317,256	2015/08/12	
SWEDEN 3.0 07/12/16	国債証券	3.000	18,000	17,846	232,001	2016/07/12	
SWEDEN 3.75 08/12/17	国債証券	3.750	19,000	19,550	254,155	2017/08/12	
SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	4.250	33,000	35,147	456,915	2019/03/12	
SWEDEN 5.0 12/01/20	国債証券	5.000	33,000	37,336	485,374	2020/12/01	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.500	16,000	15,068	195,890	2039/03/30	
小計	—	—	195,000	207,212	2,693,761	—	
(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 4.0 11/15/12	国債証券	4.000	24,000	25,032	381,988	2012/11/15	
DENMARK 5.0 11/15/13	国債証券	5.000	35,000	37,906	578,457	2013/11/15	
DENMARK 4.0 11/15/15	国債証券	4.000	32,000	34,126	520,768	2015/11/15	
DENMARK 4.0 11/15/17	国債証券	4.000	25,000	26,653	406,736	2017/11/15	
DENMARK 4.0 11/15/19	国債証券	4.000	33,000	34,815	531,276	2019/11/15	
DENMARK 7.0 11/10/24	国債証券	7.000	11,000	15,108	230,555	2024/11/10	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.500	38,000	43,702	666,896	2039/11/15	
小計	—	—	198,000	217,344	3,316,679	—	
(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	20,000	21,684	317,453	2013/05/15	
NORWAY 5.0 05/15/15	国債証券	5.000	20,000	21,500	314,760	2015/05/15	
NORWAY 4.25 05/19/17	国債証券	4.250	17,000	17,739	259,706	2017/05/19	
NORWAY 4.5 05/22/19	国債証券	4.500	9,000	9,524	139,435	2019/05/22	
小計	—	—	66,000	70,447	1,031,355	—	
(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 4.75 04/25/12	国債証券	4.750	19,000	19,038	554,196	2012/04/25	
POLAND 10/25/12	国債証券	—	4,000	3,683	107,217	2012/10/25	
POLAND 5.25 04/25/13	国債証券	5.250	14,000	14,046	408,893	2013/04/25	
POLAND 5.0 10/24/13	国債証券	5.000	10,000	9,990	290,808	2013/10/24	
POLAND 5.75 04/25/14	国債証券	5.750	18,000	18,191	529,565	2014/04/25	
POLAND 6.25 10/24/15	国債証券	6.250	16,000	16,400	477,404	2015/10/24	
POLAND 5.25 10/25/17	国債証券	5.250	12,000	11,523	335,434	2017/10/25	
POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	5.500	12,000	11,434	332,860	2019/10/25	
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.250	4,000	3,703	107,811	2020/10/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.750	12,000	11,280	328,360	2022/09/23	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.750	3,000	2,760	80,356	2029/04/25	
小計	—	—	124,000	122,051	3,552,909	—	
(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 5.75 04/15/12	国債証券	5.750	5,500	5,553	467,638	2012/04/15	
AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	国債証券	6.500	9,000	9,267	780,291	2013/05/15	
AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	国債証券	6.250	7,500	7,727	650,653	2014/06/15	
AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	国債証券	6.250	6,000	6,208	522,745	2015/04/15	
AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	国債証券	4.750	2,500	2,422	203,991	2016/06/15	
AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	国債証券	6.000	6,000	6,157	518,456	2017/02/15	
AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	国債証券	5.250	5,000	4,893	412,053	2019/03/15	
AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	4.500	4,500	4,142	348,826	2020/04/15	
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.750	4,000	4,033	339,615	2021/05/15	
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.750	2,000	2,010	169,299	2022/07/15	
小計	—	—	52,000	52,417	4,413,572	—	

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	
(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 2.625 04/01/12	国債証券	2.625	3,000	3,072	200,396	2012/04/01
SINGAPORE 2.25 07/01/13	国債証券	2.250	3,000	3,136	204,535	2013/07/01
SINGAPORE 3.625 07/01/14	国債証券	3.625	4,000	4,431	289,049	2014/07/01
SINGAPORE 3.75 09/01/16	国債証券	3.750	3,000	3,330	217,190	2016/09/01
SINGAPORE 4.0 09/01/18	国債証券	4.000	2,500	2,794	182,273	2018/09/01
SINGAPORE 3.25 09/01/20	国債証券	3.250	2,800	2,927	190,928	2020/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.125	1,700	1,732	112,981	2022/09/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.500	2,000	2,070	135,023	2027/03/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.875	300	281	18,328	2030/09/01
小 計	—	—	22,300	23,776	1,550,708	—
(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 3.718 06/15/12	国債証券	3.718	15,000	15,148	413,566	2012/06/15
MALAYSIA 3.702 02/25/13	国債証券	3.702	8,000	8,089	220,830	2013/02/25
MALAYSIA 5.094 04/30/14	国債証券	5.094	13,000	13,686	373,642	2014/04/30
MALAYSIA 4.262 09/15/16	国債証券	4.262	7,000	7,249	197,903	2016/09/15
MALAYSIA 3.814 02/15/17	国債証券	3.814	7,000	7,089	193,542	2017/02/15
MALAYSIA 4.24 02/07/18	国債証券	4.240	7,000	7,161	195,510	2018/02/07
MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	4.378	6,000	6,183	168,795	2019/11/29
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.502	5,000	4,435	121,075	2027/05/31
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.248	2,000	2,160	58,974	2028/09/15
小 計	—	—	70,000	71,202	1,943,841	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
MEXICAN BONDS 9.0 12/20/12	国債証券	9.000	85,000	90,734	627,885	2012/12/20
MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	国債証券	9.500	120,000	132,814	919,078	2014/12/18
MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	国債証券	7.750	70,000	72,580	502,254	2017/12/14
MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	8.000	60,000	62,115	429,839	2020/06/11
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.000	45,000	53,507	370,273	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.500	43,000	44,430	307,456	2029/05/31
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.500	35,000	35,441	245,251	2038/11/18
小 計	—	—	458,000	491,624	3,402,041	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 5.0 04/25/12	国債証券	5.000	9,000	9,399	1,069,016	2012/04/25
FR TREASURY 4.5 07/12/12	国債証券	4.500	2,000	2,081	236,774	2012/07/12
FRANCE OAT 4.75 10/25/12	国債証券	4.750	18,000	18,963	2,156,661	2012/10/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債証券	4.000	18,000	18,882	2,147,449	2013/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債証券	4.000	14,000	14,782	1,681,225	2013/10/25
FR TREASURY 2.5 01/12/14	国債証券	2.500	10,000	10,171	1,156,747	2014/01/12
FRANCE OAT 4.0 04/25/14	国債証券	4.000	14,000	14,841	1,687,912	2014/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/14	国債証券	4.000	13,000	13,821	1,571,930	2014/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/15	国債証券	3.500	16,000	16,681	1,897,198	2015/04/25
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	国債証券	3.000	17,000	17,311	1,968,791	2015/10/25
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	国債証券	3.250	13,000	13,332	1,516,339	2016/04/25
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	国債証券	5.000	10,000	11,122	1,264,905	2016/10/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	国債証券	3.750	9,000	9,391	1,068,095	2017/04/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	国債証券	4.250	8,000	8,562	973,801	2017/10/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	国債証券	4.000	9,000	9,461	1,076,079	2018/04/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	国債証券	4.250	8,000	8,539	971,208	2018/10/25
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	国債証券	4.250	10,500	11,155	1,268,680	2019/04/25
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	国債証券	8.500	4,000	5,521	627,971	2019/10/25
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	国債証券	3.750	8,000	8,169	929,128	2019/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	国債証券	3.500	10,000	9,961	1,132,864	2020/04/25
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	国債証券	2.500	7,000	6,390	726,768	2020/10/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	国債証券	3.750	11,500	11,606	1,320,058	2021/04/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.500	4,000	5,867	667,322	2023/04/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.250	9,500	9,914	1,127,541	2023/10/25

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	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.000	6,000	7,396	841,169	2025/10/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.500	6,000	5,684	646,486	2026/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.500	8,000	9,453	1,075,157	2029/04/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.750	8,000	9,868	1,122,287	2032/10/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.750	7,000	7,658	870,944	2035/04/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.000	9,500	9,324	1,060,446	2038/10/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.500	5,000	5,322	605,356	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.000	6,000	5,881	668,937	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.000	3,000	2,917	331,807	2060/04/25
小計	—	—	311,000	329,438	37,467,069	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDES OBL 4.0 04/13/12	国債証券	4.000	5,000	5,164	587,358	2012/04/13
DEUTSCHLAND 5.0 07/04/12	国債証券	5.000	16,000	16,814	1,912,301	2012/07/04
BUNDES OBL 4.25 10/12/12	国債証券	4.250	16,000	16,759	1,906,023	2012/10/12
DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	国債証券	4.500	19,000	20,077	2,283,391	2013/01/04
DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	国債証券	3.750	18,000	18,932	2,153,181	2013/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債証券	4.250	18,000	19,249	2,189,211	2014/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債証券	4.250	19,000	20,466	2,327,689	2014/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債証券	3.750	19,000	20,206	2,298,085	2015/01/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	国債証券	3.250	18,000	18,828	2,141,410	2015/07/04
DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	国債証券	3.500	12,000	12,639	1,437,433	2016/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	国債証券	4.000	10,000	10,776	1,225,554	2016/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	国債証券	3.750	8,000	8,512	968,069	2017/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	国債証券	4.250	8,000	8,730	992,908	2017/07/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	国債証券	4.000	8,000	8,602	978,350	2018/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	国債証券	4.250	9,000	9,808	1,115,486	2018/07/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	国債証券	3.750	9,000	9,481	1,078,330	2019/01/04
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	国債証券	3.500	9,000	9,259	1,053,048	2019/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債証券	3.250	9,000	9,071	1,031,656	2020/01/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.000	8,000	7,889	897,284	2020/07/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.250	6,000	5,562	632,566	2020/09/04
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	国債証券	2.500	5,000	4,693	533,734	2021/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.250	4,000	5,153	586,073	2024/01/04
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.500	4,500	6,048	687,890	2027/07/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.625	5,500	6,807	774,199	2028/01/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.750	4,500	5,068	576,423	2028/07/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.250	3,500	4,693	533,791	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.500	6,500	8,064	917,181	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.750	8,000	9,220	1,048,590	2034/07/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.000	9,000	9,290	1,056,559	2037/01/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.250	5,500	6,054	688,629	2039/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.750	6,500	7,749	881,327	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.250	1,500	1,380	157,032	2042/07/04
小計	—	—	308,000	331,054	37,650,779	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 5.0 07/15/12	国債証券	5.000	7,000	7,352	836,233	2012/07/15
NETHERLANDS 1.75 01/15/13	国債証券	1.750	1,500	1,507	171,413	2013/01/15
NETHERLANDS 4.25 07/15/13	国債証券	4.250	7,000	7,420	843,956	2013/07/15
NETHERLANDS 3.75 07/15/14	国債証券	3.750	7,000	7,389	840,373	2014/07/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/15	国債証券	2.750	5,000	5,095	579,454	2015/01/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/15	国債証券	3.250	6,000	6,216	707,013	2015/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/16	国債証券	4.000	5,000	5,331	606,294	2016/07/15
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	国債証券	4.500	6,000	6,536	743,384	2017/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債証券	4.000	5,000	5,282	600,721	2018/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	国債証券	4.000	6,000	6,309	717,590	2019/07/15

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	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	国債証券	3.500	6,000	6,051	688,248	2020/07/15
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.500	4,500	6,193	704,369	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.500	4,500	5,437	618,389	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.000	4,500	4,620	525,500	2037/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.750	2,800	2,803	318,794	2042/01/15
小計	—	—	77,800	83,546	9,501,741	—
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 4.25 09/15/12	国債証券	4.250	2,000	2,084	237,013	2012/09/15
FINLAND 5.375 07/04/13	国債証券	5.375	3,000	3,255	370,259	2013/07/04
FINLAND 3.125 09/15/14	国債証券	3.125	1,500	1,557	177,171	2014/09/15
FINLAND 4.25 07/04/15	国債証券	4.250	2,000	2,154	245,065	2015/07/04
FINLAND 1.75 04/15/16	国債証券	1.750	3,000	2,887	328,395	2016/04/15
FINLAND 3.875 09/15/17	国債証券	3.875	3,000	3,165	359,955	2017/09/15
FINLAND 4.375 07/04/19	国債証券	4.375	2,000	2,154	245,019	2019/07/04
FINLAND 3.375 04/15/20	国債証券	3.375	1,000	996	113,320	2020/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.000	2,800	2,869	326,325	2025/07/04
小計	—	—	20,300	21,124	2,402,526	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.0 07/30/12	国債証券	5.000	11,000	11,422	1,299,032	2012/07/30
SPAIN 6.15 01/31/13	国債証券	6.150	11,000	11,684	1,328,894	2013/01/31
SPAIN 4.2 07/30/13	国債証券	4.200	10,000	10,250	1,165,812	2013/07/30
SPAIN 4.25 01/31/14	国債証券	4.250	8,000	8,172	929,447	2014/01/31
SPAIN 4.75 07/30/14	国債証券	4.750	6,000	6,211	706,468	2014/07/30
SPAIN 3.3 10/31/14	国債証券	3.300	5,000	4,925	560,177	2014/10/31
SPAIN 4.4 01/31/15	国債証券	4.400	7,000	7,070	804,071	2015/01/31
SPAIN 3.0 04/30/15	国債証券	3.000	6,000	5,740	652,832	2015/04/30
SPAIN 3.15 01/31/16	国債証券	3.150	8,500	8,032	913,536	2016/01/31
SPAIN 3.8 01/31/17	国債証券	3.800	5,000	4,815	547,609	2017/01/31
SPAIN 5.5 07/30/17	国債証券	5.500	6,000	6,277	713,905	2017/07/30
SPAIN 4.1 07/30/18	国債証券	4.100	6,000	5,701	648,465	2018/07/30
SPAIN 4.6 07/30/19	国債証券	4.600	5,000	4,837	550,112	2019/07/30
SPAIN 4.3 10/31/19	国債証券	4.300	6,000	5,674	645,326	2019/10/31
SPAIN 4.0 04/30/20	国債証券	4.000	5,000	4,600	523,158	2020/04/30
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.850	5,000	4,866	553,495	2020/10/31
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.500	2,000	2,017	229,393	2021/04/30
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.800	6,000	5,586	635,364	2024/01/31
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.650	5,500	4,921	559,742	2025/07/30
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.000	7,000	7,073	804,469	2029/01/31
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.750	5,500	5,383	612,297	2032/07/30
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.200	6,000	4,614	524,859	2037/01/31
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.900	5,000	4,227	480,793	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.700	3,500	2,869	326,325	2041/07/30
小計	—	—	151,000	146,976	16,715,589	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 5.0 02/01/12	国債証券	5.000	13,000	13,387	1,522,519	2012/02/01
ITALY BTPS 4.0 04/15/12	国債証券	4.000	10,000	10,220	1,162,331	2012/04/15
ITALY BTPS 4.25 10/15/12	国債証券	4.250	17,000	17,515	1,992,088	2012/10/15
ITALY BTPS 4.75 02/01/13	国債証券	4.750	14,000	14,561	1,656,052	2013/02/01
ITALY BTPS 4.25 08/01/13	国債証券	4.250	16,000	16,494	1,875,908	2013/08/01
ITALY BTPS 3.75 12/15/13	国債証券	3.750	12,000	12,216	1,389,325	2013/12/15
ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債証券	4.250	19,000	19,552	2,223,751	2014/08/01
ITALY BTPS 4.25 02/01/15	国債証券	4.250	13,000	13,347	1,517,965	2015/02/01
ITALY BTPS 3.0 04/15/15	国債証券	3.000	10,000	9,786	1,112,961	2015/04/15
ITALY BTPS 3.75 08/01/15	国債証券	3.750	15,000	15,073	1,714,309	2015/08/01
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	国債証券	3.750	12,500	12,477	1,419,066	2016/08/01

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 4.0 02/01/17	国債証券	4.000	9,000	9,019	1,025,821	2017/02/01
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	国債証券	5.250	9,000	9,579	1,089,487	2017/08/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	国債証券	4.500	9,000	9,148	1,040,458	2018/02/01
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	国債証券	4.500	8,000	8,083	919,302	2018/08/01
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	国債証券	4.250	8,500	8,421	957,811	2019/02/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	国債証券	4.500	8,500	8,548	972,215	2019/03/01
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	国債証券	4.250	9,000	8,854	1,006,988	2019/09/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	国債証券	4.500	9,000	8,962	1,019,271	2020/02/01
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	国債証券	4.250	9,000	8,762	996,547	2020/03/01
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債証券	4.000	9,000	8,560	973,619	2020/09/01
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.750	6,500	5,996	681,953	2021/03/01
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.750	11,000	10,161	1,155,701	2021/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.750	7,000	6,897	784,407	2023/08/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.000	5,000	6,840	777,913	2023/11/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.000	7,500	7,415	843,310	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.500	4,000	3,741	425,486	2026/03/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.250	4,000	4,844	550,908	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.500	10,500	11,859	1,348,809	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.250	11,000	10,951	1,245,525	2029/11/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.000	11,500	12,305	1,399,447	2031/05/01
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.750	6,000	6,255	711,449	2033/02/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.000	8,500	8,079	918,853	2034/08/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.000	9,500	7,784	885,308	2037/02/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.000	7,500	7,038	800,517	2039/08/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.000	6,800	6,364	723,868	2040/09/01
小計	—	—	355,800	359,107	40,841,264	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.0 09/28/12	国債証券	5.000	9,000	9,410	1,070,244	2012/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/13	国債証券	4.000	7,000	7,228	822,142	2013/03/28
BELGIUM 4.25 09/28/13	国債証券	4.250	5,000	5,135	584,003	2013/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/14	国債証券	4.000	2,000	2,068	235,239	2014/03/28
BELGIUM 4.25 09/28/14	国債証券	4.250	9,000	9,378	1,066,559	2014/09/28
BELGIUM 3.5 03/28/15	国債証券	3.500	5,000	5,054	574,791	2015/03/28
BELGIUM 3.75 09/28/15	国債証券	3.750	5,000	5,080	577,748	2015/09/28
BELGIUM 2.75 03/28/16	国債証券	2.750	3,000	2,894	329,214	2016/03/28
BELGIUM 3.25 09/28/16	国債証券	3.250	5,000	4,906	558,016	2016/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/17	国債証券	4.000	4,000	4,054	461,152	2017/03/28
BELGIUM 5.5 09/28/17	国債証券	5.500	4,000	4,382	498,410	2017/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/18	国債証券	4.000	4,000	4,032	458,604	2018/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/19	国債証券	4.000	4,000	4,004	455,420	2019/03/28
BELGIUM 3.75 09/28/20	国債証券	3.750	6,500	6,291	715,515	2020/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.250	1,000	999	113,707	2021/09/28
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.000	5,000	4,883	555,343	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.500	6,000	6,674	759,079	2028/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.000	5,300	5,587	635,457	2035/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.250	1,800	1,681	191,202	2041/03/28
小計	—	—	91,600	93,747	10,661,854	—
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 5.0 07/15/12	国債証券	5.000	4,000	4,197	477,379	2012/07/15
AUSTRIA 3.8 10/20/13	国債証券	3.800	2,500	2,622	298,256	2013/10/20
AUSTRIA 4.3 07/15/14	国債証券	4.300	7,000	7,478	850,563	2014/07/15
AUSTRIA 3.4 10/20/14	国債証券	3.400	3,000	3,112	353,984	2014/10/20
AUSTRIA 3.5 07/15/15	国債証券	3.500	4,000	4,152	472,206	2015/07/15
AUSTRIA 4.0 09/15/16	国債証券	4.000	5,000	5,280	600,494	2016/09/15
AUSTRIA 4.3 09/15/17	国債証券	4.300	4,000	4,266	485,172	2017/09/15

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	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 4.65 01/15/18	国債証券	4.650	4,000	4,352	494,952	2018/01/15
AUSTRIA 4.35 03/15/19	国債証券	4.350	5,000	5,352	608,739	2019/03/15
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.900	5,000	5,120	582,297	2020/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.500	5,000	4,917	559,267	2021/09/15
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.650	1,500	1,488	169,230	2022/04/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.850	2,500	2,739	311,591	2026/03/15
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.250	3,000	3,799	432,117	2027/07/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.150	3,500	3,515	399,846	2037/03/15
小 計	—	—	59,000	62,394	7,096,101	—
(ユーロ…ポルトガル)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
PORTUGUESE 5.0 06/15/12	国債証券	5.000	3,000	3,048	346,649	2012/06/15
PORTUGUESE 5.45 09/23/13	国債証券	5.450	3,000	3,018	343,271	2013/09/23
PORTUGUESE 4.375 06/16/14	国債証券	4.375	4,000	3,804	432,628	2014/06/16
PORTUGUESE 3.35 10/15/15	国債証券	3.350	2,000	1,740	197,935	2015/10/15
PORTUGUESE 4.2 10/15/16	国債証券	4.200	5,000	4,400	500,412	2016/10/15
PORTUGUESE 4.35 10/16/17	国債証券	4.350	2,000	1,700	193,341	2017/10/16
PORTUGUESE 4.45 06/15/18	国債証券	4.450	3,000	2,541	289,090	2018/06/15
PORTUGUESE 4.75 06/14/19	国債証券	4.750	2,000	1,701	193,484	2019/06/14
PORTUGUESE 3.85 04/15/21	国債証券	3.850	3,000	2,265	257,646	2021/04/15
PORTUGUESE 4.95 10/25/23	国債証券	4.950	3,000	2,401	273,122	2023/10/25
PORTUGUESE 4.1 04/15/37	国債証券	4.100	3,000	2,073	235,864	2037/04/15
小 計	—	—	33,000	28,694	3,263,445	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 3.9 03/05/12	国債証券	3.900	2,000	1,988	226,147	2012/03/05
IRISH 5.0 04/18/13	国債証券	5.000	3,000	2,891	328,797	2013/04/18
IRISH 4.0 01/15/14	国債証券	4.000	3,000	2,695	306,508	2014/01/15
IRISH 4.6 04/18/16	国債証券	4.600	3,000	2,527	287,469	2016/04/18
IRISH 4.5 10/18/18	国債証券	4.500	3,000	2,320	263,900	2018/10/18
IRISH 4.4 06/18/19	国債証券	4.400	3,000	2,250	255,892	2019/06/18
IRISH 5.9 10/18/19	国債証券	5.900	3,000	2,463	280,151	2019/10/18
IRISH 4.5 04/18/20	国債証券	4.500	3,000	2,171	246,956	2020/04/18
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5.000	2,000	1,477	167,979	2020/10/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.400	3,000	2,185	248,556	2025/03/13
小 計	—	—	28,000	22,969	2,612,359	—
合 計	—	—	—	—	387,562,288	—

■投資信託財産の構成

2011年2月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
	387,562,288	97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,342,420	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	397,904,793	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、397,712,540千円、100.0%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、2011年2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル=83.09円、1カナダドル=84.28円、1英ポンド=134.96円、1スイスフラン=87.93円、1スウェーデンクローネ=13.00円、1デンマーククローネ=15.26円、1ノルウェークローネ=14.64円、1ポーランドズロチ=29.11円、1オーストラリアドル=84.20円、1シンガポールドル=65.22円、1マレーシアリングギット=27.30円、1メキシコペソ=6.92円、1ユーロ=113.73円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2011年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	398,149,298,545円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,515,863,751
公 社 債 (評価額)	387,562,288,897
未 収 入 金	244,807,361
未 収 利 息	4,579,744,257
前 払 費 用	246,594,279
(B) 負 債	348,431,880
未 払 金	244,589,880
未 払 解 約 金	103,842,000
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	397,800,866,665
元 本	345,553,272,555
次 期 繰 越 損 益 金	52,247,594,110
(D) 受 益 権 総 口 数	345,553,272,555口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,512円

<注記事項>

※ 期首元本額	339,953,352,217円
期中追加設定元本額	47,643,597,077円
期中一部解約元本額	42,043,676,739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	: 4,635,181,676円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	: 3,573,111,024円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	: 297,561,636円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	: 1,083,613,768円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	: 1,181,500,654円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	: 323,613,584円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	: 632,799,046円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	: 423,895,387円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	: 175,688,656円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	: 1,610,329,665円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	: 839,479円
D I AMバッシブ資産分散ファンド	: 8,814,535,217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)	: 4,057,469,028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)	: 7,922,878,027円
外国債券バッシブファンド(適格機関投資家限定)	: 947,377,584円
D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	: 264,971,288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)	: 51,108,994,549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)	: 2,902,426,874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)	: 489,729,476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)	: 800,269,682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)	: 227,560,599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)	: 99,827,730円
D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	: 29,973,964,177円
D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	: 6,666,128,697円
D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	: 12,087,672,315円
D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	: 5,681,457,193円
D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	: 8,231,174,492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)	: 3,109,475,162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)	: 9,161,917,543円
D I AMアキラ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	: 10,661,402,167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)	: 52,529,099,994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)	: 270,088,311円
D I AM為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け)	: 610,881,068円
D I AM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	: 7,332,934,639円
D I AMアイエスジー世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	: 16,266,742,763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)	: 285,986,643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)	: 27,343,990,805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)	: 33,134,813,878円
D I AMバランス30VA(適格機関投資家限定)	: 851,719,069円
D I AMバランス50VA(適格機関投資家限定)	: 240,989円
D I AMバランス70VA(適格機関投資家限定)	: 150,746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)	: 28,904,693,381円
D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	: 226,705,158円
D I AMバランス20VA(適格機関投資家限定)	: 647,495,325円
D I AMバランス40VA(適格機関投資家限定)	: 225,302円
D I AMバランス60VA(適格機関投資家限定)	: 138,109円
期末元本合計	: 345,553,272,555円

■損益の状況

当期 自2010年2月23日 至2011年2月21日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	15,051,031,252円
受 取 利 息	15,051,031,252
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△43,410,538,725
売 買 損 益	3,915,751,149
売 買 損 益	△47,326,289,874
(C) そ の 他 費 用	△ 61,909,086
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△28,421,416,559
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	79,970,905,044
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 7,700,824,298
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,398,929,923
(H) 計 (D+E+F+G)	52,247,594,110
次 期 繰 越 損 益 金	52,247,594,110

(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。