

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型株式投資信託 / バランス型		
信託期間	無期限		
運用方針	シティグループ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。 (運用はファミリーファンド方式で行い、親投資信託を介して運用目標実現に努めます。)		
主要運用対象	子投資信託	中央三井外国債券インデックスファンド	中央三井外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	親投資信託	中央三井外国債券マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	子投資信託	中央三井外国債券インデックスファンド	株式への実質投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権を行使したものに限りです。外貨建資産への投資には、制限を設けません。
	親投資信託	中央三井外国債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権を行使したものに限りです。外貨建資産への投資には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。 分配金額は、原則として利子等収益の範囲内で行うものとします。ただし、基準価額の水準や分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。		

中央三井外国債券 インデックスファンド

運用報告書

第 8 期(決算日 2009年 2月23日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、このたび「中央三井外国債券インデックスファンド」は、2009年2月23日に第8期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

中央三井アセットマネジメント

東京都港区芝三丁目23番1号

お問合せ窓口(お客様相談窓口) TEL03-5440-0190

(受付時間: 営業日の9:00~17:00(本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は9:00~12:00))

当ファンドの基準価額は当社ホームページにてご覧いただけます。

<http://www.cmam.co.jp>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入率	債券先物比率	純資産
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
4期(2005年2月21日)	14,203	10	4.8	280.525	5.5	97.2	1.2	822
5期(2006年2月21日)	15,464	20	9.0	308.272	9.9	96.4	1.7	2,161
6期(2007年2月21日)	16,847	0	8.9	338.366	9.8	97.1	1.1	4,267
7期(2008年2月21日)	17,099	0	1.5	345.157	2.0	97.6	0.7	7,934
8期(2009年2月23日)	14,069	0	17.7	288.148	16.5	97.5	0.8	8,409

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2008年2月21日	円	%		%	%	%
	17,099	-	345.157	-	97.6	0.7
2月末	16,993	0.6	348.086	0.8	96.8	1.0
3月末	16,712	2.3	336.729	2.4	96.9	1.0
4月末	17,027	0.4	343.696	0.4	96.6	1.2
5月末	17,062	0.2	345.351	0.1	96.5	1.3
6月末	17,361	1.5	350.987	1.7	97.6	0.4
7月末	17,612	3.0	358.078	3.7	98.1	0.3
8月末	17,347	1.5	353.112	2.3	97.2	0.8
9月末	16,347	4.4	337.852	2.1	97.3	0.7
10月末	14,403	15.8	291.373	15.6	96.0	1.8
11月末	14,441	15.5	293.992	14.8	97.7	0.6
12月末	14,738	13.8	300.028	13.1	97.8	0.7
2009年1月末	13,470	21.2	278.647	19.3	95.6	2.2
(期末) 2009年2月23日	14,069	17.7	288.148	16.5	97.5	0.8

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

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

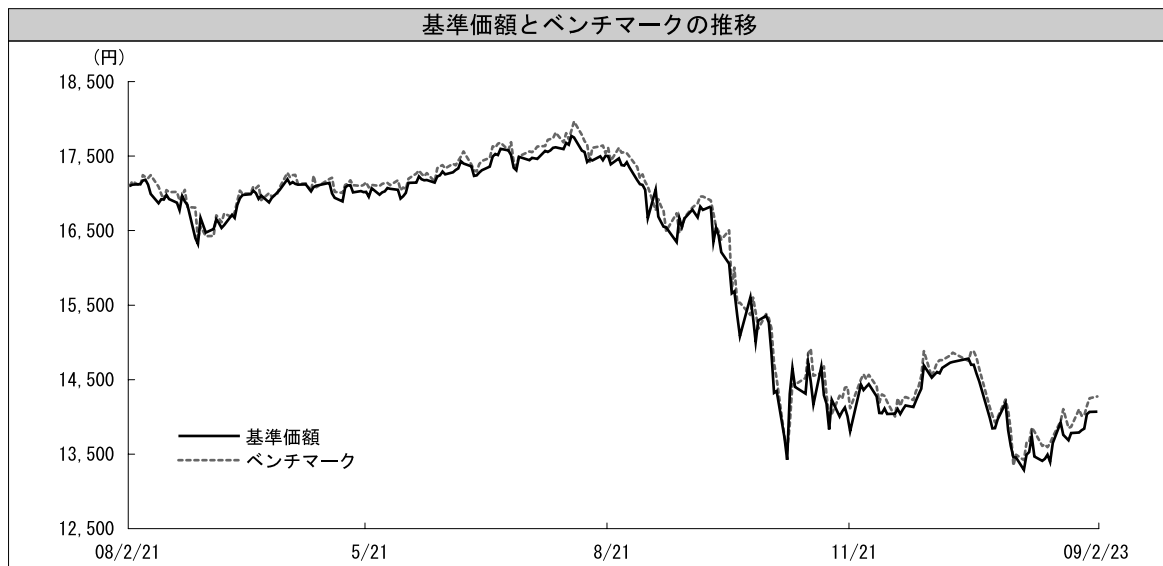
シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。なお、本資料においては、基準価額への反映を考慮して各期日の前営業日(現地ベース)の指数を掲載しています。

【報告書の記載について】

- ・原則として、数量、額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数で表記することがあります。
- ・ - 印は、組み入れ、異動等の該当がないことを示します。

第8期（2008年2月22日～2009年2月23日）の運用状況と今後の運用方針

1. 基準価額の推移



(注) ベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しております。

基準価額の期中高値・安値

決算期	期首(前期末)	期中高値	期中安値	期末
第8期	2008年2月21日	2008年8月7日	2009年1月26日	2009年2月23日
	17,099円	17,772円	13,287円	14,069円

基準価額とベンチマークとの差異

	期首(前期末)	期末	期間中の 分配金額	差額 (- +)	騰落率 (/) × 100
基準価額	17,099円	14,069円		3,030円	17.7%
ベンチマーク	345.157	288.148		57.009	16.5%

当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離（1.2%）が生じた主な要因は、信託報酬及び為替評価要因 等です。

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

2. 基準価額の主な変動要因と市場動向

2008年2月(期首)～8月上旬

基準価額	上昇
外国債券市場	<p>< マイナス要因 > 長期金利は、金融機関への信用不安後退を背景に堅調な推移となった株価や、米連邦準備制度理事会（F R B）の利下げ休止観測、さらには原油等商品価格の高騰を受けたインフレ懸念の高まりから、上昇（債券価格は下落）となりました。</p>
外国為替市場	<p>< プラス要因 > 米ドル円為替は、米欧金融機関の資本増強を好感した株高や過度な信用不安の後退からドル高円安基調となり、8月には原油等商品価格反落によるドル買戻しにより110円台までドル上昇となりました。円は他の主要通貨に対しても、円安推移となりました。</p>

2008年8月中旬～10月下旬

基準価額	下落
外国債券市場	<p>< プラス要因 > 長期金利は、世界的な景気減速懸念や原油価格下落によるインフレ懸念の後退、9月には金融システム不安から低下（債券価格は上昇）となりました。その後は、金融市場の混乱の中、需給悪化懸念や株価急落を材料に乱高下推移となりました。</p>
外国為替市場	<p>< マイナス要因 > 米ドル円為替は、9月の金融システム不安でドル安推移となり、以降も株価急落や米国景気悪化懸念の高まりから円高が加速しました。世界的な金融危機による株価急落に加え欧州景気に対する悲観的な見方が強まると、投資家のリスク回避による円買いから、円は他の主要通貨に対しても全面高の展開となりました。</p>

2008年11月上旬～2009年2月(期末)

基準価額	下落
外国債券市場	<p>< プラス要因 > 長期金利は、12月末まで景気回復と金融安定化に向けた主要国中央銀行による政策金利の引き下げから、大幅に低下（債券価格は上昇）しました。しかし、年明け以降は各国政府の景気対策を受けた国債増発懸念の高まりから、金利は反発基調（債券価格は下落基調）となりました。</p>
外国為替市場	<p>< マイナス要因 > 米ドル円為替は、F R Bによる積極的なゼロ金利政策と量的緩和策の導入を受け、円高推移となりました。一方、12月にユーロへの資金回帰などから、一時ユーロに対して円安となりましたが、その後は欧州での景気後退の深刻化、中央政府（又は中央銀行）の長期的な債務履行能力についての格付けである長期ソブリン格付けの引き下げなどを背景に、再び円高推移となりました。また、英国における追加利下げ観測から、英ポンドに対して円高が加速しました。</p>

3. 運用経過

【前期における今後の運用方針】

今後の運用にあたりましては、当ファンドの運用の基本方針に従い、主要投資対象である中央三井外国債券マザーファンドへの投資を通じて、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、ヘッジなし・円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

当ファンドの運用につきましては、原則として中央三井外国債券マザーファンド（以下マザーファンド）の受益証券へほぼ100%投資しました。

【マザーファンドの運用経過】

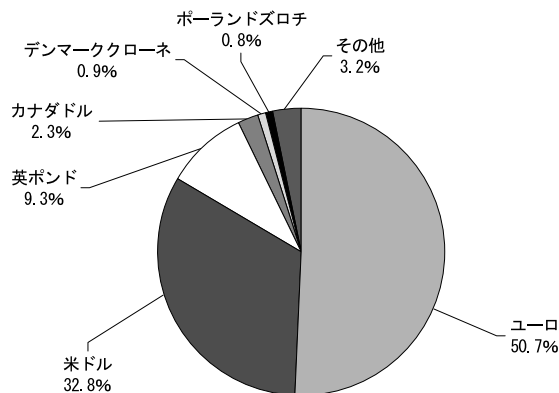
(1) ポートフォリオ構成

当マザーファンドは、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行っています。ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

(2) 債券組入比率

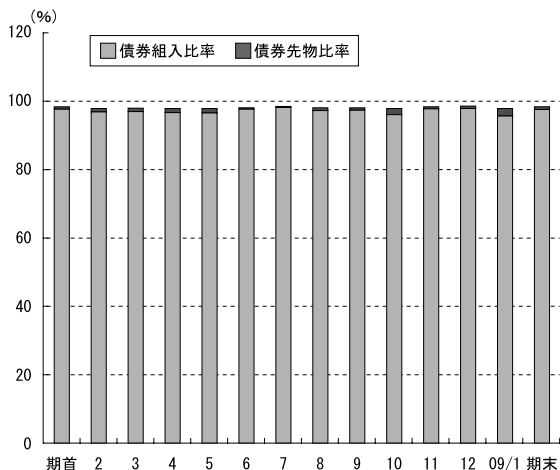
債券の組入比率は、期を通じて高位を維持しました。また、ファンドのキャッシュフローへ効率的に対応するためキャッシュマネジメントの一環で海外債券先物と為替先物予約を利用しました。

通貨別構成比(当期末)



(注) 構成比は、マザーファンドの債券評価総額に対する各通貨の評価額の比率です。

債券等組入比率の推移(月末値)



(注) 債券等組入比率は、マザーファンドでの組入比率を当ファンドに換算したものです。

4．収益分配金

当期は、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を見送らせていただきました。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

5．今後の運用方針

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

今後とも、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

1 万口 (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)	119円 (56) (55) (8)
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (先 物 ・ オ ブ シ ョ ン)	0 (0)
(c) 保 管 費 用 等	5
合 計	124

- (注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。
 (a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率
 (b) 売買委託手数料、(c) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
 (注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
 (注3) 売買委託手数料及び保管費用等は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

売買及び取引の状況 (2008年2月22日から2009年2月23日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
中央三井外国債券マザーファンド	2,147,912	3,573,485	919,299	1,570,820

主要な売買銘柄 (2008年2月22日から2009年2月23日まで)

中央三井外国債券マザーファンド 公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
US TREASURY N/B 1.75% (アメリカ)	3,441,194	US TREASURY N/B 6% (アメリカ)	6,814,581
FRANCE O.A.T. 5% (ユーロ・フランス)	3,232,484	US TREASURY N/B 3.5% (アメリカ)	5,663,431
US TREASURY N/B 4.5% (アメリカ)	2,812,206	BTPS 4.5% (ユーロ・イタリア)	4,531,714
US TREASURY N/B 4.5% (アメリカ)	2,781,505	DEUTSCHLAND REP 4.5% (ユーロ・ドイツ)	4,406,809
US TREASURY N/B 2.875% (アメリカ)	2,767,195	FRANCE O.A.T. 4% (ユーロ・フランス)	4,376,247
US TREASURY N/B 4.75% (アメリカ)	2,584,397	BTPS 4.25% (ユーロ・イタリア)	3,803,650
US TREASURY N/B 1.5% (アメリカ)	2,489,658	US TREASURY N/B 4.875% (アメリカ)	3,652,107
BTPS 3.75% (ユーロ・イタリア)	2,485,407	BUNDESOBL-145 3.5% (ユーロ・ドイツ)	2,486,570
US TREASURY N/B 4.5% (アメリカ)	2,417,851	US TREASURY N/B 6.5% (アメリカ)	2,298,722
TREASURY 4.5% (イギリス)	2,380,777	BUNDESOBL-144 3.25% (ユーロ・ドイツ)	2,109,134

(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（2008年2月22日から2009年2月23日まで）

(1) 当ファンドにおける利害関係人との取引状況

当期中の利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける利害関係人との取引状況

投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項第16号には「当該投資信託財産の計算期間中における利害関係人等との取引の状況」を運用報告書に表示しなければならない旨が規定されていますが、これまで「為替取引の状況」を記載しておりませんでした。今後は規則の定めに従い記載することと致します。

なお、中央三井外国債券マザーファンドでは、従来から、利害関係人である中央三井信託銀行株式会社との為替取引がありましたが、約定価格は市場実勢に基づいたもので当該取引をしたことによるファンドへの不利益はございません。

中央三井外国債券マザーファンド

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	192,984	192,984	100.0	192,133	192,133	100.0
為替直物取引	51,186	50,232	98.1	49,768	48,813	98.1

<平均保有割合 1.8%>

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

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当	期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)		90千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)		- 千円
(B) / (A)		0.0%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、中央三井信託銀行株式会社です。

組入資産の明細（2009年2月23日現在）

親投資信託残高

種 類	期 首 (前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
中央三井外国債券マザーファンド	千口 4,411,733	千口 5,640,347	千円 8,439,087	

< 補足情報 >

下記は、中央三井外国債券マザーファンド全体（278,129,653千口）の内容です。（2009年2月23日現在）
 (1) 外国（外貨建）公社債

区 分	当 期				未			
	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 1,249,580	千米ドル 1,424,278	千円 132,700,026	% 31.9	% -	% 13.9	% 12.9	% 5.1
カ ナ ダ	千カナダドル 109,280	千カナダドル 127,560	9,468,794	2.3	-	1.4	0.7	0.3
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	374,890	410,153	48,865,747	11.7	-	5.6	4.5	1.6
イ タ リ ア	376,880	390,572	46,532,825	11.2	-	6.7	3.3	1.2
フ ラ ンス	321,470	348,744	41,549,411	10.0	-	5.6	3.6	0.7
オ ラ ン ダ	79,450	84,283	10,041,502	2.4	-	1.4	0.7	0.3
ス ペ イン	139,590	147,271	17,545,936	4.2	-	2.2	1.7	0.4
ベルギー	107,850	112,978	13,460,266	3.2	-	1.7	1.1	0.4
オーストリア	59,840	61,055	7,274,140	1.7	-	1.3	0.3	0.1
フィンランド	19,610	20,794	2,477,477	0.6	-	0.2	0.3	0.1
アイルランド	21,700	20,795	2,477,603	0.6	-	0.4	0.2	-
ポルトガル	39,450	39,818	4,743,963	1.1	-	0.7	0.4	0.1
そ の 他	86,990	83,983	10,005,737	2.4	-	1.2	0.9	0.3
イ ギ リ ス	千英ポンド 253,470	千英ポンド 280,984	37,688,428	9.1	-	6.5	2.1	0.5
ス イ ス	千スイスフラン 35,260	千スイスフラン 39,434	3,173,267	0.8	-	0.4	0.3	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 205,620	千スウェーデンクローナ 233,122	2,468,767	0.6	-	0.4	0.2	-
ノルウェー	千ノルウェークローネ 81,910	千ノルウェークローネ 89,585	1,223,738	0.3	-	0.1	0.2	-
デンマーク	千デンマーククローネ 209,730	千デンマーククローネ 228,403	3,652,178	0.9	-	0.5	0.3	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 131,640	千ポーランドズロチ 128,617	3,174,286	0.8	-	0.3	0.3	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 24,600	千オーストラリアドル 26,240	1,570,252	0.4	-	0.2	0.1	-
シンガポール	千シンガポールドル 27,700	千シンガポールドル 29,964	1,823,616	0.4	-	0.2	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 84,850	千マレーシアリンギット 86,371	2,192,114	0.5	-	0.2	0.2	0.1
合 計	-	-	404,110,084	97.1	-	51.2	34.3	11.6

(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、当親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注4) 株式及び新株予約権証券（新株引受権証券を含む。）は組み入れていません。

(2) 外国(外貨建)公社債銘柄別

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償 還 年 月 日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償 還 年 月 日
		外貨建金額	千米ドル	外貨建金額	千米ドル				邦貨換算金額	千円	外貨建金額	千米ドル	
国債証券 (アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円			国債証券 (アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円		
US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,974	1,115,681	2011/12/15	US TREASURY N/B	4.5	9,500	11,090	1,033,302	2038/5/15		
US TREASURY N/B	1.5	27,120	26,776	2,494,790	2013/12/31	US TREASURY N/B	4.625	31,700	34,500	3,214,457	2011/8/31		
US TREASURY N/B	1.75	37,240	37,804	3,522,237	2011/11/15	US TREASURY N/B	4.625	19,040	20,778	1,935,968	2011/10/31		
US TREASURY N/B	11.25	9,550	14,259	1,328,543	2015/2/15	US TREASURY N/B	4.625	7,910	8,765	816,717	2012/7/31		
US TREASURY N/B	2.0	6,500	6,570	612,181	2013/11/30	US TREASURY N/B	4.625	9,450	10,790	1,005,371	2016/11/15		
US TREASURY N/B	2.75	15,630	16,384	1,526,556	2013/2/28	US TREASURY N/B	4.625	23,500	26,907	2,506,971	2017/2/15		
US TREASURY N/B	2.875	17,740	18,689	1,741,288	2013/1/31	US TREASURY N/B	4.75	22,670	24,975	2,327,010	2012/1/31		
US TREASURY N/B	3.375	20,810	22,382	2,085,343	2013/7/31	US TREASURY N/B	4.75	18,670	20,697	1,928,380	2014/5/31		
US TREASURY N/B	3.5	6,500	6,683	622,732	2010/2/15	US TREASURY N/B	4.75	29,400	33,791	3,148,365	2012/5/15		
US TREASURY N/B	3.625	33,680	34,979	3,259,071	2010/6/15	US TREASURY N/B	4.75	11,150	13,254	1,234,927	2037/2/15		
US TREASURY N/B	3.625	10,000	10,840	1,010,021	2013/5/15	US TREASURY N/B	4.875	18,000	19,511	1,817,906	2011/4/30		
US TREASURY N/B	3.75	9,840	10,674	994,576	2018/11/15	US TREASURY N/B	4.875	6,900	7,502	699,023	2011/5/31		
US TREASURY N/B	3.875	14,000	14,617	1,361,956	2010/7/15	US TREASURY N/B	4.875	9,960	10,884	1,014,100	2011/7/31		
US TREASURY N/B	3.875	4,200	4,403	410,237	2010/9/15	US TREASURY N/B	4.875	2,830	3,128	291,521	2012/2/15		
US TREASURY N/B	3.875	18,200	19,799	1,844,729	2012/10/31	US TREASURY N/B	4.875	12,000	13,901	1,295,179	2016/8/15		
US TREASURY N/B	3.875	16,200	17,716	1,650,620	2013/2/15	US TREASURY N/B	5.0	25,960	28,089	2,617,101	2011/2/15		
US TREASURY N/B	3.875	7,980	8,746	814,941	2018/5/15	US TREASURY N/B	5.0	2,730	3,377	314,683	2037/5/15		
US TREASURY N/B	4.0	49,990	51,704	4,817,308	2010/3/15	US TREASURY N/B	5.0	27,050	29,771	2,773,848	2011/8/15		
US TREASURY N/B	4.0	6,500	6,742	628,220	2010/4/15	US TREASURY N/B	5.125	9,010	9,872	919,800	2011/6/30		
US TREASURY N/B	4.0	10,000	11,100	1,034,187	2014/2/15	US TREASURY N/B	5.125	27,000	31,779	2,960,928	2016/5/15		
US TREASURY N/B	4.0	20,020	22,225	2,070,733	2015/2/15	US TREASURY N/B	5.25	4,140	4,949	461,181	2028/11/15		
US TREASURY N/B	4.0	17,000	18,585	1,731,637	2012/11/15	US TREASURY N/B	5.25	4,650	5,564	518,467	2029/2/15		
US TREASURY N/B	4.125	12,000	12,601	1,174,116	2010/8/15	US TREASURY N/B	5.375	7,390	9,066	844,735	2032/2/15		
US TREASURY N/B	4.125	18,200	19,886	1,852,810	2012/8/31	US TREASURY N/B	5.5	9,660	11,889	1,107,730	2018/8/15		
US TREASURY N/B	4.125	12,000	13,357	1,244,518	2015/5/15	US TREASURY N/B	5.75	7,200	7,729	720,192	2010/8/15		
US TREASURY N/B	4.25	7,500	7,930	738,899	2010/10/15	US TREASURY N/B	6.0	840	1,079	100,616	2026/2/15		
US TREASURY N/B	4.25	18,190	19,996	1,863,046	2012/9/30	US TREASURY N/B	6.125	18,160	23,812	2,218,591	2027/11/15		
US TREASURY N/B	4.25	6,930	7,724	719,718	2013/8/15	US TREASURY N/B	6.125	6,200	8,216	765,572	2029/8/15		
US TREASURY N/B	4.25	11,250	12,589	1,172,959	2013/11/15	US TREASURY N/B	6.25	4,660	5,970	556,283	2023/8/15		
US TREASURY N/B	4.25	12,550	14,126	1,316,174	2014/8/15	US TREASURY N/B	6.25	7,520	10,174	947,941	2030/5/15		
US TREASURY N/B	4.25	9,230	10,408	969,738	2014/11/15	US TREASURY N/B	6.5	17,340	18,317	1,706,632	2010/2/15		
US TREASURY N/B	4.25	6,000	6,735	627,587	2015/8/15	US TREASURY N/B	6.5	5,150	6,982	650,538	2026/11/15		
US TREASURY N/B	4.25	12,950	14,532	1,353,977	2017/11/15	US TREASURY N/B	6.625	2,500	3,437	320,235	2027/2/15		
US TREASURY N/B	4.375	25,300	26,916	2,507,840	2010/12/15	US TREASURY N/B	6.875	5,850	8,192	763,317	2025/8/15		
US TREASURY N/B	4.375	21,500	23,717	2,209,730	2012/8/15	US TREASURY N/B	7.125	6,550	8,966	835,393	2023/2/15		
US TREASURY N/B	4.375	6,100	6,930	645,684	2038/2/15	US TREASURY N/B	7.25	5,670	7,326	682,628	2016/5/15		
US TREASURY N/B	4.5	5,000	5,313	495,038	2010/11/15	US TREASURY N/B	7.25	12,000	16,516	1,538,877	2022/8/15		
US TREASURY N/B	4.5	26,420	28,717	2,675,590	2011/9/30	US TREASURY N/B	7.5	8,250	10,830	1,009,096	2016/11/15		
US TREASURY N/B	4.5	24,300	26,509	2,469,916	2011/11/30	US TREASURY N/B	7.5	4,690	6,918	644,560	2024/11/15		
US TREASURY N/B	4.5	25,370	27,869	2,596,586	2012/4/30	US TREASURY N/B	7.625	5,000	7,469	695,936	2025/2/15		
US TREASURY N/B	4.5	4,210	4,808	447,987	2015/11/15	US TREASURY N/B	7.875	6,650	9,437	879,320	2021/2/15		
US TREASURY N/B	4.5	18,200	20,671	1,925,937	2016/2/15	US TREASURY N/B	8.0	8,400	12,140	1,131,142	2021/11/15		
US TREASURY N/B	4.5	25,530	29,044	2,706,063	2017/5/15	US TREASURY N/B	8.125	15,000	21,342	1,988,451	2019/8/15		
US TREASURY N/B	4.5	17,000	19,340	1,801,922	2036/2/15	US TREASURY N/B	8.125	1,000	1,450	135,111	2021/5/15		

当期末						当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
国債証券 (アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円		国債証券 (ドイツ)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
US TREASURY N/B	8.125	4,750	6,907	643,575	2021/8/15	DEUTSCHLAND REP	3.25	2,430	2,525	300,873	2015/7/4
US TREASURY N/B	8.5	8,100	11,832	1,102,418	2020/2/15	DEUTSCHLAND REP	3.5	12,600	13,241	1,577,648	2016/1/4
US TREASURY N/B	8.75	5,200	7,369	686,604	2017/5/15	DEUTSCHLAND REP	3.75	3,610	3,852	458,997	2013/7/4
US TREASURY N/B	8.75	5,000	7,454	694,553	2020/5/15	DEUTSCHLAND REP	3.75	24,060	25,797	3,073,470	2015/1/4
US TREASURY N/B	8.75	6,800	10,168	947,364	2020/8/15	DEUTSCHLAND REP	3.75	8,860	9,428	1,123,348	2017/1/4
US TREASURY N/B	8.875	6,750	9,685	902,418	2017/8/15	DEUTSCHLAND REP	3.75	1,800	1,909	227,490	2019/1/4
US TREASURY N/B	8.875	800	1,184	110,336	2019/2/15	DEUTSCHLAND REP	4.0	7,300	7,875	938,343	2016/7/4
US TREASURY N/B	9.0	9,350	13,949	1,299,631	2018/11/15	DEUTSCHLAND REP	4.0	7,650	8,326	991,990	2018/1/4
US TREASURY N/B	9.125	7,500	11,179	1,041,556	2018/5/15	DEUTSCHLAND REP	4.0	12,040	12,415	1,479,200	2037/1/4
小計				132,700,026		DEUTSCHLAND REP	4.25	13,950	15,296	1,822,386	2014/1/4
国債証券 (カナダ)		千カナダドル	千カナダドル			DEUTSCHLAND REP	4.25	8,350	9,164	1,091,863	2014/7/4
CANADA-GOV'T	2.75	7,080	7,267	539,449	2010/12/1	DEUTSCHLAND REP	4.25	10,010	11,014	1,312,208	2017/7/4
CANADA-GOV'T	3.0	4,220	4,416	327,848	2014/6/1	DEUTSCHLAND REP	4.25	8,170	9,019	1,074,604	2018/7/4
CANADA-GOV'T	3.5	2,590	2,759	204,842	2013/6/1	DEUTSCHLAND REP	4.25	7,960	8,664	1,032,283	2039/7/4
CANADA-GOV'T	3.75	6,200	6,548	486,095	2011/9/1	DEUTSCHLAND REP	4.5	9,220	10,075	1,200,408	2013/1/4
CANADA-GOV'T	3.75	1,090	1,161	86,249	2012/6/1	DEUTSCHLAND REP	4.75	11,590	12,831	1,528,719	2028/7/4
CANADA-GOV'T	4.0	2,990	3,118	231,511	2010/9/1	DEUTSCHLAND REP	4.75	10,120	11,354	1,352,791	2034/7/4
CANADA-GOV'T	4.0	6,570	7,245	537,859	2016/6/1	DEUTSCHLAND REP	4.75	2,050	2,423	288,688	2040/7/4
CANADA-GOV'T	4.0	5,790	6,367	472,676	2017/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.0	23,690	25,668	3,058,099	2011/7/4
CANADA-GOV'T	4.0	1,020	1,097	81,471	2041/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.0	16,740	18,325	2,183,273	2012/1/4
CANADA-GOV'T	4.25	3,390	3,767	279,697	2018/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.0	27,400	30,224	3,600,999	2012/7/4
CANADA-GOV'T	4.5	7,870	8,898	660,555	2015/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.25	10,400	10,963	1,306,212	2010/7/4
CANADA-GOV'T	5.0	2,300	2,635	195,669	2014/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.25	15,690	16,822	2,004,177	2011/1/4
CANADA-GOV'T	5.0	7,060	8,807	653,769	2037/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.5	10,460	12,640	1,506,038	2031/1/4
CANADA-GOV'T	5.25	8,030	8,942	663,780	2012/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.625	970	1,173	139,776	2028/1/4
CANADA-GOV'T	5.25	8,850	10,062	746,902	2013/6/1	DEUTSCHLAND REP	6.0	11,490	13,709	1,633,393	2016/6/20
CANADA-GOV'T	5.5	4,130	4,363	323,875	2010/6/1	DEUTSCHLAND REP	6.25	7,370	9,405	1,120,582	2024/1/4
CANADA-GOV'T	5.75	6,960	8,930	662,927	2029/6/1	DEUTSCHLAND REP	6.25	2,190	2,864	341,305	2030/1/4
CANADA-GOV'T	5.75	7,160	9,493	704,693	2033/6/1	DEUTSCHLAND REP	6.5	8,200	10,840	1,291,525	2027/7/4
CANADA-GOV'T	6.0	6,600	7,282	540,585	2011/6/1	国債証券 (イタリア)					
CANADA-GOV'T	8.0	3,750	5,614	416,783	2023/6/1	BTPS	2.75	16,690	16,920	2,015,887	2010/6/15
CANADA-GOV'T	8.0	5,630	8,777	651,550	2027/6/1	BTPS	3.5	10,760	11,044	1,315,789	2011/3/15
小計				9,468,794		BTPS	3.75	7,940	8,177	974,256	2011/2/1
国債証券 (ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ			BTPS	3.75	6,500	6,709	799,423	2011/9/15
BUNDESOBL-146	3.25	8,180	8,376	997,954	2010/4/9	BTPS	3.75	17,160	17,328	2,064,477	2015/8/1
BUNDESOBL-147	2.5	18,410	18,754	2,234,383	2010/10/8	BTPS	3.75	7,170	7,178	855,258	2016/8/1
BUNDESOBL-148	3.5	15,640	16,346	1,947,573	2011/4/8	BTPS	3.75	9,270	8,470	1,009,226	2021/8/1
BUNDESOBL-149	3.5	6,410	6,755	804,850	2011/10/14	BTPS	4.0	5,210	5,345	636,851	2010/3/1
BUNDESOBL-150	4.0	6,190	6,631	790,021	2012/4/13	BTPS	4.0	12,350	12,769	1,521,405	2012/4/15
BUNDESOBL-151	4.25	8,820	9,571	1,140,396	2012/10/12	BTPS	4.0	13,730	13,856	1,650,841	2017/2/1
BUNDESOBL-152	3.5	10,000	10,601	1,263,062	2013/4/12	BTPS	4.0	13,800	11,452	1,364,465	2037/2/1
BUNDESOBL-153	4.0	4,870	5,261	626,802	2013/10/11	BTPS	4.25	5,680	5,917	705,001	2011/9/1
						BTPS	4.25	8,050	8,373	997,631	2012/10/15

当期末						当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
国債証券 (イタリア)						国債証券 (フランス)					
BTPS	4.25	4,760	4,940	588,656	2013/4/15	FRANCE O.A.T.	4.25	16,010	17,079	2,034,847	2017/10/25
BTPS	4.25	15,880	16,491	1,964,783	2013/8/1	FRANCE O.A.T.	4.25	3,470	3,667	436,897	2018/10/25
BTPS	4.25	15,000	15,576	1,855,724	2014/8/1	FRANCE O.A.T.	4.25	11,300	11,931	1,421,539	2019/4/25
BTPS	4.25	6,400	6,624	789,183	2015/2/1	FRANCE O.A.T.	4.25	4,090	4,201	500,536	2023/10/25
BTPS	4.25	16,850	16,883	2,011,524	2019/2/1	FRANCE O.A.T.	4.75	7,750	8,418	1,003,018	2012/10/25
BTPS	4.5	9,060	9,324	1,110,927	2018/2/1	FRANCE O.A.T.	4.75	13,000	14,272	1,700,372	2035/4/25
BTPS	4.5	6,030	6,155	733,357	2018/8/1	FRANCE O.A.T.	5.0	21,650	23,433	2,791,921	2011/10/25
BTPS	4.5	7,200	7,260	865,013	2019/3/1	FRANCE O.A.T.	5.0	9,700	10,561	1,258,280	2012/4/25
BTPS	4.5	9,820	9,839	1,172,294	2020/2/1	FRANCE O.A.T.	5.0	8,750	9,838	1,172,106	2016/10/25
BTPS	4.75	10,240	10,840	1,291,485	2013/2/1	FRANCE O.A.T.	5.5	14,320	15,252	1,817,150	2010/10/25
BTPS	4.75	1,230	1,210	144,241	2023/8/1	FRANCE O.A.T.	5.5	8,090	9,516	1,133,835	2029/4/25
BTPS	5.0	14,510	15,400	1,834,864	2012/2/1	FRANCE O.A.T.	5.75	9,760	12,024	1,432,612	2032/10/25
BTPS	5.0	10,450	10,122	1,206,044	2034/8/1	FRANCE O.A.T.	6.0	4,650	5,703	679,482	2025/10/25
BTPS	5.0	4,060	3,890	463,537	2039/8/1	FRANCE O.A.T.	6.5	3,500	3,852	459,022	2011/4/25
BTPS	5.25	20,670	22,044	2,626,388	2011/8/1	FRANCE O.A.T.	8.5	6,170	7,567	901,621	2012/12/26
BTPS	5.25	19,200	20,928	2,493,361	2017/8/1	FRANCE O.A.T.	8.5	7,880	11,212	1,335,870	2019/10/25
BTPS	5.25	9,920	9,951	1,185,650	2029/11/1	FRANCE O.A.T.	8.5	4,640	6,910	823,293	2023/4/25
BTPS	5.5	9,500	10,052	1,197,702	2010/11/1	国債証券 (オランダ)					
BTPS	5.75	11,900	12,447	1,482,983	2033/2/1	NETHERLANDS GOVT	2.5	1,840	1,859	221,541	2012/1/15
BTPS	6.0	12,330	13,296	1,584,165	2031/5/1	NETHERLANDS GOVT	3.25	8,410	8,447	1,006,476	2015/7/15
BTPS	6.5	14,750	16,720	1,992,092	2027/11/1	NETHERLANDS GOVT	3.75	2,680	2,783	331,619	2014/7/15
BTPS	7.25	6,020	7,382	879,602	2026/11/1	NETHERLANDS GOVT	3.75	1,680	1,609	191,808	2023/1/15
BTPS	9.0	6,790	9,641	1,148,724	2023/11/1	NETHERLANDS GOVT	4.0	4,000	4,169	496,766	2011/1/15
国債証券 (フランス)						NETHERLANDS GOVT	4.0	5,030	5,140	612,458	2018/7/15
BTAN-5YR ISSUE	2.5	1,330	1,351	160,975	2010/7/12	NETHERLANDS GOVT	4.0	6,370	6,207	739,569	2037/1/15
BTAN-5YR ISSUE	3.0	8,840	9,078	1,081,633	2011/1/12	NETHERLANDS GOVT	4.0	8,210	8,517	1,014,721	2016/7/15
BTAN-5YR ISSUE	3.5	17,640	18,370	2,188,637	2011/7/12	NETHERLANDS GOVT	4.25	7,520	7,982	951,032	2013/7/15
BTAN-5YR ISSUE	3.75	10,680	11,231	1,338,071	2012/1/12	NETHERLANDS GOVT	4.5	4,540	4,834	575,945	2017/7/15
BTAN-5YR ISSUE	3.75	3,210	3,386	403,473	2013/1/12	NETHERLANDS GOVT	5.0	7,170	7,691	916,422	2011/7/15
BTAN-5YR ISSUE	4.5	9,120	9,826	1,170,764	2012/7/12	NETHERLANDS GOVT	5.0	6,600	7,161	853,161	2012/7/15
BTAN-5YR ISSUE	4.5	4,680	5,067	603,686	2013/7/12	NETHERLANDS GOVT	5.5	6,890	7,272	866,433	2010/7/15
FRANCE O.A.T.	3.0	2,100	2,102	250,519	2015/10/25	NETHERLANDS GOVT	5.5	4,390	5,048	601,478	2028/1/15
FRANCE O.A.T.	3.25	10,990	11,111	1,323,882	2016/4/25	NETHERLANDS GOVT	7.5	4,120	5,557	662,067	2023/1/15
FRANCE O.A.T.	3.5	18,740	19,420	2,313,730	2015/4/25	国債証券 (スペイン)					
FRANCE O.A.T.	3.75	13,240	13,662	1,627,733	2017/4/25	SPANISH GOV'T	2.75	1,900	1,905	227,067	2012/4/30
FRANCE O.A.T.	3.75	8,350	8,272	985,567	2021/4/25	SPANISH GOV'T	3.15	4,120	3,971	473,185	2016/1/31
FRANCE O.A.T.	4.0	12,720	13,488	1,606,994	2013/4/25	SPANISH GOV'T	3.25	6,510	6,670	794,758	2010/7/30
FRANCE O.A.T.	4.0	10,700	11,365	1,354,090	2013/10/25	SPANISH GOV'T	3.8	10,390	10,363	1,234,720	2017/1/31
FRANCE O.A.T.	4.0	14,560	15,471	1,843,269	2014/4/25	SPANISH GOV'T	3.9	3,500	3,633	432,881	2012/10/31
FRANCE O.A.T.	4.0	2,170	2,311	275,338	2014/10/25	SPANISH GOV'T	4.0	6,980	7,154	852,387	2010/1/31
FRANCE O.A.T.	4.0	6,000	6,247	744,291	2018/4/25	SPANISH GOV'T	4.1	7,690	8,018	955,326	2011/4/30
FRANCE O.A.T.	4.0	3,470	3,424	408,041	2038/10/25	SPANISH GOV'T	4.1	4,120	4,153	494,832	2018/7/30
FRANCE O.A.T.	4.0	8,200	8,110	966,299	2055/4/25						

当期末						当期末							
銘柄	利率	額面金額		評価額		償還年月日	銘柄	利率	額面金額		評価額		償還年月日
		外貨建金額	千ユーロ	千ユーロ	千円				外貨建金額	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券 (スペイン)						国債証券 (オーストリア)							
SPANISH GOV'T	4.2	700	730	87,050	2013/7/30	REP OF AUSTRIA	4.15	3,320	3,079	366,867	2037/3/15		
SPANISH GOV'T	4.2	6,920	6,446	768,056	2037/1/31	REP OF AUSTRIA	4.3	2,310	2,361	281,295	2017/9/15		
SPANISH GOV'T	4.25	2,190	2,286	272,396	2014/1/31	REP OF AUSTRIA	4.3	5,660	5,943	708,116	2014/7/15		
SPANISH GOV'T	4.4	6,640	6,946	827,637	2015/1/31	REP OF AUSTRIA	4.35	2,260	2,296	273,564	2019/3/15		
SPANISH GOV'T	4.75	9,560	10,200	1,215,289	2014/7/30	REP OF AUSTRIA	4.65	5,440	5,690	677,935	2018/1/15		
SPANISH GOV'T	4.8	1,930	2,000	238,333	2024/1/31	REP OF AUSTRIA	5.0	5,350	5,736	683,482	2012/7/15		
SPANISH GOV'T	4.9	5,780	6,107	727,605	2040/7/30	REP OF AUSTRIA	5.25	4,610	4,888	582,464	2011/1/4		
SPANISH GOV'T	5.0	11,590	12,433	1,481,357	2012/7/30	REP OF AUSTRIA	6.25	3,470	4,083	486,549	2027/7/15		
SPANISH GOV'T	5.35	8,350	8,977	1,069,629	2011/10/31	国債証券 (フィンランド)							
SPANISH GOV'T	5.4	9,080	9,741	1,160,545	2011/7/30	FINNISH GOV'T	2.75	2,240	2,288	272,664	2010/9/15		
SPANISH GOV'T	5.5	8,640	9,620	1,146,203	2017/7/30	FINNISH GOV'T	3.875	3,190	3,265	389,025	2017/9/15		
SPANISH GOV'T	5.75	7,270	8,217	979,006	2032/7/30	FINNISH GOV'T	4.25	2,430	2,582	307,720	2012/9/15		
SPANISH GOV'T	6.0	6,550	7,460	888,838	2029/1/31	FINNISH GOV'T	4.25	2,610	2,764	329,395	2015/7/4		
SPANISH GOV'T	6.15	9,180	10,230	1,218,825	2013/1/31	FINNISH GOV'T	4.375	2,100	2,198	261,878	2019/7/4		
国債証券 (ベルギー)						国債証券 (フィンランド)							
BELGIAN 0262	8.0	2,340	2,755	328,328	2012/12/24	FINNISH GOV'T	5.375	3,390	3,752	447,100	2013/7/4		
BELGIAN 0282	8.0	3,870	4,779	569,423	2015/3/28	FINNISH GOV'T	5.75	3,650	3,942	469,693	2011/2/23		
BELGIAN 0291	5.5	6,260	6,947	827,781	2028/3/28	国債証券 (アイルランド)							
BELGIAN 0295	5.75	6,670	7,081	843,694	2010/9/28	IRISH GOVT	4.0	1,980	2,024	241,254	2011/11/11		
BELGIAN 0296	5.0	4,760	5,063	603,231	2011/9/28	IRISH GOVT	4.0	3,010	2,931	349,273	2014/1/15		
BELGIAN 0298	5.0	8,900	9,519	1,134,146	2012/9/28	IRISH GOVT	4.4	3,720	3,393	404,256	2019/6/18		
BELGIAN 0300	5.5	7,200	7,979	950,622	2017/9/28	IRISH GOVT	4.5	3,120	2,915	347,391	2018/10/18		
BELGIAN 0301	4.25	10,650	11,120	1,324,923	2013/9/28	IRISH GOVT	4.5	3,580	3,251	387,430	2020/4/18		
BELGIAN 0303	4.25	690	719	85,692	2014/9/28	IRISH GOVT	4.6	2,970	2,882	343,386	2016/4/18		
BELGIAN 0304	5.0	7,440	7,781	927,087	2035/3/28	IRISH GOVT	5.0	3,320	3,396	404,610	2013/4/18		
BELGIAN 0305	3.0	7,080	7,196	857,429	2010/3/28	国債証券 (ポルトガル)							
BELGIAN 0306	3.75	8,720	8,733	1,040,563	2015/9/28	PORTUGUESE OT'S	3.2	2,880	2,930	349,151	2011/4/15		
BELGIAN 0307	3.25	3,300	3,162	376,806	2016/9/28	PORTUGUESE OT'S	3.35	3,580	3,475	414,071	2015/10/15		
BELGIAN 0308	4.0	4,870	4,653	554,450	2022/3/28	PORTUGUESE OT'S	3.85	3,400	3,173	378,118	2021/4/15		
BELGIAN 0309	4.0	1,620	1,634	194,705	2017/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.1	3,240	2,919	347,856	2037/4/15		
BELGIAN 0310	4.0	5,260	5,436	647,732	2013/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.2	2,810	2,825	336,638	2016/10/15		
BELGIAN 0312	4.0	7,120	7,078	843,356	2018/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.35	2,900	2,916	347,458	2017/10/16		
BELGIAN 0313	3.5	4,170	4,285	510,575	2011/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.375	2,430	2,511	299,266	2014/6/16		
BELGIAN 0314	4.0	5,370	5,516	657,183	2014/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.45	3,590	3,590	427,772	2018/6/15		
BELGIAN 0315	4.0	1,560	1,532	182,531	2019/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.95	1,890	1,908	227,390	2023/10/25		
国債証券 (オーストリア)						国債証券 (ポルトガル)							
REP OF AUSTRIA	3.4	1,500	1,504	179,281	2014/10/20	PORTUGUESE OT'S	5.0	3,460	3,693	440,004	2012/6/15		
REP OF AUSTRIA	3.5	6,110	5,564	662,939	2021/9/15	PORTUGUESE OT'S	5.15	2,790	2,957	352,391	2011/6/15		
REP OF AUSTRIA	3.5	3,830	3,835	456,945	2015/7/15	PORTUGUESE OT'S	5.45	3,350	3,631	432,708	2013/9/23		
REP OF AUSTRIA	3.8	6,280	6,462	769,971	2013/10/20	PORTUGUESE OT'S	5.85	3,130	3,282	391,135	2010/5/20		
REP OF AUSTRIA	3.9	4,010	3,852	459,023	2020/7/15	国債証券 (その他)							
REP OF AUSTRIA	4.0	5,690	5,755	685,702	2016/9/15	HELLENIC REPUBLI	3.1	4,030	4,054	483,015	2010/4/20		
						HELLENIC REPUBLI	3.6	2,670	2,382	283,844	2016/7/20		

当期 末						当期 末							
銘柄	利率	額面金額		評価額		償還年月日	銘柄	利率	額面金額		評価額		償還年月日
		外貨建金額	千ユーロ	千ユーロ	千円				外貨建金額	千英ポンド	千英ポンド	千円	
国債証券 (その他)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円				千英ポンド	千英ポンド	千円			
HELLENIC REPUBLI	3.7	10,020	9,268	1,104,249	2015/7/20	国債証券 (イギリス)							
HELLENIC REPUBLI	3.8	2,130	2,153	256,585	2011/3/20	TREASURY	6.25	4,100	4,460	598,327	2010/11/25		
HELLENIC REPUBLI	3.9	8,890	8,948	1,066,145	2011/8/20	TREASURY	8.0	3,540	4,417	592,575	2013/9/27		
HELLENIC REPUBLI	4.0	1,530	1,476	175,940	2013/8/20	TREASURY	8.0	12,340	17,766	2,382,989	2021/6/7		
HELLENIC REPUBLI	4.1	1,400	1,382	164,727	2012/8/20	TREASURY	8.0	6,430	8,407	1,127,661	2015/12/7		
HELLENIC REPUBLI	4.3	2,110	1,939	231,098	2017/7/20	TREASURY	8.75	4,970	6,976	935,709	2017/8/25		
HELLENIC REPUBLI	4.5	2,700	2,635	314,022	2014/5/20	TREASURY	9.0	3,750	4,402	590,507	2011/7/12		
HELLENIC REPUBLI	4.5	4,740	3,726	443,929	2037/9/20	小計				37,688,428			
HELLENIC REPUBLI	4.6	4,780	4,738	564,534	2013/5/20	国債証券 (スイス)		千スイスフラン	千スイスフラン				
HELLENIC REPUBLI	4.6	3,500	3,269	389,468	2018/7/20	SWISS (GOVT)	2.5	1,270	1,354	108,982	2016/3/12		
HELLENIC REPUBLI	4.6	4,270	3,322	395,891	2040/9/20	SWISS (GOVT)	2.75	860	914	73,619	2012/6/10		
HELLENIC REPUBLI	4.7	6,460	5,663	674,747	2024/3/20	SWISS (GOVT)	3.0	1,550	1,679	135,143	2018/1/8		
HELLENIC REPUBLI	5.25	5,450	5,605	667,883	2012/5/18	SWISS (GOVT)	3.0	2,610	2,830	227,794	2019/5/12		
HELLENIC REPUBLI	5.35	2,450	2,549	303,714	2011/5/18	SWISS (GOVT)	3.0	2,610	2,830	227,794	2019/5/12		
HELLENIC REPUBLI	5.9	4,420	4,497	535,866	2022/10/22	SWISS (GOVT)	3.5	5,490	5,755	463,118	2010/8/7		
HELLENIC REPUBLI	6.0	6,210	6,462	769,897	2010/5/19	SWISS (GOVT)	4.0	4,950	5,360	431,387	2011/6/10		
HELLENIC REPUBLI	6.5	2,860	3,056	364,183	2014/1/11	SWISS (GOVT)	4.0	5,610	6,271	504,661	2013/2/11		
HELLENIC REPUBLI	6.5	6,370	6,849	815,992	2019/10/22	SWISS (GOVT)	4.0	2,140	2,549	205,131	2023/2/11		
小計				204,974,612		SWISS (GOVT)	4.0	2,980	3,611	290,638	2028/4/8		
国債証券 (イギリス)		千英ポンド	千英ポンド			SWISS (GOVT)	4.0	2,980	3,611	290,638	2028/4/8		
TREASURY	3.25	8,470	8,796	1,179,922	2011/12/7	SWISS (GOVT)	4.25	1,470	1,680	135,241	2014/1/6		
TREASURY	4.0	12,730	13,608	1,825,290	2016/9/7	SWISS (GOVT)	4.25	6,330	7,425	597,547	2017/6/5		
TREASURY	4.25	7,920	8,363	1,121,798	2011/3/7	小計				3,173,267			
TREASURY	4.25	6,410	6,407	859,403	2027/12/7	国債証券 (スウェーデン)		千スウェーデン クローナ	千スウェーデン クローナ				
TREASURY	4.25	16,930	16,951	2,273,659	2032/6/7	SWEDEN GOVT	3.0	21,810	22,483	238,104	2016/7/12		
TREASURY	4.25	9,640	9,778	1,311,580	2036/3/7	SWEDEN GOVT	3.75	28,030	30,392	321,861	2017/8/12		
TREASURY	4.25	11,370	11,531	1,546,683	2046/12/7	SWEDEN GOVT	4.25	18,180	20,499	217,092	2019/3/12		
TREASURY	4.25	5,600	5,660	759,307	2049/12/7	SWEDEN GOVT	4.5	21,110	23,833	252,393	2015/8/12		
TREASURY	4.25	10,340	10,734	1,439,883	2055/12/7	SWEDEN GOVT	5.0	30,110	36,288	384,295	2020/12/1		
TREASURY	4.5	14,520	15,822	2,122,264	2013/3/7	SWEDEN GOVT	5.25	24,700	26,787	283,675	2011/3/15		
TREASURY	4.5	5,000	5,461	731,243	2019/3/7	SWEDEN GOVT	5.5	29,600	33,548	355,280	2012/10/8		
TREASURY	4.5	5,880	6,224	834,909	2042/12/7	SWEDEN GOVT	6.75	32,080	39,288	416,063	2014/5/5		
TREASURY	4.75	11,110	11,632	1,560,222	2010/6/7	小計				2,468,767			
TREASURY	4.75	9,190	10,241	1,373,682	2015/9/7	国債証券 (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				
TREASURY	4.75	6,030	6,666	894,132	2020/3/7	NORWEGIAN GOV'T	4.25	13,800	14,368	196,274	2017/5/19		
TREASURY	4.75	3,150	3,370	452,085	2030/12/7	NORWEGIAN GOV'T	5.0	19,050	20,713	282,940	2015/5/15		
TREASURY	4.75	12,030	13,319	1,786,608	2038/12/7	NORWEGIAN GOV'T	6.0	22,950	24,751	338,106	2011/5/16		
TREASURY	5.0	15,930	17,366	2,329,356	2012/3/7	NORWEGIAN GOV'T	6.5	26,110	29,752	406,417	2013/5/15		
TREASURY	5.0	10,840	12,379	1,660,418	2018/3/7	小計				1,223,738			
TREASURY	5.0	12,290	13,457	1,805,077	2025/3/7								
TREASURY	5.0	9,100	10,226	1,371,691	2014/9/7								
TREASURY	5.25	4,310	4,748	636,910	2012/6/7								
TREASURY	6.0	9,550	11,813	1,584,524	2028/12/7								

当 期 末					
銘 柄	利 率	額 面 金 額		評 価 額	
		額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
国債証券 (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 - BULLET	4.0	26,020	26,766	428,000	2010/11/15
DENMARK - BULLET	4.0	32,990	34,425	550,456	2015/11/15
DENMARK - BULLET	4.0	27,430	28,591	457,180	2017/11/15
DENMARK - BULLET	4.5	44,140	49,043	784,212	2039/11/15
DENMARK - BULLET	5.0	32,840	35,703	570,901	2013/11/15
DENMARK - BULLET	6.0	32,600	35,501	567,667	2011/11/15
DENMARK - BULLET	7.0	13,710	18,371	293,758	2024/11/10
小 計				3,652,178	
国債証券 (ポーランド)		千ポーランド ズロチ	千ポーランド ズロチ		
POLAND GOVT BOND	4.25	17,650	17,083	421,627	2011/5/24
POLAND GOVT BOND	4.75	17,730	17,116	422,445	2012/4/25
POLAND GOVT BOND	5.0	13,530	13,041	321,872	2013/10/24
POLAND GOVT BOND	5.25	5,990	5,835	144,029	2013/4/25
POLAND GOVT BOND	5.25	13,230	12,552	309,792	2017/10/25
POLAND GOVT BOND	5.5	3,660	3,478	85,859	2019/10/25
POLAND GOVT BOND	5.75	14,170	14,184	350,065	2010/3/24
POLAND GOVT BOND	5.75	5,810	5,757	142,101	2014/4/25
POLAND GOVT BOND	5.75	11,690	11,116	274,366	2022/9/23
POLAND GOVT BOND	6.0	16,280	16,338	403,224	2010/11/24
POLAND GOVT BOND	6.25	11,900	12,111	298,902	2015/10/24
小 計				3,174,286	
特殊債券(除く金融債) (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		
QUEENSLAND TREAS	6.0	2,020	2,124	127,157	2011/6/14
QUEENSLAND TREAS	6.0	7,390	7,865	470,643	2013/8/14
QUEENSLAND TREAS	6.0	15,190	16,250	972,452	2015/10/14
小 計				1,570,252	
国債証券 (シンガポール)		千シンガ ポールドル	千シンガ ポールドル		
SPR GOV'T	1.625	1,810	1,856	112,981	2013/4/1
SPR GOV'T	2.25	900	946	57,594	2013/7/1
SPR GOV'T	2.5	2,200	2,322	141,339	2012/10/1
SPR GOV'T	2.625	1,800	1,843	112,171	2010/4/1
SPR GOV'T	2.625	200	211	12,847	2012/4/1
SPR GOV'T	2.875	850	920	56,016	2015/7/1
SPR GOV'T	3.125	1,160	1,217	74,074	2011/2/1
SPR GOV'T	3.125	2,100	2,250	136,941	2022/9/1

当 期 末					
銘 柄	利 率	額 面 金 額		評 価 額	
		額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
国債証券 (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	
SPR GOV'T	3.25	1,330	1,457	88,690	2020/9/1
SPR GOV'T	3.5	2,100	2,281	138,862	2012/7/1
SPR GOV'T	3.5	1,760	1,899	115,623	2027/3/1
SPR GOV'T	3.625	2,700	2,886	175,694	2011/7/1
SPR GOV'T	3.625	2,320	2,601	158,351	2014/7/1
SPR GOV'T	3.75	2,870	3,284	199,890	2016/9/1
SPR GOV'T	4.0	1,450	1,713	104,289	2018/9/1
SPR GOV'T	4.625	2,150	2,271	138,247	2010/7/1
小 計				1,823,616	
国債証券 (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		
MALAYSIAN GOV'T	3.461	3,570	3,603	91,462	2013/7/31
MALAYSIAN GOV'T	3.502	3,820	3,316	84,160	2027/5/31
MALAYSIAN GOV'T	3.702	8,740	8,911	226,166	2013/2/25
MALAYSIAN GOV'T	3.718	6,820	6,968	176,866	2012/6/15
MALAYSIAN GOV'T	3.756	14,710	15,014	381,079	2011/4/28
MALAYSIAN GOV'T	3.814	6,790	6,737	170,992	2017/2/15
MALAYSIAN GOV'T	3.869	13,050	13,245	336,173	2010/4/13
MALAYSIAN GOV'T	4.24	7,360	7,489	190,090	2018/2/7
MALAYSIAN GOV'T	4.262	10,510	10,752	272,900	2016/9/15
MALAYSIAN GOV'T	5.094	6,940	7,565	192,007	2014/4/30
MALAYSIAN GOV'T	5.248	2,540	2,766	70,214	2028/9/15
小 計				2,192,114	
合 計				404,110,084	

(注) 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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外		
US 5YR NOTE	463	-
US 10YR NOTE	344	-
US LONG BOND	285	-
国		
EURO-SCHATZ	554	-
EURO-BOBL FU	628	-
EURO-BUND FU	1,061	-

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

投資信託財産の構成（2009年2月23日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
中央三井外国債券マザーファンド	8,439,087	99.9
コール・ローン等、その他	4,997	0.1
投資信託財産総額	8,444,084	100.0

（注1）中央三井外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（411,966,589千円）の投資信託財産総額（416,282,213千円）に対する比率は99.0%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。当期末は、1米ドル=93.17円、1カナダドル=74.23円、1ユーロ=119.14円、1英ポンド=134.13円、1スイスフラン=80.47円、1スウェーデンクローナ=10.59円、1ノルウェークローネ=13.66円、1デンマーククローネ=15.99円、1ポーランドズロチ=24.68円、1オーストラリアドル=59.84円、1シンガポールドル=60.86円、1マレーシアリンギット=25.38円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 (2009年2月23日現在)
(A) 資 産	8,444,084,125 円
中央三井外国債券マザーファンド(評価額)	8,439,087,450
未 収 入 金	4,996,675
(B) 負 債	35,083,551
未 払 解 約 金	4,996,675
未 払 信 託 報 酬	30,086,876
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	8,409,000,574
元 本	5,977,082,977
次 期 繰 越 損 益 金	2,431,917,597
(D) 受 益 権 総 口 数	5,977,082,977 口
1万口当たり基準価額(C / D)	14,069 円

損益の状況

項 目	当 期 自 2008年2月22日 至 2009年2月23日
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,436,869,218 円
売 買 益	90,867,584
売 買 損	1,527,736,802
(B) 信 託 報 酬 等	60,481,112
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	1,497,350,330
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	282,701,741
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,646,566,186
(配 当 等 相 当 額)	(3,273,549,011)
(売 買 損 益 相 当 額)	(373,017,175)
(F) 計 (C + D + E)	2,431,917,597
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	2,431,917,597
追 加 信 託 差 損 益 金	3,646,566,186
(配 当 等 相 当 額)	(3,286,998,602)
(売 買 損 益 相 当 額)	(359,567,584)
分 配 準 備 積 立 金	744,062,083
繰 越 損 益 金	1,958,710,672

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

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

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

< 注記事項 >（本運用報告書作成時点では監査未了です。）

当ファンドの期首元本額は4,640,661,905円、期中追加設定元本額は2,276,796,857円、期中一部解約元本額は940,375,785円です。

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（299,533,532円）、費用控除後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（3,286,998,602円）及び分配準備積立金（444,528,551円）より分配対象収益は、4,031,060,685円（1万口当たり6,744.19円）であります。基準価額の水準等を勘案し、分配を行っておりません。

< 信託約款変更のお知らせ >

- ・約款内の用語の統一を図るため「追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法」の記載内容に所要の変更を行いました。

中央三井外国債券 マザーファンド

運用報告書 第8期(決算日2009年2月9日)

親投資信託「中央三井外国債券マザーファンド」は、2009年2月9日に第8期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
運用方針	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権を行使したものに限定することとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資には、制限を設けません。

中央三井アセットマネジメント
東京都港区芝三丁目23番1号

お問合せ窓口(お客様相談窓口) TEL03-5440-0190

(受付時間: 営業日の9:00~17:00(本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は9:00~12:00))

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産
	円	期中騰落率		期中騰落率			
4期(2005年2月7日)	14,372	6.1	275.360	6.4	96.3	1.8	172,346
5期(2006年2月7日)	16,148	12.4	309.262	12.3	97.0	1.0	378,954
6期(2007年2月7日)	17,479	8.2	335.795	8.6	97.2	0.8	462,868
7期(2008年2月7日)	17,870	2.2	344.199	2.5	97.6	0.5	494,028
8期(2009年2月9日)	14,804	17.2	281.433	18.2	97.2	0.9	412,110

(注) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

【報告書の記載について】

- ・原則として、数量、額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数で表記することがあります。
- ・ - 印は、組み入れ、異動等の該当がないことを示します。

当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマ ーク		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %		
(期 首) 2008年2月7日	17,870	-	344.199	-	97.6	0.5
2月末	17,939	0.4	348.086	1.1	96.8	1.0
3月末	17,654	1.2	336.729	2.2	96.8	1.0
4月末	17,997	0.7	343.696	0.1	96.5	1.2
5月末	18,045	1.0	345.351	0.3	96.4	1.3
6月末	18,372	2.8	350.987	2.0	97.4	0.4
7月末	18,648	4.4	358.078	4.0	97.8	0.3
8月末	18,379	2.8	353.112	2.6	97.2	0.8
9月末	17,331	3.0	337.852	1.8	97.2	0.7
10月末	15,281	14.5	291.373	15.3	95.8	1.8
11月末	15,330	14.2	293.992	14.6	97.4	0.6
12月末	15,655	12.4	300.028	12.8	97.5	0.7
2009年1月末	14,321	19.9	278.647	19.0	95.2	2.2
(期 末) 2009年2月9日	14,804	17.2	281.433	18.2	97.2	0.9

(注1) 騰落率は期首比です。

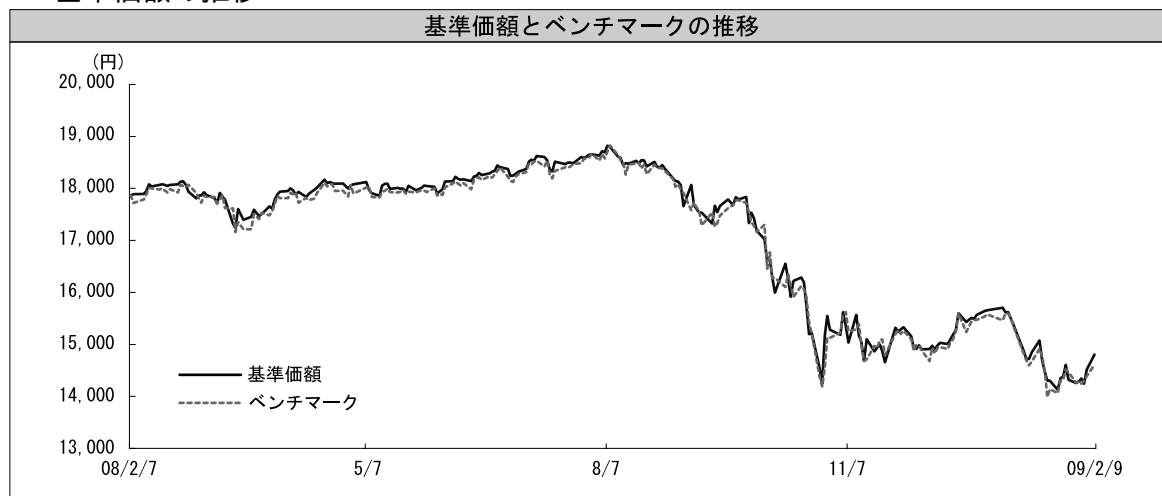
(注2) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

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

シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。なお、本資料においては、基準価額への反映を考慮して各期日の前営業日（現地ベース）の指数を掲載しています。

当期（2008年2月8日～2009年2月9日）の運用状況と今後の運用方針

1. 基準価額の推移



(注) ベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しております。

基準価額の期中高値・安値

決算期	期首(前期末)	期中高値	期中安値	期末
第8期	2008年2月7日	2008年8月7日	2009年1月26日	2009年2月9日
	17,870円	18,820円	14,126円	14,804円

基準価額とベンチマークとの差異

	期首(前期末)	期末	差額 (-)	騰落率 (/) × 100
基準価額	17,870円	14,804円	3,066円	17.2%
ベンチマーク	344.199	281.433	62.766	18.2%

当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離(1.0%)が生じた要因は、為替評価要因 等です。

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

2. 基準価額の主な変動要因と市場動向

2008年2月(期首)～8月上旬

基準価額	上昇
外国債券市場	<p>< マイナス要因 > 長期金利は、金融機関への信用不安後退を背景に堅調な推移となった株価や、米連邦準備制度理事会(FRB)の利下げ休止観測、さらには原油等商品価格の高騰を受けたインフレ懸念の高まりから、上昇(債券価格は下落)となりました。</p>
外国為替市場	<p>< プラス要因 > 米ドル円為替は、米欧金融機関の資本増強を好感した株高や過度な信用不安の後退からドル高円安基調となり、8月には原油等商品価格反落によるドル買戻しにより110円台までドル上昇となりました。円は他の主要通貨に対しても、円安推移となりました。</p>

2008年8月中旬～10月下旬

基準価額	下落
外国債券市場	<p>< プラス要因 > 長期金利は、世界的な景気減速懸念や原油価格下落によるインフレ懸念の後退、9月には金融システム不安から低下(債券価格は上昇)となりました。その後は、金融市場の混乱の中、需給悪化懸念や株価急落を材料に乱高下推移となりました。</p>
外国為替市場	<p>< マイナス要因 > 米ドル円為替は、9月の金融システム不安でドル安推移となり、以降も株価急落や米国景気悪化懸念の高まりから円高が加速しました。円は他の主要通貨に対しても、世界的な金融危機による株価急落に加え欧州景気に対する悲観的な見方が強まると、投資家のリスク回避による円買いから円全面高の展開となりました。</p>

2008年11月上旬～2009年2月(期末)

基準価額	下落
外国債券市場	<p><プラス要因></p> <p>長期金利は、12月末まで景気回復と金融安定化に向けた主要国中央銀行による政策金利下げから、大幅に低下（債券価格は上昇）しました。しかし、年明け以降は各国政府の景気対策を受けた国債増発懸念の高まりから、金利は反発基調（債券価格は下落基調）となりました。</p>
外国為替市場	<p><マイナス要因></p> <p>米ドル円為替は、F R Bによる積極的なゼロ金利政策と量的緩和策の導入を受け、円高推移となりました。一方、12月にユーロへの資金回帰などから、一時ユーロに対して円安となりましたが、その後は欧州での景気後退の深刻化、中央政府（又は中央銀行）の長期的な債務履行能力についての格付けである長期ソブリン格付けの引き下げなどを背景に、再び円高推移となりました。また、英国における追加利下げ観測から、英ポンドに対して円高が加速しました。</p>

3. 運用経過

【前期における今後の運用方針】

今後の運用にあたりましては、当ファンドの運用の基本方針に従い、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、ヘッジなし・円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

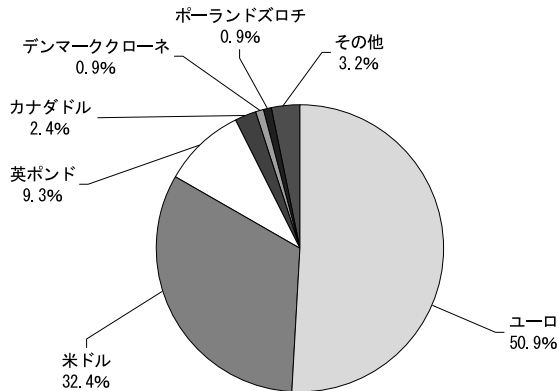
(1) ポートフォリオ構成

当ファンドは、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行っています。ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

(2) 債券組入比率

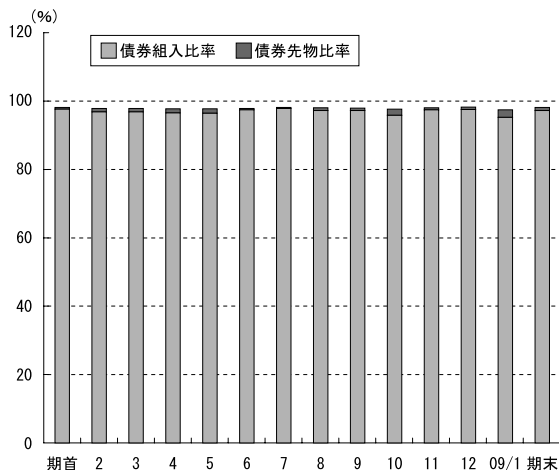
債券の組入比率は、期を通じて高位を維持しました。また、ファンドのキャッシュフローへ効率的に対応するためキャッシュマネジメントの一環で海外債券先物と為替先物予約を利用しました。

通貨別構成比(期末)



(注) 構成比は、債券評価総額に対する各通貨の評価額の比率です。

債券等組入比率の推移(月末値)



4. 今後の運用方針

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

1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	0円 (0)
(b) 保 管 費 用 等	6
合 計	6

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買及び取引の状況（2008年2月8日から2009年2月9日まで）

(1) 公社債

			買 付 額	売 付 額	
外	ア	メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 489,567	千米ドル 346,978
	カ	ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 31,326	千カナダドル 25,628
	ユ	ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
		ド イ ツ	国 債 証 券	84,742	117,672
		イ タ リ ア	国 債 証 券	77,309	86,655
		フ ラ ン ス	国 債 証 券	93,663	101,388
		オ ラ ン ダ	国 債 証 券	14,682	24,513
		ス ベ イ ン	国 債 証 券	44,201	34,768
		ベ ル ギ ー	国 債 証 券	22,049	21,772
		オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,875	16,015
		フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	3,454	4,756
		ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	9,165	4,031
		ポ ル ト ガ ル	国 債 証 券	7,594	6,452
		そ の 他	国 債 証 券	17,894	15,781
国	イ	ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 111,087	千英ポンド 33,221
	ス	イ ス	国 債 証 券	千スイスフラン 4,930	千スイスフラン 8,910
	ス	ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 44,203	千スウェーデンクローナ 49,297
	ノ	ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 11,773	千ノルウェークローネ 31,184
	デ	ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 67,208	千デンマーククローネ 51,533
	ポ	ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 39,676	千ポーランドズロチ 36,803
	オ	ー ス ト ラ リ ア	特 殊 債 券	千オーストラリアドル 10,012	千オーストラリアドル 9,811
	シ	ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 7,467	千シンガポールドル 4,820
	マ	レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 27,538	千マレーシアリンギット 25,505

(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。)

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国 債 券 先 物 取 引	百万円 72,861	百万円 71,189	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡代金です。

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

主要な売買銘柄 (2008年2月8日から2009年2月9日まで)

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
US TREASURY N/B 1.75% (アメリカ)	3,441,194	US TREASURY N/B 6% (アメリカ)	6,814,581
FRANCE O.A.T. 5% (ユーロ・フランス)	3,232,484	US TREASURY N/B 3.5% (アメリカ)	5,663,431
US TREASURY N/B 4.5% (アメリカ)	2,812,206	BTPS 4.5% (ユーロ・イタリア)	4,531,714
US TREASURY N/B 4.5% (アメリカ)	2,781,505	DEUTSCHLAND REP 4.5% (ユーロ・ドイツ)	4,406,809
US TREASURY N/B 2.875% (アメリカ)	2,767,195	FRANCE O.A.T. 4% (ユーロ・フランス)	4,376,247
US TREASURY N/B 4.75% (アメリカ)	2,584,397	BTPS 4.25% (ユーロ・イタリア)	3,803,650
BTPS 3.75% (ユーロ・イタリア)	2,485,407	US TREASURY N/B 4.875% (アメリカ)	3,652,107
US TREASURY N/B 1.5% (アメリカ)	2,454,653	BUNDESOBL-145 3.5% (ユーロ・ドイツ)	2,486,570
US TREASURY N/B 4.5% (アメリカ)	2,417,851	US TREASURY N/B 6.5% (アメリカ)	2,298,722
TREASURY 4.5% (イギリス)	2,380,777	BUNDESOBL-144 3.25% (ユーロ・ドイツ)	2,109,134

(注1) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

利害関係人との取引状況等 (2008年2月8日から2009年2月9日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項第16号には「当該投資信託財産の計算期間中における利害関係人等との取引の状況」を運用報告書に表示しなければならない旨が規定されていますが、これまで「為替取引の状況」を記載しておりませんでした。今後は規則の定めに従い記載することと致します。

なお、当ファンドでは、従来から、利害関係人である中央三井信託銀行株式会社との為替取引がりましたが、約定価格は市場実勢に基づいたもので当該取引をしたことによるファンドへの不利益はございません。

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 201,338	百万円 201,338	% 100.0	百万円 198,865	百万円 198,865	% 100.0
為替直物取引	51,184	50,232	98.1	49,766	48,813	98.1

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	5,145千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	- 千円
(B) / (A)	0.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、中央三井信託銀行株式会社です。

組入資産の明細（2009年2月9日現在）

(1) 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 1,249,580	千米ドル 1,414,445	千円 129,930,939	% 31.5	% -	% 13.9	% 13.2	% 4.4
カ ナ ダ	千カナダドル 109,280	千カナダドル 126,637	9,586,425	2.3	-	1.4	0.7	0.3
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	374,890	405,214	48,297,567	11.7	-	5.6	4.6	1.6
イ タ リ ア	376,880	390,532	46,547,528	11.3	-	6.8	3.3	1.2
フ ラ ン ス	321,470	345,119	41,134,819	10.0	-	5.6	3.6	0.7
オ ラ ン ダ	79,450	83,696	9,975,726	2.4	-	1.4	0.7	0.3
ス ペ イ ン	139,590	146,059	17,408,828	4.2	-	2.2	1.7	0.4
ベルギー	107,850	113,143	13,485,625	3.3	-	1.7	1.1	0.4
オーストリア	59,840	61,307	7,307,267	1.8	-	1.3	0.4	0.1
フィンランド	19,610	20,624	2,458,287	0.6	-	0.2	0.3	0.1
アイルランド	21,700	20,879	2,488,653	0.6	-	0.4	0.2	-
ポルトガル	39,450	39,817	4,745,906	1.2	-	0.7	0.4	0.1
そ の 他	86,990	83,577	9,961,564	2.4	-	1.2	0.9	0.3
イ ギ リ ス	千英ポンド 253,470	千英ポンド 274,548	37,415,432	9.1	-	6.4	2.1	0.5
ス イ ス	千スイスフラン 35,260	千スイスフラン 39,211	3,105,970	0.8	-	0.4	0.3	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 205,620	千スウェーデンクローナ 229,369	2,607,929	0.6	-	0.5	0.2	-
ノルウェー	千ノルウェークローネ 81,910	千ノルウェークローネ 90,024	1,228,838	0.3	-	0.1	0.2	-
デンマーク	千デンマーククローネ 209,730	千デンマーククローネ 224,999	3,599,993	0.9	-	0.5	0.3	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 131,640	千ポーランドズロチ 131,422	3,434,081	0.8	-	0.3	0.3	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 24,600	千オーストラリアドル 26,117	1,614,298	0.4	-	0.2	0.1	-
シンガポール	千シンガポールドル 27,700	千シンガポールドル 29,665	1,826,181	0.4	-	0.2	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 84,850	千マレーシアリンギット 88,536	2,259,450	0.5	-	0.3	0.2	0.1
合 計	-	-	400,421,316	97.2	-	51.2	34.9	11.1

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注4) 株式及び新株予約権証券（新株引受権証券を含む。）は組み入れていません。

(2) 外国(外貨建)公社債銘柄別

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
国債証券 (アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円		国債証券 (アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,920	1,094,999	2011/12/15	US TREASURY N/B	4.5	9,500	10,883	999,752	2038/5/15
US TREASURY N/B	1.5	27,120	26,598	2,443,364	2013/12/31	US TREASURY N/B	4.625	31,700	34,406	3,160,616	2011/8/31
US TREASURY N/B	1.75	37,240	37,656	3,459,083	2011/11/15	US TREASURY N/B	4.625	19,040	20,741	1,905,332	2011/10/31
US TREASURY N/B	11.25	9,550	14,171	1,301,776	2015/2/15	US TREASURY N/B	4.625	7,910	8,731	802,055	2012/7/31
US TREASURY N/B	2.0	6,500	6,527	599,655	2013/11/30	US TREASURY N/B	4.625	9,450	10,650	978,349	2016/11/15
US TREASURY N/B	2.75	15,630	16,323	1,499,484	2013/2/28	US TREASURY N/B	4.625	23,500	26,444	2,429,223	2017/2/15
US TREASURY N/B	2.875	17,740	18,636	1,711,967	2013/1/31	US TREASURY N/B	4.75	22,670	24,919	2,289,085	2012/1/31
US TREASURY N/B	3.375	20,810	22,273	2,046,016	2013/7/31	US TREASURY N/B	4.75	18,670	20,607	1,892,960	2012/5/31
US TREASURY N/B	3.5	6,500	6,686	614,233	2010/2/15	US TREASURY N/B	4.75	29,400	33,607	3,087,219	2014/5/15
US TREASURY N/B	3.625	33,680	35,027	3,217,598	2010/6/15	US TREASURY N/B	4.75	11,150	13,052	1,198,999	2037/2/15
US TREASURY N/B	3.625	10,000	10,798	991,944	2013/5/15	US TREASURY N/B	4.875	18,000	19,548	1,795,705	2011/4/30
US TREASURY N/B	3.75	9,840	10,476	962,373	2018/11/15	US TREASURY N/B	4.875	6,900	7,496	688,601	2011/5/31
US TREASURY N/B	3.875	14,000	14,650	1,345,820	2010/7/15	US TREASURY N/B	4.875	9,960	10,873	998,841	2011/7/31
US TREASURY N/B	3.875	4,200	4,409	405,072	2010/9/15	US TREASURY N/B	4.875	2,830	3,114	286,122	2012/2/15
US TREASURY N/B	3.875	18,200	19,735	1,812,914	2012/10/31	US TREASURY N/B	4.875	12,000	13,762	1,264,223	2016/8/15
US TREASURY N/B	3.875	16,200	17,635	1,619,971	2013/2/15	US TREASURY N/B	5.0	25,960	28,134	2,584,403	2012/2/15
US TREASURY N/B	3.875	7,980	8,578	788,021	2018/5/15	US TREASURY N/B	5.0	2,730	3,320	305,008	2037/5/15
US TREASURY N/B	4.0	49,990	51,895	4,767,154	2010/3/15	US TREASURY N/B	5.0	27,050	29,700	2,728,247	2011/8/15
US TREASURY N/B	4.0	6,500	6,758	620,833	2010/4/15	US TREASURY N/B	5.125	9,010	9,858	905,574	2011/6/30
US TREASURY N/B	4.0	10,000	11,035	1,013,761	2014/2/15	US TREASURY N/B	5.125	27,000	31,497	2,893,331	2016/5/15
US TREASURY N/B	4.0	20,020	22,072	2,027,538	2015/2/15	US TREASURY N/B	5.25	4,140	4,875	447,863	2028/11/15
US TREASURY N/B	4.0	17,000	18,551	1,704,117	2012/11/15	US TREASURY N/B	5.25	4,650	5,482	503,635	2029/2/15
US TREASURY N/B	4.125	12,000	12,626	1,159,847	2010/8/15	US TREASURY N/B	5.375	7,390	8,936	820,872	2031/2/15
US TREASURY N/B	4.125	18,200	19,819	1,820,620	2012/8/31	US TREASURY N/B	5.5	9,660	11,690	1,073,853	2028/8/15
US TREASURY N/B	4.125	12,000	13,247	1,216,944	2015/5/15	US TREASURY N/B	5.75	7,200	7,756	712,546	2010/8/15
US TREASURY N/B	4.25	7,500	7,943	729,694	2010/10/15	US TREASURY N/B	6.0	840	1,065	97,887	2026/2/15
US TREASURY N/B	4.25	18,190	19,926	1,830,455	2012/9/30	US TREASURY N/B	6.125	18,160	23,474	2,156,380	2027/11/15
US TREASURY N/B	4.25	6,930	7,696	707,012	2013/8/15	US TREASURY N/B	6.125	6,200	8,093	743,506	2029/8/15
US TREASURY N/B	4.25	11,250	12,557	1,153,560	2013/11/15	US TREASURY N/B	6.25	4,660	5,883	540,468	2023/8/15
US TREASURY N/B	4.25	12,550	14,042	1,289,923	2014/8/15	US TREASURY N/B	6.25	7,520	10,023	920,797	2030/5/15
US TREASURY N/B	4.25	9,230	10,330	948,949	2014/11/15	US TREASURY N/B	6.5	17,340	18,361	1,686,681	2010/2/15
US TREASURY N/B	4.25	6,000	6,674	613,079	2015/8/15	US TREASURY N/B	6.5	5,150	6,888	632,817	2026/11/15
US TREASURY N/B	4.25	12,950	14,259	1,309,846	2017/11/15	US TREASURY N/B	6.625	2,500	3,391	311,534	2027/2/15
US TREASURY N/B	4.375	25,300	26,938	2,474,577	2010/12/15	US TREASURY N/B	6.875	5,850	8,084	742,677	2025/8/15
US TREASURY N/B	4.375	21,500	23,633	2,170,946	2012/8/15	US TREASURY N/B	7.125	6,550	8,836	811,707	2023/2/15
US TREASURY N/B	4.375	6,100	6,817	626,274	2038/2/15	US TREASURY N/B	7.25	5,670	7,221	663,346	2016/5/15
US TREASURY N/B	4.5	5,000	5,319	488,652	2010/11/15	US TREASURY N/B	7.25	12,000	16,265	1,494,160	2022/8/15
US TREASURY N/B	4.5	26,420	28,640	2,630,955	2011/9/30	US TREASURY N/B	7.5	8,250	10,670	980,225	2016/11/15
US TREASURY N/B	4.5	24,300	26,426	2,427,515	2011/11/30	US TREASURY N/B	7.5	4,690	6,832	627,655	2024/11/15
US TREASURY N/B	4.5	25,370	27,756	2,549,699	2012/4/30	US TREASURY N/B	7.625	5,000	7,372	677,252	2025/2/15
US TREASURY N/B	4.5	4,210	4,766	437,851	2015/11/15	US TREASURY N/B	7.875	6,650	9,282	852,734	2021/2/15
US TREASURY N/B	4.5	18,200	20,497	1,882,923	2016/2/15	US TREASURY N/B	8.0	8,400	11,951	1,097,876	2021/11/15
US TREASURY N/B	4.5	25,530	28,509	2,618,912	2017/5/15	US TREASURY N/B	8.125	15,000	20,969	1,926,261	2019/8/15
US TREASURY N/B	4.5	17,000	19,032	1,748,282	2036/2/15	US TREASURY N/B	8.125	1,000	1,426	131,015	2021/5/15

中央三井外国債券マザーファンド - 第 8 期 -

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
国債証券 (アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円		国債証券 (ドイツ)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
US TREASURY N/B	8.125	4,750	6,796	624,368	2021/8/15	DEUTSCHLAND REP	3.25	2,430	2,483	296,047	2015/7/4
US TREASURY N/B	8.5	8,100	11,636	1,068,897	2020/2/15	DEUTSCHLAND REP	3.5	12,600	13,028	1,552,854	2016/1/4
US TREASURY N/B	8.75	5,200	7,252	666,203	2017/5/15	DEUTSCHLAND REP	3.75	3,610	3,821	455,490	2013/7/4
US TREASURY N/B	8.75	5,000	7,336	673,950	2020/5/15	DEUTSCHLAND REP	3.75	24,060	25,442	3,032,461	2015/1/4
US TREASURY N/B	8.75	6,800	9,994	918,134	2020/8/15	DEUTSCHLAND REP	3.75	8,860	9,232	1,100,376	2017/1/4
US TREASURY N/B	8.875	6,750	9,524	874,955	2017/8/15	DEUTSCHLAND REP	3.75	1,800	1,859	221,664	2019/1/4
US TREASURY N/B	8.875	800	1,163	106,844	2019/2/15	DEUTSCHLAND REP	4.0	7,300	7,733	921,770	2016/7/4
US TREASURY N/B	9.0	9,350	13,702	1,258,677	2018/11/15	DEUTSCHLAND REP	4.0	7,650	8,098	965,235	2018/1/4
US TREASURY N/B	9.125	7,500	10,965	1,007,266	2018/5/15	DEUTSCHLAND REP	4.0	12,040	12,044	1,435,621	2037/1/4
小 計				129,930,939		DEUTSCHLAND REP	4.25	13,950	15,137	1,804,279	2014/1/4
国債証券 (カナダ)		千カナダドル	千カナダドル			DEUTSCHLAND REP	4.25	8,350	9,056	1,079,433	2014/7/4
CANADA-GOV'T	2.75	7,080	7,282	551,268	2010/12/1	DEUTSCHLAND REP	4.25	10,010	10,794	1,286,630	2017/7/4
CANADA-GOV'T	3.0	4,220	4,407	333,634	2014/6/1	DEUTSCHLAND REP	4.25	8,170	8,817	1,051,003	2018/7/4
CANADA-GOV'T	3.5	2,590	2,758	208,807	2013/6/1	DEUTSCHLAND REP	4.25	7,960	8,408	1,002,262	2039/7/4
CANADA-GOV'T	3.75	6,200	6,562	496,768	2011/9/1	DEUTSCHLAND REP	4.5	9,220	10,000	1,191,901	2013/1/4
CANADA-GOV'T	3.75	1,090	1,162	87,994	2012/6/1	DEUTSCHLAND REP	4.75	11,590	12,476	1,487,090	2028/7/4
CANADA-GOV'T	4.0	2,990	3,126	236,648	2010/9/1	DEUTSCHLAND REP	4.75	10,120	11,065	1,318,862	2034/7/4
CANADA-GOV'T	4.0	6,570	7,179	543,478	2016/6/1	DEUTSCHLAND REP	4.75	2,050	2,350	280,135	2040/7/4
CANADA-GOV'T	4.0	5,790	6,302	477,114	2017/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.0	23,690	25,594	3,050,629	2011/7/4
CANADA-GOV'T	4.0	1,020	1,066	80,733	2041/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.0	16,740	18,235	2,173,515	2012/1/4
CANADA-GOV'T	4.25	3,390	3,727	282,156	2018/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.0	27,400	30,022	3,578,343	2012/7/4
CANADA-GOV'T	4.5	7,870	8,847	669,734	2015/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.25	10,400	10,977	1,308,372	2010/7/4
CANADA-GOV'T	5.0	2,300	2,632	199,246	2014/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.25	15,690	16,793	2,001,558	2011/1/4
CANADA-GOV'T	5.0	7,060	8,592	650,415	2037/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.5	10,460	12,341	1,471,013	2031/1/4
CANADA-GOV'T	5.25	8,030	8,950	677,539	2012/6/1	DEUTSCHLAND REP	5.625	970	1,144	136,355	2028/1/4
CANADA-GOV'T	5.25	8,850	10,062	761,760	2013/6/1	DEUTSCHLAND REP	6.0	11,490	13,690	1,631,751	2016/6/20
CANADA-GOV'T	5.5	4,130	4,374	331,161	2010/6/1	DEUTSCHLAND REP	6.25	7,370	9,205	1,097,247	2024/1/4
CANADA-GOV'T	5.75	6,960	8,777	664,480	2029/6/1	DEUTSCHLAND REP	6.25	2,190	2,802	334,035	2030/1/4
CANADA-GOV'T	5.75	7,160	9,306	704,496	2033/6/1	DEUTSCHLAND REP	6.5	8,200	10,579	1,260,987	2027/7/4
CANADA-GOV'T	6.0	6,600	7,305	553,054	2011/6/1	国債証券 (イタリア)					
CANADA-GOV'T	8.0	3,750	5,563	421,139	2023/6/1	BTPS	2.75	16,690	16,890	2,013,152	2010/6/15
CANADA-GOV'T	8.0	5,630	8,649	654,791	2027/6/1	BTPS	3.5	10,760	11,061	1,318,393	2011/3/15
小 計				9,586,425		BTPS	3.75	7,940	8,181	975,138	2011/2/1
国債証券 (ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ			BTPS	3.75	6,500	6,695	798,054	2011/9/15
BUNDESUBL-146	3.25	8,180	8,379	998,763	2010/4/9	BTPS	3.75	17,160	17,194	2,049,391	2015/8/1
BUNDESUBL-147	2.5	18,410	18,734	2,232,907	2010/10/8	BTPS	3.75	7,170	7,094	845,619	2016/8/1
BUNDESUBL-148	3.5	15,640	16,334	1,946,899	2011/4/8	BTPS	3.75	9,270	8,504	1,013,627	2021/8/1
BUNDESUBL-149	3.5	6,410	6,727	801,826	2011/10/14	BTPS	4.0	5,210	5,337	636,224	2010/3/1
BUNDESUBL-150	4.0	6,190	6,596	786,184	2012/4/13	BTPS	4.0	12,350	12,778	1,523,074	2012/4/15
BUNDESUBL-151	4.25	8,820	9,496	1,131,887	2012/10/12	BTPS	4.0	13,730	13,709	1,634,023	2017/2/1
BUNDESUBL-152	3.5	10,000	10,489	1,250,183	2013/4/12	BTPS	4.0	13,800	11,587	1,381,157	2037/2/1
BUNDESUBL-153	4.0	4,870	5,218	621,986	2013/10/11	BTPS	4.25	5,680	5,907	704,079	2011/9/1
						BTPS	4.25	8,050	8,372	997,858	2012/10/15

当期						期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
国債証券 (イタリア)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		国債証券 (フランス)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS	4.25	4,760	4,933	588,052	2013/4/15	FRANCE O.A.T.	4.25	16,010	16,733	1,994,483	2017/10/25
BTPS	4.25	15,880	16,467	1,962,768	2013/8/1	FRANCE O.A.T.	4.25	3,470	3,598	428,850	2018/10/25
BTPS	4.25	15,000	15,540	1,852,212	2014/8/1	FRANCE O.A.T.	4.25	11,300	11,686	1,392,909	2019/4/25
BTPS	4.25	6,400	6,602	786,997	2015/2/1	FRANCE O.A.T.	4.25	4,090	4,138	493,288	2023/10/25
BTPS	4.25	16,850	16,732	1,994,293	2019/2/1	FRANCE O.A.T.	4.75	7,750	8,390	1,000,021	2012/10/25
BTPS	4.5	9,060	9,204	1,097,139	2018/2/1	FRANCE O.A.T.	4.75	13,000	13,979	1,666,176	2035/4/25
BTPS	4.5	6,030	6,092	726,190	2018/8/1	FRANCE O.A.T.	5.0	21,650	23,379	2,786,642	2011/10/25
BTPS	4.5	7,200	7,196	857,738	2019/3/1	FRANCE O.A.T.	5.0	9,700	10,541	1,256,496	2012/4/25
BTPS	4.5	9,820	9,814	1,169,743	2020/2/1	FRANCE O.A.T.	5.0	8,750	9,681	1,153,930	2016/10/25
BTPS	4.75	10,240	10,843	1,292,393	2013/2/1	FRANCE O.A.T.	5.5	14,320	15,273	1,820,473	2010/10/25
BTPS	4.75	1,230	1,212	144,536	2023/8/1	FRANCE O.A.T.	5.5	8,090	9,356	1,115,228	2029/4/25
BTPS	5.0	14,510	15,416	1,837,537	2012/2/1	FRANCE O.A.T.	5.75	9,760	11,777	1,403,770	2032/10/25
BTPS	5.0	10,450	10,245	1,221,123	2034/8/1	FRANCE O.A.T.	6.0	4,650	5,613	669,126	2025/10/25
BTPS	5.0	4,060	3,941	469,829	2039/8/1	FRANCE O.A.T.	6.5	3,500	3,858	459,840	2011/4/25
BTPS	5.25	20,670	22,005	2,622,809	2011/8/1	FRANCE O.A.T.	8.5	6,170	7,539	898,654	2012/12/26
BTPS	5.25	19,200	20,693	2,466,489	2017/8/1	FRANCE O.A.T.	8.5	7,880	11,003	1,311,457	2019/10/25
BTPS	5.25	9,920	10,048	1,197,735	2029/11/1	FRANCE O.A.T.	8.5	4,640	6,780	808,176	2023/4/25
BTPS	5.5	9,500	10,063	1,199,450	2010/11/1	国債証券 (オランダ)					
BTPS	5.75	11,900	12,619	1,504,171	2033/2/1	NETHERLANDS GOVT	2.5	1,840	1,856	221,217	2012/1/15
BTPS	6.0	12,330	13,411	1,598,497	2031/5/1	NETHERLANDS GOVT	3.25	8,410	8,362	996,774	2015/7/15
BTPS	6.5	14,750	16,950	2,020,353	2027/11/1	NETHERLANDS GOVT	3.75	2,680	2,765	329,618	2014/7/15
BTPS	7.25	6,020	7,486	892,312	2026/11/1	NETHERLANDS GOVT	3.75	1,680	1,592	189,826	2023/1/15
BTPS	9.0	6,790	9,693	1,155,356	2023/11/1	NETHERLANDS GOVT	4.0	4,000	4,173	497,403	2011/1/15
国債証券 (フランス)						NETHERLANDS GOVT	4.0	5,030	5,053	602,343	2018/7/15
BTAN-5YR ISSUE	2.5	1,330	1,350	160,932	2010/7/12	NETHERLANDS GOVT	4.0	6,370	6,143	732,287	2037/1/15
BTAN-5YR ISSUE	3.0	8,840	9,068	1,080,928	2011/1/12	NETHERLANDS GOVT	4.0	8,210	8,431	1,004,970	2016/7/15
BTAN-5YR ISSUE	3.5	17,640	18,329	2,184,719	2011/7/12	NETHERLANDS GOVT	4.25	7,520	7,957	948,473	2013/7/15
BTAN-5YR ISSUE	3.75	10,680	11,193	1,334,178	2012/1/12	NETHERLANDS GOVT	4.5	4,540	4,758	567,204	2017/7/15
BTAN-5YR ISSUE	3.75	3,210	3,364	400,964	2013/1/12	NETHERLANDS GOVT	5.0	7,170	7,690	916,635	2011/7/15
BTAN-5YR ISSUE	4.5	9,120	9,786	1,166,473	2012/7/12	NETHERLANDS GOVT	5.0	6,600	7,143	851,395	2012/7/15
BTAN-5YR ISSUE	4.5	4,680	5,042	601,039	2013/7/12	NETHERLANDS GOVT	5.5	6,890	7,273	866,961	2010/7/15
FRANCE O.A.T.	3.0	2,100	2,075	247,345	2015/10/25	NETHERLANDS GOVT	5.5	4,390	4,987	594,405	2028/1/15
FRANCE O.A.T.	3.25	10,990	10,957	1,305,968	2016/4/25	NETHERLANDS GOVT	7.5	4,120	5,505	656,207	2023/1/15
FRANCE O.A.T.	3.5	18,740	19,180	2,286,110	2015/4/25	国債証券 (スペイン)					
FRANCE O.A.T.	3.75	13,240	13,439	1,601,904	2017/4/25	SPANISH GOV'T	2.75	1,900	1,901	226,642	2012/4/30
FRANCE O.A.T.	3.75	8,350	8,165	973,241	2021/4/25	SPANISH GOV'T	3.15	4,120	3,921	467,393	2016/1/31
FRANCE O.A.T.	4.0	12,720	13,438	1,601,756	2013/4/25	SPANISH GOV'T	3.25	6,510	6,666	794,626	2010/7/30
FRANCE O.A.T.	4.0	10,700	11,309	1,348,026	2013/10/25	SPANISH GOV'T	3.8	10,390	10,194	1,215,077	2017/1/31
FRANCE O.A.T.	4.0	14,560	15,357	1,830,506	2014/4/25	SPANISH GOV'T	3.9	3,500	3,624	432,020	2012/10/31
FRANCE O.A.T.	4.0	2,170	2,288	272,790	2014/10/25	SPANISH GOV'T	4.0	6,980	7,163	853,826	2010/1/31
FRANCE O.A.T.	4.0	6,000	6,138	731,659	2018/4/25	SPANISH GOV'T	4.1	7,690	7,998	953,343	2011/4/30
FRANCE O.A.T.	4.0	3,470	3,358	400,271	2038/10/25	SPANISH GOV'T	4.1	4,120	4,070	485,120	2018/7/30
FRANCE O.A.T.	4.0	8,200	7,940	946,473	2055/4/25						

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
国債証券 (スペイン)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		国債証券 (オーストリア)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPANISH GOV'T	4.2	700	728	86,812	2013/7/30	REP OF AUSTRIA	4.15	3,320	3,181	379,170	2037/3/15
SPANISH GOV'T	4.2	6,920	6,291	749,903	2037/1/31	REP OF AUSTRIA	4.3	2,310	2,355	280,752	2017/9/15
SPANISH GOV'T	4.25	2,190	2,272	270,866	2014/1/31	REP OF AUSTRIA	4.3	5,660	5,945	708,683	2014/7/15
SPANISH GOV'T	4.4	6,640	6,894	821,733	2015/1/31	REP OF AUSTRIA	4.35	2,260	2,280	271,820	2019/3/15
SPANISH GOV'T	4.75	9,560	10,149	1,209,760	2014/7/30	REP OF AUSTRIA	4.65	5,440	5,656	674,199	2018/1/15
SPANISH GOV'T	4.8	1,930	1,968	234,614	2024/1/31	REP OF AUSTRIA	5.0	5,350	5,766	687,276	2012/7/15
SPANISH GOV'T	4.9	5,780	5,918	705,383	2040/7/30	REP OF AUSTRIA	5.25	4,610	4,905	584,686	2011/1/4
SPANISH GOV'T	5.0	11,590	12,405	1,478,663	2012/7/30	REP OF AUSTRIA	6.25	3,470	4,157	495,562	2027/7/15
SPANISH GOV'T	5.35	8,350	8,961	1,068,087	2011/10/31	国債証券 (フィンランド)					
SPANISH GOV'T	5.4	9,080	9,728	1,159,517	2011/7/30	FINNISH GOV'T	2.75	2,240	2,284	272,298	2010/9/15
SPANISH GOV'T	5.5	8,640	9,483	1,130,310	2017/7/30	FINNISH GOV'T	3.875	3,190	3,210	382,611	2017/9/15
SPANISH GOV'T	5.75	7,270	8,087	963,993	2032/7/30	FINNISH GOV'T	4.25	2,430	2,575	306,980	2012/9/15
SPANISH GOV'T	6.0	6,550	7,407	882,887	2029/1/31	FINNISH GOV'T	4.25	2,610	2,724	324,742	2015/7/4
SPANISH GOV'T	6.15	9,180	10,221	1,218,242	2013/1/31	FINNISH GOV'T	4.375	2,100	2,158	257,307	2019/7/4
国債証券 (ベルギー)						FINNISH GOV'T	5.375	3,390	3,734	445,065	2013/7/4
BELGIAN 0262	8.0	2,340	2,775	330,864	2012/12/24	FINNISH GOV'T	5.75	3,650	3,937	469,281	2011/2/23
BELGIAN 0282	8.0	3,870	4,800	572,153	2015/3/28	国債証券 (アイルランド)					
BELGIAN 0291	5.5	6,260	6,941	827,382	2028/3/28	IRISH GOVT	4.0	1,980	2,027	241,681	2011/11/11
BELGIAN 0295	5.75	6,670	7,103	846,672	2010/9/28	IRISH GOVT	4.0	3,010	2,946	351,235	2014/1/15
BELGIAN 0296	5.0	4,760	5,078	605,356	2011/9/28	IRISH GOVT	4.4	3,720	3,408	406,199	2019/6/18
BELGIAN 0298	5.0	8,900	9,567	1,140,350	2012/9/28	IRISH GOVT	4.5	3,120	2,919	347,957	2018/10/18
BELGIAN 0300	5.5	7,200	7,948	947,417	2017/9/28	IRISH GOVT	4.5	3,580	3,269	389,730	2020/4/18
BELGIAN 0301	4.25	10,650	11,175	1,331,953	2013/9/28	IRISH GOVT	4.6	2,970	2,897	345,342	2016/4/18
BELGIAN 0303	4.25	690	721	86,007	2014/9/28	IRISH GOVT	5.0	3,320	3,410	406,505	2013/4/18
BELGIAN 0304	5.0	7,440	7,837	934,127	2035/3/28	国債証券 (ポルトガル)					
BELGIAN 0305	3.0	7,080	7,208	859,223	2010/3/28	PORTUGUESE OT'S	3.2	2,880	2,932	349,562	2011/4/15
BELGIAN 0306	3.75	8,720	8,746	1,042,454	2015/9/28	PORTUGUESE OT'S	3.35	3,580	3,457	412,158	2015/10/15
BELGIAN 0307	3.25	3,300	3,152	375,705	2016/9/28	PORTUGUESE OT'S	3.85	3,400	3,196	380,935	2021/4/15
BELGIAN 0308	4.0	4,870	4,661	555,553	2022/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.1	3,240	2,923	348,469	2037/4/15
BELGIAN 0309	4.0	1,620	1,612	192,218	2017/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.2	2,810	2,817	335,844	2016/10/15
BELGIAN 0310	4.0	5,260	5,460	650,825	2013/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.35	2,900	2,906	346,463	2017/10/16
BELGIAN 0312	4.0	7,120	7,008	835,394	2018/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.375	2,430	2,513	299,551	2014/6/16
BELGIAN 0313	3.5	4,170	4,288	511,137	2011/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.45	3,590	3,586	427,472	2018/6/15
BELGIAN 0314	4.0	5,370	5,532	659,443	2014/3/28	PORTUGUESE OT'S	4.95	1,890	1,913	228,105	2023/10/25
BELGIAN 0315	4.0	1,560	1,521	181,380	2019/3/28	PORTUGUESE OT'S	5.0	3,460	3,688	439,644	2012/6/15
国債証券 (オーストリア)						PORTUGUESE OT'S	5.15	2,790	2,958	352,565	2011/6/15
REP OF AUSTRIA	3.4	1,500	1,508	179,786	2014/10/20	PORTUGUESE OT'S	5.45	3,350	3,635	433,317	2013/9/23
REP OF AUSTRIA	3.5	6,110	5,618	669,699	2021/9/15	PORTUGUESE OT'S	5.85	3,130	3,287	391,814	2010/5/20
REP OF AUSTRIA	3.5	3,830	3,825	455,949	2015/7/15	国債証券 (その他)					
REP OF AUSTRIA	3.8	6,280	6,483	772,765	2013/10/20	HELLENIC REPUBLI	3.1	4,030	4,063	484,274	2010/4/20
REP OF AUSTRIA	3.9	4,010	3,875	461,940	2020/7/15	HELLENIC REPUBLI	3.6	2,670	2,365	281,926	2016/7/20
REP OF AUSTRIA	4.0	5,690	5,746	684,973	2016/9/15						

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
国債証券 (その他)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		国債証券 (イギリス)	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
HELLENIC REPUBLI	3.7	10,020	9,181	1,094,322	2015/7/20	TREASURY	6.25	4,100	4,458	607,638	2010/11/25
HELLENIC REPUBLI	3.8	2,130	2,153	256,667	2011/3/20	TREASURY	8.0	3,540	4,375	596,246	2013/9/27
HELLENIC REPUBLI	3.9	8,890	8,938	1,065,426	2011/8/20	TREASURY	8.0	12,340	17,078	2,327,466	2021/6/7
HELLENIC REPUBLI	4.0	1,530	1,470	175,321	2013/8/20	TREASURY	8.0	6,430	8,198	1,117,257	2015/12/7
HELLENIC REPUBLI	4.1	1,400	1,379	164,446	2012/8/20	TREASURY	8.75	4,970	6,726	916,741	2017/8/25
HELLENIC REPUBLI	4.3	2,110	1,923	229,208	2017/7/20	TREASURY	9.0	3,750	4,393	598,695	2011/7/12
HELLENIC REPUBLI	4.5	2,700	2,624	312,802	2014/5/20	小 計				37,415,432	
HELLENIC REPUBLI	4.5	4,740	3,736	445,301	2037/9/20	国債証券 (スイス)		千スイス フラン	千スイス フラン		
HELLENIC REPUBLI	4.6	4,780	4,720	562,663	2013/5/20	SWISS (GOVT)	2.5	1,270	1,348	106,813	2016/3/12
HELLENIC REPUBLI	4.6	3,500	3,217	383,541	2018/7/20	SWISS (GOVT)	2.75	860	912	72,241	2012/6/10
HELLENIC REPUBLI	4.6	4,270	3,316	395,243	2040/9/20	SWISS (GOVT)	3.0	1,550	1,681	133,211	2018/1/8
HELLENIC REPUBLI	4.7	6,460	5,583	665,482	2024/3/20	SWISS (GOVT)	3.0	2,610	2,808	222,450	2019/5/12
HELLENIC REPUBLI	5.25	5,450	5,598	667,254	2012/5/18	SWISS (GOVT)	3.5	5,490	5,744	454,997	2010/8/7
HELLENIC REPUBLI	5.35	2,450	2,552	304,221	2011/5/18	SWISS (GOVT)	4.0	4,950	5,345	423,378	2011/6/10
HELLENIC REPUBLI	5.9	4,420	4,464	532,140	2022/10/22	SWISS (GOVT)	4.0	5,610	6,241	494,359	2013/2/11
HELLENIC REPUBLI	6.0	6,210	6,484	772,885	2010/5/19	SWISS (GOVT)	4.0	2,140	2,497	197,817	2023/2/11
HELLENIC REPUBLI	6.5	2,860	3,029	361,131	2014/1/11	SWISS (GOVT)	4.0	2,980	3,540	280,422	2028/4/8
HELLENIC REPUBLI	6.5	6,370	6,773	807,300	2019/10/22	SWISS (GOVT)	4.25	1,470	1,673	132,588	2014/1/6
小 計				203,811,775		SWISS (GOVT)	4.25	6,330	7,419	587,690	2017/6/5
国債証券 (イギリス)		千英ポンド	千英ポンド			小 計				3,105,970	
TREASURY	3.25	8,470	8,753	1,192,960	2011/12/7	国債証券 (スウェーデン)		千スウェー デンクロー ナ	千スウェー デンクロー ナ		
TREASURY	4.0	12,730	13,161	1,793,672	2016/9/7	SWEDEN GOVT	3.0	21,810	22,065	250,881	2016/7/12
TREASURY	4.25	7,920	8,331	1,135,419	2011/3/7	SWEDEN GOVT	3.75	28,030	29,689	337,568	2017/8/12
TREASURY	4.25	6,410	6,246	851,279	2027/12/7	SWEDEN GOVT	4.25	18,180	20,028	227,728	2019/3/12
TREASURY	4.25	16,930	16,432	2,239,388	2032/6/7	SWEDEN GOVT	4.5	21,110	23,400	266,062	2015/8/12
TREASURY	4.25	9,640	9,471	1,290,748	2036/3/7	SWEDEN GOVT	5.0	30,110	35,385	402,330	2020/12/1
TREASURY	4.25	11,370	11,239	1,531,684	2046/12/7	SWEDEN GOVT	5.25	24,700	26,653	303,053	2011/3/15
TREASURY	4.25	5,600	5,480	746,828	2049/12/7	SWEDEN GOVT	5.5	29,600	33,252	378,082	2012/10/8
TREASURY	4.25	10,340	10,448	1,423,860	2055/12/7	SWEDEN GOVT	6.75	32,080	38,893	442,222	2014/5/5
TREASURY	4.5	14,520	15,681	2,137,088	2013/3/7	小 計				2,607,929	
TREASURY	4.5	5,000	5,240	714,168	2019/3/7	国債証券 (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		
TREASURY	4.5	5,880	6,028	821,511	2042/12/7	NORWEGIAN GOV'T	4.25	13,800	14,469	197,505	2017/5/19
TREASURY	4.75	11,110	11,626	1,584,459	2010/6/7	NORWEGIAN GOV'T	5.0	19,050	20,859	284,735	2015/5/15
TREASURY	4.75	9,190	9,980	1,360,120	2015/9/7	NORWEGIAN GOV'T	6.0	22,950	24,797	338,485	2011/5/16
TREASURY	4.75	6,030	6,395	871,608	2020/3/7	NORWEGIAN GOV'T	6.5	26,110	29,898	408,111	2013/5/15
TREASURY	4.75	3,150	3,267	445,332	2030/12/7	小 計				1,228,838	
TREASURY	4.75	12,030	12,926	1,761,636	2038/12/7						
TREASURY	5.0	15,930	17,220	2,346,786	2012/3/7						
TREASURY	5.0	10,840	11,895	1,621,073	2018/3/7						
TREASURY	5.0	12,290	13,211	1,800,497	2025/3/7						
TREASURY	5.0	9,100	10,101	1,376,564	2014/9/7						
TREASURY	5.25	4,310	4,706	641,404	2012/6/7						
TREASURY	6.0	9,550	11,471	1,563,291	2028/12/7						

銘柄	利率	当 期		末		償還年月日
		額面金額	評 価 額		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
国債証券 (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 - BULLET	4.0	26,020	26,714	427,435	2010/11/15	
DENMARK - BULLET	4.0	32,990	33,979	543,675	2015/11/15	
DENMARK - BULLET	4.0	27,430	28,076	449,220	2017/11/15	
DENMARK - BULLET	4.5	44,140	47,017	752,286	2039/11/15	
DENMARK - BULLET	5.0	32,840	35,414	566,634	2013/11/15	
DENMARK - BULLET	6.0	32,600	35,589	569,430	2011/11/15	
DENMARK - BULLET	7.0	13,710	18,206	291,310	2024/11/10	
小 計				3,599,993		
国債証券 (ポーランド)		千ポーランド ズロチ	千ポーランド ズロチ			
POLAND GOVT BOND	4.25	17,650	17,342	453,165	2011/5/24	
POLAND GOVT BOND	4.75	17,730	17,466	456,405	2012/4/25	
POLAND GOVT BOND	5.0	13,530	13,347	348,759	2013/10/24	
POLAND GOVT BOND	5.25	5,990	5,979	156,252	2013/4/25	
POLAND GOVT BOND	5.25	13,230	12,941	338,149	2017/10/25	
POLAND GOVT BOND	5.5	3,660	3,594	93,929	2019/10/25	
POLAND GOVT BOND	5.75	14,170	14,288	373,368	2010/3/24	
POLAND GOVT BOND	5.75	5,810	5,909	154,411	2014/4/25	
POLAND GOVT BOND	5.75	11,690	11,536	301,455	2022/9/23	
POLAND GOVT BOND	6.0	16,280	16,535	432,079	2010/11/24	
POLAND GOVT BOND	6.25	11,900	12,480	326,105	2015/10/24	
小 計				3,434,081		
特殊債券(除金融債) (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			
QUEENSLAND TREAS	6.0	2,020	2,116	130,790	2011/6/14	
QUEENSLAND TREAS	6.0	7,390	7,825	483,698	2013/8/14	
QUEENSLAND TREAS	6.0	15,190	16,175	999,809	2015/10/14	
小 計				1,614,298		
国債証券 (シンガポール)		千シンガ ポールドル	千シンガ ポールドル			
SPR GOV'T	1.625	1,810	1,830	112,680	2013/4/1	
SPR GOV'T	2.25	900	934	57,522	2013/7/1	
SPR GOV'T	2.5	2,200	2,296	141,386	2012/10/1	
SPR GOV'T	2.625	1,800	1,843	113,485	2010/4/1	
SPR GOV'T	2.625	200	210	12,934	2012/4/1	
SPR GOV'T	2.875	850	907	55,849	2015/7/1	
SPR GOV'T	3.125	1,160	1,217	74,920	2011/2/1	
SPR GOV'T	3.125	2,100	2,201	135,535	2022/9/1	

銘柄	利率	当 期		末		償還年月日
		額面金額	評 価 額		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
国債証券 (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		
SPR GOV'T	3.25	1,330	1,433	88,224	2020/9/1	
SPR GOV'T	3.5	2,100	2,267	139,597	2012/7/1	
SPR GOV'T	3.5	1,760	1,858	114,412	2027/3/1	
SPR GOV'T	3.625	2,700	2,885	177,637	2011/7/1	
SPR GOV'T	3.625	2,320	2,569	158,153	2014/7/1	
SPR GOV'T	3.75	2,870	3,246	199,857	2016/9/1	
SPR GOV'T	4.0	1,450	1,690	104,042	2018/9/1	
SPR GOV'T	4.625	2,150	2,273	139,941	2010/7/1	
小 計				1,826,181		
国債証券 (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			
MALAYSIAN GOV'T	3.461	3,570	3,651	93,184	2013/7/31	
MALAYSIAN GOV'T	3.502	3,820	3,737	95,370	2027/5/31	
MALAYSIAN GOV'T	3.702	8,740	9,022	230,246	2013/2/25	
MALAYSIAN GOV'T	3.718	6,820	7,047	179,849	2012/6/15	
MALAYSIAN GOV'T	3.756	14,710	15,102	385,414	2011/4/28	
MALAYSIAN GOV'T	3.814	6,790	6,992	178,453	2017/2/15	
MALAYSIAN GOV'T	3.869	13,050	13,270	338,674	2010/4/13	
MALAYSIAN GOV'T	4.24	7,360	7,824	199,682	2018/2/7	
MALAYSIAN GOV'T	4.262	10,510	11,120	283,803	2016/9/15	
MALAYSIAN GOV'T	5.094	6,940	7,678	195,963	2014/4/30	
MALAYSIAN GOV'T	5.248	2,540	3,088	78,806	2028/9/15	
小 計				2,259,450		
合 計				400,421,316		

(注) 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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期		末
	買 建 額	売 建 額	
	百万円		百万円
外	US 5YR NOTE	508	-
	US 10YR NOTE	380	-
	US LONG BOND	346	-
国	EURO-SCHATZ	644	-
	EURO-BOBL FU	733	-
	EURO-BUND FU	1,236	-

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

投資信託財産の構成 (2009年2月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	400,421,317	97.0 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,172,547	3.0
投 資 信 託 財 産 総 額	412,593,864	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(407,565,376千円)の投資信託財産総額(412,593,864千円)に対する比率は98.8%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取場の仲値により邦貨換算したものです。当期末は、1米ドル=91.86円、1カナダドル=75.70円、1ユーロ=119.19円、1英ポンド=136.28円、1スイスフラン=79.21円、1スウェーデンクローナ=11.37円、1ノルウェークローネ=13.65円、1デンマーククローネ=16.00円、1ポーランドズロチ=26.13円、1オーストラリアドル=61.81円、1シンガポールドル=61.56円、1マレーシアリンギット=25.52円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 (2009年2月9日現在)
(A) 資 産	433,369,414,914 円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,440,339,999
公 社 債 (評価額)	400,421,317,139
未 収 入 金	20,999,403,300
未 収 入 利 息	5,774,217,848
未 払 費 用	422,292,189
前 差 入 委 託 証 拠 金	311,844,439
(B) 負 債	21,258,607,569
未 払 金	21,088,468,063
未 払 解 約 金	170,139,506
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	412,110,807,345
元 本	278,382,992,341
次 期 繰 越 損 益	133,727,815,004
(D) 受 益 権 総 口 数	278,382,992,341 口
1万口当たり基準価額 (C / D)	14,804 円

損益の状況

項 目	当 期 自 2008年2月8日 至 2009年2月9日
(A) 配 当 等 収 益	17,409,972,574 円
受 取 利 息	17,406,284,915
そ の 他 収 益	3,687,659
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	103,179,636,043
売 買 損 益	13,673,360,851
先 物 取 引 等 取 引 損 益	116,852,996,894
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	197,585,142
取 引 損 益	497,059,345
(D) そ の 他 費 用 等	299,474,203
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	170,710,353
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	85,742,788,680
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	217,567,845,112
(H) 解 約 差 損 益 金	29,932,993,260
(I) 計 (E + F + G + H)	28,030,234,688
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	133,727,815,004

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益及び(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注2) 損益の状況の中で(D)その他の費用等は外貨建資産の保管費用等をさします。
 (注3) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注4) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

当マザーファンドの期首元本額は276,460,484,310円、期中追加設定元本額は42,975,366,685円、期中一部解約元本額は41,052,858,654円です。

当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、中央三井外国債券インデックスファンド5,624,357,429円、中央三井D C 外国債券インデックスファンド1,569,993,412円、中央三井D C 外国債券インデックスファンドL6,072,160,004円、物価連動債組入世界債券ファンド316,877,451円、中央三井D C バランスファンド3,034,948,150円、中央三井D C バランスファンド5,057,422,497円、中央三井D C バランスファンド7,012,898,624円、ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)218,985,119円、ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)124,102,692円、新生・4分散ファンド143,892,697円、ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド195,376,823円、4資産インデックスバランスオープン(分配型)62,410,419円、4資産インデックスバランスオープン(成長型)126,568,460円、中央三井外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)759,938,066円、中央三井外国債券インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)24,609,653,035円、中央三井バランスV A 3 0(適格機関投資家専用)9,208,979,681円、中央三井バランスV A 5 0(適格機関投資家専用)29,106,689,540円、中央三井V A バランスファンド(株25 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)110,247,585,908円、中央三井V A バランスファンド(株5 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)5,242,602,260円、中央三井V A バランス株式3 0(適格機関投資家専用)120,340,318円、中央三井V A バランスファンド(株6 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)10,282,635,074円、中央三井バランスV A 2 5(適格機関投資家専用)7,254,409,177円、中央三井バランスV A 3 7.5(適格機関投資家専用)1,770,308,020円、中央三井バランスV A 5 0 L(適格機関投資家専用)19,330,788,416円、中央三井バランスV A 7 5(適格機関投資家専用)585,720,826円、中央三井V L 株式3 0(適格機関投資家専用)3,700,314円、中央三井V L 株式5 0(適格機関投資家専用)3,800,370円、中央三井V A バランスファンド(株4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)35,404,871,105円、中央三井V A ポートフォリオ4 0(適格機関投資家専用)3,853,352,600円、中央三井V A ポートフォリオ2 0(適格機関投資家専用)437,178,179円、中央三井バランスV A 4 0(適格機関投資家専用)2,630,744,424円、中央三井V A バランス株式4 0(適格機関投資家専用)2,776,591,737円、中央三井V A バランスファンド2(株4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)193,074,413円、C M A M・V A バランス5 0 - 5 0(適格機関投資家専用)35,101円です。