

ともに挑む。ともに実る。

MIZUHO みずほ信託銀行

確定拠出年金向け 年金投資基金信託

信託商品説明書
(2025年4月)

みずほ信託銀行
外国債券
インデックスファンド

みずほ信託銀行

金(広)05-8609-03022

- 本説明書は、当ファンドの内容をご説明するために作成されたものです。投資等に係る最終的な決定はお客さまご自身の判断で行っていただきますようお願い申し上げます。
- 本説明書内の実績・データ等は過去のものであり、将来の運用成果を予測もしくは約束・保証するものではありません。本説明書は信頼できると考えられる情報に基づいて当行が作成しておりますが、情報の正確性、完全性が保証されているものではありません。なお、本説明書内の記述内容、数値等については作成時点のものであり、今後の金融情勢・社会情勢等の変化により内容が変更変更される場合があります。契約締結にあたっては、契約締結前交付書面等の内容をご確認ください。

**本説明書は2024年12月31日現在の内容を記載しております。
記載内容は変更される場合がありますので、当行ホームページまたは最新版にて随時ご確認ください。**

【お問い合わせ先】

◇みずほ信託銀行株式会社
アセットマネジメント推進部 業務管理チーム (電話番号) 03-3240-7058
<受付時間> 営業日 午前9時 ~ 午後5時

◇みずほ信託銀行株式会社 ホームページ <https://www.mizuho-tb.co.jp/>

お申込みにあたり、本説明書をよくお読みいただき
当ファンドの内容をよくご理解いただいた上でお申込みください

● 運用商品提供会社に関する事項

運用商品提供会社:みずほ信託銀行株式会社

登録番号:関東財務局長(登金)第34号

● 手数料等

1. 信託報酬

信託報酬は、純資産総額に対して、年率0.275%(税抜0.25%)を乗じた額となります。

2. 申込み手数料

ありません

3. 解約手数料

ありません

4. 信託財産留保金

留保金率は現在0%としております。

5. マザーファンドの信託財産留保金

当ファンドとマザーファンド間での売買額に対し、0.02%を乗じた額が当ファンドから支払われマザーファンドに留保されます。

6. その他の手数料等

マザーファンドから、証券会社等に有価証券の売買委託手数料や外貨建資産の保管手数料等が支払われることがあります。

● 元本毀損リスク

当ファンドは、マザーファンドを通じて、FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)に連動する収益を目指して公社債など値動きのある証券や為替変動のある外貨建証券への投資、預金や貸付等を行いますので、同指標や価格の下落、円高方向への為替変動、あるいは証券の発行体や預金先等の信用不安、または投資対象国・地域の政治・経済情勢の変化等により、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

また、当ファンドの信託財産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。したがって、預金とは異なり、元本が保証されているものではありません。また、預金保険、投資者保護基金の対象ではありません。

当ファンドが有するリスクおよび留意点は以下のとおりです。

(1) 価格変動リスク

当ファンドはマザーファンドを通じて債券など値動きのある証券に投資しますので、各資産の市場価格の変動に伴い、マザーファンドの信託財産の価格が変動し、当ファンドの信託財産の価格も変動します。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

(2) 信用リスク

当ファンドやマザーファンドが保有する証券価格等は、一般に、発行体の財政状況の悪化等により下落し、それに伴って、当ファンドの基準価格が低下する要因となることがあります。また、短期金融商品として受託会社等に預金や貸付等を行う場合は、当該預金先や貸付先等の破綻も、当ファンドの基準価格が低下する要因となります。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

(3) 流動性リスク

有価証券等を購入あるいは売却するにあたり、市場の規模や当該有価証券等の取引量が小さい場合は望ましい時期や価格で売買することができず、この結果当ファンドの基準価格が低下する可能性があります。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

(4) 為替変動リスク

当ファンドはマザーファンドを通じて、外国通貨にて有価証券等に投資します。したがって、当該通貨等の為替変動の影響を直接受けます。円安方向の為替変動は基準価格の上昇要因となりますが、円高方向への為替変動は基準価格の低下要因となります。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

(5) カントリーリスク

当ファンドがマザーファンドを通じて組入れる有価証券等の発行国(地域)あるいは周辺国(地域)の政治・経済・社会情勢、資本規制、税制等の変化により金融・証券市場が混乱した場合、当ファンドの基準価格が変動する可能性があります。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

(6) 当ファンドおよびマザーファンドのインデックス運用

当ファンドおよびマザーファンドはベンチマークに連動した収益を目指しますが、一定の連動水準を保証するものではありません。

(7) 資産規模についての留意点

当ファンドは1円以上1円単位でお申し込みいただくことができますが、ファンドの純資産残高が少額である場合は、所定の運用ができない場合があります。

(8) ご解約による資金流出に伴う留意点

ご解約の支払代金を手当てするために組入有価証券等を売却しなければならないことがあります。この場合、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことによって、ご解約代金を手当てすることがあります。その場合の借入金利は当ファンドが負担します。

<注>上記リスク要因等によっては、投資の基本方針に従った運用ができない場合があります。

目次

[第 I 部 ファンド情報]

頁

1. ファンドの概要	2
2. 運用の内容	
(1)目的	4
(2)特色	4
(3)投資対象	4
(4)ファンドの仕組み	4
<ご参考>確定拠出年金制度と当ファンド	5
(5)投資態度	5
<ご参考>FTSE世界国債インデックス(除く日本・ 円ベース)について、マザーファンド概要	6
(6)投資制限	6
(7)分配方針	6
(8)運用管理態勢	7
(9)運用体制	8
(10)リスク管理手法	8
3. 投資のリスクおよびご留意点	9
4. 手数料等および税金	10
5. 運用状況	
(1)投資状況	11
<ご参考>外国債券マザーファンドの投資状況	11
(2)投資資産	11
<ご参考>外国債券マザーファンドの投資資産	12
(3)運用実績	13
6. ご投資の手引(お手続き等の概要)	
お申込み手続き・ご解約申込み手続き	14
7. 管理および運営の概要	
(1)資産の評価(基準価格の算出)	15
<ご参考>マザーファンドの時価評価基準	15
(2)持分の計算方法	16
(3)その他管理および運営の仕組み	16
(4)受益者の権利等	17
(5)受託会社の概況	17
8. 財務ハイライト情報	
(1)資産、負債、元本および基準価格の状況	18
(2)損益の状況	18
◇用語解説	19
◇年金投資基金信託 (確定拠出年金口 みずほ信託銀行 外国債券インデックスファンド) 約款	21~23
◇マザーファンド 年金投資基金信託(外貨建証券口)約款	24~27

[第Ⅱ部 ファンドの詳細情報]	頁
1. ファンドの沿革	29
2. 決算状況	
(1) 資産、負債、元本および基準価格の状況	29
(2) 損益の状況	29
(3) 付属明細表	31
<ご参考> マザーファンドの運用状況	31
3. ファンドの現況	40
<ご参考> 外国債券マザーファンドの現況	40
4. 設定および解約の実績	40

第 I 部 ファンド情報

1. ファンドの概要

ファンドの名称※	みずほ信託銀行 外国債券インデックスファンド
ファンドの目的	確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、日本以外の世界の主要国の国債に分散投資し、リスクを抑えつつ信託財産の長期的な成長を目指します。
設定日	2005年 11月 30日
ファンドの枠組	年金投資基金信託(確定拠出年金向け)
基本的性格	日本以外の世界の主要国の国債の価格指数であるFTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)に連動する収益を目指します。(為替ヘッジは行いません。)
主な投資対象	外国債券マザーファンド(当行を受託者とする年金投資基金信託)、短期金融商品。 なお、年金投資基金信託については、みずほ信託銀行とアセットマネジメントOne株式会社との投資一任契約に基づき、マザーファンドの運用にかかる業務の一部(有価証券の売買や余裕資金運用の指図等)を委託しております。 <注>外国債券マザーファンドは、FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)に連動する収益を目指すインデックスファンドです。(為替ヘッジは行いません。)
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)
運用実績	「5. 運用状況」(11頁)をご参照下さい。
主な投資制限	外国債券マザーファンドにおいては、原則として100分の10を超えて同一会社の発行する株式、社債およびこれらを担保とする貸付金ならびに当該会社に対する貸付金には運用しません。ただし、対象となるベンチマークにおいて当該株式もしくは社債の構成比率が100分の10を超える場合、ベンチマーク構成比率を基準として上記割合を超えて運用することがあります。
主な投資リスク	当ファンドは、マザーファンドを通じて主に海外の債券に投資しています。そのため、金利の変動に伴い組み入れた債券の価格の下落により損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資を行う場合、為替変動により損失を被ることがあります。 また、当ファンドの信託財産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。したがって、預金とは異なり、元金が保証されているものではありません。 当ファンドの基準価格変動要因としては、主に価格変動リスク、信用リスク、流動性リスク、為替変動リスク、カントリーリスク等があります。 詳しくは、「3. 投資のリスクおよびご留意点」(9頁)をご参照下さい。
申込単位	1円以上1円単位
お申込み・他商品からのスイッチング	<ul style="list-style-type: none"> ・ 1円以上1円単位でお申し込みいただくことができます。 ・ ご加入の確定拠出年金プランの運営管理機関を通じてお申し込みいただくことができます。 ・ お申込口数は、お申込金額をお申込日の翌営業日の基準価格に1口当たりの信託財産留保金を加えた額で除して得た口数とします。 <注>お申込日とはお客様の指図が当行に15時までに到着した日をいいます。15時以降の到着分は、翌営業日の扱いとなります。
申込み手数料	ありません
ご解約・他商品へのスイッチング	<ul style="list-style-type: none"> ・ ご利用の確定拠出年金プランの運営管理機関を通じてお客様の指図を受領し実行します。 ・ ご解約・スイッチング金額は、お客様ご指図の口数に、ご解約申込日の翌営業日の基準価格から1口当たりの信託財産留保金を差引いた金額を乗じた金額とします。 <注>ご解約申込日とはお客様の指図が当行に15時までに到着した日をいいます。15時以降の到着分は、翌営業日の扱いとなります。 確定拠出年金法により原則として60歳前のご解約は、他商品へのスイッチングのみ認められております。
解約手数料	ありません

持分の計算方法	計算日の基準価格より1口当たりの信託財産留保金を控除した額に、保有口数を乗じて得た額。
信託報酬	純資産総額に対して、年率0.275% (税抜0.25%) を乗じた額。
信託財産留保金	留保金率は0%としております。詳しくは、「4. 手数料等および税金」(10頁)をご参照下さい。
マザーファンドの信託財産留保金	当ファンドが各マザーファンド受益権を売買する際に下記留保金率によりファンドから支払われます。 外国債券マザーファンド: 0.02%
その他の費用等	<ul style="list-style-type: none"> 当ファンド運営において資金の借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産より支払われます。 当ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産より支払われます。 当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産より支払われます。
課税上の取扱い	<ul style="list-style-type: none"> 当ファンドの分配、解約時の運用益への課税はありません。 年金資産に対し特別法人税1.173%が課税されます。ただし、2026年3月末まで課税が停止されています。
解約代金の支払い方法	確定拠出年金制度における資産管理機関 ^{※※} を経由して支払います。
信託期間	原則として無期限
償還条項	当ファンドの信託財産の純資産総額がファンド設定日より10年経過後最初の収益計算期以降に1億円を下回ったとき、または信託目的を達成したとき、もしくは信託目的の達成が不可能もしくは著しく困難と受託者が認めたとき、この信託契約は終了します。
決算日	毎年11月30日(同日が休業日のときは翌営業日)
収益分配	<p>決算時に分配し、全額を再投資します。</p> <ul style="list-style-type: none"> 分配金額は、分配方針に基づき当行が決定します。 再投資には信託財産留保金はかかりません。

※ 本説明書において適宜当商品を「当ファンド」と呼びます。

※※ 事業主が締結する確定拠出年金法第8条に規定する契約の相手をいいます。

<注>

当ファンドは確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドです。

このため、本説明書においては確定拠出年金制度の資産管理機関において当ファンドの受益権をお持ちの加入者等を「お客さま」または「受益者」と呼びます。

2. 運用の内容

(1) 目的

「みずほ信託銀行 外国債券インデックスファンド」は日本以外の世界の主要国の国債の価格指数であるFTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)に連動する収益を目指します。(為替ヘッジは行いません。)

(2) 特色

A. 日本以外の世界の主要国の国債の価格指数に連動する収益を目指します。

<日本以外の世界の主要国の国債に分散投資>

当ファンドは日本以外の世界の主要国の国債の価格指数への連動を目指すため、日本以外の世界の主要国の国債等に分散して投資します。(投資はマザーファンドを通じて行います。)

<ベンチマークにFTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)を採用>

市場を構成する銘柄群を広くカバーしていることや指数算定が一定程度に合理的・透明であること、指標として広く利用されていること等よりベンチマークにFTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)※を採用し、当ファンドにおける日本以外の世界の主要国の国債の価格変動の指標とします。

※ベンチマークは、年金等の運用における採用状況等を勘案し、変更することがあります。

<為替ヘッジは行いません>

当ファンドはマザーファンドを通じて外国債券等に投資しますが、現地の通貨に対して為替ヘッジは行いません。

B. 資産の運用方法は、インデックス運用を基本とします。

<インデックス運用>

インデックス運用※を採用し、市場に連動した収益を目指します。

※市場の指標を上回る収益の獲得を目指すアクティブ運用に対して、市場に連動した収益を目指す運用手法をインデックス運用といいます。

<ファミリーファンド方式を採用>

お客さまの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を同じ目的の他の資金とまとめてマザーファンドに投資して効率的な運用を行います。

(3) 投資対象

信託財産は次に掲げる有価証券等に運用します。

A. 外国債券マザーファンド … 年金投資基金信託(外貨建証券口)

B. 預金(譲渡性預金を含む)、コールローン、手形割引市場において売買される手形および円建銀行引受手形、コマーシャル・ペーパー(資産担保型コマーシャル・ペーパーを含む)、受託会社への貸付(再信託の受託会社への貸付も含む)

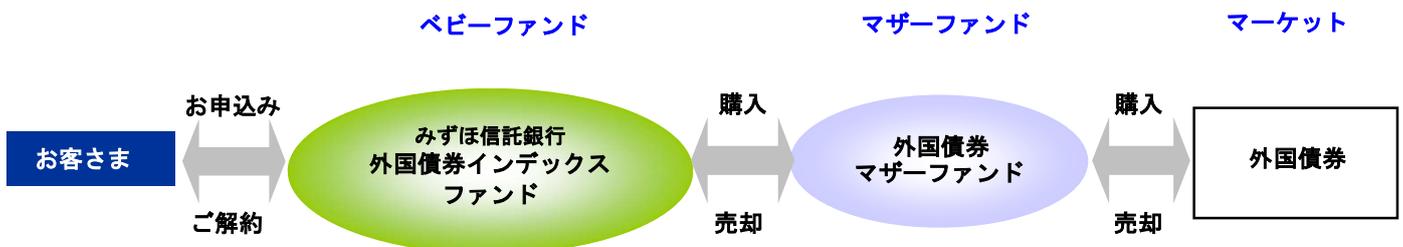
(4) ファンドの仕組み

A. ファミリーファンド方式の運用

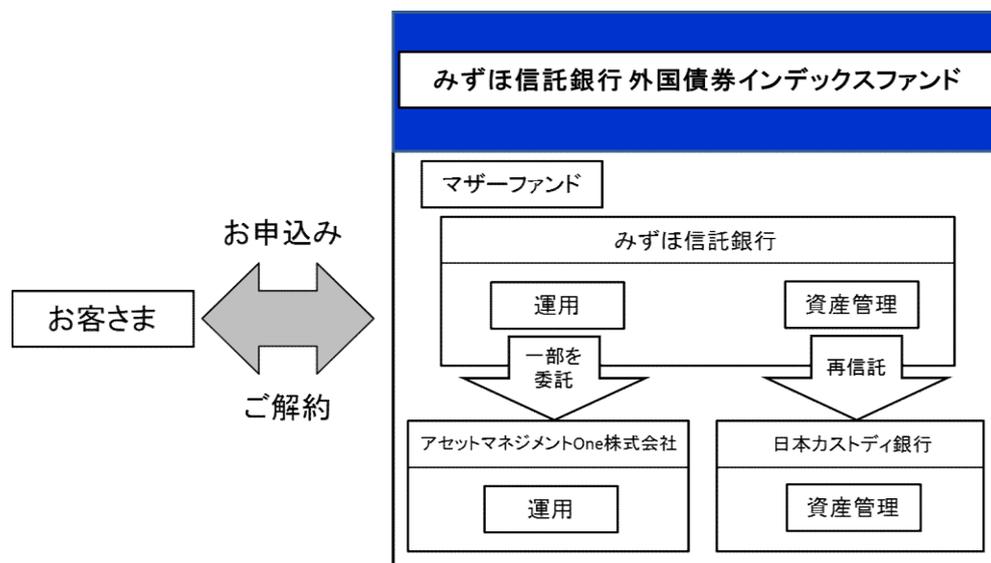
・ファミリーファンド方式とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資された資金をまとめてベビーファンド(「みずほ信託銀行 外国債券インデックスファンド」)とし、その資金を同じ目的の他の資金とまとめてマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。

・当ファンドは企業年金(確定給付企業年金等)向けにご提供しているインデックスファンドである年金投資基金信託(外国債券マザーファンド)をマザーファンドとします。

・なお、マザーファンドにおいて運用はみずほ信託銀行とアセットマネジメントOne株式会社、資産管理はみずほ信託銀行と日本カストディ銀行が行います。



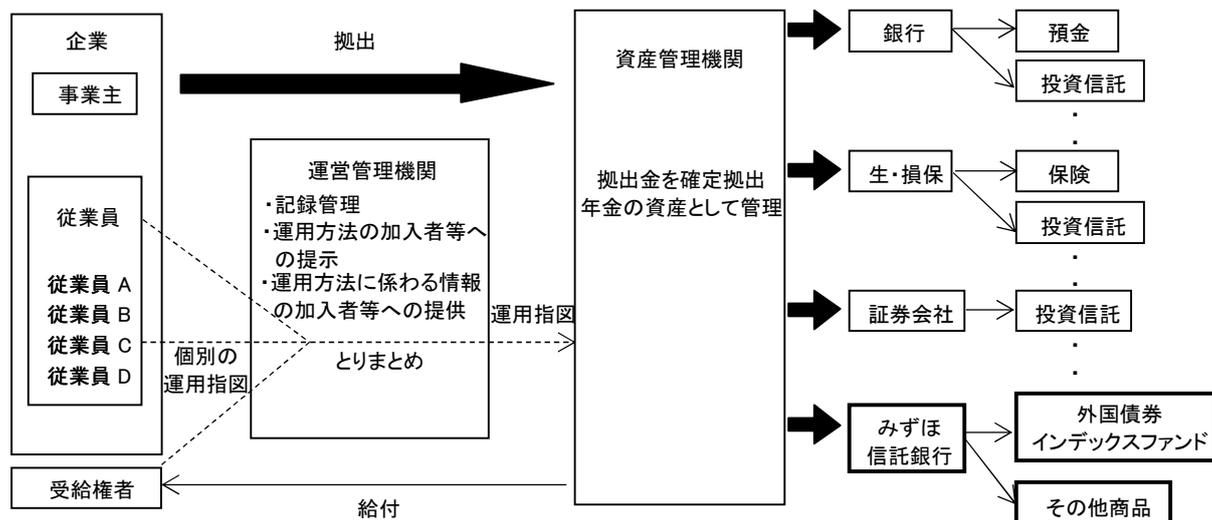
B. 関連法人の役割図



<ご参考>

■確定拠出年金制度と当ファンド [企業型のイメージ図]

詳細は関連法令でご確認下さい。



当ファンドは確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドであるため、

- ①お客様からのお申込み、ご解約の連絡は運営管理機関より受領します。
- ②お客様への換金は資産管理機関を経由して行います。

(5) 投資態度

当ファンドは主として、FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)に連動する収益を目指す年金投資基金信託である外国債券マザーファンドに投資します。ただし、解約に備えて一部を短期金融商品にて保有します。

当ファンドはマザーファンドを通じて外貨建証券に投資しますが、現地の通貨に対して為替ヘッジは行いません。

当ファンドは、FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)をベンチマークとし、当ベンチマークに連動する収益を目指します。

(なお、当ファンドの時価評価はマザーファンドの知り得る直近(通常は前営業日)の基準価格に基づくため、ベンチマークも前営業日基準のものを利用します。)

<ご参考>

■FTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）について

概要	FTSE International Limitedが運営する債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。
構成国	アメリカ、イギリス、カナダ、オーストラリア、ニュージーランド、デンマーク、スウェーデン、ノルウェー、ポーランド、シンガポール、マレーシア、メキシコ、イスラエル、中国、ユーロ圏（オーストリア、ベルギー、ドイツ、スペイン、フィンランド、フランス、イタリア、オランダ、アイルランド）

<注> 「FTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）」に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limitedに帰属します。FTSE International Limitedは、本商品を推奨などするものではなく、本商品の運用成果に関し一切の責任はありません。

■マザーファンド概要

運用方針	通貨別のウェイト、デュレーションをベンチマークに近づけることにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）の収益率との連動を目指します。
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）
投資対象	原則としてベンチマーク構成銘柄、ベンチマーク構成通貨
推定T.E.	後述「推定T.E.管理レンジ一覧」を参照
派生商品の利用	ヘッジ目的に限定し先物を利用
レバレッジ	無し

<推定T.E.管理レンジ一覧>

マザーファンド	推定T.E.の管理レンジ	
	時価総額	推定T.E.
外国債券マザーファンド	50～90億円未満	T.E. ≤ 0.50%
	90～130億円未満	T.E. ≤ 0.40%
	130～200億円未満	T.E. ≤ 0.35%
	200～300億円未満	T.E. ≤ 0.30%
	300～800億円未満	T.E. ≤ 0.25%
	800～1,500億円未満	T.E. ≤ 0.20%
	1,500億円～3,000億円未満	T.E. ≤ 0.15%
	3,000億円以上	T.E. ≤ 0.12%

(6) 投資制限

外国債券マザーファンドにおいては、原則として100分の10を超えて同一会社の発行する株式、社債およびこれらを担保とする貸付金ならびに当該会社に対する貸付金には運用しません。ただし、対象となるベンチマークにおいて当該株式もしくは社債の構成比率が100分の10を超える場合、ベンチマーク構成比率を基準として上記割合を超えて運用することがあります。また、先物取引、オプション取引、スワップ取引等の派生商品の利用は、当該資産の価格等のヘッジ目的に限定します。

(7) 分配方針

年1回の決算日(11月30日。ただし、当行休業日のときは翌営業日)を基準日として、原則、次のとおり収益分配を行う方針です。

A. 分配対象額の範囲

経費、信託報酬およびこれに係る消費税相当額控除後の繰越し分を含めた利子、配当収入および売買益等の全額とします。

B. 配当方針

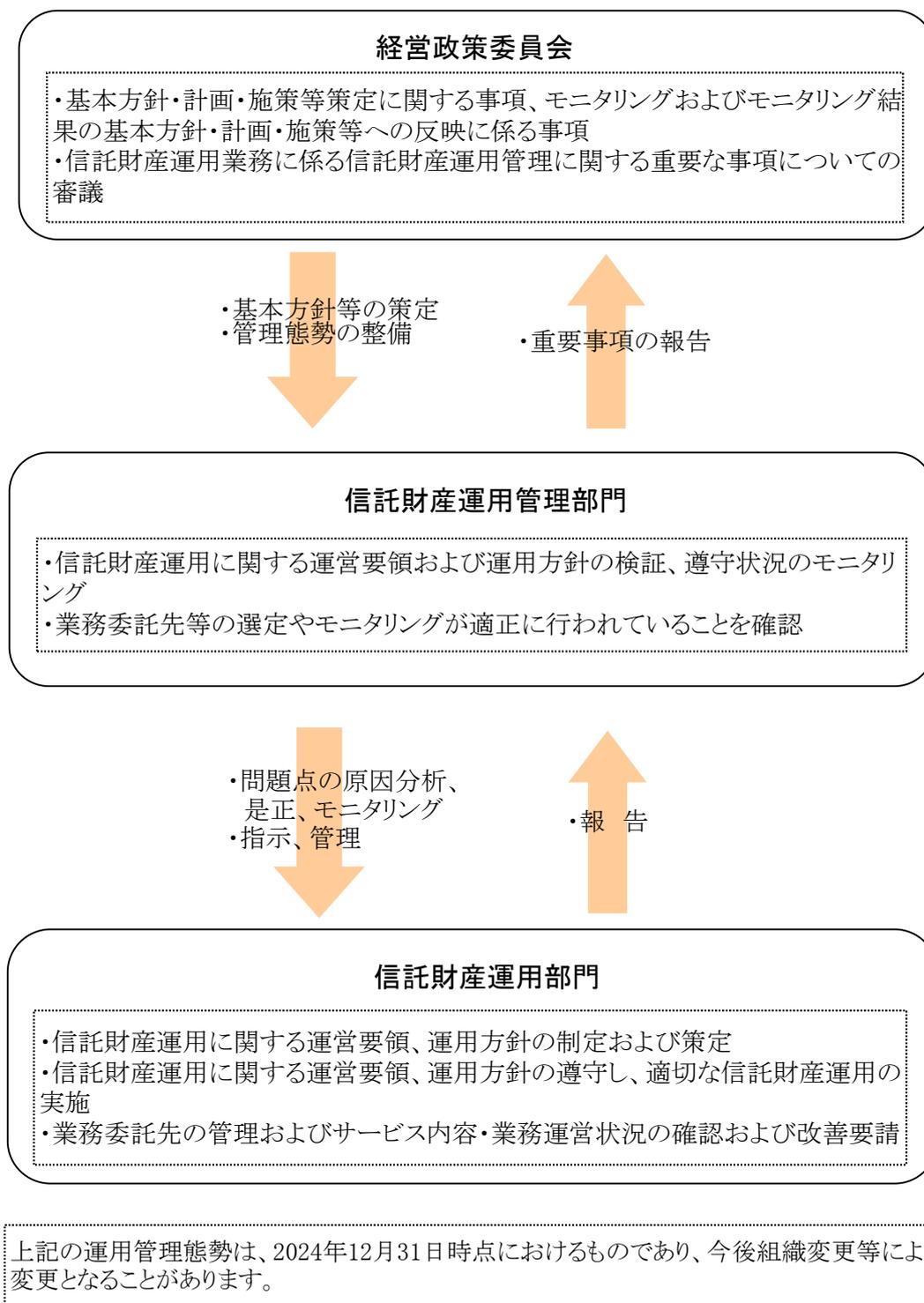
分配金額は、基準価格水準、市況動向等を勘案して当行が決定します。

C. 収益分配金の再投資

収益分配金は決算日の翌営業日に自動的に当ファンドに再投資されます。なお、再投資の際には、信託財産留保金はかかりません。

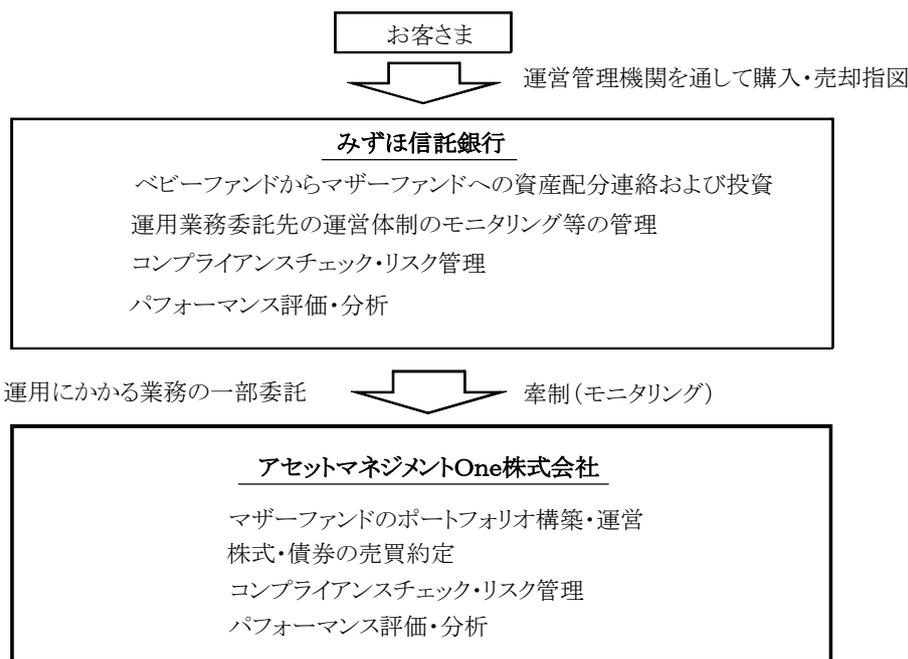
(8) 運用管理態勢

当ファンドおよび当ファンドが投資するマザーファンドの運用管理・リスク管理は、以下の態勢で運営します。



(9) 運用体制

当ファンドおよび当ファンドが投資するマザーファンドの運用体制は下記の通りです。



<注>運用体制は2024年12月31日現在のものであり、変更されることがあります。

(10) リスク管理手法

投資方針を遵守した運用を行うため、リスク管理基準を規定し、次のようにリスク管理をします。

A. 当ファンドのリスク管理

- ・時価にて評価したマザーファンドへの投資割合のモニタリングを日々行い、短期金融商品への投資割合が乖離許容幅を超過した場合は原則としてリスク管理基準に規定した投資割合に近づけるよう調整します。
- ・この乖離状況のモニタリングは直接のポートフォリオ管理セクション以外にコンプライアンス・リスク管理室においても実施し、牽制機能を強化しております。

B. マザーファンドのリスク管理

- ・外国債券マザーファンドはベンチマークへの連動を目指すインデックスファンドであるため、運用業務の一部委託先であるアセットマネジメントOne株式会社において、通貨構成や通貨別デュレーション等のベンチマークからの乖離、投資実績の要因分析等のモニタリングを行いファンド運営に反映させております。
- ・当行は、運用業務の一部委託先であるアセットマネジメントOne株式会社の運營業務の管理・運営の状況等につき、定期的に適正性を確認します。また、委託業務の品質向上への取組等について、定期的に報告を受理し、必要に応じて指導・助言等を行う体制を整備しております。

<注>リスク管理手法は2024年12月31日現在のものであり、変更されることがあります。

3. 投資のリスクおよびご留意点

当ファンドは、マザーファンドを通じて、FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)に連動する収益を目指して公社債など値動きのある証券や為替変動のある外貨建証券への投資、預金や貸付等を行いますので、同指標や価格の下落、円高方向への為替変動、あるいは証券の発行体や預金先等の信用不安、または投資対象国・地域の政治・経済情勢の変化等により、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

また、当ファンドの信託財産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。したがって、預金とは異なり、元金が保証されているものではありません。また、預金保険、投資者保護基金の対象ではありません。当行による元本の補填・利益の補足もありません。当ファンドが有する主なリスクおよび留意点は以下のとおりです。

A. 価格変動リスク

当ファンドはマザーファンドを通じて債券など値動きのある証券に投資しますので、各資産の市場価格の変動に伴い、マザーファンドの信託財産の価格が変動し、当ファンドの信託財産の価格も変動します。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

B. 信用リスク

当ファンドやマザーファンドが保有する証券価格等は、一般に、発行体の財務状況の悪化等により下落し、それに伴って、当ファンドの基準価格が低下する要因となることがあります。また、短期金融商品として受託会社等に預金や貸付等を行う場合は、当該預金先や貸付先等の破綻も、当ファンドの基準価格が低下する要因となります。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

C. 流動性リスク

有価証券等を購入あるいは売却するにあたり、市場の規模や当該有価証券等の取引量が小さい場合は望ましい時期や価格で売ることができず、この結果当ファンドの基準価格が低下する可能性があります。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

D. 為替変動リスク

当ファンドはマザーファンドを通じて、外国通貨にて有価証券等に投資します。従って当該通貨の為替変動の影響を直接受けます。円安方向の為替変動は基準価格の上昇要因となりますが、円高方向への為替変動は基準価格の低下要因となります。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

E. カントリーリスク

当ファンドがマザーファンドを通じて組入れる有価証券等の発行国(地域)あるいは周辺国(地域)の政治・経済・社会情勢、資本規制、税制等の変化により金融・証券市場が混乱した場合、当ファンドの基準価格が変動する可能性があります。この結果、投資元本に損失が生じるおそれがあります。

F. 当ファンドおよびマザーファンドのインデックス運用

当ファンドおよびマザーファンドはベンチマークに連動した収益を目指しますが、一定の連動水準を保証するものではありません。

G. 資産規模についての留意点

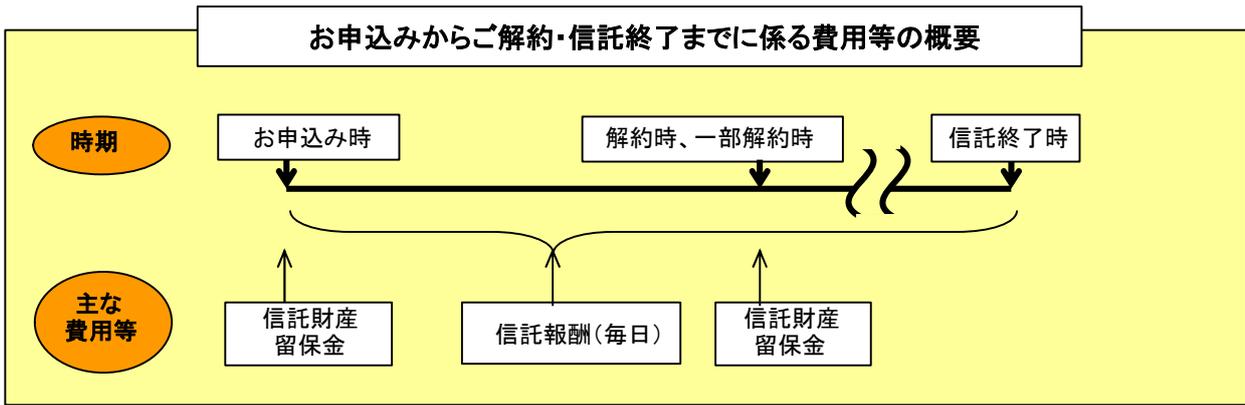
当ファンドは1円以上1円単位でお申込みいただくことができますが、ファンドの総資産残高が少額である場合は、所定の運用ができない場合があります。

H. ご解約による資金流出に伴う留意点

ご解約の支払代金を手当てするために組入有価証券等を売却しなければならないことがあります。この場合、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことによって、ご解約代金を手当てすることがあります。その場合の借入金利は当ファンドが負担します。

I. 上記リスク要因等によっては、投資の基本方針に従った運用ができない場合があります。

4. 手数料等および税金



(1) お申込み時、解約時、一部解約時に直接ご負担いただく費用等

時期	項目	金額
お申込み時	申込手数料	ありません
	信託財産留保金	現在0%としております
分配時		ありません
解約時、一部解約時	解約手数料	ありません
	信託財産留保金	現在0%としております
信託終了時		ありません

<注1> 信託財産留保金

信託財産留保金はお申込み・ご解約時の信託財産の売買コスト相当分を、お申込み・ご解約をされたお客さまに公平に負担していただくためのもので、同留保金はお申込み・ご解約のあったファンド全体の資産としてファンドに留保されます。

当ファンドは信託財産留保金制度を採用しておりますが、お客さまのお申込み・ご解約の実績等を勘案し、現在信託財産留保金率は0%としております。

※信託財産留保金率は、お客さまのお申込み・ご解約の実績や信託財産の売買コスト相当分の実績等を勘案し、随時見直されます。

<ご参考> 当ファンドが投資するマザーファンドでの信託財産留保金率は0.02%です。

<注2> ・当ファンドは、お申込み時およびご解約時の手数料はありません。

・当ファンドは確定拠出年金専用ファンドであるため、分配金は全額再投資となります。

また、確定拠出年金法により60歳前のご解約は、原則として他商品へのスイッチングのみ認められています。

(2) 信託期間を通じて間接的にご負担いただく費用

時期	項目	金額
毎日	信託報酬	純資産総額に対して、年率0.275% (税抜0.25%) を乗じた額

<注1> 信託報酬および信託報酬に係る消費税等に相当する金額は、信託財産(ファンド)より支払われます。

(3) その他の費用等

(a) ファンド運営において資金の借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産より支払われます。

(b) ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産より支払われます。

(c) ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産より支払われます。

(4) 課税上の取扱い

・確定拠出年金法第86条は、確定拠出年金制度に係る掛金、積立金および給付について、所得税、法人税、相続税、道府県民税(都民税を含む)、市町村税(特別区民税を含む)の課税について必要な措置を講ずるとしており、運用益に対し非課税となっております。

・年金資産に対し特別法人税1.173%が課税されます。ただし、2026年3月末まで課税停止となっております。

5. 運用状況 (2024年12月31日現在※)

※ マザーファンドの基準時点については、外国債券インデックスファンドの基準価格がマザーファンドの知り得る直近の基準価格を用いて算出されるため、外国債券インデックスファンドの基準日の前営業日としております。(以下、本資料中同様。)

(1) 投資状況

(2024年12月31日現在)

資産の種類	投資地域	評価額(円)	比率(%)※
受益権(外国債券マザーファンド)	日本	1,692,806,136	99.92
銀行勘定貸し、その他	---	8,909,923	0.53
資産合計	---	1,701,716,059	100.45
負債合計	---	7,563,629	0.45
純資産総額(資産合計-負債合計)	---	1,694,152,430	100.00

※「比率」は、ファンド純資産総額に対する当該資産の評価額の割合です。

<ご参考>外国債券マザーファンドの投資状況

(2024年12月30日現在)

資産の種類	投資地域	評価額(円)	比率(%)※
国債証券	アメリカ	131,744,400,079	46.60
	イギリス	14,271,298,525	5.05
	カナダ	5,402,348,145	1.91
	オーストラリア	3,359,458,617	1.19
	デンマーク	613,916,685	0.22
	ニュージーランド	758,271,728	0.27
	スウェーデン	463,740,590	0.16
	マレーシア	1,420,564,109	0.50
	ノルウェー	414,015,418	0.15
	シンガポール	1,072,166,546	0.38
	メキシコ	2,103,807,635	0.74
	ポーランド	1,497,791,630	0.53
	ユーロ圏	82,852,473,049	29.30
	中華人民共和国	31,284,655,556	11.07
イスラエル	937,024,708	0.33	
銀行勘定貸し、その他	---	4,950,364,001	1.75
資産合計	---	283,146,297,021	100.15
負債合計	---	417,856,448	0.15
純資産総額(資産合計-負債合計)	---	282,728,440,573	100.00

※「比率」は、マザーファンド純資産総額に対する当該資産の評価額の割合です。

(2) 投資資産

A. 投資有価証券の主要銘柄

投資残高はありません。

B. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)※
当行を受託者とする年金投資基金信託の受益権	99.92

*「投資比率」は、ファンド純資産総額に対する時価金額の割合です。

C. 投資不動産物件

投資残高はありません。

D. 有価証券、不動産以外の投資資産の主要なもの

種類	科目	国/地域	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	時価単価(円)	時価金額(円)	投資比率(%)※
当行を受託者とする年金投資基金信託の受益権	外国債券マザーファンド	日本	55,992	22,735	1,272,968,429	30,233	1,692,806,136	99.92

*「投資比率」は、ファンド純資産総額に対する時価金額の割合です。

<ご参考>外国債券マザーファンドの投資資産(2024年12月30日現在)

A. 投資有価証券の主要銘柄

順位	国/地域	種類	銘柄	額面	簿価単価 (円)	簿価残高 (円)	時価単価 (円)	時価残高 (円)	利率 (%)	償還日	投資比率 (%)※
1	アメリカ	国債	T 4.375 260731	10,520,000	14,812.16	1,558,239,322	15,747.63	1,656,650,967	4.375	20260731	0.59
2	中国	国債	CGB 2.85 270604	61,500,000	2,052.23	1,262,123,830	2,236.15	1,375,233,004	2.850	20270604	0.49
3	アメリカ	国債	T 2.75 320815	9,360,000	13,324.09	1,247,135,168	13,976.06	1,308,159,450	2.750	20320815	0.46
4	アメリカ	国債	T 4.5 331115	8,300,000	15,399.01	1,278,117,876	15,689.91	1,302,262,610	4.500	20331115	0.46
5	アメリカ	国債	T 3.875 330815	8,520,000	14,549.68	1,239,632,708	15,002.16	1,278,184,115	3.875	20330815	0.45
6	中国	国債	CGB 2.39 261115	57,000,000	2,092.73	1,192,855,829	2,199.07	1,253,467,900	2.39	20261115	0.44
7	アメリカ	国債	T 1.625 310515	8,700,000	11,701.83	1,018,059,506	13,285.24	1,155,816,073	1.63	20310515	0.41
8	アメリカ	国債	T 4 340215	7,600,000	14,925.19	1,134,314,125	15,094.27	1,147,164,541	4.00	20340215	0.41
9	アメリカ	国債	T 2.875 320515	8,000,000	13,324.64	1,065,971,578	14,151.68	1,132,134,756	2.88	20320515	0.40
10	アメリカ	国債	T 1.875 320215	8,470,000	11,705.85	991,485,664	13,253.31	1,122,555,439	1.88	20320215	0.40
11	アメリカ	国債	T 3.5 330215	7,400,000	13,352.79	988,106,138	14,660.74	1,084,894,925	3.50	20330215	0.38
12	中国	国債	CGB 2.5 270725	48,000,000	2,061.02	989,287,244	2,216.03	1,063,694,769	2.50	20270725	0.38
13	アメリカ	国債	T 4.125 321115	6,900,000	13,989.57	965,280,572	15,372.13	1,060,677,213	4.13	20321115	0.38
14	アメリカ	国債	T 4.375 340515	6,730,000	15,376.44	1,034,834,550	15,525.96	1,044,896,855	4.38	20340515	0.37
15	アメリカ	国債	T 1.375 311115	8,100,000	11,209.42	907,962,926	12,873.82	1,042,779,441	1.38	20311115	0.37
16	アメリカ	国債	T 1.25 310815	8,000,000	11,381.97	910,557,388	12,856.63	1,028,530,121	1.25	20310815	0.36
17	中国	国債	CGB 2.68 300521	45,000,000	1,985.10	893,294,480	2,282.69	1,027,211,322	2.68	20300521	0.36
18	中国	国債	CGB 2.05 290415	45,000,000	2,212.08	995,435,631	2,205.88	992,645,806	2.05	20290415	0.35
19	アメリカ	国債	T 1.5 270131	6,660,000	11,870.25	790,558,897	14,863.08	989,880,844	1.50	20270131	0.35
20	アメリカ	国債	T 0.625 300815	7,700,000	10,843.22	834,927,816	12,786.62	984,570,008	0.63	20300815	0.35
21	中国	国債	CGB 2.18 260815	45,040,000	2,037.41	917,650,347	2,185.16	984,197,907	2.18	20260815	0.35
22	アメリカ	国債	T 0.875 301115	7,600,000	11,118.17	844,981,187	12,881.80	979,017,031	0.88	20301115	0.35
23	中国	国債	CGB 1.85 270515	43,000,000	2,079.21	894,062,431	2,183.95	939,099,237	1.85	20270515	0.33
24	アメリカ	国債	T 0.375 251231	6,160,000	13,523.51	833,048,397	15,134.68	932,296,449	0.38	20251231	0.33
25	アメリカ	国債	T 1.625 290815	6,500,000	13,122.71	852,976,402	13,960.40	907,426,258	1.63	20290815	0.32
26	アメリカ	国債	T 4.125 290331	5,600,000	15,558.04	871,250,069	15,578.77	872,410,870	4.13	20290331	0.31
27	アメリカ	国債	T 2.875 280815	5,820,000	11,479.99	668,135,604	14,957.64	870,534,733	2.88	20280815	0.31
28	アメリカ	国債	T 4.375 270715	5,500,000	14,901.65	819,591,009	15,759.30	866,761,500	4.38	20270715	0.31
29	アメリカ	国債	T 4.375 261215	5,500,000	14,873.83	818,060,405	15,755.00	866,525,083	4.38	20261215	0.31
30	アメリカ	国債	T 3.375 330515	5,870,000	14,208.45	834,035,740	14,484.51	850,240,517	3.38	20330515	0.30

※ 「投資比率」は、マザーファンド純資産総額に対する当該銘柄の時価残高の割合です。

B. 種別・業種別投資比率

種類	投資比率 (%)※
国債証券	98.40

※「投資比率」は、マザーファンド純資産総額に対する時価評価額の割合です。

C. 投資不動産物件

投資残高はありません。

D. その他投資資産の主要なもの

投資残高はありません。

(3)運用実績

A. 純資産の推移

(単位: 円)

基準日	純資産総額	1万口あたりの 純資産総額
第19期計算期末 (2023年11月30日)	1,593,400,582	17,352
12月末日	1,585,902,687	17,162
2024年1月末日	1,633,791,384	17,666
2月末日	1,657,694,137	17,877
3月末日	1,683,333,330	18,088
4月末日	1,717,201,877	18,367
5月末日	1,743,593,408	18,505
6月末日	1,796,388,899	19,090
7月末日	1,746,135,701	18,701
8月末日	1,676,247,593	18,055
9月末日	1,668,474,703	18,040
10月末日	1,707,929,386	18,707
11月末日	1,662,009,996	18,355
第20期計算期末 (2024年12月2日)	1,664,181,091	18,355
12月末日	1,694,152,430	18,827

B. 分配と収益率の推移

計算期間	1万口あたりの 分配金 (円)	収益率 (%)
第16期計算期 (2019年12月3日 ~ 2020年11月30日)	0	4.4
第17期計算期 (2020年12月1日 ~ 2021年11月30日)	0	3.7
第18期計算期 (2021年12月1日 ~ 2022年11月30日)	0	0.4
第19期計算期 (2022年12月1日 ~ 2023年11月30日)	0	8.7
第20期計算期 (2023年12月1日 ~ 2024年12月2日)	0	5.8

※「収益率」は、計算期末の基準価格(分配前)から前計算期末の基準価格(分配後)を控除した額の、前計算期末の基準価格(分配後)に対する割合です。

6. ご投資の手引(お手続き等の概要)

○お申込み手続き・ご解約申込み手続き

A. お申込み

申込単位	1円以上1円単位でお申込みいただくことができます。
申込方法	ご加入の確定拠出年金プランの運営管理機関を通じてお申込みいただくことができます。 申込方法の詳細は、当該運営管理機関のマニュアル等をご参照下さい。
申込口数の 計算方法	お申込口数は、お申込金額をお申込日の翌営業日の基準価格に1口当たりの信託財産留保金を加えた額で除して得た口数とします。(留保金率は0%としております。) <注>お申込日とはお客さまの指図が当行に15時までに到着した日をいいます。15時以降の到着分は、翌営業日の扱いとなります。 留保金率については、詳しくは「4. 手数料等および税金」(10頁)をご参照下さい。
申込手数料	ありません
信託財産留保金 <注1>	現在留保金率は0%としております。
その他	金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受領を停止することがございます。

B. ご解約申込み

ご解約申込単位	1口単位にてご解約申込みいただくことができます。
ご解約申込方法	ご利用の確定拠出年金プランの運営管理機関を通じてお客さまの指図を受領し実行します。 ご解約申込方法の詳細は、当該運営管理機関のマニュアル等をご参照下さい。
ご解約金額の 計算方法	ご解約・スイッチング金額は、お客さまご指図の口数に、ご解約申込日の翌営業日の基準価格から1口当たりの信託財産留保金を差引いた金額を乗じた金額とします。(留保金率は0%としております。) <注>ご解約申込日とはお客さまの指図が当行に15時までに到着した日をいいます。15時以降の到着分は、翌営業日の扱いとなります。 留保金率については、詳しくは「4. 手数料等および税金」(10頁)をご参照下さい。
ご解約申込手数料	ありません
信託財産留保金 <注1>	現在留保金率は0%としております。
その他	<ul style="list-style-type: none"> 当ファンドは確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドです。確定拠出年金法により原則として60歳前のご解約は、他商品へのスイッチングのみ認められております。 金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご解約の申込みの受領を停止することがございます。

<注1>信託財産留保金

信託財産留保金はお申込み・ご解約時の信託財産の売買コスト相当分を、お申込み・ご解約をされたお客さまに公平に負担していただくためのもので、同留保金はお申込み・ご解約のあったファンド全体の資産としてファンドに留保されます。

当ファンドは信託財産留保金制度を採用しておりますが、お客さまのお申込み・ご解約の実績等を勘案し、現在信託財産留保金率は0%としております。

当ファンドがマザーファンド受益権を売買する際に0.02%の留保金率によりファンドから支払われます。

7. 管理および運営の概要

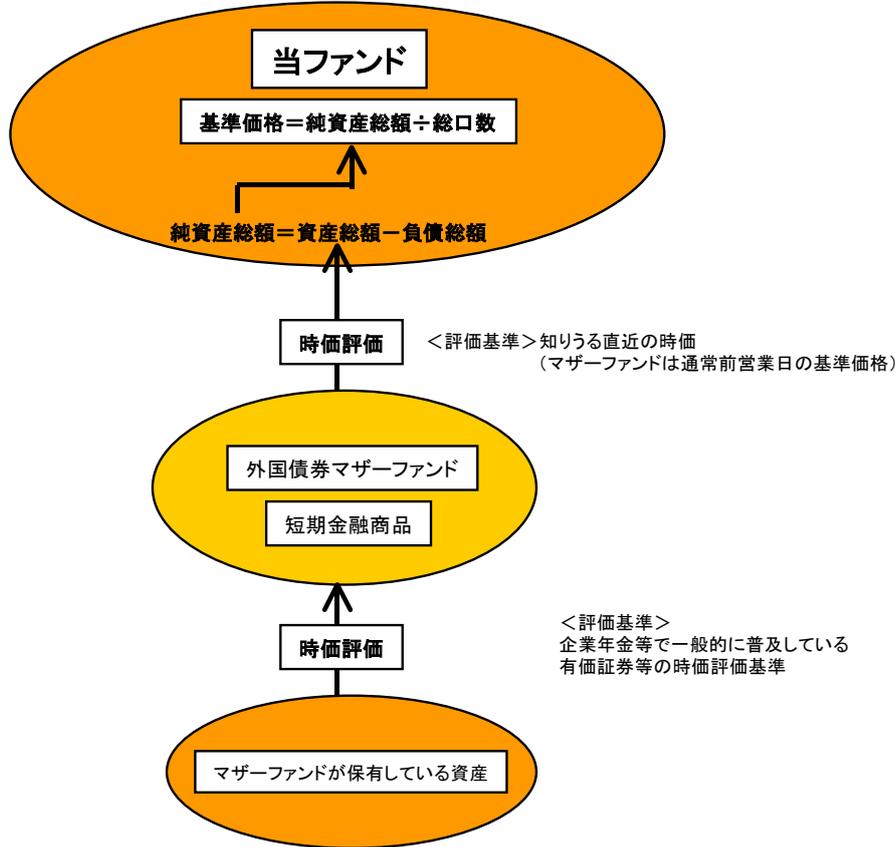
(1) 資産の評価（基準価格の算出）

A. 算出方法

基準価格とは、信託財産に属する資産を時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

- ・当ファンドの基準価格はマザーファンドの知り得る直近（通常は前営業日）の基準価格にて時価評価し、算出します。
- ・マザーファンドの基準価格は、企業年金等で一般的に普及している有価証券等の時価評価基準に従い時価評価し、算出します。

<基準価格算定の流れ>



<ご参考> マザーファンドの時価評価基準①

<注> 時価評価基準は変更することがあります。

外貨建運用資産	評価基準	情報入手先
上場債券	①当該債券が上場されている、上場取引所の終値、但し、終値が公表されず仲値が公表されている場合は仲値 ②当日終値または仲値がない場合は公表された買気配と売気配の仲値 ③買気配と売気配のいずれか片方しか公表されていない場合は原則当該気配値 ※2 ④上場取引所の終値または気配値の該当がない場合は、業界団体が発表する価格 ⑤業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ⑥理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データサービス・ジャパン ブルームバーグL.P. SIX Financial ブローカー
上場債券（取引所取引の価格が実勢を反映しないもの）	①業界団体が発表する価格 ②業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ③理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データサービス・ジャパン ブルームバーグL.P. SIX Financial ブローカー
非上場債券	①業界団体が発表する価格 ②業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ③理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データサービス・ジャパン ブルームバーグL.P. SIX Financial ブローカー
特殊債（上場債券・非上場債券）		
スワップ債	①当該債券が上場されている場合、上場取引所の終値または仲値 ※1 ②当日終値または仲値がない場合は公表された買気配と売気配の仲値 ※1 ③買気配と売気配のいずれか片方しか公表されていない場合は原則当該気配値 ※2 ④上場取引所の終値または気配値のない場合及び当該債券が上場されていない場合は、業界団体が発表する価格 ⑤業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ⑥理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データサービス・ジャパン ブルームバーグL.P. SIX Financial ブローカー
MTN	①当該債券が上場されている場合、上場取引所の終値または仲値 ※1 ②当日終値または仲値がない場合は公表された買気配と売気配の仲値 ※1 ③買気配と売気配のいずれか片方しか公表されていない場合は原則当該気配値 ※2 ④上場取引所の終値または気配値のない場合及び当該債券が上場されていない場合は、業界団体が発表する価格 ⑤業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ⑥理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データサービス・ジャパン ブルームバーグL.P. SIX Financial ブローカー
FRN（変動利付債）	①当該債券が上場されている場合、上場取引所の終値または仲値 ※1 ②当日終値または仲値がない場合は公表された買気配と売気配の仲値 ※1 ③買気配と売気配のいずれか片方しか公表されていない場合は原則当該気配値 ※2 ④上場取引所の終値または気配値のない場合及び当該債券が上場されていない場合は、業界団体が発表する価格 ⑤業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ⑥理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データサービス・ジャパン ブルームバーグL.P. SIX Financial ブローカー

<ご参考> マザーファンドの時価評価基準②

外貨建運用資産	評価基準	情報入手先
特殊債(上場債券・非上場債券)		
ステップアップ債	①当該債券が上場されている場合、上場取引所の終値または仲値 ※1 ②当日終値または仲値がない場合は公表された買気配と売気配の仲値 ※1 ③買気配と売気配のいずれか片方しか公表されていない場合は原則当該気配値 ※2 ④上場取引所の終値または気配値のない場合及び当該債券が上場されていない場合は、業界団体が発表する価格 ⑤業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ⑥理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データ・サービス・ジャパン ブルームバーグLP. SIX Finacial ブローカー
CMO/ABS	①当該債券が上場されている場合、上場取引所の終値または仲値 ※1 ②当日終値または仲値がない場合は公表された買気配と売気配の仲値 ※1 ③買気配と売気配のいずれか片方しか公表されていない場合は原則当該気配値 ※2 ④上場取引所の終値または気配値のない場合及び当該債券が上場されていない場合は、業界団体が発表する価格 ⑤業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ⑥理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データ・サービス・ジャパン ブルームバーグLP. SIX Finacial ブローカー
パスルー債	①当該債券が上場されている場合、上場取引所の終値または仲値 ※1 ②当日終値または仲値がない場合は公表された買気配と売気配の仲値 ※1 ③買気配と売気配のいずれか片方しか公表されていない場合は原則当該気配値 ※2 ④上場取引所の終値または気配値のない場合及び当該債券が上場されていない場合は、業界団体が発表する価格 ⑤業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ⑥理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データ・サービス・ジャパン ブルームバーグLP. SIX Finacial ブローカー
その他債券	①当該債券が上場されている場合、上場取引所の終値または仲値 ※1 ②当日終値または仲値がない場合は公表された買気配と売気配の仲値 ※1 ③買気配と売気配のいずれか片方しか公表されていない場合は原則当該気配値 ※2 ④上場取引所の終値または気配値のない場合及び当該債券が上場されていない場合は、業界団体が発表する価格 ⑤業界団体が発表する価格がない場合は、債券の特性に応じて算出された理論値 ⑥理論値が提供されない場合は、マーケットメイクをしているブローカーの気配値	ICE データ・サービス・ジャパン ブルームバーグLP. SIX Finacial ブローカー
為替		
為替予約	ロンドン時間午後4時のスポットレート ・ロンドン時間午後4時のフォワードレート ・予約期日がフォワードレート期日以外の場合は、その前後のフォワードレートを日数で按分して線形補間で求めたレートを使用 計算事例：期日直前・直後のフォワードレートが発表されている場合 評価レート=直前フォワードレート+[差]×A÷B [差]・・・直後のフォワードレート-直前のフォワードレート A・・・直前のフォワード日から予約期日までの日数(片端) B・・・直前のフォワード日から直後フォワード日までの日数(片端)	Refinitiv Refinitiv

※1 上場債券であっても米国内債、NY取引所上場債のように取引所での取引が少ない等の理由により、取引所の価格が実勢を反映しないと判断された場合は「上場債券(取引所の価格が実勢を反映しないもの)」の評価基準を採用

※2 買気配または売気配いずれか片方しか公表されない場合で実勢との乖離が大きい場合は気配値を採用せず

※ 市場価額、合理的に算定された価額および適切なブローカーの気配値等のない有価証券は、取得原価または償却原価にて評価

<ご参考> マザーファンドの時価評価基準③

運用資産	評価基準	情報入手先
外貨建債券未収収益	各国・債券種類別における計算基準によって算定した額から外国源泉税を控除した額 <注> 課税ファンドについては、外国源泉税控除前の額	-
上場先物取引	取引を行った取引所の清算価格 ①上場取引所の終値 ②当日終値のない場合は、気配値 ③気配値もない場合は、直近採用値	ICE データ・サービス・ジャパン ブルームバーグLP.

B. 基準価格の算出頻度

基準価格は日々算出します。

(2)持分の計算方法

お客様の持分は、計算日の基準価格より1口あたりの信託財産留保金を控除した額に保有口数を乗じて得た額として計算されます。

(3)その他管理および運営の仕組み

A. 信託期間

無期限とします。ただし、信託契約の全部が解約または内戻しされた場合、または合同運用財産の純資産総額が、ファンド設定後10年経過後の最初の決算日以降に1億円を下回ったとき、または信託目的を達成したとき、もしくは信託目的の達成が不可能もしくは著しく困難と受託会社が認めたとき、この信託契約は終了します。終了に際して受託会社は、あらかじめ確定拠出年金の運営管理機関に通知します。

B. 収益計算期

毎年12月1日から翌年11月30日とします。

なお、収益計算期の終了日が当行休業日のときは、計算期終了日はその翌営業日とし、その翌日より次の計算期を開始します。

C. 運用状況のご報告

<運用報告>

基準価格および運用状況は運営管理機関を通じてご報告します。

<決算報告>

決算終了後に、期中の運用経過や期末残高状況、有価証券の売買状況、収益分配結果を記載した決算報告書を作成します。

<その他のお問い合わせ>

その他のご照会につきましては、下記までお問い合わせ下さい。

◇みずほ信託銀行株式会社

アセットマネジメント推進部 業務管理チーム (電話番号) 03-3240-7058

<受付時間> 営業日 午前9時～午後5時

◇みずほ信託銀行株式会社のホームページ <https://www.mizuho-tb.co.jp/>

D. 約款および本説明書の改訂

約款および本説明書の記載事項について、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社は約款および本説明書を改訂することがあります。改訂に際して受託会社は、確定拠出年金の運営管理機関に通知します。

(4) 受益者の権利等

A. 収益分配金を請求する権利

収益分配時における受益者は、収益分配金を、持分に応じて受託会社に請求する権利があります。

B. 解約請求権

受益者は、受益権の持分の一部および全部を、運営管理機関を通じて受託会社に請求することができます。

C. 当ファンドの信託終了時における交付金を請求する権利

信託終了時における受益者は、終了時の純資産総額を当該終了日の残存口数によって按分した金額を受託会社に請求する権利があります。

(5) 受託会社の概況 (2024年9月30日現在)

A. 名称

みずほ信託銀行株式会社

B. 資本の額

資本金 2,473億円

発行済株式総数(普通株式) 7,914,784千株

C. 会社の沿革

年月	事項
1925年 5月 9日	共済信託株式会社として設立
1926年 2月 12日	商号を安田信託銀行に変更
1962年 7月 25日	適格退職年金信託第1号受託
1966年 10月 1日	厚生年金基金信託業務開始
1999年 10月 1日	第一勧業富士信託銀行へ財管3部門(年金・資産運用、証券管理、証券代行)を営業譲り渡し
2002年 4月 1日	商号をみずほアセット信託銀行に変更
2003年 3月 12日	みずほ信託銀行 [*] と合併、商号をみずほ信託銀行に変更
2011年 9月 1日	みずほフィナンシャルグループの完全子会社となる。

※合併前旧みずほ信託銀行の沿革

年月	事項
1999年 4月 1日	第一勧業信託銀行と富士信託銀行が合併、第一勧業富士信託銀行が発足
1999年 10月 1日	第一勧業富士信託銀行が、安田信託銀行から財管3部門(年金・資産運用、証券管理、証券代行)を営業譲り受け
2000年 10月 1日	第一勧業富士信託銀行と興信託銀行が合併、みずほ信託銀行が発足
2003年 3月 12日	みずほアセット信託銀行と合併

D. 大株主の状況 (普通株式) (2024年9月30日現在)

株主	保有株数	比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	7,914,784千株	100.00%

8. 財務ハイライト情報

以下の情報は、「第Ⅱ部 ファンドの詳細情報」の「2. 決算状況」に記載されている当ファンドの決算内容から抜粋して記載したものです。

(1) 資産、負債、元本および基準価格の状況

項目	第19期(2023年11月30日)	第20期(2024年12月2日)
(A) 資産	1,594,881,321 円	1,668,825,147 円
外国債券マザーファンド(評価額)	1,592,280,188	1,662,493,635
銀行勘定貸	2,601,133	6,331,512
未収金	0	0
(B) 負債	1,480,739 円	4,644,056 円
未払金	1,480,739	4,644,056
(C) 純資産総額(A-B)	1,593,400,582 円	1,664,181,091 円
元本	918,302,132	906,670,924
分配準備積立金	675,098,450	757,510,167
信託損失	0	0
(D) 受益権総口数	918,302,132 口	906,670,924 口
1万口あたり基準価格(C/D×10,000)	17,352 円	18,355 円

(2) 損益の状況

項目	第19期 (2022年12月1日～2023年11月30日)	第20期 (2023年12月1日～2024年12月2日)
(A) 利配当等収益	0 円	566 円
銀行勘定貸利息	0	566
(B) 売買損益等	130,676,629 円	97,941,420 円
売買損益	20,433,391	41,800,528
評価損益	110,243,238	56,140,892
(C) 信託報酬	△ 4,035,176 円	△ 4,648,805 円
(D) その他費用	0 円	0 円
(E) 雑益	0 円	0 円
(F) 当期利益(A+B+C+D+E)	126,641,453 円	93,293,181 円
(G) 信託財産留保金	0 円	0 円
(H) 収益調整金	15,136,269 円	△ 10,881,464 円
(I) 前期繰越損益	533,320,728 円	675,098,450 円
分配準備積立金	533,320,728	675,098,450
信託損失	0	0
(J) 当期末処分利益(F+G+H+I)	675,098,450 円	757,510,167 円
<利益処分>		
(K) 収益分配金	0 円	0 円
(L) 次期繰越損益(J-K)	675,098,450 円	757,510,167 円
分配準備積立金	675,098,450	757,510,167
信託損失	0	0

○ 重要な会計方針

項目	期別 第19期計算期 (2022年12月1日～2023年11月30日)
運用資産の評価基準 および評価方法	<マザーファンド>移動平均法に基づき、2023年11月29日付基準価格で評価しております。
費用・収益の計上基準	<有価証券売買等損益の計上基準>約定日基準で計上しております。

項目	期別 第20期計算期 (2023年12月1日～2024年12月2日)
運用資産の評価基準 および評価方法	<マザーファンド>移動平均法に基づき、2024年11月29日付基準価格で評価しております。
費用・収益の計上基準	<有価証券売買等損益の計上基準>約定日基準で計上しております。

<50音順>

■インデックス運用とアクティブ運用

市場の指標を上回る収益の獲得を目指すアクティブ運用に対して、市場に連動した収益を目指す運用手法をインデックス運用といいます。一般に、超過収益を追求するため高コストとなりがちなアクティブ運用に対して、インデックス運用は市場に連動した収益を低コストで目指します。

当ファンドは、外国債券のインデックス運用をするマザーファンドに投資します。

■基準価格

計算日時点のファンドの資産総額から負債総額を差引いた金額（純資産総額）をそのときの受益権口数で除した1口当たりの純資産総額をいい、投資信託における基準価額に相当するものです。

お客さまの持分計算の基準となるもので、日々算出しております。

（基準価格の計算方法や資産の評価方法については、本説明書15頁をご参照下さい。）

$$\text{基準価格} = \frac{\text{計算日時点のファンドの純資産総額(貸借対照表の資産の部より負債の部を差し引いたもの)}}{\text{計算日時点の総口数}}$$

■収益分配金

ファンドの決算時に、決算日時点での受益者に支払われる収益金のこと。収益金は、ファンドに組み入れた有価証券等から生ずる利子・配当、売買益、評価益などの合計額から経費、信託報酬およびこれに係る消費税相当額を差し引いた金額を原資とし、分配方針にしたがって受益権口数に応じて平等に分配されます。（詳細は約款第11条(本説明書22頁)をご参照下さい。）

当ファンドでは、分配金額は全額再投資されます。（本説明書6頁）

■受益権

信託財産の元本および運用成果を受取る権利のことをいい、その持分は口数によって計られます。（本説明書16頁）

当ファンドは、元金が保証されているものではなく、預金保険、投資者保護基金の対象ではありません。また、当行による元本の補填・利益の補足もありません。

■受益者

受益権を持つ個人や法人をいいます。

■信託期間

ファンド毎に定められた存続期間のことをいいます。

当ファンドについては、「原則として無期限」ですが、一定の事由により信託契約が終了することがあります。詳細は本説明書16頁および約款第18条(本説明書23頁)をご参照下さい。

■信託財産留保金

信託財産留保金はお申込み・ご解約時の信託財産の売買コスト相当分を、お申込み・ご解約をされたお客さまに公平に負担していただくためのもので、次の金額がお申込み・ご解約されたファンド全体の資産としてファンドに留保されます。

- ・お申込み時 お申込み金額 × 留保金率
- ・ご解約申込時 ご解約申込み口数 × 適用される基準価格 × 留保金率

■信託報酬

信託財産の運用および管理の対価として、信託銀行に対し信託財産より支払われる報酬をいいます。

当ファンドの信託報酬率は、本説明書の3頁または10頁をご参照下さい。

■スイッチング

複数の商品群の間で、運用商品を切り替えることをいいます。

具体的には、一方の商品の全部あるいは一部について運用を中止して換金し、その分を他方の商品に投資することによって切り替えを行います。

特に、確定拠出年金制度においては、当該確定拠出年金プランのラインナップ商品間でスイッチングを行うことによって、運用方法を変更することになります。

■スポットレート、フォワードレート

外国為替取引は為替の受渡しの時期を基準にして直物為替と先物為替に区分されます。スポットレートは直物為替相場のこと、銀行間取引で原則として翌々営業日渡しのものに適用される相場をいい、対顧客取引では当日渡しの相場となります。

他方、フォワードレートは先物相場のこと、為替の受渡しが将来の特定の時期に行われるものに適用される相場をいいます。

■デュレーション

キャッシュフロー（元本と利息）および利回りを考慮した債券の平均残存期間のこと。

投資した債券元本を回収するために必要な平均投資期間を意味すると共に債券価格の金利変化に対する感応度を示し、デュレーションの値が大きいほど金利変化に対する感応度は大きく、金利変動リスクは大きいといえます。

■デリバティブ

株式、公社債、為替や金利などの本来の金融商品から派生したものの総称で、先物取引、オプション取引、スワップ取引などがあり、派生商品ともいいます。

- ・当ファンド（ベビーファンド）は原則として、デリバティブに投資することはありません。（本説明書4頁）
- ・当ファンド（ベビーファンド）が投資するマザーファンドは、ヘッジ目的に限定してデリバティブに投資します。（本説明書6頁）
- ・当ファンドが投資するマザーファンドのデリバティブへの投資状況については、本説明書「第Ⅱ部 2. 決算状況」（30頁）をご参照下さい。

■年金投資基金信託

年金投資基金信託は、信託法および信託業法に基づき、信託銀行が自ら運用を行いまた資産管理も行う金銭信託です。

厚生年金基金や確定給付企業年金、確定拠出年金など年金資金の運用において、効率性、投資リスクの分散、運用対象の多様化を図るため、同じ目的の資金をまとめて運用する仕組みで、年金信託や確定拠出年金特定金銭信託の受託者である信託銀行が委託者兼受益者となり、ファンドの運用・管理者としての信託銀行を受託者とする信託です。

信託銀行が受託した資産は信託財産として分別管理されているため、万一信託銀行が破綻しても資産は保全されます。

当ファンドにおいては追加・解約を公平に実現するために、基準価格を用いて持分を計算する仕組みを採用しています。

■年金投資基金信託約款

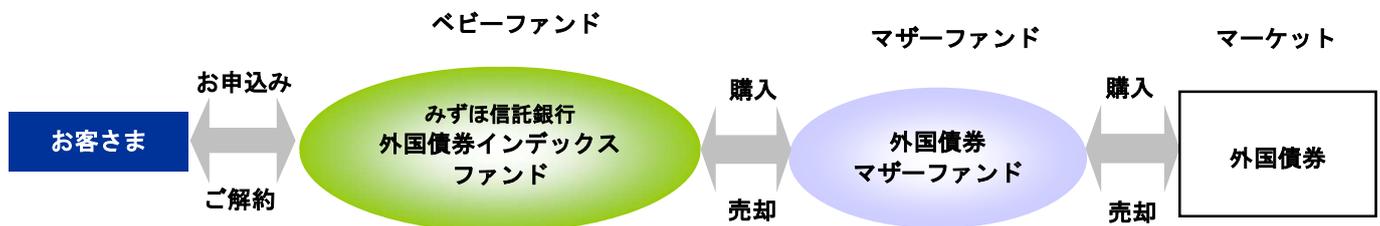
当該年金投資基金信託の運営について定めたもので、主な項目としては信託の目的、投資対象、追加・解約、信託報酬、収益分配金、信託の終了等があります。

当ファンドおよび当ファンドが投資するマザーファンドの約款は本説明書21頁～27頁をご参照下さい。

■ファミリーファンド方式

お客さまが投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を同じ目的の他の資金とまとめてマザーファンドに投資して、効率的な運用を行う仕組みです。

当ファンドを例としますと、お客さまが投資した資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を同じ目的の他の資金（マイブレンドやライフマネージ等の資金）とまとめてマザーファンド（外国債券マザーファンド）に投資します。（本説明書4頁）



■ヘッジ

有価証券や為替の価格変動による損失の可能性をデリバティブ等を用いて回避することをいいます。

■ベンチマーク

運用の目標とする指標のことをいいます。

例として、当ファンドはFTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）への連動を目指しますが、この場合の「FTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）」を「当ファンドのベンチマーク」といいます。

■リターンとリスク

ファンドのリターンとは収益率（基準価格の騰落率）、リスクとは期間毎の収益率のブレや損失の可能性をいいます。

年金投資基金信託約款 ベビーファンド／マザーファンド

年金投資基金信託（確定拠出年金口 みずほ信託銀行 外国債券インデックスファンド）約款

第 1 条（目的）

委託者は、委託者と株式会社との間に締結された 年 月 日付確定拠出年金特定金銭信託契約に基づき、当該確定拠出年金特定金銭信託契約の信託財産たる金銭を受益者のために利殖する目的で信託し、受託者はこれを引受けました。

第 2 条（追加信託）

委託者は、受託者の承諾を得て、金銭を追加信託することができます。

第 3 条（合同運用）

1. 信託財産は、運用方法が同じである他の信託財産と合同して運用します。
2. 前項に基づき合同して運用した信託財産（以下、「合同運用財産」といいます。）について生じた損益は、第 8 条、第 1 1 条および第 1 2 条から第 1 8 条までに定める方法によりそれぞれの信託財産の各受益者に帰属します。

第 4 条（運用方法）

1. 信託財産は、次に掲げる有価証券等に運用します。
 - (1) 年金投資基金信託受益権（外貨建証券口）
 - (2) 預金（譲渡性預金を含む）、コールローン、手形割引市場において売買される手形および円建銀行引受手形、コマースシャル・ペーパー（資産担保型コマースシャル・ペーパーを含みます。）
2. 前項第 1 号に掲げる財産については、みずほ信託銀行株式会社を受託者とするものを含みます。
3. 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものとして金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（以下「兼営法」といいます）施行規則第 2 3 条第 3 項に定める場合に該当するときは、受託者または第 6 条第 3 項に基づく再信託の受託者の銀行勘定との間で、次の各号に掲げる取引を行うことがあります。
 - (1) 為替取引および外国為替の売買の予約
 - (2) 預金、コールローン、手形割引市場において売買される手形、および円建銀行引受手形の取得・処分に係る取引
4. 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものとして兼営法施行規則第 2 3 条第 3 項に定める場合に該当するときは、信託業法第 2 9 条第 2 項第 1 号に定める利害関係人（同法第 2 2 条第 2 項により読み替えられる場合を含み、以下「利害関係人」といいます。）又は第 6 条に定める委託先（以下、これと利害関係人とを総称して「利害関係人等」といいます。）との間で、次の各号に掲げる取引を行うことがあります。
 - (1) 有価証券の売買等取引（売買等の委託を含みます。）
 - (2) 為替取引および外国為替の売買の予約
 - (3) 預金、コールローン、手形割引市場において売買される手形、および円建銀行引受手形の取得・処分に係る取引
5. 受託者は第 3 項による受託者または第 6 条第 3 項に基づく再信託の受託者の銀行勘定との取引、前項による利害関係人等との取引を行った場合は、受益者に対し、兼営法第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 2 9 条第 3 項に基づく報告を行います。
6. 受託者は、受益者の保護に支障が生じることがないものとして兼営法施行規則第 2 3 条第 3 項に定める場合に該当するときは、信託財産を受託者または第 6 条第 3 項に基づく再信託の受託者の銀行勘定に運用することがあります。この場合、受託者は受益者に対し、兼営法第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 2 9 条第 3 項に基づく報告を行います。
7. この信託財産の運用にあたっては、貸出先や有価証券の発行体の信用状況又は有価証券等信託財産に属する資産の値動きの状況等により、信託財産の欠損が生じることがあります。この場合、受託者は、これを補填することはできません。
8. 受託者は、受託者の銀行勘定または受託者の利害関係人の計算において、本条に基づき行われる取引と同種の取引を行うことがあります。
9. 受託者は、前項に定める取引を行った場合、受益者に対する信託法第 3 2 条第 3 項に定める通知は行わないものとします。

第 5 条（借入金）

信託財産は、新株式についての払込その他短期の資金繰上やむを得ない場合は、これを担保に供して借入をすることがあります。この借入金は信託財産に属し、前条の信託財産と同一の方法により運用します。

第 6 条（信託業務の委託）

1. 受託者は、信託業務の一部を第三者に委託するときは、次の各号に掲げる基準に適合する者を選定するものとします。
 - (1) 委託先の信用力に照らし、継続的な委託業務の遂行に懸念がないこと
 - (2) 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 - (3) 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制や内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されている者であること
2. 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、複数の部署において、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
3. 受託者は、信託事務の処理の一部について、信託法第 2 8 条に基づく信託事務の委託として、兼営法第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた金融機関のうち別に定める者（受託者の利害関係人を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができるものとします。
4. 前 3 項にかかわらず、受託者は以下の業務を、受託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含む）に委託することができるものとします。

- (1) 信託財産の保存にかかる業務
 - (2) 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 - (3) 委託者および受益者（委託者および受益者から指図の権限の委託を受けた者を含む。）のみの指図により受託者が行う業務
 - (4) 受託者（受託者から指図の権限の委託を受けた者を含む。）のみからの指図により委託先が行う業務
 - (5) 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為
5. 第1項、第3項および前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがないものとして兼営法施行規則第23条第3項に定める場合に該当するときに行うものとします。

第7条（信託の登記・登録の留保等）

1. 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受益者の利益に資する等の合理的な理由があると受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
2. 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
3. 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともにその計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受益者の利益に資する等の合理的な理由があると受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

第8条（計算方法）

1. この信託契約が締結された時に、合同運用財産において他の信託契約がまだ締結されていない場合は、1円を1口として、信託金を引受けます。
2. 前項以外の場合は、受託者が承諾を行った日の翌営業日の計算基準価格に、原則として信託財産留保金を加算した額を1口として、その整数倍の価額に相当する財産を信託金の額として引受けます。
3. 前項の場合、委託者は、受託者の承諾を得て、承諾後3営業日以内に信託金を追加することができます。
4. この約款において計算基準価格とは、合同運用財産の純資産総額を、計算日の総口数で除して得た価額をいいます。
5. この約款において純資産総額とは、受託者が信託金を拠出している年金投資基金信託受益権（外貨建証券口）については知り得る直近の基準価格に保有口数を乗じた資産額と、適正な価格によって計算した信託財産の合計である資産総額から負債総額を控除した額とします。

第9条（租税・事務費用）

信託財産に関する租税その他信託事務の処理に必要な費用（以下「諸経費」といいます。）は、信託財産の中から支払います。

第10条（信託報酬）

1. 信託報酬を計算するにあたり、信託財産の純資産総額に別に定める割合の365分の1を乗じて得た額とそれに係る消費税（地方消費税を含む）に相当する額を毎日未払金として計上します。
2. 前項の未払金として計上された額を、第11条に定める収益計算期並びに毎年5月の末日（同日が休業日のときは前営業日）に、信託財産の中から控除します。

第11条（収益計算期および収益処分方法）

1. 収益計算期は、毎年11月の各末日（同日が休業日の場合は翌営業日、以下「毎計算期末」といいます。）および信託終了のときとし、毎計算期末における収益は、信託終了のときを除き次の方法により処理します。
 - (1) 利子およびこれらに類する収益（未収収益を含む。以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税に相当する額を控除した後、その残額を各受益者の保有する口数に応じて分配します。ただし、その全部および一部を分配準備積立金として積立てることができます。
 - (2) 売買、償還およびこれに類する利益に評価差益を加えた利益（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬を控除し、信託財産につき生じた損失（以下「信託損失」といいます。）のあるときはその全額に充当した後、その残額を各受益者の保有する口数に応じて分配します。ただし、その全部または一部を分配準備積立金として積立てることができます。
 - (3) 前2号および第13条第3項に定める諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税に相当する額の控除は、配当金等収益、信託財産留保金および売買益にそれぞれ按分して行います。
2. 受益者は、前項の分配金を再投資として追加信託するものとします。なお、この場合における基準価格は毎計算期末の利益処分後基準価格とし、受託者は第8条第2項にかかわらず信託財産留保金を加算することなく基準価格で除して得た口数として、信託財産を引受けます。
3. 第1項の計算は、毎計算期末において行い、信託財産に関する計算書を作成し、これを受益者に遅滞なく提出します。ただし、信託終了のときは、第18条に定めるところによります。

第11条の2（報告書の提出）

1. 受託者は、毎計算期末現在における次の各号に掲げる報告書を、作成後遅滞なく受益者に提出します。
 - (1) 兼営法第2条第1項で準用する信託業法第27条第1項に定める信託財産状況報告書
 - (2) 信託法第37条第2項に定める財産状況開示資料
2. 受託者が前項に定める報告書を提出したときは、前条に定める収益計算に関する報告も行ったものとします。
3. 受託者が第1項に定める方法で報告書を提出したときは、信託法第37条第3項の報告も行ったものとします。

第12条（分配準備積立金）

分配準備積立金は、受託者が必要と認めた場合にはこれを取崩し、分配または信託損失の充当を行うことができます。

第13条（信託財産留保金）

1. 1口あたりの信託財産留保金は、第2条に定める受託者の承諾または第16条第1項に定める委託者の請求のあった日の基準価格に受託者が別に定める率を乗じて得た額とします。
2. 前項における率は、実績等を勘案し、随時見直します。

3. 信託財産留保金は、毎計算期末において諸経費を控除し、信託損失のあるときはその全額に充当した後、その残額を受益者に分配します。ただし、その全部または一部を分配準備積立金として積立てることができます。

第 14 条 (収益調整金)

1. 信託金、内戻財産または解約財産は、信託金、内戻財産または解約財産の口数に 1 円を乗じた金額とその他の金額とに分け、前者を元本、後者を収益調整金として処理します。
2. 収益調整金は、毎計算期末において信託損失のあるときはその全額に充当した後、その残額を分配準備積立金として積立てます。ただし、その全部または一部を受益者に分配することができます。
3. 収益調整金が負の値になったときは、毎計算期末において、信託損失として処理します。

第 15 条 (信託損失の充当順序)

1. 信託損失の充当順序は、次のとおりとします。
 - (1) 信託財産留保金
 - (2) 売買益
 - (3) 収益調整金
 - (4) 分配準備積立金
2. 前項により充当できない信託損失は、次期に繰越します。

第 16 条 (解約・内戻し)

1. 委託者は、この信託契約の解約または口数単位による信託金の内戻しを請求することができます。ただし、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときはこの限りではありません。
2. 前項の場合には、受託者は、これにより生じた損害金相当額を信託財産に留保し、残額を受益者に支払うことがあります。

第 17 条 (解約・内戻しの時期と計算)

解約、内戻しの金額は当該解約・内戻しの請求日の翌営業日の基準価格から、原則として 1 口当たりの信託財産留保金を控除した額にその口数を乗じた額とし、請求日から起算して 5 営業日以内に金銭で交付します。ただし合同運用財産の全てが解約されたときは、純資産総額を当該終了日の残存口数により按分した額の金銭を受益者に交付します。

第 18 条 (信託の終了および最終計算)

1. この信託は、第 16 条の定めによりこの信託契約の全部が解約または内戻しされた場合、または合同運用財産の純資産総額がファンド設定日より 10 年経過後最初の収益計算期以降に 1 億円を下回ったときまたは信託目的を達成したときもしくは信託目的の達成が不可能もしくは著しく困難と受益者が認めたとき終了します。
2. 前項によりこの信託が終了したときは次項の価額に相当する信託財産を終了した日から 1 ヶ月以内に受益者に交付します。
3. 最終計算においては、純資産総額を当該終了日の残存口数により按分した価額を交付額とします。
4. 受託者は、第 2 項の信託財産の交付に際し、最終計算書を作成し、受益者の承認を求めるとします。

第 19 条 (信託約款の変更)

受託者は受益者の利益のために必要と認められるとき、またはやむをえない事情が発生したときには、この信託約款を変更できるものとします。

第 20 条 (譲渡・質入)

この信託の受益権は、譲渡することまたは受託者の承諾なしに質入することはできません。

第 21 条 (善管注意義務)

1. 受託者は、信託の本旨に従い、善良な管理者の注意をもって、もっぱら受益者の利益のために信託事務を処理します。
2. 受託者がこの信託契約や法令に基づく任務を怠った場合において、信託財産に損失が生じたことにかかる措置については、信託財産に対し金銭によるてん補の方法により行うものとします。
3. 前項の場合において、信託財産に変更が生じたことにかかる措置について、原状回復が適当であると受託者が判断する場合は、この約款の信託目的に則し受託者が合理的と考える原状回復の方法により行うものとします。

第 22 条 (信託法等との関係)

この約款に定めのない事項については、信託法その他の法令の規定にしたがうものとします。

マザーファンド / 年金投資基金信託（外貨建証券口）約款

第 1 条（目的）

委託者は、委託者と 株式会社の間に締結された 年 月 日付確定拠出年金特定金銭信託契約に基づき、当該確定拠出年金特定金銭信託契約の信託財産を受益者のために利殖する目的で信託し、受託者はこれを引受けました。

第 2 条（追加信託）

委託者は、受託者の承諾を得て、金銭または有価証券を追加信託することができます。

第 3 条（合同運用）

1. 信託財産は、運用方法が同じである他の信託財産と合同して運用します。
2. 前項に基づき合同して運用した信託財産（以下「合同運用財産」といいます。）について生じた損益は、第 8 条、第 1 1 条および第 1 2 条から第 1 8 条までに定める方法によりそれぞれの信託財産の各受益者に帰属します。

第 4 条（運用方法）

1. 信託財産は、次に掲げる外国通貨をもって表示される有価証券（以下外貨建証券といいます。）等に運用します。ただし、その一部を円貨建有価証券で前各号の証券または証書の性質を有するもの（第 7 号については上場銘柄および日本証券業協会に登録された店頭売買銘柄に限る。以下円貨建証券といいます。）、指定金銭信託受益権（合同運用一般口）、預金、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形、円貨建銀行引受手形およびコマーシャル・ペーパー（資産担保型コマーシャル・ペーパーを含みます。）に運用することがあります。
 - (1) 国債
 - (2) 地方債
 - (3) 社債（社債の引受権を表示する証券または証書、資産担保型社債および特定社債を含みます。）
 - (4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - (5) 国際機関の発行する債券
 - (6) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券
 - (7) 株式（新株予約権証券を含みます。）
 - (8) 投資信託受益証券、投資法人の発行する投資証券および投資法人債券
 - (9) コマーシャル・ペーパー（資産担保型コマーシャル・ペーパーを含みます。）
 - (10) 預金、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形
 - (11) 貸付金および貸付債権を表示する証書
 - (12) 不動産に係る権利を表示する証券または証書で前各号の性質を有するもの。
 - (13) 外国法人の発行する譲渡性預金証書
2. 前項ただし書きの指定金銭信託受益権については、合同運用財産の受託者を受託者とするものを含むものとします。
3. 信託財産は、原則として、信託財産の 1 0 0 分の 1 0 をこえて同一会社の発行する社債、株式およびこれらを担保とする貸付金ならびに当該会社に対する貸付金に運用しません。ただし、対象となるベンチマークにおいて当該社債もしくは株式の構成比率が 1 0 0 分の 1 0 をこえる場合、ベンチマーク構成比率を基準として上記割合をこえて運用することがあります。
4. 受託者は、信託財産に属する有価証券を証券貸借取引（レポ取引およびリバース・レポ取引を含みます。）および条件付売買（以下「現先」といいます。）取引にて運用することがあります。証券貸借取引および現先取引を行うに際し、受託者は運用有価証券信託を設定することがあります。

受託者は、証券貸借取引における担保金等を預金、コール・ローン、現先取引、リバース・レポ取引、貸付金等に運用することがあります。

受託者は、別に定めるところにより証券貸借取引に係る貸付契約および売買契約等の代理権を第三者（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（以下「兼営法」といいます。）第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 2 9 条第 2 項第 1 号に定める利害関係人（同法第 2 2 条第 2 項により読み替えられる場合を含み、以下「利害関係人」といいます。）を含みます。）に付与することがあります。
5. 受託者は、信託財産に属する資産について、当該資産の価額等のヘッジのため、外国為替の売買の予約、有価証券・通貨・金利等に係る先物取引・指数先物取引・オプション取引、通貨・金利等に係るスワップ取引および株式信用取引を行うことがあります。
6. 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものとして兼営法施行規則第 2 3 条第 3 項に定める場合に該当するときは、受託者の銀行勘定との間で、次の各号に掲げる取引を行うことがあります。
 - (1) 有価証券・通貨・金利等に係る先物取引、指数先物取引およびオプション取引ならびに通貨・金利等に係るスワップ取引
 - (2) 為替取引および外国為替の売買の予約
 - (3) 指定金銭信託受益権、預金、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形、円貨建銀行引受手形、投資信託受益証券、投資法人の発行する投資証券、および投資法人債券の取得・処分に係る取引
7. 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものとして兼営法施行規則第 2 3 条第 3 項に定める場合に該当するときは、利害関係人または第 6 条に定める委託先（以下、これと利害関係人とを総称して「利害関係人等」といいます。）との間で、次の各号に掲げる取引を行うことがあります。
 - (1) 有価証券の売買等取引（売買等の委託を含みます。）および第 4 項に定める証券貸借取引および現先取引
 - (2) 有価証券・通貨・金利等に係る先物取引、指数先物取引およびオプション取引ならびに通貨・金利等に係るスワップ取引
 - (3) 為替取引および外国為替の売買の予約
 - (4) 指定金銭信託受益権、預金、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形、円貨建銀行引受手形、投資信託受益証券、投資法人の発行する投資証券、および投資法人債券の取得・処分に係る取引

8. 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものとして兼営法施行規則第23条第3項に定める場合に該当するときは、この信託財産と他の信託財産との間で、次の各号に掲げる取引を行うことがあります。
 - (1) 有価証券の売買取引
 - (2) 有価証券に係わる先物取引、指数先物取引およびオプション取引
9. 受託者は第6項による受託者の銀行勘定との取引、第7項による利害関係人等との取引または第8項による信託財産間の取引を行った場合は、受益者に対し、兼営法第2条第1項にて準用する信託業法第29条第3項に基づく報告を行います。
10. 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものとして兼営法施行規則第23条第3項に定める場合に該当するときは、信託財産を受託者の銀行勘定に運用することがあります。この場合、受託者は受益者に対し、兼営法第2条第1項にて準用する信託業法第29条第3項に基づく報告を行います。
11. この信託財産の運用にあたっては、貸出先や有価証券の発行体の信用状況または有価証券等信託財産に属する資産の値動きの状況等により、信託財産の欠損が生じることがあります。この場合、受託者は、これを補填することはできません。
12. 受託者は、受託者の銀行勘定または受託者の利害関係人の計算において、本条に基づき行われる取引と同種の取引を行うことがあります。
13. 受託者は、前項に定める取引を行った場合、受益者に対する信託法第32条第3項に定める通知は行わないものとします。

第5条（借入金）

信託財産は、新株式についての払込その他短期の資金繰上やむを得ない場合は、これを担保に供して借入をすることがあります。この借入金は信託財産に属し、前条の信託財産と同一の方法により運用します。

第6条（信託業務の委託）

1. 受託者は、以下の各号に掲げる業務の全部または一部について、当該各号に掲げる者（利害関係人を含みます。）に委託することがあります。
 - (1) 信託財産の有価証券の運用に係る業務
金融商品取引法に定める投資運用業に関する登録を行っている者および外国の法令に準拠して外国において有価証券の運用を業として営む者
 - (2) 有価証券の証券貸借取引および現先取引に係る業務
第4条第6項に基づき選任された者
2. 受託者は、前項に定める委託をするときは、前項各号に掲げる者の中から、次の各号に掲げる基準に適合する者を選定するものとします。
 - (1) 委託先の信用力に照らし、継続的な委託業務の遂行に懸念がないこと
 - (2) 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 - (3) 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制や内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されている者であること
3. 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、複数の部署において、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
4. 受託者は、信託事務の処理の一部について、信託法第28条に基づく信託事務の委託として、兼営法第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた金融機関のうち別に定める者（利害関係人を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができるものとします。
5. 前4項にかかわらず、受託者は以下の業務を、受託者が適当と認める者（利害関係人を含む）に委託することができるものとします。
 - (1) 信託財産の保存にかかる業務
 - (2) 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 - (3) 委託者および受益者（委託者および受益者から指図の権限の委託を受けた者を含む。）のみの指図により受託者が行う業務
 - (4) 受託者（受託者から指図の権限の委託を受けた者を含む。）のみの指図により委託先が行う業務
 - (5) 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為
6. 第1項、第4項および前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがないものとして兼営法施行規則第23条第3項に定める場合に該当するときに行うものとします。

第6条の2（運用業務の委託）

受託者は、前条第1項第1号に基づき信託財産の有価証券の運用に係る業務の一部を委託する場合は、アセットマネジメント One株式会社（東京都千代田区丸の内一丁目8番2号）に委託します。

第7条（信託の登記・登録の留保等）

1. 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受益者の利益に資する等の合理的な理由があると受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
2. 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
3. 信託財産に属する旨の記載または記録することができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともにその計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受益者の利益に資する等の合理的な理由があると受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

第8条（計算方法）

1. この信託契約が締結されたときに、合同運用財産において他の信託契約がまだ締結されていない場合は、1万円相当額を1口として、その整数倍の価額に相当する財産を信託財産の額として引受けます。
2. 前項以外の場合は、受託者が承諾を行った日の計算基準価格に、原則として信託財産留保金を加算した額を1口として、その整数倍の価額に相当する財産を信託財産の額として引受けます。
3. 前項の場合、委託者は、受託者の承諾を得て、承諾後3営業日以内に信託財産を追加することができます。

4. この約款において計算基準価格とは、合同運用財産の純資産総額を、計算日の総口数で除して得た価額をいいます。
5. 前項の純資産総額とは、外貨建証券および円貨建証券で金融商品市場等の相場のあるものについては、その終値（当該市場等における終値のないものはそれに準ずる価格。）、その他のものについては、適正な価格によって計算した信託財産の資産総額から負債総額を控除した額をいいます。なお、外貨建資産の時価評価については、原則としてロンドン時間午後4時のスポットレートによって計算するものとします。

第9条（租税・事務費用）

信託財産に関する租税その他信託事務の処理に必要な費用（以下「諸経費」といいます。）は、信託財産の中から支払います。

第10条（信託報酬）

この信託に係る信託報酬はいたしません。

第11条（収益計算期および収益処分方法）

1. 収益計算期は、毎年2月末日（以下「毎計算期末」といいます。）および信託終了のときとし、毎計算期末における収益は、信託終了のときを除き次の方法により処理します。
 - (1) 利子およびこれらに類する収益（未収収益を含む。以下利子等収益といいます。）は、諸経費を控除した後、その残額を各受益者の信託財産の口数に応じて分配します。ただし、その全部または一部を分配準備積立金として積立てることができます。
 - (2) 売買、償還およびこれに類する利益に評価差益を加えた利益（以下売買益といいます。）は、諸経費を控除し、信託財産につき生じた損失（以下信託損失といいます。）のあるときはその全額に充当した後、その残額を各受益者の信託財産の口数に応じて分配します。ただし、その全部または一部を分配準備積立金として積立てることができます。
 - (3) 前2号および第13条第2項に定める諸経費の控除は、利子等収益、信託財産留保金および売買益にそれぞれ按分して行います。
2. 前項の分配金は、毎計算期末の翌日以降1ヵ月以内に受益者に支払います。
3. 第1項の計算は、毎計算期末後2ヵ月以内に受益者に報告し、毎計算期末後3ヵ月以内に異議がないときは、受益者の承認があったものとします。ただし、信託終了のときは、第18条に定めるところによります。

第11条の2（報告書の提出）

1. 受託者は、毎計算期末現在における次の各号に掲げる報告書を、毎計算期末後2ヶ月以内に受益者に提出します。
 - (1) 兼営法第2条第1項で準用する信託業法第27条第1項に定める信託財産状況報告書
 - (2) 信託法第37条第2項に定める財産状況開示資料
2. 受託者が前項に定める報告書を提出したときは、前条に定める収益計算に関する報告も行ったものとします。
3. 受託者が第1項に定める方法で報告書を提出したときは、信託法第37条第3項の報告も行ったものとします。

第12条（分配準備積立金）

分配準備積立金は、受託者が必要と認めた場合にはこれを取崩し、分配または信託損失の充当を行うことができます。

第13条（信託財産留保金）

1. 信託財産留保金は、受託者が承諾もしくは請求を行った日の計算基準価格に別に定める料率を乗じて得た額とします。
2. 信託財産留保金は、毎計算期末において諸経費を控除し、信託損失のあるときはその全額に充当した後、その残額を受益者に分配します。ただし、その全部または一部を分配準備積立金として積立てることができます。

第14条（収益調整金）

1. 信託財産、内戻財産または解約財産は、信託財産、内戻財産または解約財産の口数に1万円を乗じた価額とその他の価額とに分け、前者を元本、後者を収益調整金として処理します。
2. 収益調整金は、毎計算期末において信託損失のあるときはその全額に充当した後、その残額を分配準備積立金として積立てます。ただし、その全部または一部を受益者に分配することができます。
3. 収益調整金が負の値になったときは、毎計算期末において、信託損失として処理します。

第15条（信託損失の充当順序）

1. 信託損失の充当順序は、次のとおりとします。
 - (1) 信託財産留保金
 - (2) 売買益
 - (3) 収益調整金
 - (4) 分配準備積立金
2. 前項により充当できない信託損失は、次期に繰越します。

第16条（解約・内戻し）

1. 委託者は、この信託契約の解約または口数単位による信託財産の内戻しを請求することができます。ただし、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときはこの限りではありません。
2. 前項の場合には、受託者は、これにより生じた損害金相当額を信託財産に留保し、残額を受益者に支払うことがあります。

第17条（解約・内戻しの時期と計算）

1. 前条による信託財産の解約・内戻しは、請求後4営業日以内に行います。
2. 前項の解約・内戻し財産は、当該解約・内戻しの請求日の計算基準価格から、原則として信託財産留保金を控除した額にその口数を乗じた価額とし、解約・内戻しの日から1ヵ月以内に受益者に交付します。

第18条（信託の終了および最終計算）

1. この信託は、第16条の定めによりこの信託契約の全部が解約された場合に終了します。
2. 前項によりこの信託が終了したときは、次項の価額に相当する信託財産を終了した日から1ヵ月以内に受益者に交付します。
3. 最終計算においては、純資産総額を当該終了日の残存口数により按分した価額を交付額とします。
4. 受託者は、第2項の信託財産の交付に際し、最終計算書を作成し、受益者の承認を求めるものとします。

第19条（譲渡・質入）

この信託の受益権は、譲渡することまたは受託者の承諾なしに質入することはできません。

第20条（善管注意義務）

1. 受託者は、信託の本旨に従い、善良な管理者の注意をもって、もっぱら受益者の利益のために信託事務を処理します。
2. 受託者がこの信託契約や法令に基づく任務を怠った場合において、信託財産に損失が生じたことにかかる措置については、信託財産に対し金銭によるてん補の方法により行うものとします。

3. 前項の場合において、信託財産に変更が生じたことにかかる措置について、原状回復が適当であると受託者が判断する場合は、この約款の信託目的に則し受託者が合理的と考える原状回復の方法により行うものとします。

第 21 条 (信託法等との関係)

この約款に定めのない事項については、信託法その他の法令の規定にしたがうものとします。

第Ⅱ部 ファンドの詳細情報

1. ファンドの沿革

2005年11月30日 | ファンド設定、運用開始

2. 決算状況

(1) 資産、負債、元本および基準価格の状況

項目	第19期(2023年11月30日)	第20期(2024年12月2日)
(A) 資産	1,594,881,321 円	1,668,825,147 円
外国債券マザーファンド(評価額)	1,592,280,188	1,662,493,635
銀行勘定貸	2,601,133	6,331,512
未収金	0	0
(B) 負債	1,480,739 円	4,644,056 円
未払金	1,480,739	4,644,056
(C) 純資産総額(A-B)	1,593,400,582 円	1,664,181,091 円
元本	918,302,132	906,670,924
分配準備積立金	675,098,450	757,510,167
信託損失	0	0
(D) 受益権総口数	918,302,132 口	906,670,924 口
1万口あたり基準価格(C/D×10,000)	17,352 円	18,355 円

(2) 損益の状況

項目	第19期 (2022年12月1日～2023年11月30日)	第20期 (2023年12月1日～2024年12月2日)
(A) 利配当等収益	0 円	566 円
銀行勘定貸利息	0	566
(B) 売買損益等	130,676,629 円	97,941,420 円
売買損益	20,433,391	41,800,528
評価損益	110,243,238	56,140,892
(C) 信託報酬	△ 4,035,176 円	△ 4,648,805 円
(D) その他費用	0 円	0 円
(E) 雑益	0 円	0 円
(F) 当期利益(A+B+C+D+E)	126,641,453 円	93,293,181 円
(G) 信託財産留保金	0 円	0 円
(H) 収益調整金	15,136,269 円	△ 10,881,464 円
(I) 前期繰越損益	533,320,728 円	675,098,450 円
分配準備積立金	533,320,728	675,098,450
信託損失	0	0
(J) 当期末処分利益(F+G+H+I)	675,098,450 円	757,510,167 円
<利益処分>		
(K) 収益分配金	0 円	0 円
(L) 次期繰越損益(J-K)	675,098,450 円	757,510,167 円
分配準備積立金	675,098,450	757,510,167
信託損失	0	0

<注1> 重要な会計方針

項目	期別 第19期計算期 (2022年12月1日～2023年11月30日)
運用資産の評価基準 および評価方法	<マザーファンド> 移動平均法に基づき、2023年11月29日付基準価格で評価しております。
費用・収益の計上基準	<有価証券売買等損益の計上基準> 約定日基準で計上しております。

項目	期別 第20期計算期 (2023年12月1日～2024年12月2日)
運用資産の評価基準 および評価方法	<マザーファンド> 移動平均法に基づき、2024年11月29日付基準価格で評価しております。
費用・収益の計上基準	<有価証券売買等損益の計上基準> 約定日基準で計上しております。

＜注2＞「資産、負債、元本および基準価格の状況」について

(単位:円)

計算期間	期首元本額	期中追加設定元本額	期中一部解約元本額
第19期計算期 (2022年12月1日～2023年11月30日)	895,432,636	166,341,478	143,471,982

計算期間	期首元本額	期中追加設定元本額	期中一部解約元本額
第20期計算期 (2023年12月1日～2024年12月2日)	918,302,132	173,957,223	185,588,431

＜注3＞「損益の状況」について(分配金の計算過程)

(単位:円)

項目	第19期計算期 (2022年12月1日～2023年11月30日)	
諸経費等控除後の利配等収益	A	0
諸経費等控除後、信託損失充当後の売買等 収益額、信託財産留保金、収益調整金	B	141,777,722
前期繰越信託損益	C	533,320,728
分配対象収益額	D=A+B+C	675,098,450
分配金額	E	0

項目	第20期計算期 (2023年12月1日～2024年12月2日)	
諸経費等控除後の利配等収益	A	540
諸経費等控除後、信託損失充当後の売買等 収益額、信託財産留保金、収益調整金	B	82,411,177
前期繰越信託損益	C	675,098,450
分配対象収益額	D=A+B+C	757,510,167
分配金額	E	0

＜注4＞有価証券等について

売買目的有価証券等の「資産、負債、元本および基準価格の状況について」計上額(A)および当計算期間[※]の損益に含まれた評価差額(B)

(単位:円)

種類	(A)	(B)
マザーファンド (当行を受託者とする年金 投資基金信託の受益権)	1,662,493,635	56,140,892
合計	1,662,493,635	56,140,892

※ 当計算期間は2023年12月1日から2024年12月2日までです。

＜注5＞デリバティブ取引について

2023年12月1日～2024年12月2日については、取引および残高はありません。

＜注6＞1万口当たり情報

1万口当たり純資産総額 18,355円 (2024年12月2日)

(3) 付属明細表

■ 有価証券明細表

有価証券の組入れはなく、次のようにマザーファンド(当行を受託者とする年金投資基金信託の受益権)を組入れております。

(単位:円)

種類	銘柄	評価額
マザーファンド (当行を受託者とする年金投資基金信託の受益権)	外国債券 マザーファンド	1,662,493,635
合計		1,662,493,635

(2024年12月2日現在)

■ 有価証券先物取引等および為替予約取引の契約額等および時価の明細表

2024年12月2日現在、残高はありません。

<ご参考>マザーファンドの運用状況

外国債券インデックスファンドは、「外国債券マザーファンド」の受益権を主要投資対象としており、2. - (1)「資産、負債、元本および基準価格の状況」に計上されたマザーファンド(評価額)は当マザーファンドの受益権にかかるものです。外国債券マザーファンドの運用状況は以下の通りです。

○ 外国債券マザーファンド

外国債券インデックスファンドの基準価格は、マザーファンドの知り得る直近の基準価格により時価評価し算出するため、基準時点は外国債券インデックスファンドの決算日の前営業日としております。

<資産、負債、元本および基準価格の状況>

項目	前期末(2023年11月29日)	今期末(2024年11月29日)
(A) 資産	263,768,311,547 円	279,249,696,047 円
外国債券時価	260,616,592,326	270,916,960,683
外貨預け金	984,562,380	1,801,792,069
銀行勘定貸	271,021,969	385,927,296
既経過利息前払金	109,640,644	239,480,012
未収外国債券利息	1,714,014,083	1,887,079,323
未収利息	0	85,247
未収金	72,461,430	4,018,352,328
その他	18,715	19,089
(B) 負債	8,492,418 円	5,257,399,241 円
未払金	8,492,418	5,257,399,241
その他	0	0
(C) 純資産総額(A-B)	263,759,819,129 円	273,992,296,806 円
元本	94,918,020,000	92,977,410,000
分配準備積立金	168,841,799,129	181,014,886,806
信託損失	0	0
(D) 受益権総口数	9,491,802 口	9,297,741 口
1口あたり基準価格(C/D)	27,788 円	29,469 円

<注>外国債券マザーファンドの計算期間は、外国債券インデックスファンドの計算期間とは異なり、原則として毎年3月1日から翌年2月末日までです。

上表は外国債券インデックスファンドの決算日の前営業日現在の資産、負債、元本および基準価格の状況を示しております。

<重要な会計方針>

項目	期別	自2023年 3月 1日 至2023年 11月29日	自2024年 3月 1日 至2024年 11月29日
	運用資産の評価基準および評価方法		○国債証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。
外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準		ロンドン時間午後4時のスポットレートにて換算しております。	
費用・収益の計上基準		○有価証券売買等損益および派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	

<付属明細表>

■ 有価証券明細表

・株式以外の有価証券

次頁のとおりです。なお、株式の残高はありません。(2024年11月29日現在)

■ 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(単位:円)

名称	種類	契約額等	うち1年超	評価額(時価)	評価損益	
市場取引 以外の 取引	<為替予約取引> 買建					
		米ドル	238,826,000	-	238,824,727	-1,273
		英ポンド	195,574,000	-	195,573,020	-980
		メキシコペソ	58,769,000	-	58,768,590	-410
		ポーランドズロティ	47,817,000	-	47,816,725	-275
		中国人民幣元	26,253,000	-	26,253,073	73
		イスラエルシユケル	19,387,000	-	19,386,630	-370
		売建				
		ユーロ	265,458,000	-	265,459,333	-1,333
		オーストラリアドル	112,096,000	-	112,096,593	-593
		デンマーククローネ	117,100,000	-	117,100,827	-827
		ニュージーランドドル	5,220,000	-	5,220,025	-25
		マレーシアリング	11,739,153	-	11,754,649	-15,496
		シンガポールドル	74,787,000	-	74,787,345	-345
	<為替予約取引> 合計		1,173,026,153	-	1,173,041,537	-21,854

(2024年11月29日現在)

<注>時価の算定方法

為替予約取引は、予約期日の属する月渡分のロンドン時間午後4時のフォワードレートにて時価評価しております。ただし、予約期日の属する月が当月の場合は、ロンドン時間午後4時のスポットレートにて時価評価します。また、予約期日の属する月渡分のフォワードレートが公表されていない場合は、その前後の月のフォワードレートを日数で按分したレートを使用します。

■ 有価証券明細表
株式以外の有価証券

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
<米ドル・・・米国>	米ドル	米ドル	円
T 0.375 251130	4,600,000	4,422,647	664,215,266
T 0.375 251231	6,160,000	5,904,577	886,778,835
T 0.375 260131	5,500,000	5,255,078	789,233,908
T 0.375 270731	4,000,000	3,625,312	544,467,554
T 0.375 270930	4,350,000	3,918,738	588,535,711
T 0.5 260228	5,400,000	5,154,047	774,060,526
T 0.5 270430	3,070,000	2,815,766	422,885,761
T 0.5 270531	2,980,000	2,724,954	409,247,201
T 0.5 270630	3,340,000	3,045,989	457,461,809
T 0.5 270831	3,000,000	2,720,508	408,579,466
T 0.5 271031	1,200,000	1,082,016	162,502,517
T 0.625 260731	5,240,000	4,939,314	741,810,885
T 0.625 270331	2,000,000	1,845,703	277,196,923
T 0.625 271130	4,200,000	3,790,746	569,313,200
T 0.625 271231	2,900,000	2,609,773	391,948,825
T 0.625 300515	5,500,000	4,571,768	686,610,915
T 0.625 300815	7,700,000	6,345,582	953,011,234
T 0.75 260331	4,980,000	4,754,636	714,074,937
T 0.75 260430	5,010,000	4,770,557	716,466,136
T 0.75 260531	5,280,000	5,013,731	752,987,226
T 0.75 260831	5,500,000	5,182,031	778,263,363
T 0.75 280131	4,230,000	3,810,470	572,275,423
T 0.875 260630	4,600,000	4,365,328	655,606,808
T 0.875 260930	5,000,000	4,709,180	707,248,153
T 0.875 301115	7,600,000	6,321,953	949,462,532
T 1 280731	5,300,000	4,742,982	712,324,811
T 1.125 261031	5,000,000	4,720,117	708,890,801
T 1.125 270228	1,500,000	1,403,555	210,792,859
T 1.125 280229	5,350,000	4,867,351	731,003,051
T 1.125 280831	2,380,000	2,134,655	320,593,230
T 1.125 310215	5,310,000	4,461,748	670,087,662
T 1.125 400515	1,470,000	934,340	140,323,858
T 1.125 400815	1,700,000	1,071,033	160,853,121
T 1.25 261130	4,200,000	3,966,375	595,690,229
T 1.25 261231	3,540,000	3,336,312	501,063,977
T 1.25 280331	5,000,000	4,556,738	684,353,741
T 1.25 280430	4,600,000	4,182,316	628,121,190
T 1.25 280531	4,300,000	3,901,914	586,008,966
T 1.25 280630	5,000,000	4,526,563	679,821,789
T 1.25 280930	5,500,000	4,946,133	742,834,960
T 1.25 310815	8,000,000	6,659,844	1,000,208,635
T 1.25 500515	4,530,000	2,317,290	348,022,146
T 1.375 260831	2,000,000	1,905,391	286,161,090
T 1.375 281031	5,000,000	4,510,449	677,401,813
T 1.375 281231	3,000,000	2,694,844	404,725,108
T 1.375 311115	8,100,000	6,756,381	1,014,707,054
T 1.375 401115	4,310,000	2,815,811	422,892,505
T 1.375 500815	3,030,000	1,596,135	239,715,586
T 1.5 260815	1,720,000	1,643,944	246,895,692
T 1.5 270131	6,660,000	6,295,261	945,453,768
T 1.5 281130	4,600,000	4,161,113	624,936,794
T 1.5 300215	4,200,000	3,691,324	554,381,527
T 1.625 260215	4,360,000	4,225,113	634,548,520
T 1.625 260515	450,000	433,441	65,096,396
T 1.625 260930	1,880,000	1,795,841	269,708,325
T 1.625 261031	2,000,000	1,907,148	286,425,088
T 1.625 261130	2,000,000	1,903,438	285,867,760
T 1.625 290815	6,500,000	5,827,148	875,150,292
T 1.625 310515	8,700,000	7,477,412	1,122,995,142
T 1.625 501115	4,400,000	2,476,117	371,875,661
T 1.75 261231	2,000,000	1,905,000	286,102,425
T 1.75 290131	4,600,000	4,188,426	629,038,722
T 1.75 291115	3,000,000	2,692,500	404,373,112
T 1.75 410815	5,160,000	3,525,832	529,527,081
T 1.875 260630	2,400,000	2,314,687	347,631,340
T 1.875 260731	2,290,000	2,204,572	331,093,684
T 1.875 270228	4,600,000	4,376,469	657,279,959
T 1.875 290228	4,500,000	4,112,754	617,673,944
T 1.875 320215	8,470,000	7,279,899	1,093,331,608
T 1.875 410215	5,070,000	3,581,282	537,854,784
T 1.875 510215	6,180,000	3,709,448	557,103,516
T 1.875 511115	5,900,000	3,516,492	528,124,375
T 2 261115	4,410,000	4,231,361	635,486,885
T 2 411115	4,430,000	3,137,599	471,220,368
T 2 500215	3,860,000	2,404,659	361,143,768

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
T 2 510815	6,870,000	4,238,065	636,493,855
T 2.125 260531	2,400,000	2,326,453	349,398,363
T 2.25 260331	2,500,000	2,435,352	365,753,272
T 2.25 270215	4,140,000	3,975,370	597,040,993
T 2.25 270815	3,930,000	3,744,246	562,329,602
T 2.25 271115	4,050,000	3,841,330	576,910,156
T 2.25 410515	4,020,000	3,005,029	451,310,206
T 2.25 460815	2,160,000	1,479,431	222,188,383
T 2.25 490815	1,590,000	1,054,027	158,299,067
T 2.25 520215	5,400,000	3,529,406	530,063,877
T 2.375 260430	2,100,000	2,046,352	307,331,307
T 2.375 270515	4,110,000	3,942,068	592,039,475
T 2.375 290331	3,150,000	2,934,976	440,789,307
T 2.375 290515	4,300,000	4,002,947	601,182,635
T 2.375 420215	4,320,000	3,239,156	486,472,682
T 2.375 491115	3,290,000	2,238,421	336,177,241
T 2.375 510515	5,570,000	3,764,319	565,344,268
T 2.5 260228	2,200,000	2,153,035	323,353,584
T 2.5 270331	3,500,000	3,373,945	506,715,979
T 2.5 450215	2,930,000	2,145,882	322,259,232
T 2.5 460215	2,300,000	1,664,535	249,988,213
T 2.625 251231	2,000,000	1,964,453	295,031,391
T 2.625 260131	2,250,000	2,207,417	331,520,922
T 2.625 270531	4,300,000	4,146,813	622,789,035
T 2.625 290215	5,590,000	5,273,051	791,933,218
T 2.625 290731	3,400,000	3,188,961	478,934,100
T 2.75 270430	3,000,000	2,905,430	436,351,956
T 2.75 270731	4,100,000	3,957,541	594,363,299
T 2.75 280215	5,300,000	5,085,205	763,721,527
T 2.75 290531	3,300,000	3,118,049	468,284,162
T 2.75 320815	9,360,000	8,497,308	1,276,168,171
T 2.75 420815	1,360,000	1,074,692	161,402,645
T 2.75 421115	2,020,000	1,589,606	238,734,954
T 2.75 470815	2,970,000	2,218,045	333,117,049
T 2.75 471115	2,920,000	2,176,427	326,866,622
T 2.875 251130	2,350,000	2,316,314	347,875,628
T 2.875 280515	4,200,000	4,032,820	605,669,116
T 2.875 280815	5,820,000	5,573,446	837,047,943
T 2.875 290430	2,300,000	2,186,482	328,376,862
T 2.875 320515	8,000,000	7,349,688	1,103,812,820
T 2.875 430515	3,070,000	2,448,085	367,665,671
T 2.875 450815	1,770,000	1,378,941	207,096,198
T 2.875 461115	1,180,000	908,001	136,368,097
T 2.875 490515	3,700,000	2,797,619	420,160,430
T 2.875 520515	2,300,000	1,727,785	259,487,414
T 3 420515	1,250,000	1,030,273	154,731,616
T 3 441115	70,000	55,967	8,405,432
T 3 450515	1,500,000	1,195,840	179,597,206
T 3 451115	1,000,000	794,219	119,279,742
T 3 470215	2,000,000	1,569,219	235,673,119
T 3 470515	1,700,000	1,331,512	199,973,087
T 3 480215	2,000,000	1,558,867	234,118,467
T 3 480815	3,440,000	2,673,727	401,553,621
T 3 490215	3,780,000	2,931,715	440,299,594
T 3 520815	5,100,000	3,934,172	590,853,603
T 3.125 270831	4,000,000	3,896,641	585,216,974
T 3.125 281115	3,190,000	3,076,792	462,088,065
T 3.125 290831	3,300,000	3,161,490	474,808,408
T 3.125 411115	1,440,000	1,220,512	183,302,668
T 3.125 420215	1,450,000	1,223,551	183,758,972
T 3.125 430215	1,600,000	1,330,000	199,746,050
T 3.125 440815	1,900,000	1,554,289	233,430,903
T 3.125 480515	2,640,000	2,101,894	315,672,914
T 3.25 270630	2,000,000	1,957,734	294,022,337
T 3.25 290630	3,400,000	3,279,672	492,557,522
T 3.25 420515	1,860,000	1,591,027	238,948,322
T 3.375 270915	3,200,000	3,138,375	471,336,850
T 3.375 330515	3,870,000	3,650,498	548,250,108
T 3.375 420815	3,500,000	3,038,711	456,368,799
T 3.375 440515	1,600,000	1,364,625	204,946,204
T 3.375 481115	2,050,000	1,702,861	255,744,227
T 3.5 260930	2,690,000	2,656,795	399,010,803
T 3.5 280131	3,000,000	2,945,332	442,344,689
T 3.5 280430	2,800,000	2,745,586	412,345,825
T 3.5 290930	3,800,000	3,702,477	556,056,443
T 3.5 300131	3,000,000	2,916,270	437,979,937

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
T 3.5 300430	2,500,000	2,427,197	364,528,623
T 3.5 330215	7,400,000	7,058,039	1,060,011,593
T 3.5 390215	770,000	706,686	106,133,569
T 3.625 260515	2,060,000	2,041,975	306,674,015
T 3.625 280331	4,000,000	3,939,375	591,635,034
T 3.625 280531	3,900,000	3,838,148	576,432,320
T 3.625 290831	4,000,000	3,921,094	588,889,466
T 3.625 300331	3,000,000	2,931,621	440,285,513
T 3.625 310930	2,000,000	1,940,313	291,405,832
T 3.625 430815	2,080,000	1,853,231	278,327,533
T 3.625 440215	2,180,000	1,932,962	290,301,855
T 3.625 530215	5,600,000	4,881,844	733,179,702
T 3.625 530515	3,280,000	2,862,313	429,876,402
T 3.75 260415	1,300,000	1,291,113	193,905,847
T 3.75 260831	4,000,000	3,968,125	595,952,853
T 3.75 270815	1,000,000	990,488	148,756,482
T 3.75 281231	1,240,000	1,223,216	183,708,755
T 3.75 300531	2,000,000	1,964,609	295,054,859
T 3.75 300630	1,000,000	982,148	147,503,963
T 3.75 301231	3,800,000	3,725,039	559,444,992
T 3.75 310831	1,500,000	1,466,338	220,221,956
T 3.75 410815	1,000,000	924,961	138,915,258
T 3.75 431115	430,000	389,234	58,457,105
T 3.875 271130	2,500,000	2,483,301	372,954,527
T 3.875 271231	1,800,000	1,788,012	268,532,538
T 3.875 290930	3,000,000	2,970,234	446,084,647
T 3.875 291130	3,100,000	3,068,697	460,872,296
T 3.875 291231	3,000,000	2,968,828	445,873,454
T 3.875 330815	8,520,000	8,329,465	1,250,960,678
T 3.875 340815	4,400,000	4,288,281	644,035,522
T 3.875 400815	1,290,000	1,221,318	183,423,579
T 3.875 430215	3,500,000	3,246,523	487,579,119
T 3.875 430515	2,560,000	2,370,050	355,945,959
T 4 251215	3,500,000	3,487,854	523,823,319
T 4 260215	1,200,000	1,195,828	179,595,447
T 4 270115	5,000,000	4,983,008	748,373,026
T 4 280229	3,300,000	3,288,076	493,819,721
T 4 280630	2,900,000	2,889,182	433,911,744
T 4 290131	4,000,000	3,982,891	598,170,430
T 4 290731	2,070,000	2,061,631	309,626,059
T 4 291031	600,000	597,445	89,727,323
T 4 300228	2,700,000	2,686,500	403,472,002
T 4 300731	3,000,000	2,982,832	447,976,626
T 4 310131	600,000	595,957	89,503,806
T 4 340215	9,100,000	8,964,922	1,346,396,792
T 4 421115	3,100,000	2,932,588	440,430,710
T 4 521115	5,000,000	4,663,086	700,325,563
T 4.125 260615	3,300,000	3,294,006	494,710,268
T 4.125 261031	4,000,000	3,994,688	599,942,145
T 4.125 270215	3,200,000	3,196,938	480,132,058
T 4.125 270930	3,540,000	3,540,830	531,779,509
T 4.125 271031	3,600,000	3,601,828	540,940,556
T 4.125 271115	3,000,000	3,001,055	450,713,397
T 4.125 280731	4,340,000	4,340,932	651,942,933
T 4.125 290331	5,600,000	5,603,172	841,512,371
T 4.125 300831	2,500,000	2,500,244	375,499,167
T 4.125 310331	3,000,000	2,999,414	450,467,002
T 4.125 310731	3,000,000	2,998,945	450,396,602
T 4.125 321115	6,900,000	6,891,510	1,035,001,393
T 4.125 530815	4,100,000	3,912,857	587,652,493
T 4.25 270315	4,100,000	4,108,488	617,033,310
T 4.25 290228	3,500,000	3,518,936	528,491,337
T 4.25 290630	3,480,000	3,501,206	525,828,660
T 4.25 310228	2,200,000	2,214,609	332,601,106
T 4.25 310630	5,000,000	5,034,570	756,116,940
T 4.25 341115	3,000,000	3,013,828	452,631,779
T 4.25 390515	950,000	944,211	141,806,320
T 4.25 401115	3,100,000	3,064,338	460,217,584
T 4.25 540215	2,600,000	2,540,230	381,504,513
T 4.25 540815	1,500,000	1,467,422	220,384,755
T 4.375 260731	10,520,000	10,543,834	1,583,525,757
T 4.375 260815	4,800,000	4,812,281	722,732,456
T 4.375 261215	5,500,000	5,520,195	829,050,537
T 4.375 270715	5,500,000	5,533,945	831,115,580
T 4.375 280831	2,700,000	2,723,150	408,976,341
T 4.375 281130	4,000,000	4,038,516	606,524,471
T 4.375 301130	3,300,000	3,343,699	502,173,468
T 4.375 340515	6,730,000	6,823,063	1,024,721,754

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
T 4.375 380215	1,200,000	1,216,781	182,742,293
T 4.375 391115	1,220,000	1,226,457	184,195,507
T 4.375 400515	1,270,000	1,275,755	191,599,218
T 4.375 410515	1,240,000	1,242,059	186,538,570
T 4.375 430815	3,260,000	3,225,808	484,468,006
T 4.5 260715	1,000,000	1,004,082	150,798,059
T 4.5 270415	5,300,000	5,341,303	802,183,552
T 4.5 270515	2,360,000	2,379,267	357,330,241
T 4.5 290531	3,720,000	3,781,540	567,930,562
T 4.5 331115	8,300,000	8,492,262	1,275,410,323
T 4.5 360215	200,000	207,039	31,094,161
T 4.5 380515	380,000	389,723	58,530,497
T 4.5 390815	700,000	713,672	107,182,811
T 4.5 440215	800,000	802,375	120,504,689
T 4.5 541115	1,000,000	1,021,016	153,341,230
T 4.625 260315	3,500,000	3,514,355	527,803,474
T 4.625 260915	4,000,000	4,027,734	604,905,284
T 4.625 261015	4,580,000	4,614,350	693,006,154
T 4.625 261115	5,000,000	5,039,844	756,908,933
T 4.625 270615	3,500,000	3,541,494	531,879,298
T 4.625 280930	2,070,000	2,106,629	316,384,119
T 4.625 290430	4,670,000	4,767,322	715,980,262
T 4.625 300930	2,000,000	2,051,875	308,160,846
T 4.625 310430	3,000,000	3,083,262	463,059,662
T 4.625 310531	2,000,000	2,055,664	308,729,906
T 4.625 400215	1,450,000	1,496,898	224,811,692
T 4.625 540515	5,030,000	5,230,414	785,529,735
T 4.75 410215	1,000,000	1,046,348	157,145,723
T 4.75 431115	3,820,000	3,963,698	595,287,934
T 4.75 531115	4,900,000	5,186,439	778,925,408
T 4.875 260430	3,180,000	3,205,962	481,487,359
T 4.875 281031	2,000,000	2,054,258	308,518,710
T 4.875 301031	3,000,000	3,117,773	468,242,802
T 5 370515	450,000	484,787	72,807,752
T 5.25 281115	1,000,000	1,042,188	156,520,929
T 5.375 310215	1,120,000	1,199,013	180,073,693
T 6 260215	490,000	500,642	75,188,947
T 6.125 271115	1,200,000	1,267,828	190,408,767
T 6.25 300515	2,010,000	2,219,323	333,308,972
<英ポンド・・・英国>	英ポンド	英ポンド	円
UKT 0.125 280131	1,390,000	1,236,328	236,005,957
UKT 0.25 310731	1,660,000	1,298,701	247,912,468
UKT 0.375 261022	3,040,000	2,838,459	541,840,892
UKT 0.375 301022	1,510,000	1,228,536	234,518,485
UKT 0.5 290131	1,750,000	1,519,394	290,041,090
UKT 0.5 611022	1,820,000	549,408	104,877,949
UKT 0.625 350731	1,800,000	1,242,540	237,191,746
UKT 0.625 501022	1,600,000	639,312	122,039,912
UKT 0.875 291022	1,450,000	1,256,461	239,849,086
UKT 0.875 330731	1,800,000	1,372,481	261,996,573
UKT 0.875 460131	1,410,000	695,412	132,749,035
UKT 1 320131	2,880,000	2,334,057	445,554,385
UKT 1.125 390131	1,810,000	1,182,972	225,820,735
UKT 1.125 731022	910,000	331,914	63,359,956
UKT 1.25 270722	1,730,000	1,611,182	307,562,849
UKT 1.25 411022	2,050,000	1,258,700	240,276,571
UKT 1.25 510731	1,970,000	943,159	180,042,084
UKT 1.5 260722	910,000	872,596	166,572,146
UKT 1.5 470722	1,400,000	780,210	148,936,254
UKT 1.5 530731	1,250,000	623,250	118,973,840
UKT 1.625 281022	1,210,000	1,110,880	212,058,843
UKT 1.625 541022	1,370,000	699,111	133,455,147
UKT 1.625 711022	1,320,000	590,304	112,684,691
UKT 1.75 370907	1,670,000	1,243,148	237,307,808
UKT 1.75 490122	970,000	560,182	106,934,615
UKT 1.75 570722	1,710,000	883,449	168,643,986
UKT 2.5 650722	1,330,000	815,554	155,683,217
UKT 3.25 330131	1,860,000	1,740,714	332,289,412
UKT 3.25 440122	1,510,000	1,236,992	236,132,673
UKT 3.5 550122	1,680,000	1,417,584	270,606,358
UKT 3.5 680722	1,110,000	877,788	167,563,272
UKT 3.75 270307	2,600,000	2,572,625	491,095,171
UKT 3.75 380129	2,380,000	2,221,492	424,066,482
UKT 3.75 520722	900,000	762,935	145,638,584
UKT 3.75 531022	1,540,000	1,298,374	247,850,046
UKT 4 311022	1,000,000	991,594	189,287,909
UKT 4 600122	940,000	828,497	158,154,021
UKT 4 631022	1,100,000	964,480	184,112,137

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
UKT 4.125 270129	2,500,000	2,494,672	476,214,445
UKT 4.125 290722	1,810,000	1,812,193	345,934,382
UKT 4.25 271207	1,260,000	1,268,064	242,064,090
UKT 4.25 320607	1,940,000	1,959,058	373,969,794
UKT 4.25 340731	1,150,000	1,150,173	219,559,469
UKT 4.25 360307	1,420,000	1,409,066	268,980,334
UKT 4.25 390907	590,000	573,303	109,439,325
UKT 4.25 401207	1,300,000	1,252,550	239,102,581
UKT 4.25 461207	1,220,000	1,139,602	217,541,639
UKT 4.25 491207	1,240,000	1,152,142	219,935,465
UKT 4.25 551207	1,470,000	1,355,777	258,807,875
UKT 4.375 400131	400,000	392,640	74,952,087
UKT 4.375 540731	1,040,000	977,288	186,557,090
UKT 4.5 280607	2,640,000	2,672,143	510,092,504
UKT 4.5 340907	1,340,000	1,368,924	261,317,503
UKT 4.625 340131	2,050,000	2,110,065	402,795,887
UKT 4.75 301207	2,130,000	2,212,474	422,344,935
UKT 4.75 381207	1,300,000	1,339,107	255,625,624
UKT 4.75 431022	1,550,000	1,562,865	298,339,432
UKT 6 281207	1,200,000	1,289,909	246,234,124
<カナダドル・・・カナダ>	カナダドル	カナダドル	円
CAN 0.25 260301	2,400,000	2,317,754	248,610,446
CAN 0.5 301201	1,850,000	1,600,642	171,690,517
CAN 1 260901	1,890,000	1,826,816	195,950,658
CAN 1 270601	640,000	611,542	65,596,095
CAN 1.25 270301	1,560,000	1,502,836	161,199,469
CAN 1.25 300601	1,920,000	1,754,601	188,204,618
CAN 1.5 260601	910,000	890,803	95,550,688
CAN 1.5 310601	2,560,000	2,333,499	250,299,323
CAN 1.5 311201	2,400,000	2,170,723	232,839,356
CAN 1.75 531201	2,290,000	1,698,968	182,237,305
CAN 2 280601	800,000	776,941	83,337,466
CAN 2 320601	2,560,000	2,382,947	255,603,250
CAN 2 511201	2,750,000	2,185,276	234,400,319
CAN 2.25 291201	670,000	649,620	69,680,492
CAN 2.5 321201	1,900,000	1,826,553	195,922,472
CAN 2.75 270901	1,320,000	1,313,738	140,916,195
CAN 2.75 330601	1,140,000	1,114,589	119,554,765
CAN 2.75 481201	660,000	618,155	66,305,420
CAN 2.75 551201	1,530,000	1,421,077	152,429,677
CAN 2.75 641201	440,000	412,943	44,293,663
CAN 3 260401	250,000	249,799	26,794,311
CAN 3 340601	2,850,000	2,834,270	304,013,722
CAN 3.25 261101	1,600,000	1,606,927	172,364,590
CAN 3.25 280901	1,620,000	1,638,965	175,801,087
CAN 3.25 331201	620,000	629,247	67,495,275
CAN 3.25 341201	500,000	507,620	54,449,049
CAN 3.5 280301	1,950,000	1,984,988	212,916,791
CAN 3.5 290901	1,460,000	1,496,897	160,562,439
CAN 3.5 451201	670,000	708,784	76,026,687
CAN 4 260501	520,000	526,660	56,491,397
CAN 4 260801	1,460,000	1,482,242	158,990,495
CAN 4 290301	1,750,000	1,825,247	195,782,433
CAN 4 410601	690,000	769,425	82,531,179
CAN 4.5 260201	500,000	507,955	54,485,072
CAN 5 370601	1,160,000	1,386,469	148,717,525
CAN 5.75 290601	600,000	672,748	72,161,306
CAN 5.75 330601	900,000	1,078,088	115,639,480
<オーストラリアドル・・・オーストラリア>	オーストラリアドル	オーストラリアドル	円
ACGB 0.5 260921	1,780,000	1,671,954	163,580,666
ACGB 1 301221	880,000	736,217	72,029,992
ACGB 1 311121	2,860,000	2,318,345	226,822,241
ACGB 1.25 320521	2,620,000	2,129,143	208,311,131
ACGB 1.5 310621	1,550,000	1,318,988	129,047,172
ACGB 1.75 321121	1,920,000	1,599,341	156,476,334
ACGB 1.75 510621	1,510,000	823,328	80,552,731
ACGB 2.25 280521	1,200,000	1,129,320	110,490,430
ACGB 2.5 300521	3,180,000	2,945,666	288,198,104
ACGB 2.75 271121	1,540,000	1,481,634	144,960,134
ACGB 2.75 281121	940,000	899,862	88,040,714
ACGB 2.75 291121	1,350,000	1,269,270	124,182,861
ACGB 2.75 350621	1,150,000	994,014	97,252,359
ACGB 2.75 410521	940,000	738,408	72,244,336
ACGB 3 331121	1,450,000	1,311,235	128,288,633
ACGB 3 470321	810,000	610,659	59,745,666
ACGB 3.25 290421	1,250,000	1,215,588	118,930,672
ACGB 3.25 390621	800,000	688,960	67,406,481
ACGB 3.5 341221	1,590,000	1,482,468	145,041,760

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
ACGB 3.75 340521	1,700,000	1,626,254	159,109,468
ACGB 3.75 370421	1,170,000	1,095,050	107,137,502
ACGB 4.25 260421	1,330,000	1,332,261	130,345,776
ACGB 4.25 340621	270,000	267,543	26,175,876
ACGB 4.25 351221	170,000	168,166	16,452,998
ACGB 4.5 330421	1,400,000	1,423,884	139,309,988
ACGB 4.75 270421	2,170,000	2,210,601	216,280,791
ACGB 4.75 540621	900,000	892,800	87,349,782
<ニュージーランドドル・・・ニュージーランド>	ニュージーランドドル	ニュージーランドドル	円
NZGB 0.25 280515	1,050,000	927,675	82,416,443
NZGB 0.5 260515	1,150,000	1,090,315	96,865,696
NZGB 1.5 310515	1,300,000	1,097,330	97,488,922
NZGB 1.75 410515	700,000	454,160	40,348,454
NZGB 2 320515	620,000	529,170	47,012,487
NZGB 2.75 370415	890,000	731,313	64,971,263
NZGB 2.75 510515	370,000	247,715	22,007,480
NZGB 3 290420	680,000	650,624	57,802,696
NZGB 3.5 330414	880,000	828,917	73,642,604
NZGB 4.25 340515	340,000	335,988	29,849,824
NZGB 4.25 360515	200,000	193,860	17,222,897
NZGB 4.5 270415	280,000	284,284	25,256,341
NZGB 4.5 300515	430,000	438,514	38,958,433
NZGB 4.5 350515	470,000	472,256	41,956,137
NZGB 5 540515	200,000	198,960	17,675,991
<デンマーククローネ・・・デンマーク>	デンマーククローネ	デンマーククローネ	円
DGB 0 311115	6,050,000	5,373,590	114,294,370
DGB 0.25 521115	4,100,000	2,553,810	54,318,646
DGB 0.5 271115	3,550,000	3,437,341	73,111,035
DGB 0.5 291115	3,400,000	3,189,200	67,833,168
DGB 2.25 261115	1,810,000	1,831,249	38,950,034
DGB 2.25 331115	1,800,000	1,860,872	39,580,105
DGB 4.5 391115	7,920,000	10,403,251	221,273,510
<スウェーデンクローナ・・・スウェーデン>	スウェーデンクローナ	スウェーデンクローナ	円
SGB 0.125 310512	3,760,000	3,378,473	46,469,723
SGB 0.75 280512	4,720,000	4,574,954	62,926,913
SGB 0.75 291112	7,210,000	6,875,384	94,568,523
SGB 1 261112	5,500,000	5,431,113	74,703,071
SGB 1.75 331111	2,920,000	2,878,624	39,594,470
SGB 2.25 320601	3,620,000	3,719,669	51,162,755
SGB 2.25 350511	2,000,000	2,047,728	28,165,786
SGB 3.5 390330	3,130,000	3,649,783	50,201,507
<マレーシアリンギ・・・マレーシア>	マレーシアリンギ	マレーシアリンギ	円
MGS 2.632 310415	2,300,000	2,154,229	72,785,787
MGS 3.502 270531	1,000,000	1,000,935	33,818,975
MGS 3.519 280420	880,000	880,334	29,744,190
MGS 3.582 320715	1,200,000	1,183,267	39,979,530
MGS 3.733 280615	2,200,000	2,215,405	74,852,773
MGS 3.757 400522	1,770,000	1,723,310	58,226,178
MGS 3.828 340705	1,630,000	1,632,942	55,172,855
MGS 3.844 330415	1,060,000	1,062,178	35,888,237
MGS 3.885 290815	1,660,000	1,680,956	56,795,141
MGS 3.892 270315	200,000	201,944	6,823,161
MGS 3.899 271116	1,940,000	1,962,761	66,316,602
MGS 3.9 261130	2,200,000	2,221,636	75,063,311
MGS 3.906 260715	1,060,000	1,068,920	36,116,018
MGS 4.054 390418	800,000	810,788	27,394,435
MGS 4.065 500615	2,250,000	2,225,239	75,185,054
MGS 4.18 440516	450,000	457,514	15,458,203
MGS 4.232 310630	900,000	923,930	31,217,191
MGS 4.254 350531	1,300,000	1,345,391	45,457,281
MGS 4.392 260415	880,000	892,175	30,144,289
MGS 4.457 530331	1,390,000	1,454,103	49,130,358
MGS 4.498 300415	1,450,000	1,510,155	51,024,227
MGS 4.504 290430	980,000	1,016,789	34,354,641
MGS 4.642 331107	2,180,000	2,316,779	78,277,952
MGS 4.696 421015	1,720,000	1,858,783	62,803,430
MGS 4.736 460315	840,000	915,005	30,915,645
MGS 4.762 370407	1,820,000	1,967,934	66,491,375
MGS 4.893 380608	1,500,000	1,645,079	55,582,958
MGS 4.921 480706	1,000,000	1,119,141	37,812,852
MGS 4.935 430930	410,000	455,805	15,400,474
<ノルウェークローネ・・・ノルウェー>	ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	円
NGB 1.25 310917	2,790,000	2,423,631	32,926,393
NGB 1.375 300819	4,640,000	4,147,587	56,347,303
NGB 1.5 260219	2,250,000	2,187,740	29,721,674
NGB 1.75 270217	5,820,000	5,578,470	75,786,654
NGB 1.75 290906	2,920,000	2,705,413	36,754,556
NGB 2 280426	2,990,000	2,847,078	38,679,156

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
NGB 2.125 320518	2,560,000	2,338,311	31,767,271
NGB 3 330815	4,500,000	4,327,650	58,793,560
NGB 3.5 421006	1,410,000	1,424,925	19,358,406
NGB 3.625 340413	2,470,000	2,494,478	33,888,883
<シンガポールドル・・・シンガポール>	シンガポールドル	シンガポールドル	円
SIGB 1.25 261101	630,000	612,206	68,581,736
SIGB 1.625 310701	380,000	352,754	39,516,920
SIGB 1.875 500301	550,000	466,675	52,278,808
SIGB 1.875 511001	360,000	303,120	33,956,720
SIGB 2.125 260601	290,000	287,274	32,181,587
SIGB 2.25 360801	740,000	703,000	78,752,884
SIGB 2.375 390701	320,000	303,253	33,971,597
SIGB 2.625 280501	510,000	508,470	56,960,852
SIGB 2.625 320801	420,000	416,010	46,603,111
SIGB 2.75 420401	420,000	417,480	46,767,787
SIGB 2.75 460301	590,000	584,823	65,514,194
SIGB 2.875 270901	290,000	291,015	32,600,669
SIGB 2.875 280801	460,000	462,530	51,814,469
SIGB 2.875 290701	580,000	583,903	65,411,205
SIGB 2.875 300901	450,000	453,285	50,778,807
SIGB 3 290401	270,000	273,186	30,603,393
SIGB 3 720801	330,000	355,905	39,869,908
SIGB 3.25 540601	260,000	287,830	32,243,917
SIGB 3.375 330901	660,000	690,888	77,396,049
SIGB 3.375 340501	100,000	105,067	11,769,971
SIGB 3.5 270301	810,000	823,365	92,236,655
<メキシコペソ・・・メキシコ>	メキシコペソ	メキシコペソ	円
MBONO 10 361120	6,010,000	6,008,138	44,539,818
MBONO 5.5 270304	27,970,000	25,621,522	189,938,706
MBONO 5.75 260305	36,120,000	34,387,462	254,922,794
MBONO 7 260903	12,430,000	11,866,548	87,969,668
MBONO 7.5 270603	25,280,000	24,065,430	178,403,012
MBONO 7.5 330526	16,640,000	14,263,642	105,739,918
MBONO 7.75 310529	40,880,000	36,859,782	273,250,722
MBONO 7.75 341123	15,060,000	12,958,760	96,066,508
MBONO 7.75 421113	31,050,000	24,706,351	183,154,318
MBONO 8 350524	5,850,000	5,126,121	38,001,208
MBONO 8 471107	16,680,000	13,203,890	97,883,718
MBONO 8 530731	18,720,000	15,462,720	114,628,984
MBONO 8.5 290301	18,650,000	17,776,434	131,781,120
MBONO 8.5 290531	17,000,000	16,216,454	120,216,604
MBONO 8.5 381118	14,370,000	12,579,436	93,254,481
<ポーランドズロティ・・・ポーランド>	ポーランドズロティ	ポーランドズロティ	円
POLGB 0 260425	600,000	563,100	20,807,551
POLGB 0.25 261025	2,810,000	2,583,317	95,458,193
POLGB 1.25 301025	4,920,000	3,945,636	145,798,298
POLGB 1.75 320425	3,200,000	2,505,264	92,573,984
POLGB 2.5 260725	4,520,000	4,356,231	160,970,538
POLGB 2.5 270725	2,500,000	2,356,624	87,081,461
POLGB 2.75 280425	3,080,000	2,872,366	106,139,075
POLGB 2.75 291025	3,350,000	3,010,008	111,225,165
POLGB 3.75 270525	2,800,000	2,729,115	100,845,686
POLGB 4.75 290725	1,800,000	1,770,252	65,413,987
POLGB 5 300125	1,000,000	992,614	36,678,860
POLGB 5 341025	2,300,000	2,212,186	81,744,228
POLGB 5.75 290425	2,240,000	2,295,978	84,840,477
POLGB 6 331025	3,140,000	3,257,460	120,368,955
POLGB 7.5 280725	2,950,000	3,190,681	117,901,359
<イスラエルシェケル・・・イスラエル>	イスラエルシェケル	イスラエルシェケル	円
ILGOV 0.5 260227	1,820,000	1,736,911	71,750,017
ILGOV 1 300331	3,380,000	2,854,892	117,932,667
ILGOV 1.3 320430	2,230,000	1,796,519	74,212,352
ILGOV 1.5 370531	2,250,000	1,591,921	65,760,641
ILGOV 2 270331	1,730,000	1,643,820	67,904,525
ILGOV 2.25 280928	2,000,000	1,858,603	76,776,989
ILGOV 2.8 521129	410,000	278,185	11,491,539
ILGOV 3.75 270930	460,000	453,576	18,736,778
ILGOV 3.75 290228	3,160,000	3,094,428	127,827,661
ILGOV 3.75 470331	2,470,000	2,101,066	86,792,916
ILGOV 4 350330	660,000	631,864	26,101,663
ILGOV 5.5 420131	1,650,000	1,795,435	74,167,597
ILGOV 6.25 261030	1,000,000	1,035,434	42,772,732
<中国人民幣・・・中国>	中国人民幣	中国人民幣	円
CGB 1.62 270815	35,000,000	35,180,957	728,719,282
CGB 1.67 260615	12,000,000	12,061,534	249,836,072
CGB 1.85 270515	43,000,000	43,423,017	899,440,843
CGB 1.87 310915	18,000,000	18,005,306	372,952,161
CGB 1.91 290715	23,000,000	23,251,970	481,628,700

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
CGB 2.04 270225	36,000,000	36,473,468	755,491,663
CGB 2.05 290415	50,000,000	50,854,550	1,053,373,595
CGB 2.11 340825	25,000,000	25,172,180	521,402,898
CGB 2.12 310625	17,530,000	17,796,509	368,627,236
CGB 2.18 260815	45,040,000	45,616,377	944,872,915
CGB 2.27 340525	27,000,000	27,552,955	570,716,973
CGB 2.28 310325	14,000,000	14,340,351	297,038,265
CGB 2.35 340225	28,930,000	29,650,759	614,169,759
CGB 2.37 270120	5,000,000	5,096,516	105,566,471
CGB 2.37 290115	26,000,000	26,741,907	553,917,381
CGB 2.39 261115	62,000,000	63,151,259	1,308,080,971
CGB 2.4 280715	25,780,000	26,508,339	549,079,374
CGB 2.44 271015	10,000,000	10,256,734	212,452,430
CGB 2.46 260215	14,000,000	14,178,682	293,689,536
CGB 2.48 270415	30,000,000	30,717,273	636,260,950
CGB 2.48 280925	25,000,000	25,784,698	534,090,253
CGB 2.5 270725	48,000,000	49,184,309	1,018,777,124
CGB 2.52 330825	28,000,000	29,076,625	602,277,460
CGB 2.54 301225	28,000,000	29,119,798	603,171,726
CGB 2.55 281015	35,240,000	36,450,631	755,018,630
CGB 2.6 300915	25,000,000	26,096,160	540,541,719
CGB 2.6 320901	5,000,000	5,232,733	108,387,985
CGB 2.62 280415	4,000,000	4,141,196	85,778,481
CGB 2.62 290925	17,000,000	17,721,971	367,083,311
CGB 2.62 300625	20,000,000	20,885,872	432,618,636
CGB 2.64 280115	13,000,000	13,429,000	278,161,030
CGB 2.67 330525	22,570,000	23,714,915	491,217,903
CGB 2.67 331125	26,000,000	27,331,946	566,139,125
CGB 2.68 300521	45,000,000	47,222,082	978,132,621
CGB 2.69 260812	20,500,000	20,944,598	433,835,052
CGB 2.69 320815	25,000,000	26,342,125	545,636,505
CGB 2.75 290615	21,000,000	21,984,782	455,380,871
CGB 2.75 320217	13,000,000	13,758,746	284,991,216
CGB 2.76 320515	10,000,000	10,585,632	219,265,045
CGB 2.79 291215	19,000,000	19,997,473	414,216,829
CGB 2.8 290324	17,000,000	17,799,978	368,699,089
CGB 2.8 321115	9,320,000	9,895,318	204,966,255
CGB 2.85 270604	61,500,000	63,620,864	1,317,808,115
CGB 2.88 330225	12,000,000	12,833,854	265,833,490
CGB 2.89 311118	15,040,000	16,051,545	332,483,012
CGB 2.91 281014	19,000,000	19,923,672	412,688,140
CGB 3 531015	14,000,000	16,307,147	337,777,403
CGB 3.01 280513	42,100,000	44,178,864	915,097,059
CGB 3.02 310527	29,000,000	31,124,033	644,686,346
CGB 3.03 260311	22,000,000	22,480,581	465,650,578
CGB 3.12 521025	10,000,000	11,816,154	244,753,411
CGB 3.13 291121	15,000,000	16,056,653	332,586,936
CGB 3.19 530415	6,000,000	7,174,838	148,615,702
CGB 3.25 260606	13,520,000	13,911,230	288,149,672
CGB 3.27 301119	11,000,000	11,971,406	247,969,209
CGB 3.28 271203	3,000,000	3,164,987	65,557,827
CGB 3.29 290523	2,000,000	2,149,383	44,521,154
CGB 3.32 520415	15,500,000	18,889,376	391,264,293
CGB 3.39 500316	15,000,000	18,310,172	379,266,972
CGB 3.53 511018	15,900,000	20,010,689	414,490,570
CGB 3.72 510412	17,690,000	22,943,475	475,238,718
CGB 3.81 500914	3,000,000	3,917,013	81,134,891
CGB 3.86 490722	13,500,000	17,606,815	364,698,021
CGB 4.08 481022	7,500,000	10,025,454	207,661,822
<ユーロ・・・ベルギー>	ユーロ	ユーロ	円
BGB 0 271022	930,000	875,733	138,913,437
BGB 0 311022	730,000	620,427	98,415,479
BGB 0.1 300622	370,000	327,524	51,953,624
BGB 0.35 320622	1,300,000	1,105,650	175,384,170
BGB 0.4 400622	680,000	462,400	73,348,383
BGB 0.65 710622	680,000	304,118	48,240,881
BGB 0.8 270622	1,320,000	1,278,323	202,774,542
BGB 0.8 280622	1,430,000	1,356,784	215,220,400
BGB 0.9 290622	1,220,000	1,149,306	182,309,150
BGB 1 260622	610,000	600,098	95,190,812
BGB 1 310622	1,190,000	1,088,761	172,705,106
BGB 1.25 330422	830,000	750,237	119,006,641
BGB 1.4 530622	820,000	545,288	86,496,542
BGB 1.45 370622	100,000	85,396	13,546,037
BGB 1.6 470622	600,000	450,060	71,390,946
BGB 1.7 500622	1,060,000	789,096	125,170,634
BGB 1.9 380622	530,000	471,395	74,775,258
BGB 2.15 660622	640,000	487,488	77,327,977

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
BGB 2.25 570622	610,000	487,543	77,336,719
BGB 2.7 291022	800,000	815,321	129,330,610
BGB 2.75 390422	500,000	489,877	77,706,933
BGB 2.85 341022	700,000	709,651	112,568,622
BGB 3 330622	1,600,000	1,649,248	261,612,618
BGB 3 340622	1,000,000	1,027,900	163,051,045
BGB 3.3 540622	510,000	513,688	81,483,974
BGB 3.45 430622	200,000	210,397	33,374,307
BGB 3.5 550622	300,000	312,198	49,522,460
BGB 3.75 450622	750,000	821,100	130,247,313
BGB 4 320328	560,000	615,062	97,564,498
BGB 4.25 410328	1,420,000	1,644,797	260,906,634
BGB 4.5 260328	1,000,000	1,030,048	163,391,693
BGB 5 350328	1,800,000	2,166,604	343,678,451
BGB 5.5 280328	1,490,000	1,645,789	261,063,963
<ユーロ・フランス>	ユーロ	ユーロ	円
FRTR 0 260225	4,090,000	3,983,141	631,827,254
FRTR 0 270225	3,360,000	3,201,663	507,865,121
FRTR 0 291125	3,090,000	2,736,112	434,016,784
FRTR 0 301125	4,000,000	3,439,780	545,636,468
FRTR 0 311125	4,900,000	4,085,559	648,073,378
FRTR 0 320525	3,500,000	2,867,550	454,866,257
FRTR 0.25 261125	3,310,000	3,188,664	505,803,042
FRTR 0.5 260525	4,280,000	4,177,280	662,622,698
FRTR 0.5 290525	4,410,000	4,050,448	642,503,968
FRTR 0.5 400525	2,130,000	1,440,849	228,555,268
FRTR 0.5 440625	1,640,000	1,001,074	158,795,832
FRTR 0.5 720525	910,000	345,234	54,762,950
FRTR 0.75 280225	4,000,000	3,806,532	603,812,649
FRTR 0.75 280525	3,210,000	3,038,907	482,047,829
FRTR 0.75 281125	4,610,000	4,324,946	686,046,341
FRTR 0.75 520525	2,320,000	1,259,142	199,731,855
FRTR 0.75 530525	2,250,000	1,193,256	189,280,706
FRTR 1 270525	3,140,000	3,048,961	483,642,680
FRTR 1.25 340525	2,900,000	2,514,300	398,831,835
FRTR 1.25 360525	3,000,000	2,489,400	394,882,063
FRTR 1.25 380525	1,830,000	1,456,863	231,095,471
FRTR 1.5 310525	5,230,000	4,893,737	776,270,998
FRTR 1.5 500525	2,410,000	1,662,458	263,708,118
FRTR 1.75 390625	2,540,000	2,146,325	340,461,718
FRTR 1.75 660525	1,430,000	915,772	145,264,697
FRTR 2 321125	4,100,000	3,882,600	615,878,895
FRTR 2 480525	2,230,000	1,759,304	279,070,362
FRTR 2.5 260924	1,530,000	1,538,776	244,089,015
FRTR 2.5 270924	2,260,000	2,273,841	360,688,990
FRTR 2.5 300525	4,100,000	4,098,922	650,193,075
FRTR 2.5 430525	1,490,000	1,335,949	211,915,424
FRTR 2.75 271025	4,180,000	4,236,913	672,081,973
FRTR 2.75 290225	3,520,000	3,562,222	565,058,942
FRTR 2.75 300225	1,680,000	1,697,785	269,311,791
FRTR 3 330525	2,910,000	2,954,436	468,648,535
FRTR 3 341125	1,900,000	1,910,640	303,076,028
FRTR 3 490625	700,000	665,242	105,524,197
FRTR 3 540525	1,860,000	1,719,068	272,687,812
FRTR 3.25 450525	2,200,000	2,194,500	348,103,433
FRTR 3.25 550525	1,160,000	1,119,926	177,648,761
FRTR 3.5 260425	3,390,000	3,449,664	547,204,321
FRTR 3.5 331125	2,900,000	3,051,482	484,042,464
FRTR 4 381025	2,090,000	2,300,672	364,945,009
FRTR 4 550425	1,340,000	1,482,040	235,089,183
FRTR 4 600425	1,690,000	1,883,738	298,808,722
FRTR 4.5 410425	2,750,000	3,204,732	508,351,933
FRTR 4.75 350425	2,010,000	2,336,942	370,698,285
FRTR 5.5 290425	3,010,000	3,387,412	537,329,646
FRTR 5.75 321025	2,110,000	2,553,100	404,986,501
<ユーロ・ドイツ>	ユーロ	ユーロ	円
BKO 2.9 260618	2,170,000	2,198,080	348,671,280
BKO 3.1 251212	370,000	373,356	59,223,727
DBR 0 260815	2,670,000	2,584,880	410,027,679
DBR 0 271115	1,900,000	1,799,490	285,444,815
DBR 0 281115	1,000,000	930,330	147,573,965
DBR 0 290815	1,150,000	1,055,505	167,429,820
DBR 0 300215	1,420,000	1,290,638	204,727,965
DBR 0 300815	2,550,000	2,296,403	364,267,758
DBR 0 300815	700,000	630,441	100,003,953
DBR 0 310215	2,400,000	2,137,848	339,116,987
DBR 0 310815	2,500,000	2,202,125	349,312,952
DBR 0 310815	850,000	748,884	118,792,021

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
DBR 0 320215	2,620,000	2,280,396	361,728,657
DBR 0 350515	1,910,000	1,529,948	242,688,640
DBR 0 360515	1,990,000	1,550,986	246,025,785
DBR 0 500815	2,180,000	1,220,974	193,677,548
DBR 0 500815	1,270,000	713,029	113,104,476
DBR 0 520815	2,100,000	1,124,319	178,345,547
DBR 0.25 270215	1,700,000	1,641,979	260,459,570
DBR 0.25 280815	2,090,000	1,973,775	313,090,858
DBR 0.25 290215	2,390,000	2,239,167	355,188,770
DBR 0.5 260215	3,000,000	2,944,920	467,139,104
DBR 0.5 270815	1,210,000	1,168,134	185,295,719
DBR 0.5 280215	2,370,000	2,273,612	360,652,621
DBR 1 380515	2,020,000	1,724,413	273,535,760
DBR 1.25 480815	2,400,000	1,941,504	307,971,842
DBR 1.7 320815	2,670,000	2,619,537	415,525,096
DBR 1.8 530815	2,070,000	1,847,289	293,026,903
DBR 1.8 530815	1,350,000	1,207,265	191,502,810
DBR 2.1 291115	2,000,000	2,016,200	319,820,525
DBR 2.2 340215	2,500,000	2,527,700	400,957,415
DBR 2.3 330215	3,000,000	3,065,040	486,193,186
DBR 2.3 330215	300,000	306,624	48,638,353
DBR 2.4 301115	1,500,000	1,536,945	243,798,510
DBR 2.5 440704	1,940,000	1,994,786	316,423,657
DBR 2.5 460815	1,760,000	1,816,003	288,064,228
DBR 2.5 540815	1,330,000	1,379,622	218,843,135
DBR 2.6 330815	2,280,000	2,380,958	377,680,471
DBR 2.6 340815	250,000	261,043	41,407,970
DBR 2.6 410515	800,000	829,080	131,513,144
DBR 3.25 420704	1,390,000	1,574,787	249,801,149
DBR 4 370104	2,000,000	2,374,340	376,630,625
DBR 4.25 390704	1,240,000	1,538,369	244,024,361
DBR 4.75 280704	1,340,000	1,472,446	233,567,267
DBR 4.75 340704	2,410,000	2,967,192	470,672,008
DBR 4.75 400704	1,400,000	1,844,598	292,600,090
DBR 5.5 310104	1,450,000	1,742,175	276,353,201
DBR 6.25 300104	770,000	929,105	147,379,665
DBR 6.5 270704	1,220,000	1,359,861	215,708,459
GERMANY 5.625%280104	1,130,000	1,256,165	199,259,592
OBL 0 260410	2,950,000	2,872,681	455,680,084
OBL 0 261009	2,350,000	2,269,278	359,965,044
OBL 0 270416	2,550,000	2,439,330	386,939,689
OBL 1.3 271015	800,000	787,744	124,956,204
OBL 1.3 271015	600,000	590,820	93,719,057
OBL 2.1 290412	1,430,000	1,440,696	228,531,038
OBL 2.1 290412	1,000,000	1,007,730	159,851,571
OBL 2.2 280413	1,900,000	1,920,102	304,576,942
OBL 2.4 281019	2,290,000	2,333,167	370,099,462
OBL 2.5 291011	1,310,000	1,342,750	212,994,251
RAGB 1.5 861102	290,000	187,775	29,785,883
RFCB 2.95 550415	280,000	285,656	45,312,296
<ユーロ・イタリア>	ユーロ	ユーロ	円
BTPS 0 260401	1,340,000	1,300,872	206,351,337
BTPS 0 260801	2,340,000	2,255,292	357,746,588
BTPS 0.25 280315	1,830,000	1,707,573	270,864,445
BTPS 0.45 290215	1,200,000	1,102,560	174,894,017
BTPS 0.5 260201	1,880,000	1,841,648	292,132,145
BTPS 0.5 280715	1,500,000	1,402,200	222,424,531
BTPS 0.6 310801	1,150,000	994,635	157,774,371
BTPS 0.85 270115	2,050,000	1,991,575	315,914,375
BTPS 0.9 310401	1,400,000	1,245,720	197,602,829
BTPS 0.95 270915	1,900,000	1,830,840	290,417,721
BTPS 0.95 300801	1,200,000	1,088,040	172,590,776
BTPS 0.95 311201	1,500,000	1,314,450	208,505,153
BTPS 0.95 320601	1,730,000	1,503,197	238,445,220
BTPS 0.95 370301	1,230,000	933,324	148,048,890
BTPS 1.1 270401	460,000	447,902	71,048,632
BTPS 1.35 300401	2,240,000	2,094,848	332,296,095
BTPS 1.45 360301	1,220,000	1,009,672	160,159,621
BTPS 1.5 450430	1,210,000	840,224	133,280,865
BTPS 1.6 260601	1,500,000	1,485,750	235,677,683
BTPS 1.65 301201	2,000,000	1,875,200	297,454,344
BTPS 1.65 320301	1,860,000	1,710,642	271,351,266
BTPS 1.7 510901	1,290,000	859,914	136,404,199
BTPS 1.8 410301	1,550,000	1,208,380	191,679,757
BTPS 2 251201	2,070,000	2,063,976	327,399,059
BTPS 2 280201	1,560,000	1,543,308	244,807,844
BTPS 2.05 270801	1,460,000	1,450,656	230,110,883
BTPS 2.1 260715	1,620,000	1,617,408	256,561,986

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
BTPS 2.15 520901	710,000	515,531	81,776,309
BTPS 2.15 720301	690,000	457,815	72,621,086
BTPS 2.2 270601	1,590,000	1,587,933	251,886,502
BTPS 2.25 360901	1,580,000	1,416,628	224,713,178
BTPS 2.45 330901	1,250,000	1,194,000	189,398,724
BTPS 2.45 500901	1,530,000	1,205,793	191,269,393
BTPS 2.5 321201	1,500,000	1,449,300	229,895,787
BTPS 2.65 271201	2,300,000	2,319,550	367,939,539
BTPS 2.7 470301	1,310,000	1,113,500	176,629,379
BTPS 2.8 281201	430,000	435,676	69,109,278
BTPS 2.8 290615	1,500,000	1,514,700	240,269,888
BTPS 2.8 670301	750,000	600,375	95,234,722
BTPS 2.95 270215	1,600,000	1,620,800	257,100,043
BTPS 2.95 380901	1,070,000	1,000,664	158,730,724
BTPS 3 290801	2,000,000	2,040,000	323,595,809
BTPS 3 291001	600,000	609,360	96,659,971
BTPS 3.25 380301	960,000	936,768	148,595,195
BTPS 3.25 460901	1,480,000	1,378,472	218,660,668
BTPS 3.35 290701	90,000	92,790	14,718,850
BTPS 3.35 350301	1,600,000	1,618,720	256,770,102
BTPS 3.4 280401	1,000,000	1,031,000	163,542,784
BTPS 3.45 270715	1,400,000	1,438,220	228,138,218
BTPS 3.45 310715	1,400,000	1,447,460	229,603,917
BTPS 3.45 480301	1,070,000	1,009,652	160,156,449
BTPS 3.5 260115	680,000	688,296	109,181,226
BTPS 3.5 300301	2,050,000	2,139,380	339,360,001
BTPS 3.5 310215	1,500,000	1,555,650	246,765,598
BTPS 3.7 300615	1,000,000	1,048,500	166,318,728
BTPS 3.8 260415	1,000,000	1,019,400	161,702,729
BTPS 3.8 280801	1,430,000	1,495,780	237,268,696
BTPS 3.85 260915	1,700,000	1,744,710	276,755,316
BTPS 3.85 291215	1,700,000	1,795,030	284,737,346
BTPS 3.85 340701	890,000	938,149	148,814,257
BTPS 3.85 490901	1,330,000	1,344,497	213,271,370
BTPS 4 301115	1,400,000	1,491,000	236,510,466
BTPS 4 311030	1,000,000	1,072,800	170,173,325
BTPS 4 350430	1,100,000	1,178,320	186,911,477
BTPS 4 370201	2,550,000	2,723,400	432,000,406
BTPS 4.05 371030	880,000	938,080	148,803,312
BTPS 4.1 290201	450,000	477,405	75,728,557
BTPS 4.15 391001	740,000	787,286	124,883,554
BTPS 4.2 340301	2,330,000	2,523,623	400,310,700
BTPS 4.3 541001	400,000	425,520	67,498,278
BTPS 4.35 331101	1,950,000	2,139,735	339,416,313
BTPS 4.4 330501	1,800,000	1,982,520	314,478,022
BTPS 4.45 430901	1,200,000	1,316,880	208,890,612
BTPS 4.5 260301	2,060,000	2,115,620	335,591,062
BTPS 4.5 531001	500,000	554,150	87,902,263
BTPS 4.75 280901	1,840,000	1,989,960	315,658,195
BTPS 4.75 440901	1,410,000	1,613,040	255,869,110
BTPS 5 340801	1,190,000	1,369,928	217,305,372
BTPS 5 390801	1,700,000	1,978,970	313,914,901
BTPS 5 400901	1,960,000	2,281,636	361,925,416
BTPS 5.75 330201	2,030,000	2,426,662	384,930,223
BTPS 7.25 261101	300,000	328,110	52,046,579
ITALY	2,450,000	2,910,845	461,733,943
ITALY 5.2508291101	830,000	932,422	147,905,809
ITALY 6.5% 271101	2,270,000	2,530,369	401,380,787
<ユーロ・・・オランダ>	ユーロ	ユーロ	円
NETHER 0 260115	860,000	839,704	133,198,380
NETHER 0 270115	1,200,000	1,151,658	182,682,159
NETHER 0 290115	1,270,000	1,167,588	185,209,184
NETHER 0 300715	1,020,000	907,800	144,000,135
NETHER 0 310715	370,000	321,253	50,958,845
NETHER 0 380115	1,080,000	784,399	124,425,539
NETHER 0 520115	1,420,000	749,760	118,930,977
NETHER 0.25 290715	1,260,000	1,159,200	183,878,560
NETHER 0.5 260715	1,030,000	1,005,898	159,560,969
NETHER 0.5 320715	1,310,000	1,154,669	183,159,888
NETHER 0.5 400115	910,000	687,383	109,036,447
NETHER 0.75 270715	1,490,000	1,444,221	229,090,050
NETHER 0.75 280715	1,380,000	1,318,659	209,172,807
NETHER 2 540115	880,000	797,842	126,558,054
NETHER 2.5 300115	40,000	40,769	6,467,001
NETHER 2.5 330115	1,250,000	1,278,625	202,822,398
NETHER 2.5 330715	700,000	705,040	111,837,249
NETHER 2.5 340715	700,000	708,470	112,381,335
NETHER 2.75 470115	1,570,000	1,653,210	262,241,092

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
NETHER 3.25 440115	570,000	637,166	101,070,701
NETHER 3.75 420115	1,460,000	1,696,520	269,111,158
NETHER 4 370115	1,310,000	1,524,578	241,836,790
NETHER 5.5 280115	1,030,000	1,136,296	180,245,404
<ユーロ・・・オーストリア>	ユーロ	ユーロ	円
RAGB 0 281020	820,000	754,154	119,627,977
RAGB 0 300220	1,010,000	898,193	142,476,221
RAGB 0 310220	170,000	147,050	23,325,864
RAGB 0 401020	600,000	391,440	62,092,325
RAGB 0.25 361020	990,000	748,044	118,658,776
RAGB 0.5 270420	1,160,000	1,117,080	177,197,258
RAGB 0.5 290220	1,080,000	1,006,992	159,734,505
RAGB 0.7 710420	370,000	182,854	29,005,288
RAGB 0.75 261020	930,000	907,494	143,951,596
RAGB 0.75 280220	1,000,000	956,700	151,756,917
RAGB 0.75 510320	740,000	464,202	73,634,226
RAGB 0.85 200630	340,000	161,568	25,628,788
RAGB 0.9 320220	1,570,000	1,413,628	224,237,302
RAGB 1.5 470220	460,000	362,894	57,564,204
RAGB 1.85 490523	500,000	419,200	66,495,766
RAGB 2 260715	680,000	678,436	107,617,179
RAGB 2. 1 710920	240,000	197,304	31,297,425
RAGB 2.4 340523	1,050,000	1,038,345	164,707,887
RAGB 2.5 291020	580,000	587,214	93,147,014
RAGB 2.9 290523	550,000	565,785	89,747,870
RAGB 2.9 330220	1,600,000	1,648,960	261,566,934
RAGB 3.15 440620	690,000	724,707	114,956,935
RAGB 3.15 531020	340,000	359,176	56,974,435
RAGB 3.2 390715	300,000	316,830	50,257,284
RAGB 3.45 301020	110,000	116,820	18,530,618
RAGB 3.8 620126	360,000	439,524	69,719,668
RAGB 4.15 370315	1,050,000	1,211,700	192,206,393
RAGB 4.85 260315	320,000	330,400	52,409,831
RAGB 6.25 270715	490,000	541,107	85,833,312
<ユーロ・・・アイルランド>	ユーロ	ユーロ	円
IRISH 0 311018	790,000	677,421	107,456,182
IRISH 0.2 270515	730,000	699,451	110,950,714
IRISH 0.2 301018	500,000	446,488	70,824,328
IRISH 0.35 321018	370,000	319,403	50,665,348
IRISH 0.4 350515	630,000	511,454	81,129,544
IRISH 0.55 410422	180,000	130,943	20,770,853
IRISH 0.9 280515	380,000	366,206	58,089,587
IRISH 1 260515	710,000	699,158	110,904,178
IRISH 1.1 290515	990,000	947,852	150,353,437
IRISH 1.3 330515	300,000	276,957	43,932,390
IRISH 1.35 310318	380,000	361,850	57,398,549
IRISH 1.5 500515	660,000	524,156	83,144,453
IRISH 1.7 370515	640,000	582,849	92,454,698
IRISH 2 450218	700,000	630,876	100,072,881
IRISH 2.4 300515	540,000	546,929	86,756,788
IRISH 2.6 341018	200,000	203,436	32,270,036
IRISH 3 431018	330,000	349,944	55,509,934
<ユーロ・・・スペイン>	ユーロ	ユーロ	円
SPGB 0 260131	1,970,000	1,918,583	304,335,990
SPGB 0 270131	1,740,000	1,659,960	263,311,814
SPGB 0 280131	2,220,000	2,066,043	327,726,891
SPGB 0.1 310430	2,140,000	1,837,618	291,492,884
SPGB 0.5 300430	1,530,000	1,384,286	219,582,894
SPGB 0.5 311031	1,880,000	1,642,319	260,513,447
SPGB 0.6 291031	1,660,000	1,525,507	241,984,188
SPGB 0.7 320430	1,900,000	1,662,500	263,714,722
SPGB 0.8 270730	860,000	827,750	131,302,172
SPGB 0.8 290730	1,810,000	1,682,576	266,899,285
SPGB 1 420730	760,000	535,274	84,979,432
SPGB 1 501031	1,560,000	940,270	149,150,657
SPGB 1.2 401031	1,560,000	1,179,329	187,071,499
SPGB 1.25 301031	1,300,000	1,214,200	192,602,957
SPGB 1.3 261031	1,700,000	1,674,265	265,581,013
SPGB 1.4 280430	1,840,000	1,789,225	283,816,557
SPGB 1.4 280730	690,000	668,472	106,036,636
SPGB 1.45 271031	1,970,000	1,926,759	305,632,831
SPGB 1.45 290430	1,480,000	1,426,454	226,271,768
SPGB 1.45 711031	710,000	391,507	62,103,002
SPGB 1.5 270430	1,990,000	1,958,359	310,645,473
SPGB 1.85 350730	1,270,000	1,155,180	183,240,876
SPGB 1.9 521031	1,660,000	1,222,795	193,966,343
SPGB 1.95 260430	1,970,000	1,964,050	311,548,228
SPGB 1.95 300730	2,070,000	2,019,947	320,414,958

銘柄	額面金額	評価額	
		外貨建金額	邦貨建金額
SPGB 2.35 330730	1,800,000	1,752,300	277,959,283
SPGB 2.5 270531	1,400,000	1,409,375	223,562,618
SPGB 2.55 321031	2,120,000	2,110,975	334,854,272
SPGB 2.7 300131	1,000,000	1,011,100	160,386,138
SPGB 2.7 481031	1,360,000	1,224,029	194,162,016
SPGB 2.8 260531	1,500,000	1,512,140	239,863,728
SPGB 2.9 461031	1,700,000	1,600,283	253,845,542
SPGB 3.1 310730	500,000	517,450	82,080,751
SPGB 3.15 330430	1,020,000	1,056,618	167,606,449
SPGB 3.25 340430	1,900,000	1,976,191	313,474,073
SPGB 3.45 341031	1,170,000	1,234,873	195,882,218
SPGB 3.45 430730	870,000	890,517	141,258,577
SPGB 3.45 660730	970,000	964,589	153,008,328
SPGB 3.5 290531	2,470,000	2,589,894	410,823,009
SPGB 3.55 331031	1,490,000	1,587,297	251,785,616
SPGB 3.9 390730	1,070,000	1,162,127	184,342,856
SPGB 4 541031	440,000	484,785	76,899,276
SPGB 4.2 370131	2,030,000	2,287,042	362,782,889
SPGB 4.7 410730	1,660,000	1,984,563	314,802,125
SPGB 4.9 400730	1,700,000	2,063,627	327,343,588
SPGB 5.15 281031	1,540,000	1,700,930	269,810,696
SPGB 5.15 441031	1,450,000	1,848,171	293,166,929
SPGB 5.75 320730	1,970,000	2,401,627	380,959,036
SPGB 5.9 260730	1,500,000	1,589,796	252,181,950
SPGB 6 290131	1,600,000	1,834,470	290,993,595
<ユーロ・・・ポルトガル>	ユーロ	ユーロ	円
PGB 0.475 301018	2,000,000	1,818,900	288,523,734
PGB 1 520412	800,000	497,200	78,868,547
PGB 1.15 420411	400,000	303,773	48,186,033
PGB 1.65 320716	1,500,000	1,430,929	226,981,641
PGB 1.95 290615	2,000,000	1,990,850	315,799,371
PGB 4.1 370415	1,300,000	1,484,782	235,524,134
PGB 4.1 450215	500,000	578,000	91,685,479
PGB 4.125 270414	1,800,000	1,892,291	300,165,331
<ユーロ・・・フィンランド>	ユーロ	ユーロ	円
RFGB 0 260915	370,000	356,569	56,560,899
RFGB 0 300915	550,000	482,103	76,473,700
RFGB 0.125 310915	800,000	688,822	109,264,663
RFGB 0.125 360415	450,000	339,121	53,793,258
RFGB 0.125 520415	580,000	293,535	46,562,029
RFGB 0.25 400915	450,000	306,612	48,636,486
RFGB 0.5 260415	240,000	235,084	37,290,305
RFGB 0.5 270915	770,000	737,737	117,023,824
RFGB 0.5 280915	270,000	253,314	40,182,033
RFGB 0.5 290915	1,210,000	1,116,436	177,095,127
RFGB 0.5 430415	440,000	295,592	46,888,398
RFGB 0.75 310415	300,000	271,911	43,131,990
RFGB 1.125 340415	800,000	706,222	112,024,745
RFGB 1.375 270415	310,000	304,917	48,367,635
RFGB 1.375 470415	250,000	192,242	30,494,527
RFGB 1.5 320915	400,000	373,151	59,191,288
RFGB 2.625 420704	180,000	176,286	27,963,406
RFGB 2.75 280704	540,000	551,723	87,517,214
RFGB 2.75 380415	180,000	180,330	28,604,894
RFGB 2.875 290415	200,000	205,340	32,572,139
RFGB 3 330915	150,000	155,763	24,708,039
合計	—	—	270,916,982,537

<注>邦貨換算額は、期末の時価を期末日のロンドン16:00のスポットレートにより邦貨換算した
ものです。

3. ファンドの現況 (2024年12月31日現在)

○ 純資産額計算書

(単位: 円、口)

科目	金額、口数
I 資産総額	1,701,716,059
II 負債総額	7,563,629
III 純資産総額 (I - II)	1,694,152,430
IV 受益権総口数	899,837,203
V 1万口あたり純資産総額 (III / IV × 10,000)	18,827

<ご参考> 外国債券マザーファンドの現況 (2024年12月30日現在)

○ 純資産額計算書

(単位: 円、口)

科目	金額、口数
I 資産総額	283,146,297,021
II 負債総額	417,856,448
III 純資産総額 (I - II)	282,728,440,573
IV 受益権総口数	9,351,764
V 1万口あたり純資産総額 (III / IV × 10,000)	30,233

4. 設定および解約の実績

(単位: 口)

計算期間	設定口数	解約口数	期末日の受益権総口数
第20期計算期 (2023年12月1日～2024年12月2日)	173,957,223	185,588,431	906,670,924